



ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL
MUNICÍPIO DE NOVA ESPERANÇA DO SUL
SECRETARIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO PÚBLICA

REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERV. PUB. DE NOVA ESPERANÇA DO SUL - NESPREV
COMITÊ DE INVESTIMENTOS

PARECER 009/2022 DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS AO CONSELHO FISCAL

Atendendo os requisitos de aderência ao nível I do Pró-Gestão RPPS, o presente Comitê de Investimentos, emite o seguinte relatório com a rentabilidade, controle de risco e aderência das alocações à política de Investimentos, em relação ao mês de agosto de 2022.

Indicadores Econômicos:

No Brasil, destacamos o resultado do PIB do 2º trimestre de 2022 que cresceu 1,2% frente a primeiro trimestre anterior. O resultado foi puxado pela alta na indústria (2,2%), seguida pelos serviços (1,3%) e a Agropecuária avançou (0,5%). Pela ótica da demanda, o consumo das famílias teve expansão de 5,3% influenciado pelo aumento do crédito, além do saque extraordinário do FGTS. O consumo do governo, por sua vez, cresceu 0,87% e os Investimentos subiram 1,5%. No setor externo as exportações caíram 2,5%, enquanto as importações subiram 7,6%. No âmbito externo, nos EUA, o mercado de trabalho continua forte e registrou a criação de 315 mil vagas de trabalho em agosto, com a taxa de desemprego indo para 3,7%. Esse cenário, aliado a inflação elevada, seguem como determinante para a condução da política monetária pelo FED.

No Brasil, destacamos o resultado do PIB do 2º trimestre de 2022 que cresceu 1,2% frente a primeiro trimestre anterior. O resultado foi puxado pela alta na indústria (2,2%), seguida pelos serviços (1,3%) e a Agropecuária avançou (0,5%). Pela ótica da demanda, o consumo das famílias teve expansão de 5,3% influenciado pelo aumento do crédito, além do saque extraordinário do FGTS. O consumo do governo, por sua vez, cresceu 0,87% e os Investimentos subiram 1,5%. No setor externo as exportações caíram 2,5%, enquanto as importações subiram 7,6%. No âmbito externo, nos EUA, o mercado de trabalho continua forte e registrou a criação de 315 mil vagas de trabalho em agosto, com a taxa de desemprego indo para 3,7%. Esse cenário, aliado a inflação elevada, seguem como determinante para a condução da política monetária pelo FED. O Ibovespa fechou a sexta-feira (02) em alta de 0,42% aos 110.864 pts, no entanto o índice recuou 1,28% na semana. Já as bolsas americanas fecharam a semana em baixa com o S&P 500 e Do Jones, com quedas de 2,75% e 2,31% respectivamente, reflexo de relatório de emprego que reforçou as apostas de que o FED continuará a elevar os juros.

Na Renda Fixa, os juros futuros fecharam a última semana de agosto em queda, com o mercado local se descolando do cenário externo de aversão ao risco em meio as expectativas novas elevações nos juros nos EUA e na Europa. Neste sentido, os índices da Anbima seguem com desempenho positivo no ano. Desse modo, seguimos sugerindo aportes em ativos de curto prazo (CDI, IRF-M 1) e médio, com o intuito de amenizar e obter ganhos dentro deste contexto.

As expectativas do fechamento da taxa Selic para 2022, foram estimadas em 13,75%. Para 2023 a projeção foi estimada em 11,25%.



ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL
MUNICÍPIO DE NOVA ESPERANÇA DO SUL
SECRETARIA DE ADMINISTRAÇÃO E GESTÃO PÚBLICA

REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERV. PUB. DE NOVA ESPERANÇA DO SUL - NESPREV
COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Investimentos Rentabilidade x Meta:


No mês de agosto, onde a rentabilidade obtida foi de R\$ 182.237,66 (Cento e oitenta e dois mil, duzentos e trinta e sete reais e sessenta e seis centavos), o que representa um percentual 0,71% ao mês, e perfaz 6,04% da meta para o período e a meta acumulada (INPC +5,04%) fechou em 8,14%, com isso, no momento o NESPREV esta atingindo o percentual de 74,20% da meta. Sendo assim, a rentabilidade acumulada do NESPREV fechou em R\$ 1.454.264,20.

No referido mês não houve movimentações financeiras, apenas o aporte mensal que será realizado pela primeira vez no Banco Daycoval e aplicado no fundo DAYCOVAL Crédito Privado.

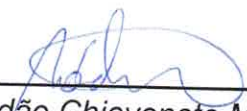
Política de Investimentos:

No tocante dos limites da política de investimentos, as aplicações financeiras, estão em conformidade com a legislação, segundo relatórios em anexo.

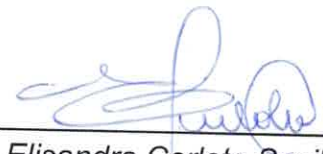
Nova Esperança do Sul, 14 de setembro de 2022.



Ana Paula Pizzolato da Silveira
Membro Comitê de Investimentos



Adão Chiavenato Machado
Membro Comitê de Investimentos



Elisandra Carloto Saciloto
Membro Comitê de Investimentos

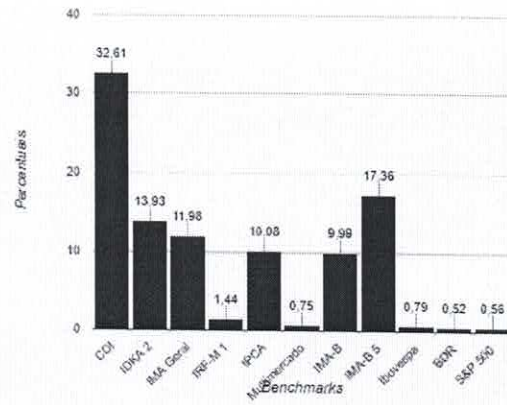
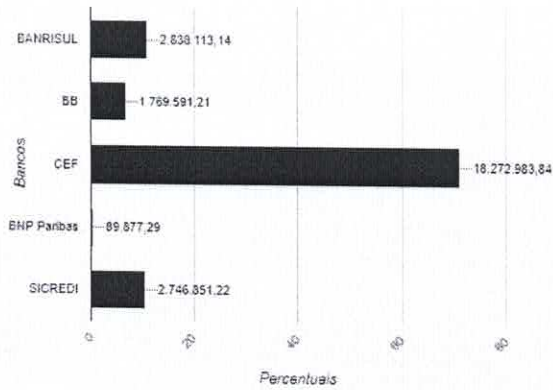
RELATÓRIO DINÂMICO - REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL SOR SRV. PUB DE NOVA ESPERANÇA DO SUL

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA	CNPJ	R\$	%
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	21.743.480/0001-50	R\$ 702.445,66	2,73%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	21.007.180/0001-03	R\$ 1.369.988,53	5,33%
BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	04.828.795/0001-81	R\$ 64.265,91	0,25%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	11.311.874/0001-86	R\$ 32.979,02	0,13%
BANRISUL SUPER FI RENDA FIXA	02.430.487/0001-78	R\$ 68.043,61	0,26%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.078.994/0001-90	R\$ 1.341.397,22	5,22%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	10.418.362/0001-50	R\$ 33.600,16	0,13%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	13.077.418/0001-49	R\$ 394.593,83	1,53%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	R\$ 4.853.093,48	18,87%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	23.215.097/0001-55	R\$ 1.384.299,34	5,38%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	R\$ 2.211.379,45	8,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	R\$ 4.464.423,72	17,36%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	R\$ 2.568.181,83	9,99%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.061.217/0001-28	R\$ 1.675.115,52	6,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	R\$ 103.179,46	0,40%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	44.683.343/0001-73	R\$ 113.043,33	0,44%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	30.036.235/0001-02	R\$ 159.925,09	0,62%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	R\$ 133.415,45	0,52%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	10.406.511/0001-61	R\$ 89.877,29	0,35%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24.633.818/0001-00	R\$ 144.412,43	0,56%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	19.196.599/0001-09	R\$ 267.262,20	1,04%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	24.634.187/0001-43	R\$ 2.335.176,59	9,08%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	44.683.378/0001-02	R\$ 606.927,17	2,36%
BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	46.521.007/0001-50	R\$ 600.390,41	2,33%
		Total: R\$ 25.717.416,70	100,00%

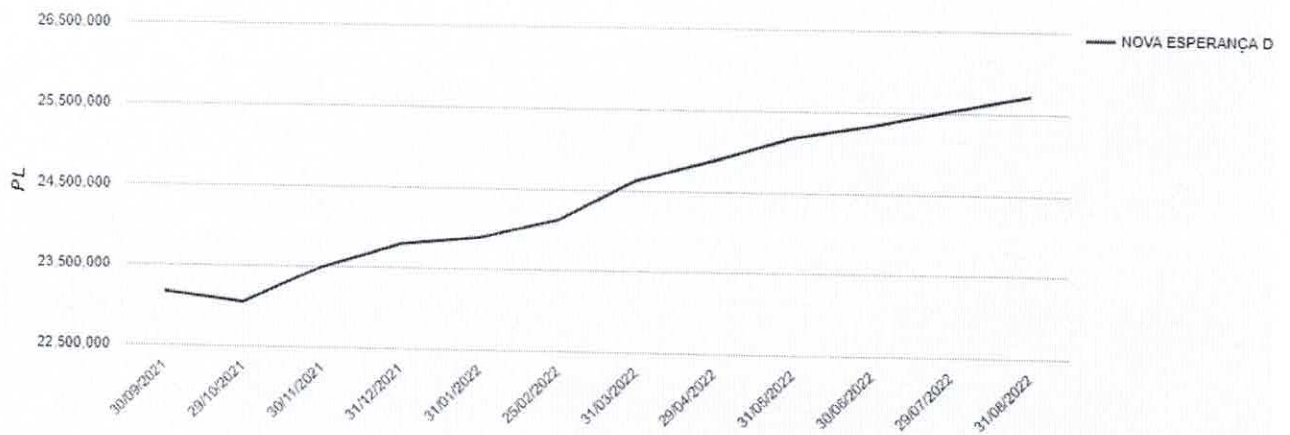
COMPETÊNCIA	SALDO RPPS	RENDIMENTOS DO ANO	RENTABILIDADE MÊS	RENTABILIDADE ACUMULADA	META ATUARIAL ACUMULADA
08/2022	R\$ 25.717.416,70	R\$ 1.454.264,20	0,71%	6,04%	8,14%

Percentual por Instituições Financeiras

Percentual por Benchmark



Evolução Patrimonial em R\$





ENQUADRAMENTO CONFORME POLÍTICA DE INVESTIMENTO - 08/2022

FUNDO DE INVESTIMENTO		ENQUADRAMENTO CONFORME POLÍTICA DE INVESTIMENTO - 08/2022				Status
Fundo de investimento	CNPJ	Saldo	% Recurso	% Limite Alvo	% Limite Superior	Status
FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"						
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	21.743.480/0001-50	R\$ 702.445,66				
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	21.007.180/0001-03	R\$ 1.369.988,53				
BANRISUL FOCO IDKA IPCA G FI RENDA FIXA LP	04.828.795/0001-81	R\$ 64.265,91				
BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	46.521.007/0001-50	R\$ 600.390,41				
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	11.311.874/0001-86	R\$ 32.979,02				
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.078.994/0001-90	R\$ 1.341.397,22				
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	44.683.378/0001-02	R\$ 606.927,17				
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	23.215.097/0001-55	R\$ 1.384.299,34				
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	R\$ 2.211.379,45				
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	R\$ 4.464.423,72				
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	R\$ 2.568.181,83				
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.061.217/0001-28	R\$ 1.675.115,52				
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	R\$ 103.179,46				
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	24.634.187/0001-43	R\$ 2.335.176,59				
		R\$ 19.460.149,83	75,67%	51,00%	100,00%	ENQUADRADO
FI Renda Fixa - Art. 7º, III, "a"						
BANRISUL SUPER FI RENDA FIXA	02.430.487/0001-78	R\$ 68.043,61				
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	13.077.418/0001-49	R\$ 394.593,83				
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	R\$ 4.853.093,48				
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	19.196.599/0001-09	R\$ 267.262,20				
		R\$ 5.582.993,12	21,71%	40,00%	65,00%	ENQUADRADO
ETF - Art. 8º, II						
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	10.406.511/0001-61	R\$ 89.877,29				
		R\$ 89.877,29	0,35%	2,50%	20,00%	ENQUADRADO
Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º, A, III						
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	R\$ 133.410,12				
		R\$ 133.410,12	0,52%	1,50%	10,00%	ENQUADRADO
Fundos Multimercados - Art. 10º, I						
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	10.418.362/0001-50	R\$ 33.600,16				
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	44.683.343/0001-73	R\$ 113.043,33				
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	30.036.235/0001-02	R\$ 159.925,09				
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24.633.818/0001-00	R\$ 144.412,43				
		R\$ 450.981,00	1,75%	1,50%	10,00%	ENQUADRADO
Total:		R\$ 25.717.411,37	100,00%			

"As informações dos relatórios são obtidas de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, onde a responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela empresa. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos de investimento. Fundos de investimentos não contam com a garantia do administrador, gestor, de qualquer mecanismo seguro ou do fundo garantidor de crédito. Rentabilidade obtida no passado não é garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendado a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos".

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	NOVA ESPERANÇA DO SUL FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR (95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,05%	702.445,66
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,45%	1,26%	1.369.988,53
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	1,35%	1,10%	64.265,91
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,11%	0,26%	0,00
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,48%	1,54%	0,00
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	1,46%	1,49%	600.390,41
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,02%	0,05%	32.979,02
02.430.487/0001-78	BANRISUL SUPER FI RENDA FIXA	0,01%	0,04%	68.043,61
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	1,05%	1.341.397,22
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,40%	0,43%	33.600,16
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,18%	2,35%	0,00
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	0,26%	0,00
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,49%	1,57%	0,00
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,04%	394.593,83
44.683.378/0001-02	CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,55%	38,21%	606.927,17
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,01%	0,05%	4.853.093,48
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,58%	0,86%	1.384.299,34
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,43%	1,33%	2.211.379,45
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,30%	1,17%	4.464.423,72
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,19%	2,38%	2.568.181,83
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,36%	1,12%	1.675.115,52
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,11%	0,26%	103.179,46
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	0,91%	6,18%	113.043,33
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9,01%	11,20%	159.925,09
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,67%	11,56%	133.415,45
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,05%	0,00
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	9,24%	8,87%	89.877,29
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9,02%	11,25%	144.412,43
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,09%	0,22%	267.262,20
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,01%	0,04%	2.335.176,59
	Total:		Total:	R\$ 25.717.416,70

VAR (95%): O VaR indica a perda percentual máxima esperada para um ativo ou portfólio de investimentos, dado um prazo, com um certo nível de confiança. Por exemplo, se o VaR de 1 dia de um fundo é de 4%, com um nível de confiança 95%, significa que, estatisticamente, temos 95% de certeza que, se houver uma perda de hoje para amanhã, o prejuízo máximo será de 4%

% ATIVOS vs RISCO



As informações dos relatórios são obtidas de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, onde a responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela empresa. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos de investimento. Fundos de investimentos não contam com a garantia do administrador, gestor, de qualquer mecanismo seguro ou do fundo garantidor de crédito. Rentabilidade obtida no passado não é garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendado a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos.