

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2022



Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

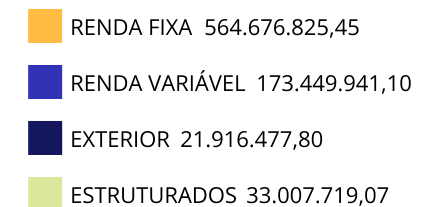
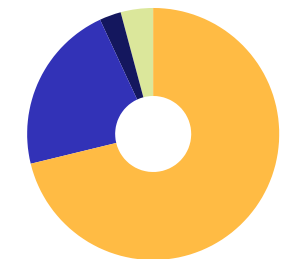
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	50.441.350,25	6,64%	1.050	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	78.200.630,02	10,29%	796	1,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	12.225.286,84	1,61%	575	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	9.925.137,39	1,31%	1.087	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	75.630.263,38	9,95%	336	2,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	2.478.744,49	0,33%	92	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	67.356.226,79	8,86%	269	3,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	135.025.945,90	17,77%	247	4,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	92.180,78	0,01%	322	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.173.823,84	0,29%	253	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	564.518,08	0,07%	1.173	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.951.698,64	0,26%	140	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.548,74	0,00%	868	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	117.518.572,64	15,46%	295	1,67%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	81.994,73	0,01%	47	0,37%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%	1	100,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	11.003.902,93	1,45%	67	2,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	5.156.878,76	0,68%	14	0,62%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	6.630.780,79	0,87%	5.193	1,99%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.849.870,78	0,51%	13.212	2,25%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	6.445.118,33	0,85%	3.616	2,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	22.961.185,52	3,02%	37.274	2,26%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	21.320.254,96	2,81%	25.273	1,49%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	9.770.063,74	1,29%	90	1,38%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	15.547.317,71	2,05%	7.736	9,16%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	12.777.508,72	1,68%	7.558	1,99%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	26.505.713,69	3,49%	3.735	2,88%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	8.754.787,84	1,15%	36	2,48%	Artigo 8º, Inciso I
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	8.147.429,02	1,07%	8.822	1,48%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	8.002.377,94	1,05%	8.596	0,79%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	5.766.670,84	0,76%	316	2,19%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	22.454.018,58	2,95%	10.270	1,30%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	10.463.515,24	1,38%	33.964	0,98%	Artigo 10º, Inciso I
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	75.025,62	0,01%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	15.159,63	0,00%	108	0,61%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	722.741,19	0,10%		1,91%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			760.043.244,35				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2022)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	760.043.244,35
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	436.065.806,40	57,37%	15,00%	29,48%	100,00%	323.977.437,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	117.525.121,38	15,46%	0,00%	23,00%	45,00%	224.494.338,58
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	81.994,74	0,01%	0,00%	0,02%	5,00%	37.920.167,48
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	11.003.902,93	1,45%	0,00%	2,50%	5,00%	26.998.259,29
Total Renda Fixa	100,00%	564.676.825,45	74,30%	15,00%	55,00%	255,00%	



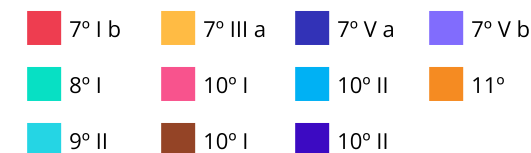
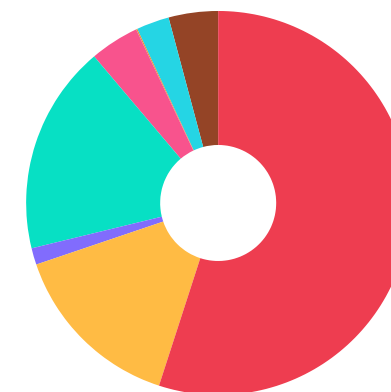
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2022)

Artigos - Renda Variável / Estruturado	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	139.719.480,84	18,38%	5,00%	26,85%	35,00%	126.295.654,68
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	32.917.533,82	4,33%	0,00%	8,00%	10,00%	43.086.790,62
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	90.185,25	0,01%	0,00%	0,03%	5,00%	37.911.976,97
Artigo 11º	5,00%	722.741,19	0,10%	0,00%	0,12%	5,00%	37.279.421,03
Total Renda Variável / Estruturado	35,00%	173.449.941,10	22,82%	5,00%	35,00%	55,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	21.916.477,80	2,88%	0,00%	6,50%	10,00%	54.087.846,64
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,50%	10,00%	76.004.324,44
Total Exterior	10,00%	21.916.477,80	2,88%	0,00%	10,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	361.844.520,42	47,61	-
CAIXA DTVM	198.405.377,35	26,10	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	117.518.572,64	15,46	0,01
ICATU VANGUARDA	26.505.713,69	3,49	0,05
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	18.708.864,42	2,46	0,00
WESTERN ASSET	10.463.515,24	1,38	0,02
XP ASSET MANAGEMENT	8.147.429,02	1,07	0,05
AZ QUEST INVESTIMENTOS	6.630.780,79	0,87	0,02
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.766.670,84	0,76	0,07
ARX INVESTIMENTOS	5.156.878,76	0,68	0,01
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	722.741,19	0,10	-
VILA RICA CAPITAL	81.994,73	0,01	0,07
PLURAL	75.025,63	0,01	0,00
PÁTRIA INVESTIMENTOS	15.159,63	0,00	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	436.065.806,40	57,37	15,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	117.525.121,38	15,46	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	81.994,74	0,01	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	11.003.902,93	1,45	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	139.719.480,84	18,38	5,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	21.916.477,80	2,88	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	32.917.533,82	4,33	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	90.185,25	0,01	0,00	5,00
Artigo 11º	722.741,19	0,10	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,36%	11,74%	4,23%	8,17%	14,78%	22,33%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,17%	-39,75%	-53,06%	-53,17%	-45,24%	-46,16%	-	0,63%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,62%	6,94%	0,09%	2,94%	8,91%	15,68%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	6,74%	0,26%	2,81%	8,72%	15,30%	1,42%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,39%	5,10%	3,01%	3,14%	5,19%	8,56%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,37%	4,93%	2,93%	3,00%	4,78%	7,89%	3,62%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,11%	8,59%	3,43%	6,17%	9,81%	12,55%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,09%	8,39%	3,37%	6,04%	9,57%	12,03%	0,13%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	8,39%	3,37%	6,02%	9,57%	11,94%	0,13%	0,02%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,42%	7,07%	0,43%	3,14%	9,25%	15,75%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,40%	6,90%	0,40%	3,05%	8,97%	15,18%	1,27%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	-	-0,02%	2,35%	-	-	1,46%	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	0,44%	-2,97%	-0,67%	2,48%	2,12%	1,46%	0,06%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,40%	6,91%	0,39%	3,03%	9,03%	15,26%	1,27%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	1,48%	6,12%	1,70%	3,16%	7,25%	12,30%	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45%	5,92%	1,63%	3,07%	6,95%	11,76%	2,43%	0,06%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,93%	7,61%	2,89%	5,46%	9,21%	11,44%	0,00%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,99%	8,08%	3,06%	5,77%	9,78%	11,85%	0,00%	0,01%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-	0,00%	0,00%	0,00%	900,00%	900,00%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	9,35%	3,44%	6,62%	11,58%	15,22%	0,01%	0,01%
IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	7,15%	0,02%	3,11%	8,79%	15,18%	0,75%	0,04%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,45%	6,72%	0,33%	2,85%	9,19%	15,17%	1,29%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	7,34%	0,58%	3,33%	9,40%	16,40%	1,45%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,54%	12,18%	1,25%	6,07%	18,42%	44,21%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
S&P 500 (Benchmark)	-9,34%	-24,77%	-5,28%	-20,85%	-16,76%	6,62%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-8,61%	-19,75%	-2,61%	-17,32%	-9,32%	18,56%	11,68%	0,22%
IBX-50 (Benchmark)	0,48%	5,31%	11,70%	-8,80%	0,58%	19,15%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	0,32%	3,65%	11,39%	-10,01%	-2,13%	15,01%	10,35%	0,22%
IDIV (Benchmark)	-1,80%	9,21%	4,42%	-5,43%	7,21%	28,20%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,48%	4,90%	10,25%	-7,40%	-3,65%	3,03%	9,96%	0,19%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-0,82%	4,29%	9,27%	-7,40%	-2,92%	20,36%	9,88%	0,20%
Ibovespa (Benchmark)	0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-1,29%	-14,48%	14,50%	-18,42%	-28,75%	-30,97%	11,41%	0,27%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-0,36%	1,67%	9,61%	-8,81%	-1,48%	22,12%	11,01%	0,21%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-2,86%	-4,12%	10,23%	-7,79%	-13,85%	0,36%	9,19%	0,21%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	12,12%	10,25%	29,82%	1,82%	5,54%	-11,35%	14,32%	0,30%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-0,45%	2,98%	11,20%	-7,71%	-7,02%	0,43%	10,40%	0,22%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,75%	0,13%	10,37%	-11,83%	-3,48%	-	10,13%	0,23%

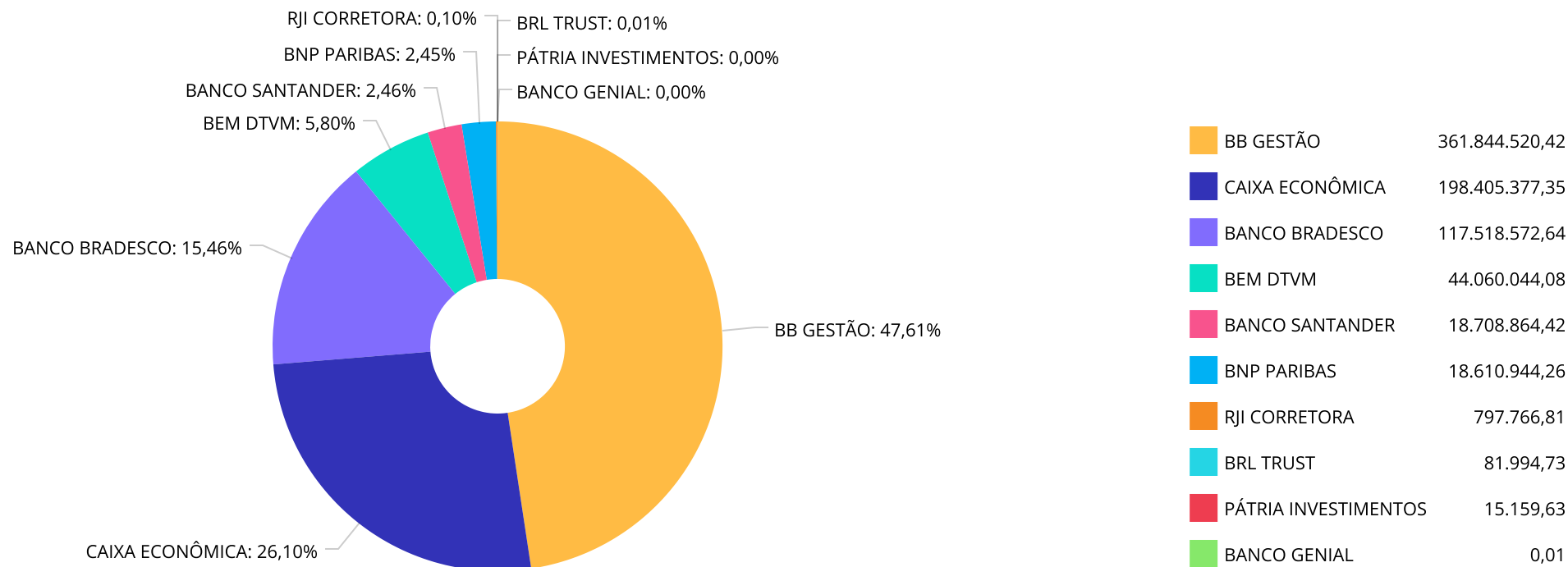
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,16%	4,40%	11,95%	-8,47%	-1,77%	8,19%	11,03%	0,22%
SMLL (Benchmark)	-1,84%	-8,06%	14,47%	-13,82%	-18,43%	-5,58%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-1,94%	-8,24%	13,94%	-14,26%	-18,90%	-7,59%	12,05%	0,29%
MSCI ACWI (Benchmark)	-5,78%	-28,97%	-4,29%	-11,25%	-22,48%	-6,15%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-8,63%	-19,76%	-2,65%	-17,23%	-9,27%	18,60%	11,70%	0,22%
IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	0,54%	-44,16%	1,60%	10,58%	128,15%	60,20%	0,11%	3,45%
IFIX (Benchmark)	0,49%	6,63%	6,98%	7,58%	10,13%	7,01%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-3,74%	0,00%	0,00%

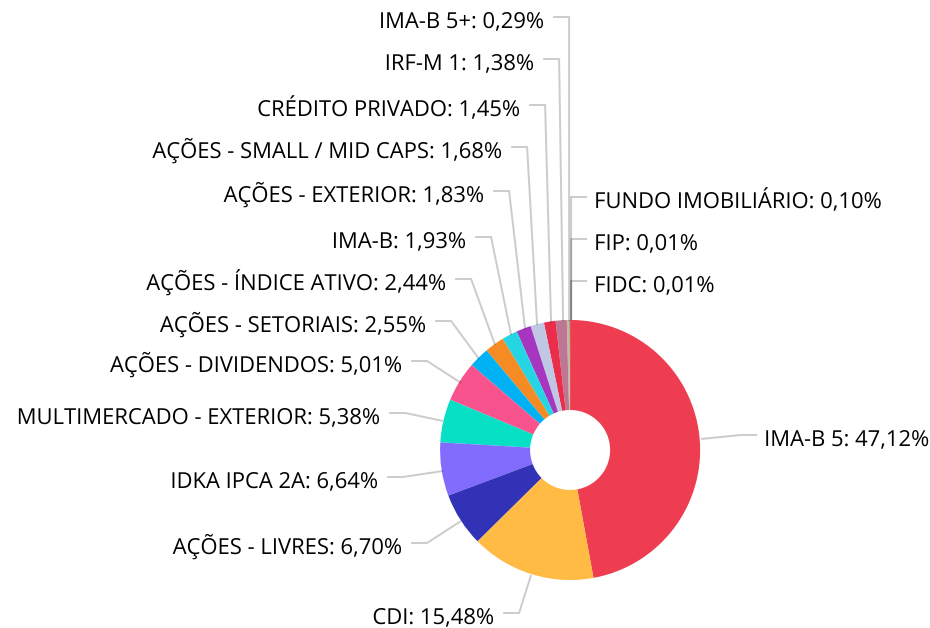
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	-5,49%	-28,69%	-3,57%	-11,09%	-21,36%	-3,69%	-	-
MSCI ACWI (Benchmark)	-5,78%	-28,97%	-4,29%	-11,25%	-22,48%	-6,15%	-	-

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2022)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2022)

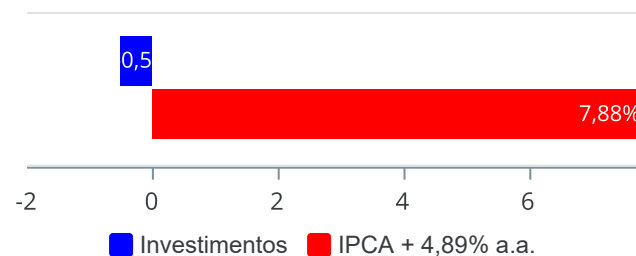


IMA-B 5	358.164.764,73	CDI	117.617.302,16	AÇÕES - LIVRES	50.912.221,27	IDKA IPCA 2A	50.441.350,25
MULTIMERCADO - EXTERIOR	40.919.911,76	AÇÕES - DIVIDENDOS	38.107.710,78	AÇÕES - SETORIAIS	19.397.188,49	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	18.524.851,58
IMA-B	14.704.031,33	AÇÕES - EXTERIOR	13.914.099,86	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	12.777.508,72	CRÉDITO PRIVADO	11.003.902,93
IRF-M 1	10.489.655,47	IMA-B 5+	2.173.823,84	FUNDO IMOBILIÁRIO	722.741,19	FIP	90.185,25
FIDC	81.994,74						

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	762.320.220,84	8.984.975,46	9.482.591,94	756.762.308,05	-5.060.296,31	-5.060.296,31	-0,66%	-0,66%	0,94%	0,94%	-70,56%	4,86%
Fevereiro	756.762.308,05	36.471.172,50	36.295.135,91	752.732.413,57	-4.205.931,07	-9.266.227,38	-0,56%	-1,22%	1,37%	2,33%	-52,22%	4,25%
Março	752.732.413,57	115.536.837,50	115.295.738,79	774.504.551,26	21.531.038,98	12.264.811,60	2,86%	1,61%	2,04%	4,42%	36,40%	5,14%
Abril	774.504.551,26	10.414.315,89	10.962.215,69	753.725.023,34	-20.231.628,12	-7.966.816,52	-2,61%	-1,05%	1,42%	5,91%	-17,69%	4,25%
Mai	753.725.023,34	12.054.729,82	11.240.314,77	758.372.330,77	3.832.892,38	-4.133.924,14	0,51%	-0,54%	0,89%	6,85%	-7,92%	4,79%
Junho	758.372.330,77	13.057.751,21	13.062.319,54	734.117.757,37	-24.250.005,07	-28.383.929,21	-3,20%	-3,72%	1,07%	7,99%	-46,57%	4,50%
Julho	734.117.757,37	171.798.826,94	186.041.242,26	736.376.065,68	16.500.723,63	-11.883.205,58	2,25%	-1,56%	-0,28%	7,69%	-20,28%	3,57%
Agosto	736.376.065,68	320.503.391,18	305.930.901,64	761.004.927,68	10.056.372,46	-1.826.833,12	1,34%	-0,24%	0,08%	7,77%	-3,10%	4,02%
Setembro	761.004.927,68	35.447.164,03	34.314.614,78	760.043.244,35	-2.094.232,58	-3.921.065,70	-0,27%	-0,51%	0,11%	7,88%	-6,53%	3,54%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.123.406,34	0,00	0,00	2.173.823,84	50.417,50	2,37%	2,37%	3,62%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	12.050.500,47	0,00	0,00	12.225.286,84	174.786,37	1,45%	1,45%	2,43%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	116.244.138,50	10.994.508,44	11.089.129,94	117.518.572,64	1.369.055,64	1,08%	1,12%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	9.415.338,51	815.088,85	413.046,22	9.925.137,39	107.756,25	1,05%	1,09%	0,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	405.173,81	154.283,28	155,80	564.518,08	5.216,79	0,93%	1,09%	0,13%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	50.175.653,93	0,00	0,00	50.441.350,25	265.696,32	0,53%	0,53%	1,42%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	123.458.151,40	10.890.080,95	0,00	135.025.945,90	677.713,55	0,50%	0,49%	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	67.030.926,63	0,00	0,00	67.356.226,79	325.300,16	0,49%	0,49%	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.466.835,38	0,00	0,00	2.478.744,49	11.909,11	0,48%	0,48%	1,45%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	10.837.815,55	0,00	10.890.080,95	0,00	52.265,40	0,48%	1,46%	1,52%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.954.691,94	0,00	0,00	11.003.902,93	49.210,99	0,45%	0,45%	1,29%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	77.888.527,64	0,00	0,00	78.200.630,02	312.102,38	0,40%	0,40%	1,27%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1.365.783,87	578.967,45	0,00	1.951.698,64	6.947,32	0,36%	0,40%	1,27%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	81.852,87	0,00	0,00	81.994,73	141,86	0,17%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	92.099,09	0,00	92.180,78	81,69	0,09%	0,93%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	75.567.059,97	0,00	0,00	75.630.263,38	63.203,41	0,08%	0,08%	0,75%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.000,00	11.760.897,88	11.760.897,88	6.548,74	5.548,74	0,05%	0,99%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	161.238,09	161.303,99	0,00	65,90	0,04%	0,86%	0,00%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
Total Renda Fixa	560.066.856,82	35.447.164,03	34.314.614,78	564.676.825,45	3.477.419,38	0,62%		1,03%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável/Estruturados/Imobiliário	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	3.433.606,49	0,00	0,00	3.849.870,78	416.264,29	12,12%	12,12%	14,32%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	74.357,56	0,00	0,00	75.025,62	668,06	0,90%	-	-
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	15.078,18	0,00	0,00	15.159,63	81,45	0,54%	0,54%	0,11%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	26.379.765,01	0,00	0,00	26.505.713,69	125.948,68	0,48%	0,48%	9,96%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	9.738.642,37	0,00	0,00	9.770.063,74	31.421,37	0,32%	0,32%	10,35%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	8.740.978,28	0,00	0,00	8.754.787,84	13.809,56	0,16%	0,16%	11,03%
ÁQUILLA FII - AQLL11	724.034,91	0,00	0,00	722.741,19	-1.293,72	-0,18%	0,00%	0,00%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	21.396.268,06	0,00	0,00	21.320.254,96	-76.013,10	-0,36%	-0,36%	11,01%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	6.660.535,31	0,00	0,00	6.630.780,79	-29.754,52	-0,45%	-0,45%	10,40%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.195.725,31	0,00	0,00	5.156.878,76	-38.846,55	-0,75%	-0,75%	10,13%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	6.498.381,99	0,00	0,00	6.445.118,33	-53.263,66	-0,82%	-0,82%	9,88%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	15.750.129,29	0,00	0,00	15.547.317,71	-202.811,58	-1,29%	-1,29%	11,41%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	13.029.783,75	0,00	0,00	12.777.508,72	-252.275,03	-1,94%	-1,94%	12,05%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	23.637.261,98	0,00	0,00	22.961.185,52	-676.076,46	-2,86%	-2,86%	9,19%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	11.449.469,68	0,00	0,00	10.463.515,24	-985.954,44	-8,61%	-8,61%	11,68%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24.573.400,52	0,00	0,00	22.454.018,58	-2.119.381,94	-8,62%	-8,62%	11,70%
Total Renda Variável	177.297.418,69	0,00	0,00	173.449.941,10	-3.847.477,59	-2,17%		10,75%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Setembro / 2022)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	8.469.479,42	0,00	0,00	8.002.377,94	-467.101,48	-5,52%	-5,52%	7,50%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	6.172.425,20	0,00	0,00	5.766.670,84	-405.754,36	-6,57%	-6,57%	9,68%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	8.998.747,55	0,00	0,00	8.147.429,02	-851.318,53	-9,46%	-9,46%	16,14%
Total Exterior	23.640.652,17	0,00	0,00	21.916.477,80	-1.724.174,37	-7,29%		11,28%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	205.227.052,44	90.392.005,06	117.518.572,64	2.683.525,26	1,31%	3,44%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	100.934.222,68	42.645.762,08	145.710.384,84	0,00	2.130.400,08	1,48%	3,41%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	135.779.908,29	1.649.761,12	135.025.945,90	895.798,73	0,66%	-2,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	68.566.816,57	1.950.897,56	67.356.226,79	740.307,78	1,08%	-0,02%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	25.449.634,23	0,00	25.879.827,22	0,00	430.192,99	1,69%	3,63%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	8.337.292,96	2.443.046,29	1.170.199,84	9.925.137,39	314.997,98	2,92%	3,37%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	77.886.110,92	0,00	0,00	78.200.630,02	314.519,10	0,40%	0,40%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	50.309.151,68	0,00	0,00	50.441.350,25	132.198,57	0,26%	0,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.111.964,82	0,00	0,00	2.173.823,84	61.859,02	2,93%	2,93%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	35.177.833,27	0,00	35.237.377,99	0,00	59.544,72	0,17%	3,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.584.835,94	0,00	3.149.262,24	2.478.744,49	43.170,79	0,77%	0,58%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.967.625,66	0,00	0,00	11.003.902,93	36.277,27	0,33%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	15.685.258,32	59.914.563,99	0,00	75.630.263,38	30.441,07	0,04%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	262.519,32	293.681,54	2.817,27	564.518,08	11.134,49	2,00%	3,37%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	29.743.339,11	0,00	29.753.168,18	0,00	9.829,07	0,03%	0,62%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1.080.630,59	863.315,89	0,00	1.951.698,64	7.752,16	0,40%	0,39%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	11.761.897,88	11.760.897,88	6.548,74	5.548,74	0,05%	3,06%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	92.099,09	0,00	92.180,78	81,69	0,09%	2,89%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	161.238,09	161.303,99	0,00	65,90	0,04%	2,65%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	174.687,94	0,00	0,00	81.994,73	-92.693,21	-53,06%	-53,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	62.765.201,99	0,00	50.000.000,00	12.225.286,84	-539.915,15	-0,86%	1,63%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	61.982.552,42	0,00	61.020.700,29	0,00	-961.852,13	-1,55%	1,64%
Total Renda Fixa	488.452.861,86	527.749.382,15	457.838.603,48	564.676.825,45	6.313.184,92	1,13%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	24.042.379,93	0,00	0,00	26.505.713,69	2.463.333,76	10,25%	10,25%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	20.830.226,55	0,00	0,00	22.961.185,52	2.130.958,97	10,23%	10,23%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	27.179.498,22	0,00	7.832.146,27	21.320.254,96	1.972.903,01	7,26%	9,61%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	13.578.143,20	0,00	0,00	15.547.317,71	1.969.174,51	14,50%	14,50%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	33.216.076,51	0,00	24.676.874,76	10.463.515,24	1.924.313,49	5,79%	-2,61%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	11.214.608,28	0,00	0,00	12.777.508,72	1.562.900,44	13,94%	13,94%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	16.230.368,18	0,00	10.734.670,30	6.630.780,79	1.135.082,91	6,99%	11,20%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	14.184.568,69	0,00	5.484.521,05	9.770.063,74	1.070.016,10	7,54%	11,39%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	7.820.188,25	0,00	0,00	8.754.787,84	934.599,59	11,95%	11,95%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	2.965.641,61	0,00	0,00	3.849.870,78	884.229,17	29,82%	29,82%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	5.898.169,93	0,00	0,00	6.445.118,33	546.948,40	9,27%	9,27%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.672.194,83	0,00	0,00	5.156.878,76	484.683,93	10,37%	10,37%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	73.885,00	0,00	0,00	75.025,62	1.140,62	1,54%	-
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	14.920,86	0,00	0,00	15.159,63	238,77	1,60%	1,60%
ÁQUILLA FII - AQLL11	726.541,66	0,00	0,00	722.741,19	-3.800,47	-0,52%	0,00%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	23.065.139,89	0,00	0,00	22.454.018,58	-611.121,31	-2,65%	-2,65%
Total Renda Variável	205.712.551,59	0,00	48.728.212,38	173.449.941,10	16.465.601,89	8,00%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.452.141,97	0,00	15.057.239,74	0,00	1.605.097,77	11,93%	-2,28%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	12.535.420,72	0,00	4.662.703,08	8.002.377,94	129.660,30	1,03%	-2,27%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	8.019.588,37	0,00	0,00	8.147.429,02	127.840,65	1,59%	1,59%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	5.945.192,86	0,00	0,00	5.766.670,84	-178.522,02	-3,00%	-3,00%
Total Exterior	39.952.343,92	0,00	19.719.942,82	21.916.477,80	1.684.076,70	4,22%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.