



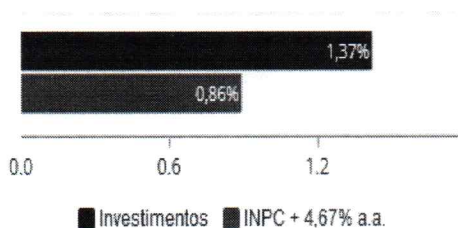
Parecer do Comitê de Investimento – Janeiro 2023

Este parecer tem como finalidade auxiliar os conselheiros na tomada de decisões sobre as estratégias adotadas pelo Comitê de Investimento do SERTPREV relativo às ações estabelecidas na Política de Investimentos do Instituto, tendo como referência os limites fixados pela Resolução 4.963/2021 e alterações posteriores visando garantir a segurança, liquidez e rentabilidade necessárias, assegurando os benefícios e esclarecendo aos conselheiros, membros do comitê de Investimento e a Diretora Executiva do SERTPREV quanto aos objetivos e restrições relativos aos investimentos dos ativos financeiros do Regime Próprio.

Retorno dos Investimentos competência janeiro/2023

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	522.212.042,58	43.550.000,00	43.523.859,12	520.397.305,34	7.159.121,90	7.159.121,90	1,37%	1,37%	0,88%	0,88%	159,40%	1,53%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



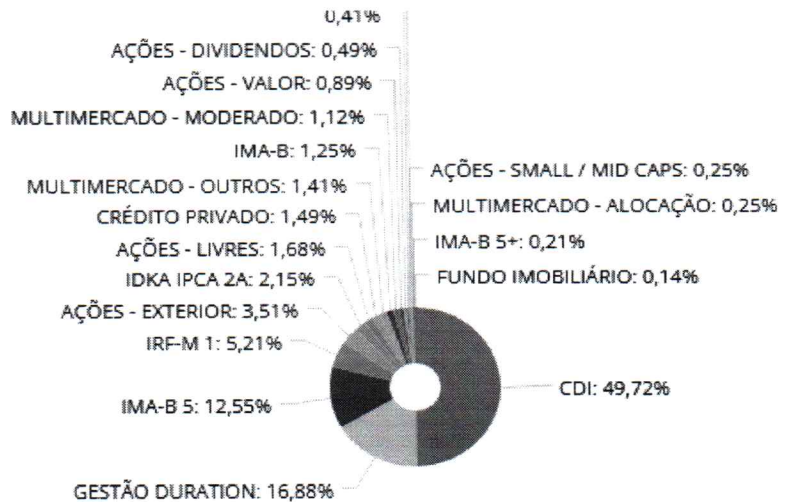
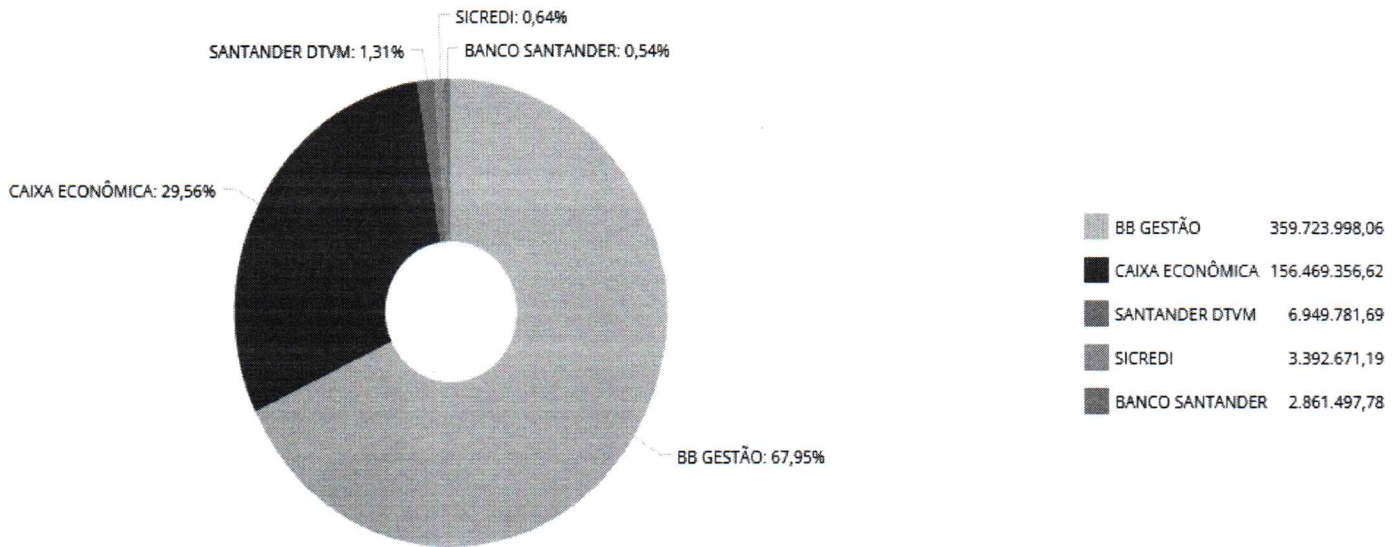
Foram utilizados para a emissão deste PARECER, o relatório mensal da Consultoria de Investimento, Quadro de Enquadramento conforme Resolução CMN 4.963/2021, Rentabilidade versus Risco e Volatilidade dos fundos de investimentos, análise do atual cenário econômico e político referente ao mês de janeiro de 2023, análises de mercado de Investimento de outras Instituições Financeiras, e outros documentos complementares internos (balancetes contábeis) do RPPS de Sertãozinho/SP.



SERTPREV

Instituto Municipal de Previdência de Sertãozinho-SP

Rua Cel. Francisco Schmidt, 1.582 – Centro – CEP 14160-710 Fone:(16)3945-2781
e-mail: sertprev@sertprev.sp.gov.br



■ CDI	263.195.844,83	■ GESTÃO DURATION	89.365.047,22	■ IMA-B 5	66.434.757,57
■ IRF-M 1	27.576.557,80	■ AÇÕES - EXTERIOR	18.589.383,61	■ IDKA IPCA 2A	11.407.995,23
■ AÇÕES - LIVRES	8.896.097,25	■ CRÉDITO PRIVADO	7.889.917,41	■ MULTIMERCADO - OUTROS	7.442.808,07
■ IMA-B	6.618.789,10	■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.932.861,68	■ AÇÕES - VALOR	4.702.589,72
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	2.615.565,16	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.154.051,35	■ MULTIMERCADO - MACRO	2.067.061,23
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.344.609,40	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.302.272,31	■ IMA-B 5+	1.100.296,40
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	760.800,00				

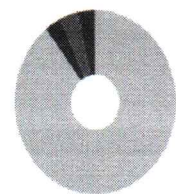


SERTPREV

Instituto Municipal de Previdência de Sertãozinho-SP

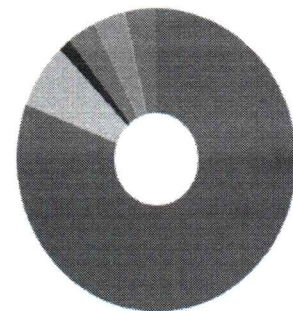
Rua Cel. Francisco Schmidt, 1.582 – Centro – CEP 14160-710 Fone:(16)3945-2781
e-mail: sertprev@sertprev.sp.gov.br

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	529.397.305,34
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	427.951.835,98	80,84%	0,00%	65,00%	100,00%	101.445.469,36
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	529.397.305,34
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	26.469.865,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	37.747.452,17	7,13%	0,00%	15,00%	60,00%	279.890.931,03
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	317.638.383,20
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	105.879.461,07
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	26.469.865,27
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	7.889.917,41	1,49%	0,00%	2,00%	5,00%	18.579.947,86
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	26.469.865,27
Total Renda Fixa	100,00%	473.589.205,56	89,46%	0,00%	86,00%	460,00%	



- RENDA FIXA 473.589.205,56
- RENDA VARIÁVEL 17.558.861,53
- EXTERIOR 18.589.383,61
- ESTRUTURADOS 18.899.054,64
- FUNDO IMOBILIÁRIO 760.800,00

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	17.558.861,53	3,32%	0,00%	5,00%	30,00%	141.260.330,07
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	158.819.191,60
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	18.899.054,64	3,57%	0,00%	4,00%	10,00%	34.040.675,89
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	26.469.865,27
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	26.469.865,27
Artigo 11º	5,00%	760.800,00	0,14%	0,00%	1,00%	5,00%	25.709.065,27
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	37.218.716,17	7,03%	0,00%	10,00%	85,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	52.939.730,53
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	52.939.730,53
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	18.589.383,61	3,51%	0,00%	4,00%	10,00%	34.350.346,92
Total Exterior	10,00%	18.589.383,61	3,51%	0,00%	4,00%	30,00%	

- 7º I b
- 7º III a
- 7º V b
- 8º I
- 10º I
- 11º
- 9º III



SERTPREV
Instituto Municipal de Previdência de Sertãozinho-SP
Rua Cel. Francisco Schmidt, 1.582 – Centro – CEP 14160-710 Fone:(16)3945-2781
e-mail: sertprev@sertprev.sp.gov.br


DESCRIÇÃO DA RECEITA	JANEIRO
CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR ATIVO – 14%	1.468.176,53
CONTRIBUIÇÃO INATIVO E PENSIONISTA – 14%	56.924,48
CONTRIBUIÇÃO PATRONAL – 17,2%	1.803.760,15
CONTRIBUIÇÃO SUPLEMENTAR - 19,80%	1.535.293,89
COMPENSAÇÃO PREVIDENCIÁRIA	104.517,44
RENDIMENTO DE APLICAÇÃO FINANCEIRA	4.234.530,80
DEMAIS RECEITAS PREVIDENCIÁRIAS (TAC) e OUTRAS	79.788,36
TOTAL	9.282.991,65

DESCRIÇÃO DA DESPESA	JANEIRO
	EMPENHADO
PROVENTOS DE APOSENTADORIAS E PENSÕES	4.527.548,57
DESPEAS COM PESSOAL ATIVO - UG	110.994,90
OUTRAS DESPEAS ADMINISTRATIVAS	258.000,90
OUTRAS DESPEAS PREVIDENCIÁRIAS	174.822,19
TOTAL	5.071.366,56

As estratégias adotadas são para resgates no Fundo BB Perfil RF LP para investimentos em fundos de vértice para 2024 e 2027 como BB Títulos Públicos XXI vértice 2024 e BB Títulos Públicos Vértice 2027 e resgates em fundos IDKA e IMA-B5+ da Caixa Econômica Federal para investimentos no fundo Caixa Brasil 2024 IV.

Diante do exposto, entendemos que no contexto geral a carteira de investimento do SERTPREV encontra-se diversificada.

Sertãozinho/SP - Janeiro/2023


Vanderlei Moscardini de Oliveira
Presidente do Comitê de Investimentos