



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

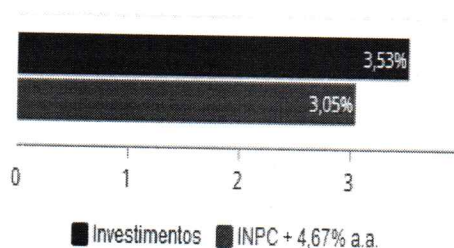
Parecer do Comitê de Investimento – Março 2023

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 março/2023:

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	522.212.042,56	43.550.000,00	43.523.859,12	529.397.305,34	7.159.121,90	7.159.121,90	1,37%	1,37%	0,86%	0,86%	159,40%	1,53%
Fevereiro	529.397.305,34	11.092.858,33	10.289.658,70	534.648.807,48	4.448.302,51	11.607.424,41	0,84%	2,22%	1,10%	1,97%	112,79%	2,34%
Março	534.648.807,48	4.109.981,81	4.000.000,00	541.614.947,23	6.856.157,94	18.463.582,35	1,28%	3,53%	1,06%	3,05%	115,79%	1,28%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



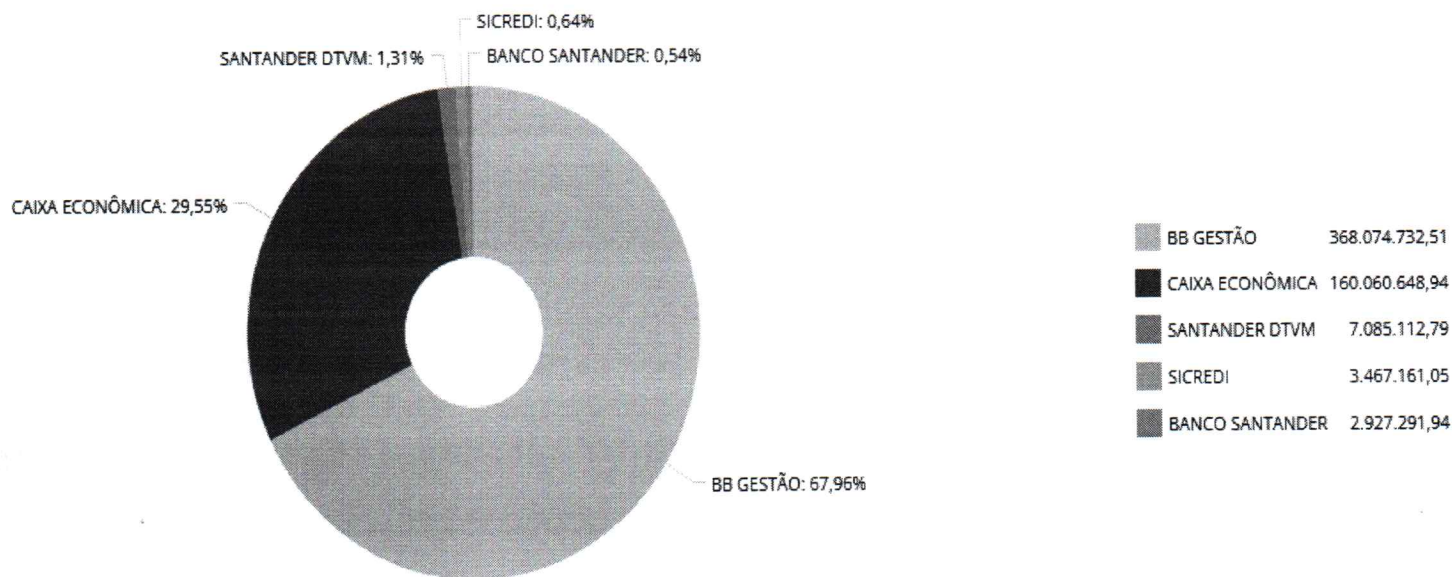
Foram utilizados para a emissão deste PARECER, o relatório mensal da Consultoria de Investimento, Quadro de Enquadramento conforme Resolução CMN 4.963/2021, Rentabilidade versus Risco e Volatilidade dos fundos de investimentos, análise do atual cenário econômico e político referente ao mês de março de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



SERTPREV

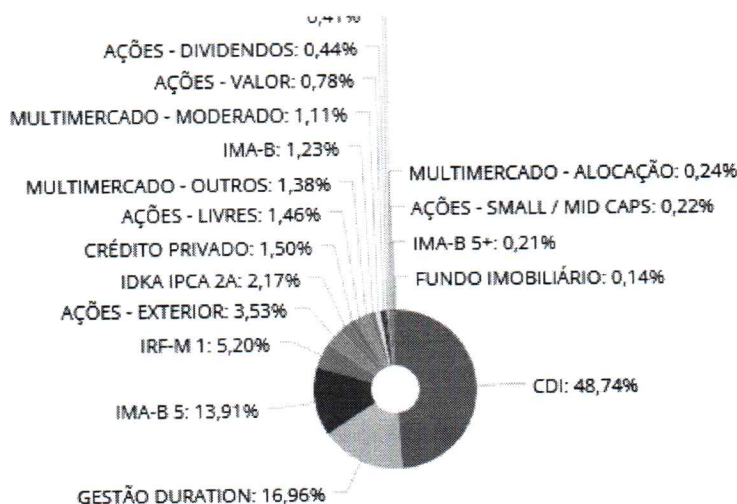
Instituto Municipal de Previdência de Sertãozinho-SP

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



BB GESTÃO	368.074.732,51
CAIXA ECONÔMICA	160.060.648,94
SANTANDER DTVM	7.085.112,79
SICREDI	3.467.161,05
BANCO SANTANDER	2.927.291,94

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Março / 2023)



■ CDI	264.005.381,44	■ GESTÃO DURATION	91.835.355,85	■ IMA-B 5	75.333.445,62
■ IRF-M 1	28.176.013,17	■ AÇÕES - EXTERIOR	19.097.077,82	■ IDKA IPCA 2A	11.738.891,10
■ CRÉDITO PRIVADO	8.115.219,53	■ AÇÕES - LIVRES	7.893.550,61	■ MULTIMERCADO - OUTROS	7.488.759,98
■ IMA-B	6.673.584,13	■ MULTIMERCADO - MODERADO	6.013.796,32	■ AÇÕES - VALOR	4.209.278,57
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	2.369.049,95	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.199.446,81	■ MULTIMERCADO - MACRO	2.097.547,17
■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.283.875,90	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.181.197,08	■ IMA-B 5+	1.153.356,18
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	750.120,00				



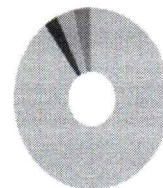
SERTPREV

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

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Março / 2023)

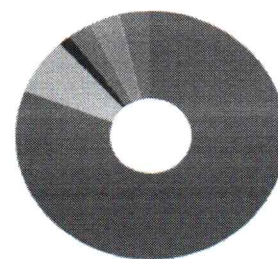
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	541.614.947,23
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	439.400.601,11	81,13%	0,00%	65,00%	100,00%	102.214.346,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	541.614.947,23
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.080.747,36
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	39.515.426,38	7,30%	0,00%	15,00%	60,00%	285.453.541,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	324.968.968,34
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	108.322.989,45
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	27.080.747,36
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	8.115.219,53	1,50%	0,00%	2,00%	5,00%	18.965.527,83
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	27.080.747,36
Total Renda Fixa	100,00%	487.031.247,02	89,92%	0,00%	86,00%	460,00%	



- RENDA FIXA 487.031.247,02
- RENDA VARIÁVEL 15.653.076,21
- EXTERIOR 19.097.077,82
- ESTRUTURADOS 19.083.426,18
- FUNDO IMOBILIÁRIO 750.120,00

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Março / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, inciso I	30,00%	15.653.076,21	2,89%	0,00%	5,00%	30,00%	146.831.407,96
Artigo 8º, inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	162.484.484,17
Artigo 10º, inciso I	10,00%	19.083.426,18	3,52%	0,00%	4,00%	10,00%	35.078.068,54
Artigo 10º, inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.080.747,36
Artigo 10º, inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.080.747,36
Artigo 11º	5,00%	750.120,00	0,14%	0,00%	1,00%	5,00%	26.330.627,36
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	35.486.622,39	6,55%	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%	54.161.494,72
Artigo 9º, inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	54.161.494,72
Artigo 9º, inciso III	10,00%	19.097.077,82	3,53%	0,00%	4,00%	10,00%	35.064.416,90
Total Exterior	10,00%	19.097.077,82	3,53%	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

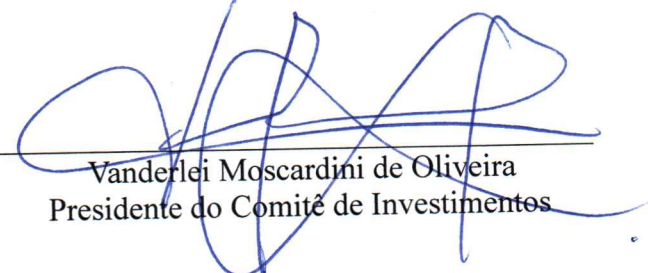
Rua Cel. Francisco Schmidt, 1.582 – Centro – CEP 14160-710 Fone:(16)3945-2781
e-mail: sertprev@sertprev.sp.gov.br

DESCRIÇÃO DA RECEITA	MARÇO
CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR ATIVO – 14%	1.478.487,02
CONTRIBUIÇÃO INATIVO E PENSIONISTA – 14%	52.394,04
CONTRIBUIÇÃO PATRONAL – 17,2%	1.816.427,18
CONTRIBUIÇÃO SUPLEMENTAR - 19,80%	2.091.003,65
COMPENSAÇÃO PREVIDENCIÁRIA	110.827,34
RENDIMENTO DE APLICAÇÃO FINANCEIRA	79.726,13
DEMAIS RECEITAS PREVIDENCIÁRIAS (TAC) e OUTRAS	79.476,57
TOTAL	5.708.341,93

DESCRIÇÃO DA DESPESA	MARÇO
	EMPENHADO
PROVENTOS DE APOSENTADORIAS E PENSÕES	4.571.349,41
DESPESAS COM PESSOAL ATIVO - UG	109.714,12
OUTRAS DESPESAS ADMINISTRATIVAS	35.298,10
OUTRAS DESPESAS PREVIDENCIÁRIAS	665.784,40
TOTAL	5.382.146,03

Na competência de março/2023 o comitê deliberou por não fazer movimentações, visto que ocorreram os pagamentos de cupons em fevereiro/2023 e foram realizadas as alocações necessárias no período. Para o excedente mensal, proveniente dos repasses dos órgãos, o comitê mantém sua estratégia de alocação em fundos atrelados ao CDI.

Sertãozinho/SP - Março/2023


Vanderlei Moscardini de Oliveira
Presidente do Comitê de Investimentos