

2022

Relatório Mensal e 3º trimestre de 2022

Setembro

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.

| Ativo | Saldo Atual | % Carteira | PL R\$ | % PL | Lei |
|---|---------------|------------|-------------------|-------|----------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.416.087,30 | 3,26% | 8.749.817.040,89 | 0,04% | 7º I b |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1.985.249,50 | 1,90% | 6.260.416.458,58 | 0,03% | 7º I b |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 399.124,86 | 0,38% | 6.071.749.354,31 | 0,01% | 7º I b |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 157.492,31 | 0,15% | 4.037.691.715,74 | 0,00% | 7º I b |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.114.612,75 | 2,02% | 3.601.305.672,83 | 0,06% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 2.001.606,25 | 1,91% | 3.960.240.224,82 | 0,05% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.937.166,44 | 1,85% | 2.902.138.561,58 | 0,07% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.925.205,51 | 1,84% | 686.647.428,69 | 0,28% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 387.532,00 | 0,37% | 772.946.064,25 | 0,05% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 6.621.310,09 | 6,33% | 8.885.835.879,64 | 0,07% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 19.038.199,00 | 18,19% | 1.171.846.641,79 | 1,62% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 4.528.451,51 | 4,33% | 3.871.147.074,69 | 0,12% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 203.250,23 | 0,19% | 5.416.816.231,94 | 0,00% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 10.967.196,55 | 10,48% | 1.672.261.160,69 | 0,66% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 10.238.994,99 | 9,78% | 930.421.879,82 | 1,10% | 7º I b |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 4.662.336,86 | 4,46% | 234.933.424,23 | 1,98% | 7º I b |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 1.762.281,78 | 1,68% | 158.144.148,14 | 1,11% | 7º I b |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA | 5.084.471,69 | 4,86% | 69.514.252,30 | 7,31% | 7º I b |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 7.957.813,69 | 7,60% | 730.227.548,87 | 1,09% | 7º III a |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 4.150.408,92 | 3,97% | 13.954.428.357,23 | 0,03% | 7º III a |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 8.528.439,31 | 8,15% | 1.761.108.354,50 | 0,48% | 7º III a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI | 122.070,88 | 0,12% | 3.261.035.114,64 | 0,00% | 7º III a |
| ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 94.764,97 | 0,09% | 22.044.959,17 | 0,43% | 7º V a |
| MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 509,56 | 0,00% | 242.995,22 | 0,21% | 7º V a |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | 238.598,87 | 0,23% | 30.976.188,91 | 0,77% | 7º V a |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES | 5.201.681,22 | 4,97% | 710.401.540,64 | 0,73% | 8º I |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 923.946,74 | 0,88% | 2.057.509.929,37 | 0,04% | 9º III |

Investimentos

 104.648.803,78

Disponibilidades Financeiras

 82.898,52

Total Carteira

 104.731.702,30

Governança (Pró Gestão)

 Não possui

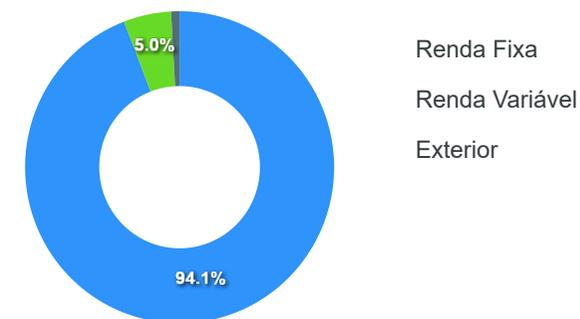
| Ativo | Saldo Atual | % Carteira | PL R\$ | % PL | Lei |
|-------------------------------------|---|------------|----------------|------|-----|
| Investimentos | | | | | |
| | \$ | | 104.648.803,78 | | |
| Disponibilidades Financeiras | | | | | |
| | \$ | | 82.898,52 | | |
| Total Carteira | | | | | |
| | \$ | | 104.731.702,30 | | |
| Governança (Pró Gestão) | | | | | |
| |  | | Não possui | | |

| Artigos | Limite (%) | Utilizado | Livre |
|--------------------------------|------------|--------------------------------|---------------|
| 7º I b - FI 100% Títulos TN | 100,00% | 73,99% 77.430.569,62 26,01% | 27.218.234,16 |
| 7º III a - FI Referenciados RF | 60,00% | 19,84% 20.758.732,80 40,16% | 42.030.549,47 |
| 7º V a - FIDC Cota Sênior | 5,00% | 0,32% 333.873,40 4,68% | 4.898.566,79 |
| 8º I - Fundos de Ações | 30,00% | 4,97% 5.201.681,22 25,03% | 26.192.959,91 |
| 9º III - Ações - BDR Nível I | 10,00% | 0,88% 923.946,74 9,12% | 9.540.933,64 |

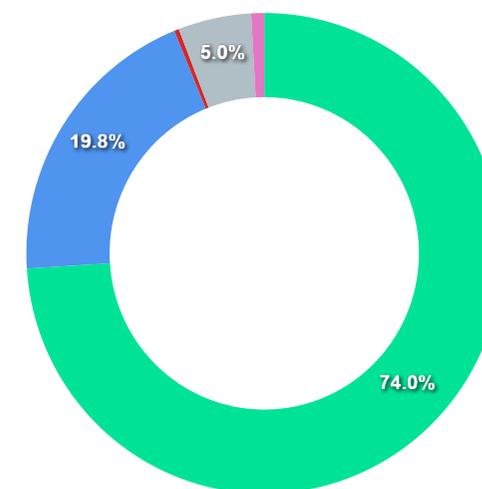
Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Segmentos



Artigos

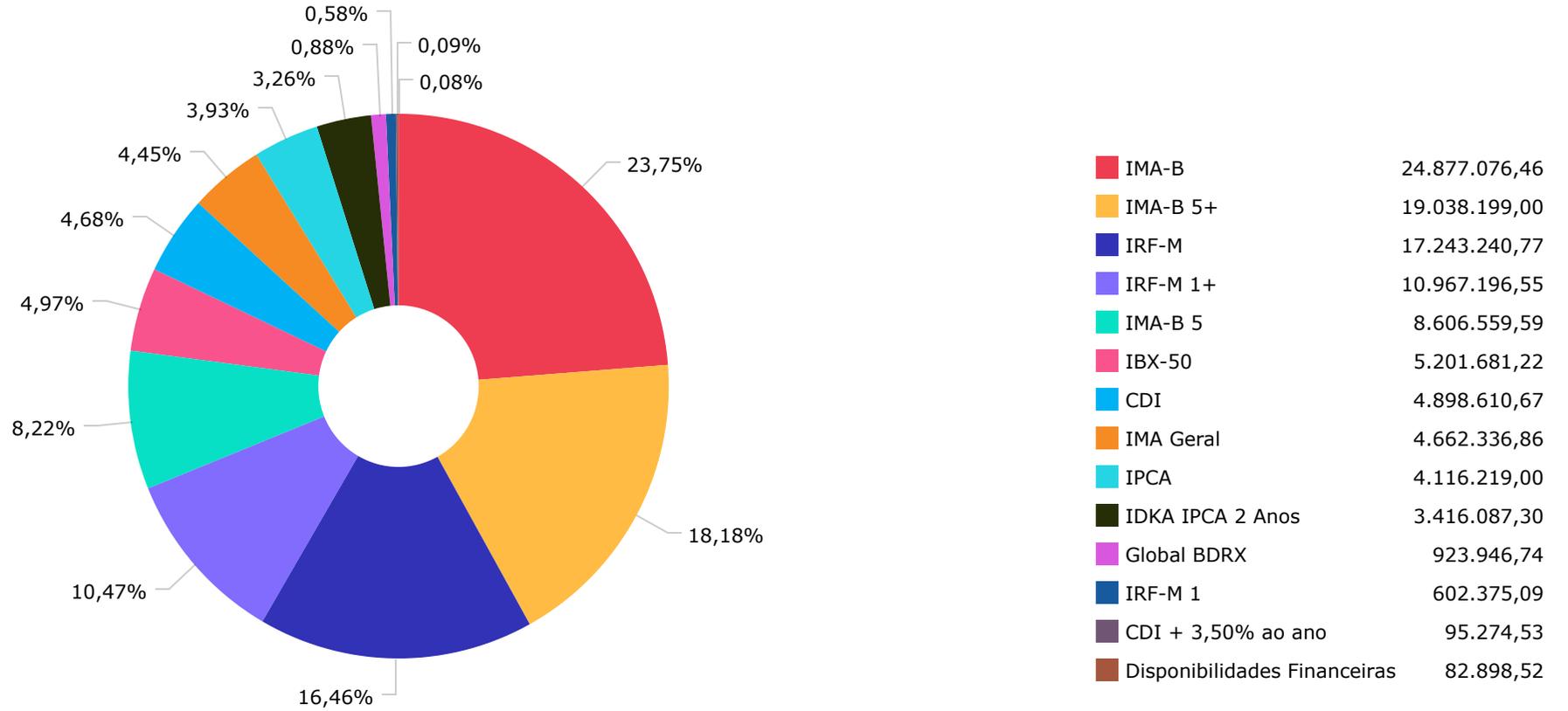


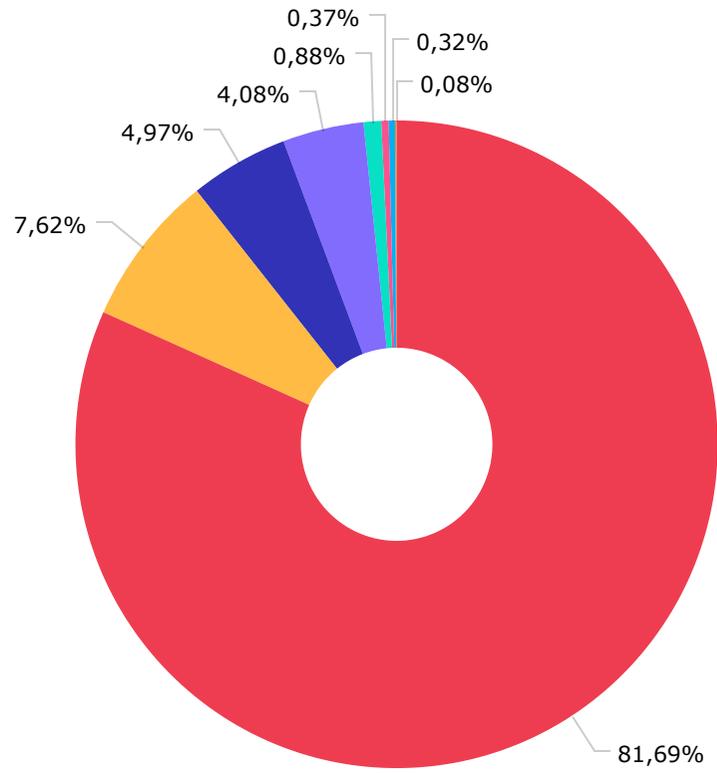
| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|--------------------------------|--------|----------|--------|----------|----------------|
| 7° I a - Títulos TN SELIC | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 100,00% | 104.648.803,78 |
| 7° I b - FI 100% Títulos TN | 73,99% | 0,00% | 29,00% | 100,00% | 27.218.234,16 |
| 7° III a - FI Referenciados RF | 19,84% | 0,00% | 20,00% | 60,00% | 42.030.549,47 |
| 7° V a - FIDC Cota Sênior | 0,32% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 4.898.566,79 |

| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|------------------------------|-------|----------|--------|----------|---------------|
| 8° I - Fundos de Ações | 4,97% | 0,00% | 29,00% | 30,00% | 26.192.959,91 |
| 9° III - Ações - BDR Nível I | 0,88% | 0,00% | 10,00% | 10,00% | 9.540.933,64 |
| 10° I - Fundos Multimercados | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 10,00% | 10.464.880,38 |

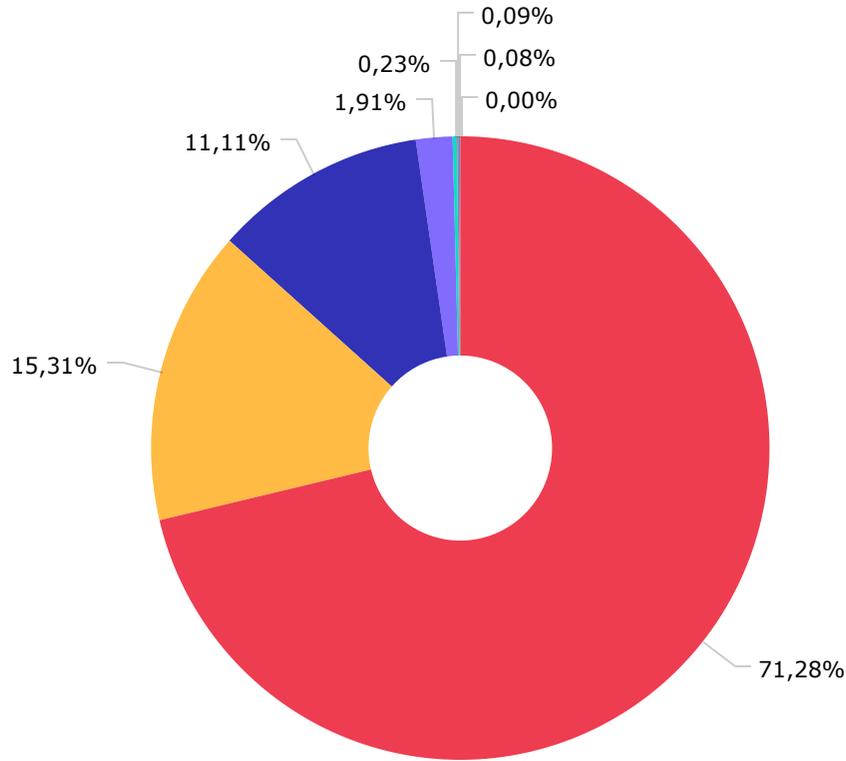
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------------|---------------|--------------|---------------|---------------|--------------|-----------|--------------------|
| CDI - BENCHMARK | 1,07 | 8,89 | 3,31 | 6,31 | 10,90 | 14,21 | | |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI | 1,12 | 9,49 | 3,40 | 6,56 | 11,70 | 15,57 | 0,01 | 0,02 |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 1,11 | 9,12 | 3,34 | 6,40 | 11,18 | 14,86 | 0,03 | 0,06 |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 0,93 | 7,61 | 2,89 | 5,46 | 9,21 | 11,44 | 0,00 | 0,00 |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | -0,46 | -59,72 | -1,52 | -59,64 | -60,12 | -62,24 | 0,06 | 0,12 |
| CDI + 3,50% AO ANO - BENCHMARK | 1,36 | 11,74 | 4,20 | 8,16 | 14,78 | 22,35 | | |
| ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 0,17 | -39,75 | -53,06 | -53,17 | -45,24 | -46,16 | | |
| MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 2,20 | -77,13 | 12,20 | -77,24 | -78,43 | -89,22 | | |
| GLOBAL BDRX - BENCHMARK | -8,38 | -30,78 | -4,37 | -14,20 | -22,27 | -5,91 | | |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | -7,72 | -30,97 | -4,35 | -14,12 | -22,81 | -8,72 | 9,55 | 20,12 |
| 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 | 21,80 |
| 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 | 2,99 |
| IMA GERAL - BENCHMARK | 1,26 | 7,80 | 3,17 | 5,13 | 9,24 | 11,95 | | |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 1,46 | 5,95 | 1,64 | 3,04 | 7,02 | 11,76 | 2,45 | 5,16 |
| IMA-B - BENCHMARK | 1,48 | 6,12 | 1,70 | 3,16 | 7,25 | 12,30 | | |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,50 | 6,09 | 1,76 | 3,18 | 7,15 | 11,91 | 2,47 | 5,20 |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 1,52 | 6,08 | 1,80 | 3,22 | 7,12 | 11,91 | 2,52 | 5,31 |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,45 | 5,87 | 1,55 | 2,93 | 6,92 | 11,66 | 2,45 | 5,17 |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,49 | 0,44 | -2,97 | -0,67 | 2,48 | 2,12 | 1,46 | 3,07 |

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------------|-------------|--------------|-------------|-------------|--------------|-----------|--------------------|
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,18 | -0,92 | -3,33 | -1,48 | 1,21 | -0,72 | 2,84 | 5,98 |
| IMA-B 5 - BENCHMARK | 0,42 | 7,07 | 0,43 | 3,14 | 9,25 | 15,75 | | |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,43 | 7,04 | 0,50 | 3,16 | 9,15 | 15,36 | 1,26 | 2,66 |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 0,40 | 6,90 | 0,40 | 3,05 | 8,97 | 15,18 | 1,27 | 2,67 |
| 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 | 7,62 |
| 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 | 3,10 | 8,79 | 15,18 | 0,75 | 1,57 |
| CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,08 | | 0,02 | -0,25 | | | 0,75 | 1,57 |
| IRF-M - BENCHMARK | 1,40 | 6,96 | 4,66 | 5,53 | 8,01 | 6,91 | | |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 1,12 | 8,47 | 3,38 | 6,08 | 9,65 | 12,23 | 0,13 | 0,27 |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,37 | 6,84 | 4,60 | 5,39 | 7,88 | 6,53 | 1,56 | 3,28 |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,38 | 6,83 | 4,63 | 5,48 | 7,83 | 6,48 | 1,56 | 3,28 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA | 1,37 | 6,74 | 4,59 | 5,37 | 7,70 | 6,38 | 1,55 | 3,27 |
| IRF-M 1 - BENCHMARK | 1,11 | 8,59 | 3,43 | 6,17 | 9,81 | 12,55 | | |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,09 | 8,39 | 3,37 | 6,02 | 9,57 | 11,94 | 0,13 | 0,27 |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,09 | 8,39 | 3,37 | 6,04 | 9,57 | 12,03 | 0,13 | 0,27 |
| IRF-M 1+ - BENCHMARK | 1,58 | 6,25 | 5,47 | 5,41 | 7,24 | 3,87 | | |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,54 | 5,99 | 5,34 | 5,23 | 6,90 | 3,28 | 2,43 | 5,12 |

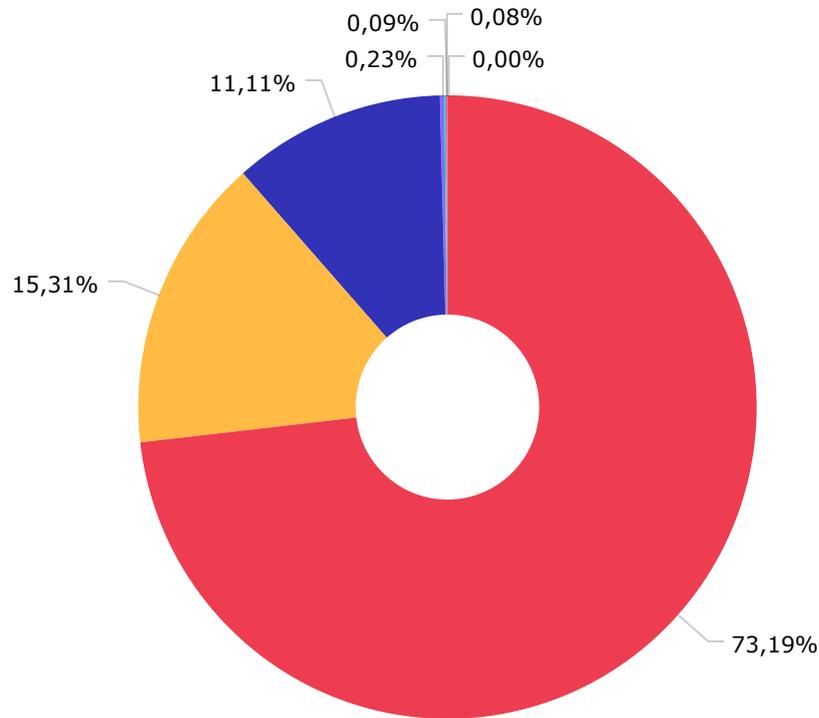




| | |
|---|---------------|
| Renda Fixa Indexados | 85.550.699,67 |
| Renda Fixa Duração Livre Soberano | 7.978.590,95 |
| Ações Índice Ativo | 5.201.681,22 |
| Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento | 4.272.479,80 |
| Ações Livre | 923.946,74 |
| Renda Fixa Duração Baixa Soberano | 387.532,00 |
| FIDC Outros | 333.873,40 |
| Disponibilidades Financeiras | 82.898,52 |



| | |
|-----------------------------------|---------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 74.651.782,51 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 16.030.380,41 |
| ITAU UNIBANCO S.A. | 11.631.161,21 |
| CAIXA DTVM | 2.001.606,25 |
| PETRA CAPITAL GESTAO DE INVEST... | 238.598,87 |
| VILA RICA CAPITAL GESTORA DE R... | 94.764,97 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 82.898,52 |
| GENIAL GESTAO LTDA | 509,56 |



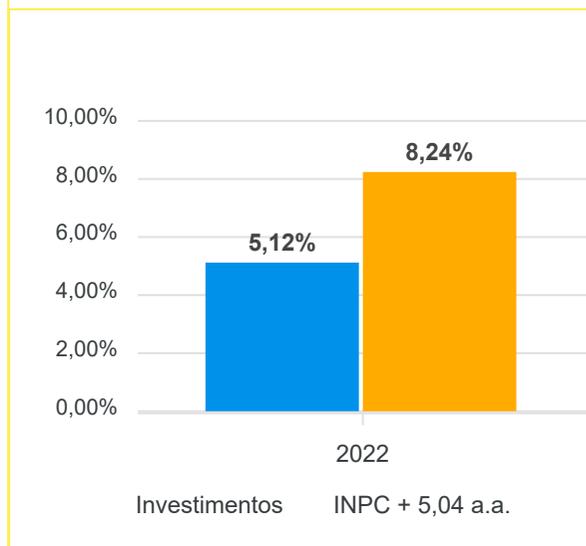
| | |
|-----------------------------------|---------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 76.653.388,76 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 16.030.380,41 |
| ITAU UNIBANCO S.A. | 11.631.161,21 |
| FINAXIS CORRETORA DE TITULOS E... | 238.598,87 |
| BRL TRUST DISTRIBUIDORA DE TIT... | 94.764,97 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 82.898,52 |
| GENIAL INVESTIMENTOS CORRETORA... | 509,56 |

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|--------------|--------------|----------------|--------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro | 98.864.498,91 | 632.000,00 | 0,00 | 99.357.886,86 | -138.612,05 | -138.612,05 | -0,14% ▼ | -0,14% | 1,08% | 1,08% | -12,96% | 2,41% |
| Fevereiro | 99.357.886,86 | 2.373,12 | 0,00 | 99.891.458,12 | 531.198,14 | 392.586,09 | 0,53% ▲ | 0,39% | 1,38% | 2,47% | 15,79% | 1,94% |
| Março | 99.891.458,12 | 625.326,78 | 502.000,00 | 102.373.551,60 | 2.358.766,70 | 2.751.352,79 | 2,36% ▲ | 2,76% | 2,15% | 4,67% | 59,10% | 2,97% |
| Abril | 102.373.551,60 | 637.308,69 | 1.117.000,00 | 101.722.527,37 | -171.332,92 | 2.580.019,87 | -0,17% ▼ | 2,59% | 1,42% | 6,16% | 42,05% | 1,03% |
| Mai | 101.722.527,37 | 663.493,00 | 566.000,00 | 102.302.909,38 | 482.889,01 | 3.062.908,88 | 0,47% ▲ | 3,08% | 0,88% | 7,09% | 43,44% | 2,73% |
| Junho | 102.302.909,38 | 9.965.493,91 | 9.683.000,00 | 101.739.791,52 | -845.611,77 | 2.217.297,11 | -0,82% ▼ | 2,23% | 1,03% | 8,20% | 27,20% | 2,48% |
| Julho | 101.739.791,52 | 756.393,46 | 700.000,00 | 101.713.958,43 | -82.226,55 | 2.135.070,56 | -0,08% ▼ | 2,14% | -0,19% | 7,99% | 26,78% | 2,54% |
| Agosto | 101.713.958,43 | 114.166,66 | 301.227,71 | 103.194.217,81 | 1.667.320,43 | 3.802.390,99 | 1,64% ▲ | 3,82% | 0,14% | 8,14% | 46,93% | 3,17% |
| Setembro | 103.194.217,81 | 861.646,96 | 704.000,00 | 104.648.803,78 | 1.296.939,01 | 5.099.330,00 | 1,25% ▲ | 5,12% | 0,09% | 8,24% | 62,14% | 2,61% |

Retorno Acumulado (Períodos)

| Período | Retorno \$ | Retorno % | Meta % |
|---------|--------------|-----------|--------|
| 1º Trim | 2.751.352,79 | 2,76% | 4,67% |
| 2º Trim | -534.055,68 | -0,52% | 3,37% |
| 1º Sem | 2.217.297,11 | 2,23% | 8,20% |
| 3º Trim | 2.882.032,89 | 2,83% | 0,04% |

Gráfico Retorno e Meta Acumulado



Gráficos

Gráfico Risco x Retorno

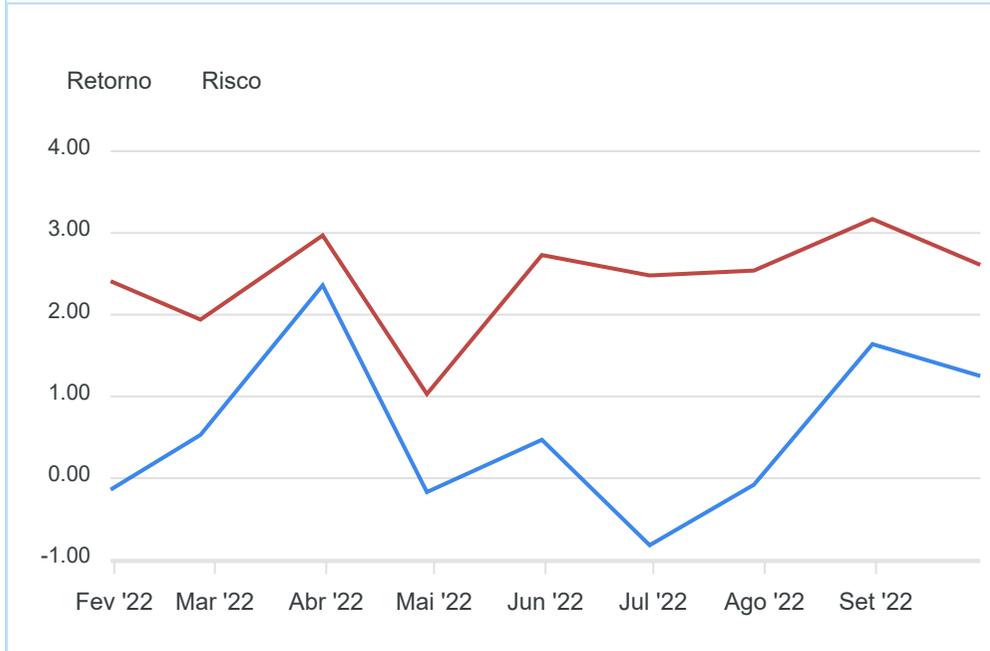
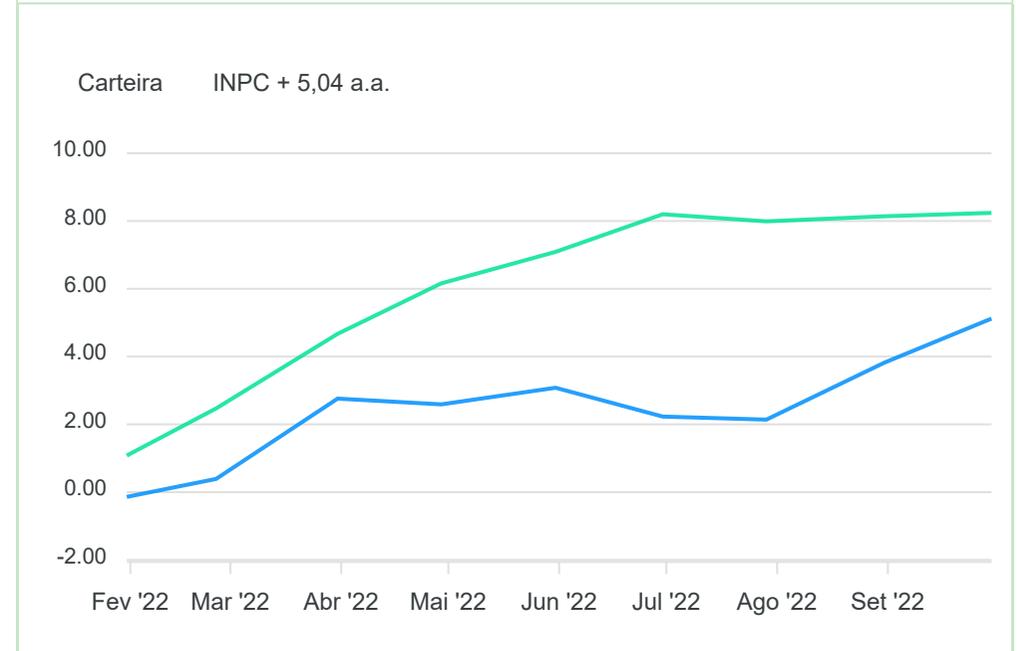


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|------------|---------------|--------------|-----------|-------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.398.093,29 | 0,00 | 0,00 | 3.416.087,30 | 17.994,01 | 0,53% ▲ | 1,42% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1.977.326,28 | 0,00 | 0,00 | 1.985.249,50 | 7.923,22 | 0,40% ▲ | 1,27% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 7.843.960,51 | 0,00 | 0,00 | 7.957.813,69 | 113.853,18 | 1,45% ▲ | 2,45% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 394.837,64 | 0,00 | 0,00 | 399.124,86 | 4.287,22 | 1,09% ▲ | 0,13% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 155.354,25 | 0,00 | 0,00 | 157.492,31 | 2.138,06 | 1,38% ▲ | 1,56% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.112.845,59 | 0,00 | 0,00 | 2.114.612,75 | 1.767,16 | 0,08% ▲ | 0,75% |
| CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.999.947,44 | 0,00 | 0,00 | 2.001.606,25 | 1.658,81 | 0,08% ▲ | 0,75% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.927.760,40 | 0,00 | 0,00 | 1.937.166,44 | 9.406,04 | 0,49% ▲ | 1,46% |
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.902.763,18 | 0,00 | 0,00 | 1.925.205,51 | 22.442,33 | 1,18% ▲ | 2,84% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 324.595,56 | 59.480,30 | 0,00 | 387.532,00 | 3.456,14 | 0,90% ▲ | 0,00% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 4.005.644,82 | 802.166,66 | 704.000,00 | 4.150.408,92 | 46.597,44 | 0,97% ▲ | 0,03% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 6.593.148,25 | 0,00 | 0,00 | 6.621.310,09 | 28.161,84 | 0,43% ▲ | 1,26% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 18.596.646,10 | 0,00 | 0,00 | 19.038.199,00 | 441.552,90 | 2,37% ▲ | 3,62% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 4.461.684,98 | 0,00 | 0,00 | 4.528.451,51 | 66.766,53 | 1,50% ▲ | 2,47% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 201.062,96 | 0,00 | 0,00 | 203.250,23 | 2.187,27 | 1,09% ▲ | 0,13% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 10.801.155,63 | 0,00 | 0,00 | 10.967.196,55 | 166.040,92 | 1,54% ▲ | 2,43% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 10.101.082,65 | 0,00 | 0,00 | 10.238.994,99 | 137.912,34 | 1,37% ▲ | 1,56% |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 8.400.624,96 | 0,00 | 0,00 | 8.528.439,31 | 127.814,35 | 1,52% ▲ | 2,52% |
| ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 94.601,02 | 0,00 | 0,00 | 94.764,97 | 163,95 | 0,17% ▲ | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI | 120.720,67 | 0,00 | 0,00 | 122.070,88 | 1.350,21 | 1,12% ▲ | 0,01% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 4.595.391,13 | 0,00 | 0,00 | 4.662.336,86 | 66.945,73 | 1,46% ▲ | 2,45% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 1.742.841,89 | 0,00 | 0,00 | 1.762.281,78 | 19.439,89 | 1,12% ▲ | 0,13% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA | 5.015.742,64 | 0,00 | 0,00 | 5.084.471,69 | 68.729,05 | 1,37% ▲ | 1,55% |
| MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 498,58 | 0,00 | 0,00 | 509,56 | 10,98 | 2,20% ▲ | - |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | 239.694,50 | 0,00 | 0,00 | 238.598,87 | -1.095,63 | -0,46% ▼ | 0,06% |
| | 97.008.024,92 | 861.646,96 | 704.000,00 | 98.523.175,82 | 1.357.503,94 | 1,40% | 2,14% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|------------------------------|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES | 5.184.952,17 | 0,00 | 0,00 | 5.201.681,22 | 16.729,05 | 0,32% ▲ | 10,35% |
| - | 5.184.952,17 | 0,00 | 0,00 | 5.201.681,22 | 16.729,05 | 0,32% | 10,35% |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|-------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 1.001.240,72 | 0,00 | 0,00 | 923.946,74 | -77.293,98 | -7,72% ▼ | 9,55% |
| | 1.001.240,72 | 0,00 | 0,00 | 923.946,74 | -77.293,98 | -7,72% | 0,00% |

| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-----------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.407.134,29 | 0,00 | 0,00 | 3.416.087,30 | 8.953,01 | 0,26% ▲ |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1.977.264,92 | 0,00 | 0,00 | 1.985.249,50 | 7.984,58 | 0,40% ▲ |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 7.836.494,87 | 0,00 | 0,00 | 7.957.813,69 | 121.318,82 | 1,55% ▲ |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 386.115,47 | 0,00 | 0,00 | 399.124,86 | 13.009,39 | 3,37% ▲ |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 150.527,83 | 0,00 | 0,00 | 157.492,31 | 6.964,48 | 4,63% ▲ |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.999.829,05 | 114.000,00 | 0,00 | 2.114.612,75 | 783,70 | 0,04% ▲ |
| CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 2.001.299,93 | 0,00 | 0,00 | 2.001.606,25 | 306,32 | 0,02% ▲ |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.996.464,95 | 0,00 | 59.492,22 | 1.937.166,44 | 193,71 | 0,01% ▲ |
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.991.588,61 | 0,00 | 87.735,49 | 1.925.205,51 | 21.352,39 | 1,07% ▲ |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 318.114,09 | 59.807,08 | 0,00 | 387.532,00 | 9.610,83 | 2,54% ▲ |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 4.013.818,90 | 1.558.400,00 | 1.558.000,00 | 4.150.408,92 | 136.190,02 | 2,44% ▲ |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 6.588.648,15 | 0,00 | 0,00 | 6.621.310,09 | 32.661,94 | 0,50% ▲ |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 18.496.442,00 | 0,00 | 0,00 | 19.038.199,00 | 541.757,00 | 2,93% ▲ |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 4.450.101,18 | 0,00 | 0,00 | 4.528.451,51 | 78.350,33 | 1,76% ▲ |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 196.629,26 | 0,00 | 0,00 | 203.250,23 | 6.620,97 | 3,37% ▲ |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 10.410.833,46 | 0,00 | 0,00 | 10.967.196,55 | 556.363,09 | 5,34% ▲ |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 9.789.108,47 | 0,00 | 0,00 | 10.238.994,99 | 449.886,52 | 4,60% ▲ |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 8.377.991,98 | 0,00 | 0,00 | 8.528.439,31 | 150.447,33 | 1,80% ▲ |
| ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 201.894,67 | 0,00 | 0,00 | 94.764,97 | -107.129,70 | -53,06% ▼ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI | 118.059,63 | 0,00 | 0,00 | 122.070,88 | 4.011,25 | 3,40% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 4.586.965,32 | 0,00 | 0,00 | 4.662.336,86 | 75.371,54 | 1,64% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 1.704.623,52 | 0,00 | 0,00 | 1.762.281,78 | 57.658,26 | 3,38% ▲ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA | 4.861.418,26 | 0,00 | 0,00 | 5.084.471,69 | 223.053,43 | 4,59% ▲ |
| MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 454,16 | 0,00 | 0,00 | 509,56 | 55,40 | 12,20% ▲ |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | 242.274,83 | 0,00 | 0,00 | 238.598,87 | -3.675,96 | -1,52% ▼ |
| | 96.104.097,80 | 1.732.207,08 | 1.705.227,71 | 98.523.175,82 | 2.392.098,65 | 2,49% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|------------------------------|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES | 4.669.744,29 | 0,00 | 0,00 | 5.201.681,22 | 531.936,93 | 11,39% ▲ |
| | 4.669.744,29 | 0,00 | 0,00 | 5.201.681,22 | 531.936,93 | 11,39% |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|--|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 965.949,43 | 0,00 | 0,00 | 923.946,74 | -42.002,69 | -4,35% ▼ |
| | 965.949,43 | 0,00 | 0,00 | 923.946,74 | -42.002,69 | -4,35% |

Cenário Econômico

O cenário macroeconômico do 3º trimestre de 2022 manteve o tom do ano em curso, ou seja, com volatilidades provocadas pela inflação persistente, e em elevação, notadamente, nos países do bloco europeu e nos Estados Unidos. Valores não verificados nos últimos 40 anos e ao redor dos 2 dígitos. Como estes países também adotam a política monetária de meta de inflação, as suas respectivas taxas de juros são o principal instrumento de contenção dos preços via sua elevação, que os Bancos Centrais lançam mão visando trazer a inflação para suas respectivas metas.

O Banco Central do Brasil iniciou este movimento antes dos demais países citados. Assim, ao final do 3º trimestre o nosso BC já estabelecia a parada deste movimento enquanto banco central americano (FED) e o banco central europeu (BOE) se debatem em que patamar farão suas próximas elevações, ainda em 2022.

No caso brasileiro, o poder executivo, alinhado com os secretários de fazenda dos estados, executou ação de política fiscal visando também conter a inflação. A escolha negociada foi a redução de parcela dos impostos incidentes sobre a gasolina, diesel, energia elétrica e gás de cozinha. Como estes itens tem elevada participação no cálculo do índice oficial da inflação brasileira, o IPCA, este apresentou deflação em julho e agosto.

Em resumo, o trimestre foi de muitas incertezas e volatilidades quanto a definição do preço mais importante de todas as economias, sua taxa básica de juros, e "temperando" este aspecto, no cenário internacional tivemos a manutenção da guerra na Ucrânia e, a nível nacional, nossas eleições para presidente, para a Câmara Federal, e para as Câmaras Estaduais assim como a renovação de 1/3 do Senado Federal.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2022. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2022 ainda não foram integralmente atingidos.

Rentabilidade e Risco (por ativo)

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados.

Distribuição por Benchmarks

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Distribuição por Classificação ANBIMA

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

Distribuição por Gestoras e Administradoras

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

A rentabilidade consolidada da carteira no período continua demonstrando recuperação face o aumento das taxas de juros visando à contenção do processo inflacionário, combinado com o crescimento do fluxo de capital estrangeiro para a Bolsa, que vem impactando de forma favorável o desempenho das Bolsas.

Retorno dos Fundos de Investimentos

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2022, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 06 de outubro de 2022.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP