



INSTITUTO
PREVIDENCIÁRIO
DO MUNICÍPIO DE
SÃO SEBASTIÃO



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS
AGOSTO
2023



Sumário

1. INTRODUÇÃO	3
2. DESTAQUE DO MÊS	3
3. MERCADO FINANCEIRO	4
4. PATRIMÔNIO DO INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO.	6
4.1 RECURSOS ALOCADOS CONFORME RESOLUÇÃO CMN Nº 4963, DE 25 DE NOVEMBRO DE 2021.....	6
4.2 FUNDOS ESTRESSADOS NA CARTEIRA DO INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO – SÃO SEBASTIÃO PREV	11
4.3 DEMONSTRAÇÃO GRÁFICA	12
5. CARTEIRA	13
5.1 RISCO DA CARTEIRA.....	13
5.2. ANÁLISE DE LIQUIDEZ	13
5.3 DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO	13
5.3.1 RENDA FIXA	13
5.3.2 RENDA VARIÁVEL.....	15
5.3.3 RENDA NO EXTERIOR.....	16
5.3.4 FUNDOS ESTRUTURADOS.....	17
5.3.5 FUNDOS IMOBILIÁRIOS	18
6. RESULTADO APURADO	19
6.1 META ATUARIAL X RENTABILIDADE	19
6.2 META ATUARIAL ACUMULADA X RENTABILIDADE ACUMULADA.....	19
COMITÊ DE INVESTIMENTOS	21
CONSELHO FISCAL	21



1. INTRODUÇÃO

Com ênfase nos segurados e a total transparência de suas atividades relacionadas com a gestão dos recursos investidos do Instituto Previdenciário do Município de São Sebastião – SÃO SEBASTIÃO PREV, apresenta o relatório mensal do mês de agosto de 2023, no qual, demonstra o acompanhamento e a rentabilidade da carteira do SÃO SEBASTIÃO PREV.

2. DESTAQUE DO MÊS

No mês de agosto, no cenário internacional, os juros globais tiveram alta, especialmente os mais longos, seguindo a expectativa de que a atividade econômica mais resiliente nos EUA possa resultar em taxas de juros mais altas por mais tempo.

Nos EUA, os dados mostram uma economia sólida, avançando além do esperado, sugerindo que a alta das taxas de juros até agora vem tendo efeito menos restritivo que o previsto. O mercado de trabalho segue aquecido, ainda que em trajetória de desaceleração. Esse ambiente aponta para uma chance menor de recessão. Ainda nos EUA, não houve alteração relevante nas expectativas para a política monetária. É provável que o FED tenha encerrado o ciclo de alta dos juros, com a taxa seguindo em 5,5%, ainda que um ajuste residual seja possível. Ao longo do ano de 2024, espera-se o início de um movimento de redução dos juros, que deve ocorrer de forma suave.

Na zona do euro, os dados econômicos seguem demonstrando sinais de fraquezas no lado da atividade, mas ainda exibe uma inflação resiliente, com destaque para desaceleração mais forte do crédito e acomodação da expectativa de crescimento, entretanto, ainda apresenta um fraco desempenho na Alemanha.

A China tem realizado esforços para conter a desaceleração do setor de construção civil, que apresenta graves problemas de excesso de oferta, falta de



demanda e dificuldades financeiras das empresas. O desempenho do setor será fundamental para ditar os rumos da economia chinesa, com repercussões importantes nos mercados emergentes. Nesse ambiente, a China deverá continuar crescendo abaixo do potencial.

Localmente, as curvas de juros tiveram alta, acompanhando o movimento do exterior. O mercado passou a refletir expectativas de queda de juros em um ritmo mais lento que o esperado. Assim, o Ibovespa teve retornos negativos, com queda mais acentuada que a das Bolsas globais. O PIB voltou a surpreender favoravelmente no segundo trimestre, superando as expectativas, com contribuição positiva dos setores industrial e de serviços, reforçando a percepção de uma economia resiliente. O setor agropecuário mostrou leve queda, após uma performance forte no primeiro trimestre, quando havia sido o principal fator impulsionando o crescimento naquele período. A inflação continua seguindo em uma direção mais construtiva. O núcleo do IPCA vem passando por desaceleração, com efeito benigno dos preços de bens, enquanto a inflação de serviços passa por descompressão mais gradual. Espera-se uma continuidade desse movimento nos próximos meses, ainda que num ritmo gradual. Já no começo de agosto, em acordo com as expectativas do mercado, o Copom iniciou o ciclo de redução dos juros com um corte de 0,50% da taxa Selic para 13,25% e a sinalização de que este ritmo deverá ser mantido nas próximas reuniões.

3. MERCADO FINANCEIRO

Assim, no mês de agosto de 2023, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território negativo, acompanhando o movimento de alta das curvas de juros, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, desvalorizaram 2,96% e 1,77%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos positivos de 11,91% e 13,97%,



respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +0,73% e +1,97%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +6,36% e +8,32% nos últimos 12 meses.

O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo a direção dos índices globais. Apresentando um retorno negativo de 5,09% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de 5,47% e de 5,68% nos últimos 12 meses.





4. PATRIMÔNIO DO INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO.

4.1 RECURSOS ALOCADOS CONFORME RESOLUÇÃO CMN Nº 4963, DE 25 DE NOVEMBRO DE 2021.

ARTIGO	DESCRIÇÃO	VALOR	% CARTEIRA	LIMITE LEGAL
7º I, Alínea a	TÍTULOS EMITIDOS PELO TESOURO NACIONAL	R\$ 400.877.348,96	45,97%	100%
7º I, Alínea b	FUNDO 100% TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 140.738.103,58	16,14%	100%
7º III, Alínea a	FUNDO DE RENDA FIXA	R\$ 175.534.955,97	20,13%	60%
7º V, Alínea a	FIDC COTA SÊNIOR	R\$ 15.106.672,58	1,73%	5%
TOTAL RENDA FIXA		R\$ 732.257.081,09	83,98%	
8º I	FUNDO DE AÇÕES	R\$ 22.474.476,77	2,58%	30%
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R\$ 22.474.476,77	2,58%	
9º III	AÇÕES - BDR NÍVEL I	R\$ 31.486.474,72	3,61%	10%
TOTAL INVESTIMENTO NO EXTERIOR		R\$ 31.486.474,72	3,61%	
10º I	FUNDO MULTIMERCADO	R\$ 30.522.300,13	3,50%	10%
10º II	FUNDO DE PARTICIPAÇÃO	R\$ 30.782.340,54	3,53%	5%
TOTAL INVESTIMENTO ESTRUTURADOS		R\$ 61.304.640,67	7,03%	
11º	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$ 24.425.737,23	2,80%	5%
TOTAL INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO		R\$ 24.425.737,23	2,80%	
TOTAL DA CARTEIRA		R\$ 871.948.410,48	100%	



SÃO SEBASTIÃO PREV
INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO
(criado pela Lei Complementar nº 241/2019)



ARTIGO 7º INCISO I, ALÍNEA a (TÍTULOS DO TESOUREO NACIONAL)	SALDO EM 31/07/2023	SALDO EM 31/08/2023	RENDIMENTO	RENTAB	PL DO FUNDO	PARTICIPA ÇÃO NO PL DO FUNDO	CARTEIRA
NTN-B (2024)	R\$ 41.785.763,50	R\$ 40.907.871,51	R\$ 338.464,68	0,81%			4,69%
NTN-B (2026)	R\$ 19.456.918,36	R\$ 19.038.584,81	R\$ 187.587,95	0,64%			2,18%
NTN-B (2030)	R\$ 29.310.147,89	R\$ 28.722.391,48	R\$ 169.998,86	0,58%			3,29%
NTN-B (2035)	R\$ 2.802.563,78	R\$ 2.821.586,95	R\$ 19.023,17	0,68%			0,32%
NTN-B (2035)	R\$ 48.292.394,79	R\$ 48.647.435,40	R\$ 355.040,61	0,74%			5,58%
NTN-B (2035)	R\$ 20.829.283,04	R\$ 20.988.145,87	R\$ 158.862,83	0,76%			2,41%
NTN-B (2035)	R\$ 7.088.909,78	R\$ 7.140.624,87	R\$ 51.715,09	0,73%			0,32%
NTN-B (2040)	R\$ 67.776.815,61	R\$ 66.559.359,61	R\$ 406.660,89	0,60%			7,63%
NTN-B (2045)	R\$ 57.167.688,47	R\$ 57.596.164,81	R\$ 428.476,34	0,75%			6,61%
NTN-B (2050)	R\$ 5.583.071,44	R\$ 5.461.747,28	R\$ 40.756,42	0,73%			0,63%
NTN-B (2055)	R\$ 77.346.644,27	R\$ 77.825.672,06	R\$ 479.027,79	0,62%			8,93%
NTN-B (2055)	R\$ 1.762.312,80	R\$ 1.773.207,64	R\$ 10.894,84	0,62%			0,20%
NTN-B (2055)	R\$ 1.827.509,96	R\$ 1.839.986,26	R\$ 12.476,30	0,68%			0,21%
NTN-B (2055)	R\$ 21.399.339,63	R\$ 21.554.570,41	R\$ 155.230,78	0,73%			2,47%
TOTAL	R\$ 402.429.363,32	R\$ 400.877.348,96		0,68%			45,97%



SÃO SEBASTIÃO PREV
INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO
(criado pela Lei Complementar nº 241/2019)



ARTIGO 7º INCISO I, ALÍNEA b (FI 100% EM TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL)							
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	R\$ 20.198.405,18	R\$ 20.315.733,84	R\$ 117.328,66	0,58%	R\$ 5.437.581.646,17	0,37%	2,33%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	R\$ 75.412.231,35	R\$ 75.996.243,06	R\$ 584.011,71	0,77%	R\$ 5.504.316.744,32	1,38%	8,72%
CAIXA BRASIL IMAB-5 TÍT. PUB. RF LP	R\$ 44.162.438,09	R\$ 44.426.126,68	R\$ 263.688,59	0,60%	R\$ 8.195.443.440,71	0,54%	5,10%
TOTAL	R\$ 139.773.074,62	R\$ 140.738.103,58		0,69%			16,14%
ARTIGO 7º INCISO III, ALÍNEA a (FI EM RENDA FIXA)							
CAIXA FIC PRATICO RF CP	R\$ 258.480,02	R\$ 16.381,08	R\$ 628,40	0,89%	R\$ 25.010.773.997,42	0,00%	0,00%
CAIXA FI BRASIL REF DI LONGO PRAZO	R\$ 26.081.430,99	R\$ 26.404.116,17	R\$ 322.685,18	1,24%	R\$ 14.797.589.893,96	0,18%	3,03%
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 73.020.167,69	R\$ 73.863.611,10	R\$ 843.443,41	1,16%	R\$ 14.734.335.445,36	0,50%	8,47%
BB PREV RF FLUXO FIC	R\$ 4.412.129,75	R\$ 9.047.047,84	R\$ 67.738,53	1,05%	R\$ 3.554.344.878,79	0,25%	1,04%
TOWER RF FI IMA-B 5	R\$ 15.010.805,44	R\$ 14.980.336,05	-R\$ 30.469,39	-0,20%	R\$ 65.488.045,80	22,87%	1,72%
LME REC IMA-B FI RF	R\$ 9.499.221,78	R\$ 9.536.146,97	R\$ 36.925,19	0,39%	R\$ 74.966.974,97	12,72%	1,09%
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	R\$ 18.504.870,07	R\$ 16.042.354,61	R\$ 642.018,60	3,47%	R\$ 48.611.239,85	33,00%	1,84%
SANTANDER RF REF DI INSTIT FIC FI	R\$ 25.309.138,24	R\$ 25.644.962,15	R\$ 335.823,91	1,33%	2.938.953.438,08	0,87%	2,94%
TOTAL	R\$ 172.096.243,98	R\$ 175.534.955,97		1,27%			20,13%



SÃO SEBASTIÃO PREV
INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO
(criado pela Lei Complementar nº 241/2019)



ARTIGO 7º INCISO V, ALÍNEA a (FIDC COTA SÊNIOR)							
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	R\$ 1.601.085,01	R\$ 1.591.598,70	-R\$ 9.486,31	-0,59%	R\$ 6.407.321,24	24,84%	0,18%
BBIF MASTER FIDC LP	R\$ 3.680.005,36	R\$ 3.668.496,75	-R\$ 11.508,61	-0,31%	R\$ 23.229.205,01	15,79%	0,42%
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	R\$ 9.883.954,01	R\$ 9.846.577,13	-R\$ 37.376,88	-0,38%	R\$ 73.239.138,77	13,44%	1,13%
TOTAL	R\$ 15.165.044,38	R\$ 15.106.672,58		-0,38%			1,73%
ARTIGO 8º INCISO I (FUNDO DE AÇÕES)							
XP INVESTOR FI DE AÇÕES	R\$ 9.511.483,00	R\$ 9.093.741,74	-R\$ 417.741,26	-4,39%	R\$ 213.114.273,14	4,27%	1,04%
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	R\$ 14.105.664,85	R\$ 13.380.735,03	-R\$ 724.929,82	-5,41%	R\$ 675.035.615,55	1,98%	1,53%
TOTAL	R\$ 23.617.147,85	R\$ 22.474.476,77		-4,84%			2,58%
ARTIGO 9º INCISO III (EXTERIOR AÇÕES - BDR NÍVEL I)							
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$ 16.165.683,33	R\$ 16.635.087,91	R\$ 469.404,58	2,90%	R\$ 2.114.296.555,90	0,79%	1,91%
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	R\$ 14.443.153,10	R\$ 14.851.386,81	R\$ 408.233,71	2,83%	R\$ 1.329.667.917,72	1,12%	1,70%
TOTAL	R\$ 30.608.836,43	R\$ 31.486.474,72		2,87%			3,61%



SÃO SEBASTIÃO PREV
INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO
(criado pela Lei Complementar nº 241/2019)



ARTIGO 10º INCISO I (FUNDOS MULTIMERCADOS)							
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	R\$ 29.367.229,64	R\$ 29.097.992,85	-R\$ 269.236,79	-0,92%	R\$ 1.616.038.532,30	1,80%	3,34%
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	R\$ 1.433.551,71	R\$ 1.424.307,28	-R\$ 9.244,43	-0,64%	R\$ 41.983.146,45	3,39%	0,16%
TOTAL	R\$ 30.800.781,35	R\$ 30.522.300,13		-0,90%			3,50%
ARTIGO 10º INCISO II (FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES)							
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-R\$ 152.605,92	-R\$ 154.507,69	-R\$ 1.901,77	1,25%	-R\$ 8.647.589,68	1,79%	-0,02%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	R\$ 16.179.633,15	R\$ 16.153.731,45	-R\$ 25.901,70	-0,16%	R\$ 123.309.593,08	13,10%	1,85%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRAT FIP	R\$ 10.370.747,45	R\$ 10.368.901,37	-R\$ 1.846,08	-0,02%	R\$ 135.737.003,50	7,64%	1,19%
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	R\$ 1.570.409,90	R\$ 1.570.269,53	-R\$ 140,37	-0,01%	R\$ 27.614.114,87	5,69%	0,18%
INFRA SANEAMENTO FIP	R\$ 2.843.844,40	R\$ 2.843.945,88	R\$ 101,48	0,00%	R\$ 1.022.851.428,98	0,28%	0,33%
TOTAL	R\$ 30.812.028,98	R\$ 30.782.340,54		-0,10%			3,53%
ARTIGO 11º (FUNDOS DE INVESTIMENTOS EM IMOBILIÁRIO)							
SÃO DOMINGOS FII	R\$ 1.363.846,09	R\$ 1.360.734,32	-R\$ 3.111,77	-0,23%	R\$ 71.343.896,64	1,91%	0,16%
BR HOTÉIS FII	R\$ 21.844.867,95	R\$ 20.312.498,30	R\$ 15.132,97	0,07%	R\$ 131.259.862,94	15,48%	2,33%
HAZ FII	R\$ 2.520.087,18	R\$ 2.520.188,62	R\$ 101,44	0,00%	R\$ 78.966.948,98	3,19%	0,29%
AQUILLA FII	R\$ 232.666,51	R\$ 232.315,99	-R\$ 350,52	-0,15%	R\$ 142.961.004,61	0,16%	0,03%
TOTAL	R\$ 25.961.467,73	R\$ 24.425.737,23		0,04%			2,80%
TOTAL DA CARTEIRA	R\$ 871.263.988,64	R\$ 871.948.410,48		0,61%			100%

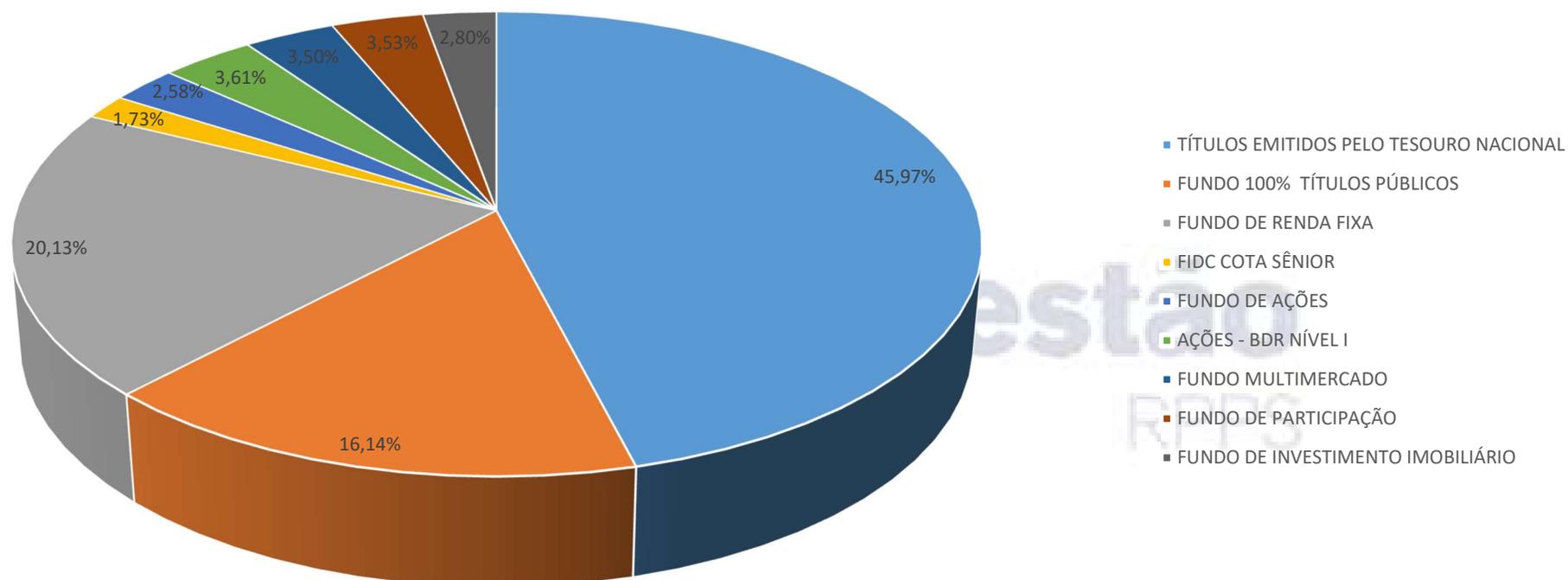


4.2 FUNDOS ESTRESSADOS NA CARTEIRA DO INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO – SÃO SEBASTIÃO PREV

FUNDOS ESTRESSADOS	SALDO EM 31/08/2023
AQUILLA FII	R\$ 232.315,99
BBIF MASTER FIDC LP	R\$ 3.668.496,75
BRASIL FLORESTAL FIC FIP	R\$ 1.570.269,53
BRASIL FLORESTAL FIP MULTIESTR	R\$ 10.368.901,37
FII BR HOTEIS	R\$ 20.312.498,30
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	-R\$ 154.507,69
HAZ FII	R\$ 2.520.188,62
INCENTIVO II FIDC MULTISETORIAL	R\$ -
INCENTIVO MULT I FIDC SÉRIE A	R\$ 1.591.598,70
LME IMA-B	R\$ 9.536.146,97
LME IPCA FIDC SENIOR	R\$ 9.846.577,13
SÃO DOMINGOS FII	R\$ 1.360.734,32
TOWER BRIDGE II RF IMA-B 5	R\$ 16.042.354,61
TOWER RF FI IMA-B	R\$ 14.980.336,05
W7 FIP	R\$ 16.153.731,45
WNG FIC FIM CP	R\$ 1.424.307,28
TOTAL	R\$ 109.453.949,38



4.3 DEMONSTRAÇÃO GRÁFICA





5. CARTEIRA

5.1 RISCO DA CARTEIRA

SEGMENTO	VaR	CONTROLE VaR – POLÍTICA DE INVESTIMENTOS
RENDA FIXA	0,22%	5%
RENDA VARIÁVEL	7,17%	20%
EXTERIOR	6,50%	20%
ESTRUTURADOS	2,62%	20%
IMOBILIÁRIO	0,02%	20%
SÃO SEBASTIÃO PREV	0,46%	

5.2. ANÁLISE DE LIQUIDEZ

PERÍODO	VALOR	%
DE 0 A 30 DIAS	R\$ 345.392.431,23	39,61%
DE 31 A 365 DIAS	R\$ 13.380.735,03	1,53%
ACIMA DE 365 DIAS	R\$ 513.175.244,22	58,85%
TOTAL	R\$ 871.948.410,48	100,00%

5.3 DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO

5.3.1 RENDA FIXA

Nº	ATIVO	RENTABILIDADE	VOLATILIDADE	VALOR
1	NTN-B 2024	0,81	0,19	R\$ 40.907.871,51
2	NTN-B 2026	0,64	0,19	R\$ 19.038.584,81
3	NTN-B 2030	0,58	0,19	R\$ 28.722.391,48
4	NTN-B 2035	0,74	0,36	R\$ 48.647.435,40
5	NTN-B 2035	0,68	0,19	R\$ 2.821.586,95
6	NTN-B 2035	0,76	0,19	R\$ 20.988.145,87
7	NTN-B 2035	0,73	0,19	R\$ 7.140.624,87
8	NTN-B 2040	0,6	0,19	R\$ 66.559.359,61
9	NTN-B 2045	0,75	0,43	R\$ 57.596.164,81
10	NTN-B 2050	0,73	6,43	R\$ 5.461.747,28
11	NTN-B 2055	0,62	6,38	R\$ 1.773.207,64



SÃO SEBASTIÃO PREV
INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO
(criado pela Lei Complementar nº 241/2019)



12	NTN-B 2055	0,62	6,36	R\$ 77.825.672,06
13	NTN-B 2055	0,73	0,83	R\$ 21.554.570,41
14	NTN-B 2055	0,68	6,23	R\$ 1.839.986,26
15	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,6	1,98	R\$ 44.426.126,68
16	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,77	1,9	R\$ 75.996.243,06
17	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,58	2,01	R\$ 20.315.733,84
18	CAIXA FIC PRATICO RF CP	0,89	0,01	R\$ 16.381,08
19	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,24	0,05	R\$ 26.404.116,17
20	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,16	0,04	R\$ 73.863.611,10
21	BB PREV RF FLUXO FIC	1,05	0,03	R\$ 9.047.047,84
22	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,2	0,29	R\$ 14.980.336,05
23	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,39	1,36	R\$ 9.536.146,97
24	TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	3,47	9,38	R\$ 16.042.354,61
25	SANTANDER RF REF DI INSTIT PREMIUM FIC FI	1,33	0,12	R\$ 25.644.962,15
26	BBIF MASTER FIDC LP	-0,31	1,04	R\$ 3.668.496,75
27	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	-0,59	1,97	R\$ 1.591.598,70
28	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	-0,38	1,25	R\$ 9.846.577,13
TOTAL DA CARTEIRA				R\$ 732.257.081,09





5.3.2 RENDA VARIÁVEL

Nº	ATIVO	RENTABILIDADE	VOLATILIDADE	VALOR
1	XP INVESTOR FI DE ACOES	-4,39	11,03	R\$ 9.093.741,74
2	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	-5,14	14,23	R\$ 13.380.735,03
TOTAL NA CARTEIRA				R\$ 22.474.476,77

RISCO X RETORNO - RENDA VARIÁVEL





5.3.3 RENDA NO EXTERIOR

Nº	ATIVO	RENTABILIDADE	VOLATILIDADE	VALOR
1	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,9	17,55	R\$ 16.635.087,91
2	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	2,83	15,37	R\$ 14.851.386,81
TOTAL NA CARTEIRA				R\$ 31.486.474,72

RISCO X RETORNO - FUNDOS NO EXTERIOR





5.3.4 FUNDOS ESTRUTURADOS

Nº	ATIVO	RENTABILIDADE	VOLATILIDADE	VALOR
1	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-0,92	12,02	R\$ 29.097.992,85
2	WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	-0,64	2,14	R\$ 1.424.307,28
3	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	0	0	-R\$ 154.507,69
4	W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,16	0,53	R\$ 16.153.731,45
5	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	-0,01	0,03	R\$ 1.570.269,53
6	INFRA SANEAMENTO - FIP	0	0,01	R\$ 2.843.945,88
7	BRASIL FLORESTAL - FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,02	0,06	R\$ 10.368.901,37
TOTAL NA CARTEIRA				R\$ 61.304.640,67

RISCO X RETORNO - FUNDOS ESTRUTURADOS





5.3.5 FUNDOS IMOBILIÁRIOS

Nº	ATIVO	RENTABILIDADE	VOLATILIDADE	VALOR
1	SÃO DOMINGOS FI IMOBILIÁRIO FII	-0,23	0,76	R\$ 1.360.734,32
2	BR HOTÉIS FII	0,07	0,23	R\$ 20.312.498,30
3	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	0	0,01	R\$ 2.520.188,62
4	AQUILLA FII	-0,15	0,5	R\$ 232.315,99
TOTAL NA CARTEIRA				R\$ 24.425.737,23

RISCO X RETORNO - FUNDOS IMOBILIÁRIOS





SÃO SEBASTIÃO PREV
INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO
(criado pela Lei Complementar nº 241/2019)



6. RESULTADO APURADO

6.1 META ATUARIAL X RENTABILIDADE

AGOSTO		
IPCA + 4,63%a.a	MÊS	ANO
RENTABILIDADE	0,61%	7,25%
IPCA + META ATUARIAL	0,64%	6,39%

6.2 META ATUARIAL ACUMULADA X RENTABILIDADE ACUMULADA

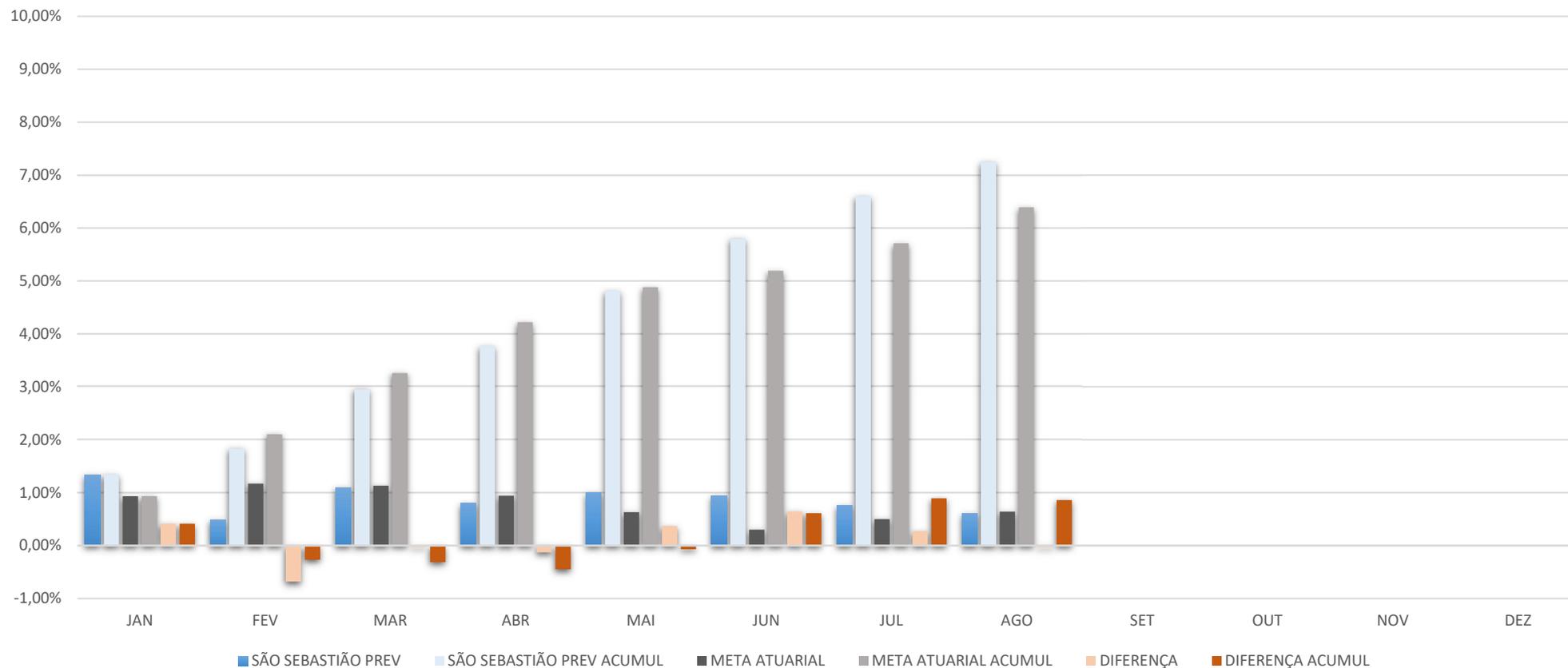
IPCA + 4,63%a.a	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
SÃO SEBASTIÃO PREV	1,34%	0,49%	1,10%	0,80%	1,00%	0,94%	0,76%	0,61%				
SÃO SEBASTIÃO PREV ACUMUL	1,34%	1,83%	2,95%	3,77%	4,81%	5,80%	6,60%	7,25%				
META ATUARIAL	0,93%	1,17%	1,13%	0,94%	0,63%	0,30%	0,50%	0,64%				
META ATUARIAL ACUMUL	0,93%	2,10%	3,26%	4,22%	4,88%	5,19%	5,71%	6,39%				
DIFERENÇA p.p	0,41	-0,68	-0,03	-0,13	0,37	0,64	0,26	-0,03				
DIFERENÇA ACUMUL p.p	0,41	-0,27	-0,31	-0,45	-0,07	0,61	0,89	0,86				



SÃO SEBASTIÃO PREV
INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO
(criado pela Lei Complementar nº 241/2019)



META ATUARIAL ACUMULADA X RENTABILIDA ACUMULADA



SÃO SEBASTIÃO, 25 DE SETEMBRO DE 2023.



COMITÊ DE INVESTIMENTOS

PARECER DO

O Comitê de Investimentos do SSPREV analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês de AGOSTO DE 2023 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do SSPREV e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos, conforme registro na ata de reunião realizada no dia 26/09/2023.

RODRIGO DE AZEVEDO CALDEIRA
PRESIDENTE DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS
INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO

CONSELHO FISCAL

O Conselho Fiscal, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, **APROVOU** o relatório de investimentos referente ao mês de AGOSTO DE 2023, conforme registro na ata de reunião realizada no dia 27/10/2023.

JEFFERSON LUIZ MELO PEREIRA SILVA
PRESIDENTE DO CONSELHO FISCAL
INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO



SÃO SEBASTIÃO PREV
INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO
(criado pela Lei Complementar nº 241/2019)



RODRIGO DE AZEVEDO CALDEIRA
PRESIDENTE CPA-10 / CP RPPS CGINV I
INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO

JULIANO SOUZA FREITAS
GERENTE DE ORC. FINANÇAS E CONTABILIDADE – CPA 10
INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO

ROGER CARLOS DOS SANTOS
ASSISTENTE DE FINANÇAS - CPA 20 / CP RPPS CGINV II
INSTITUTO PREVIDENCIÁRIO DO MUNICÍPIO DE SÃO SEBASTIÃO

