

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)

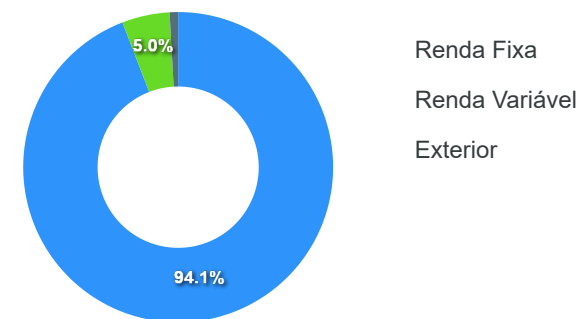
 Não possui

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

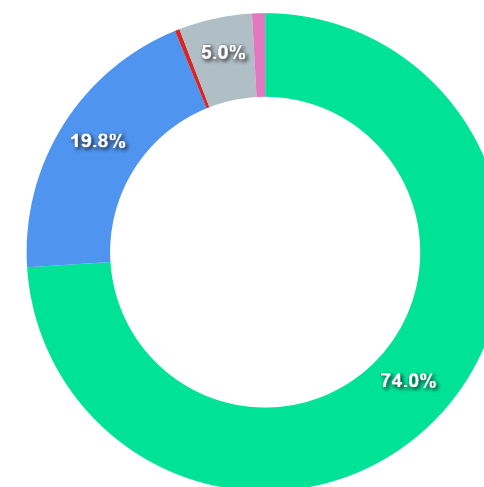
Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Segmentos



Artigos

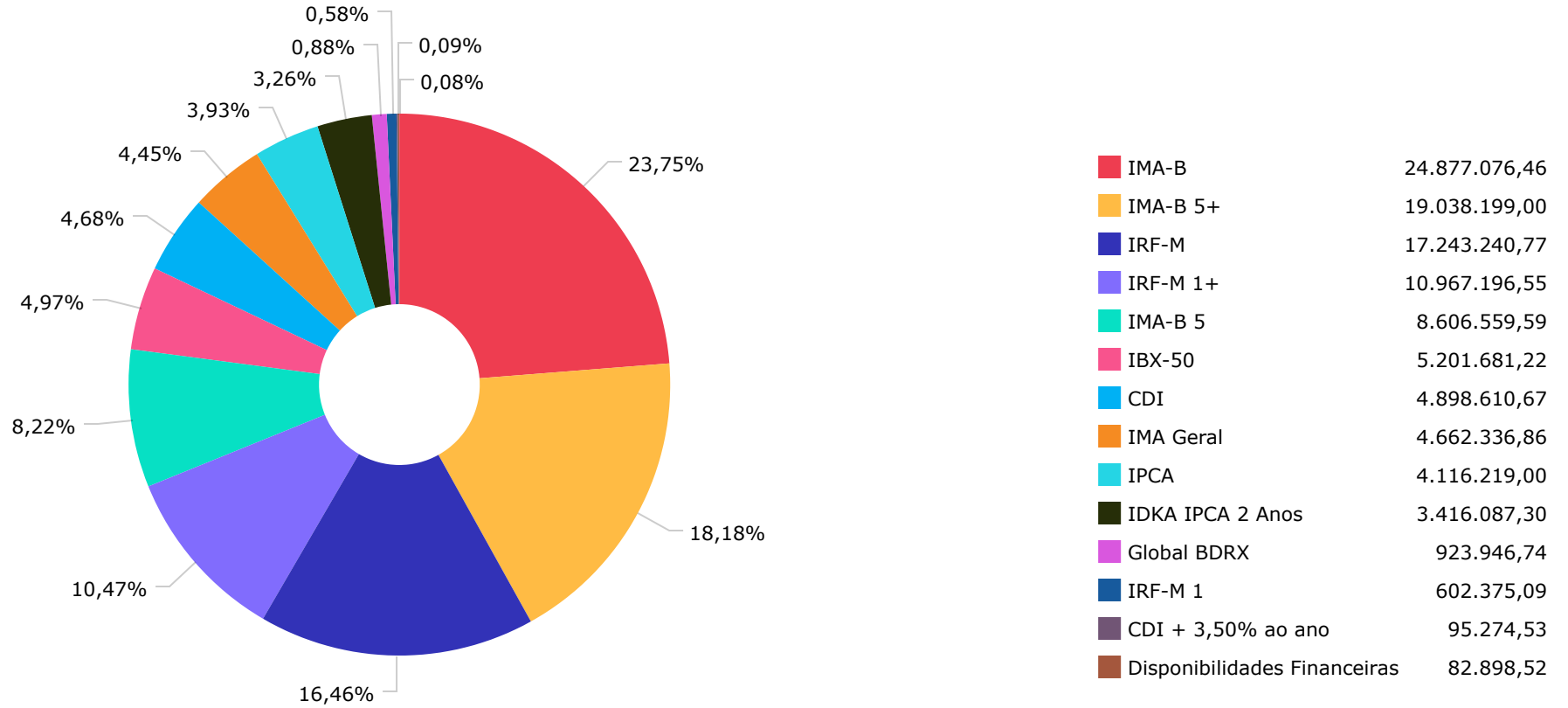


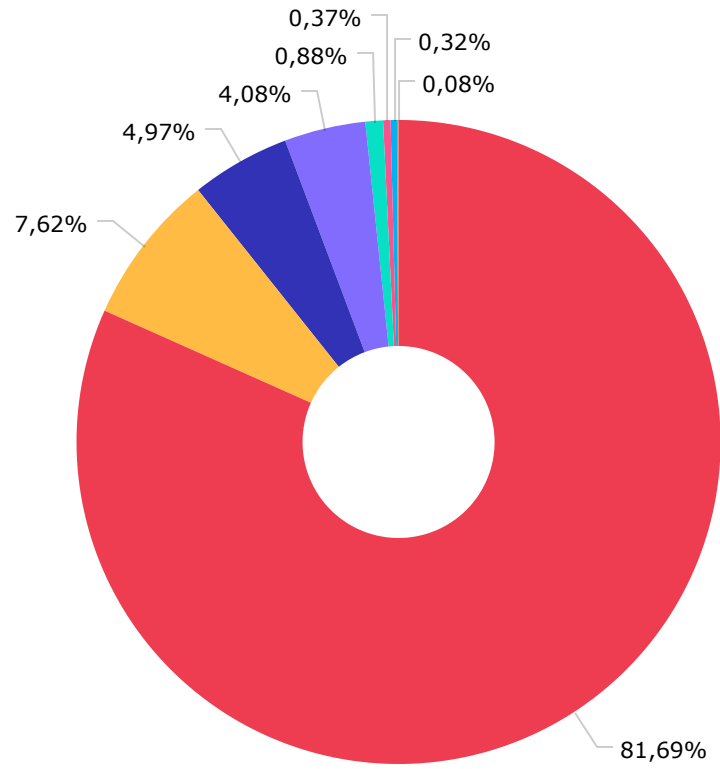
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	10,00%	100,00%	104.648.803,78
7° I b - FI 100% Títulos TN	73,99%	0,00%	29,00%	100,00%	27.218.234,16
7° III a - FI Referenciados RF	19,84%	0,00%	20,00%	60,00%	42.030.549,47
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,32%	0,00%	1,00%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

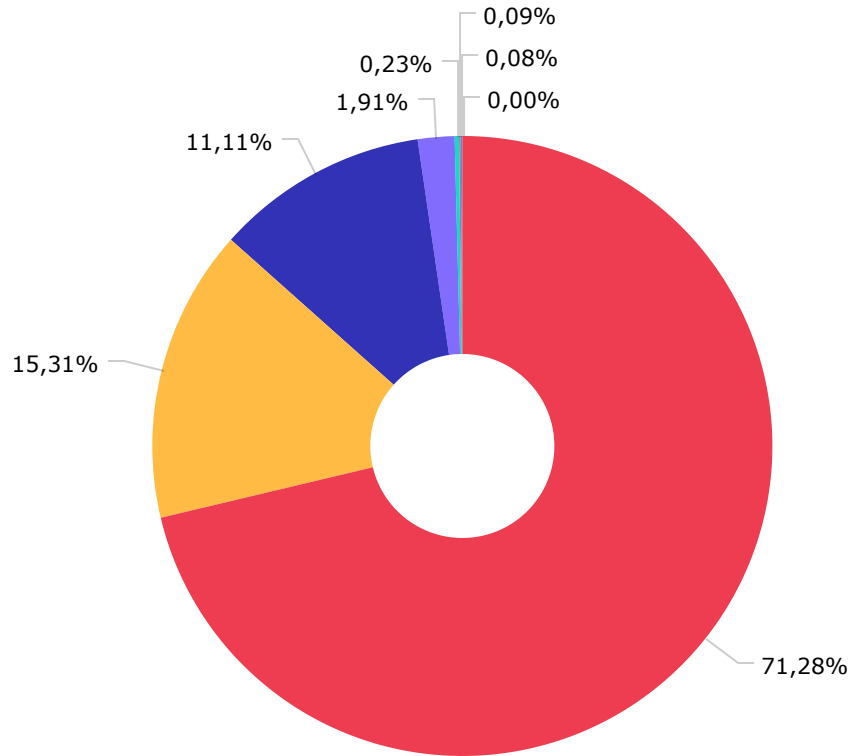
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21		
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1,12	9,49	3,40	6,56	11,70	15,57	0,01	0,02
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11	9,12	3,34	6,40	11,18	14,86	0,03	0,06
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC 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

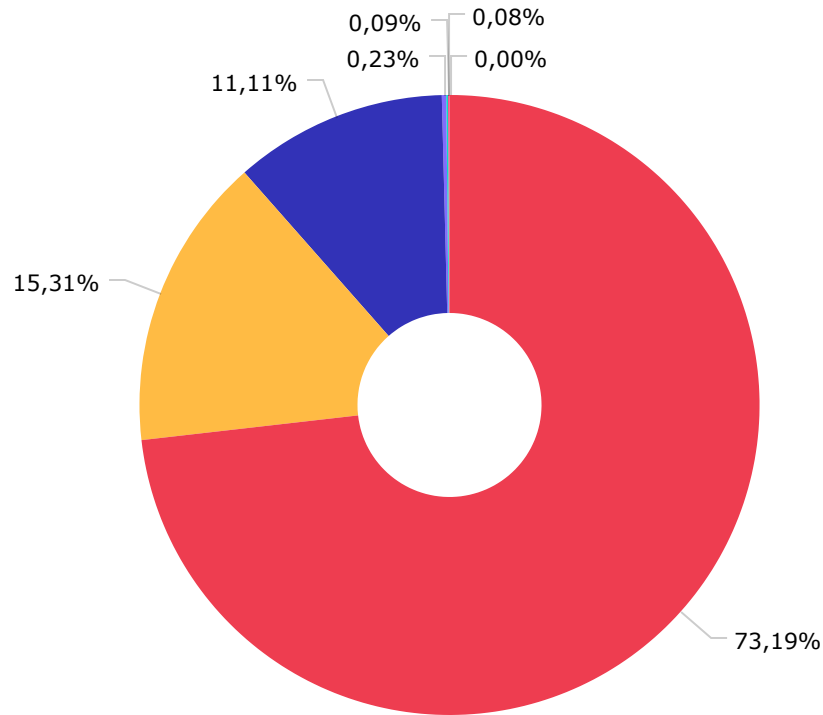




Renda Fixa Indexados	85.550.699,67
Renda Fixa Duração Livre Soberano	7.978.590,95
Ações Índice Ativo	5.201.681,22
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	4.272.479,80
Ações Livre	923.946,74
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	387.532,00
FIDC Outros	333.873,40
Disponibilidades Financeiras	82.898,52



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



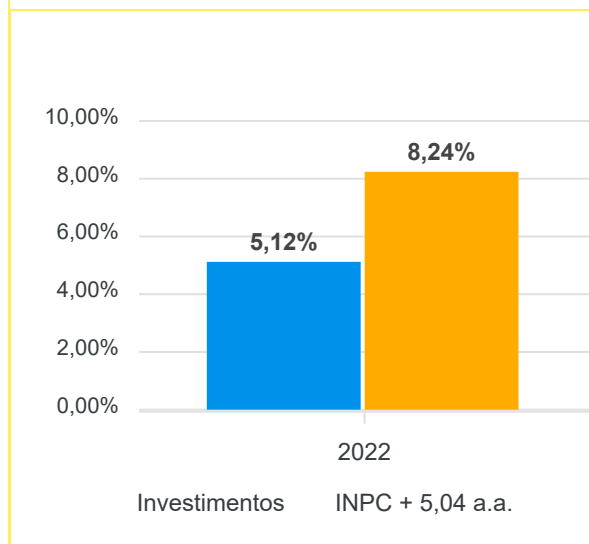
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	76.653.388,76
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	16.030.380,41
ITAU UNIBANCO S.A.	11.631.161,21
FINAXIS CORRETORA DE TITULOS E...	238.598,87
BRL TRUST DISTRIBUIDORA DE TIT...	94.764,97
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	82.898,52
GENIAL INVESTIMENTOS CORRETORA...	509,56

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

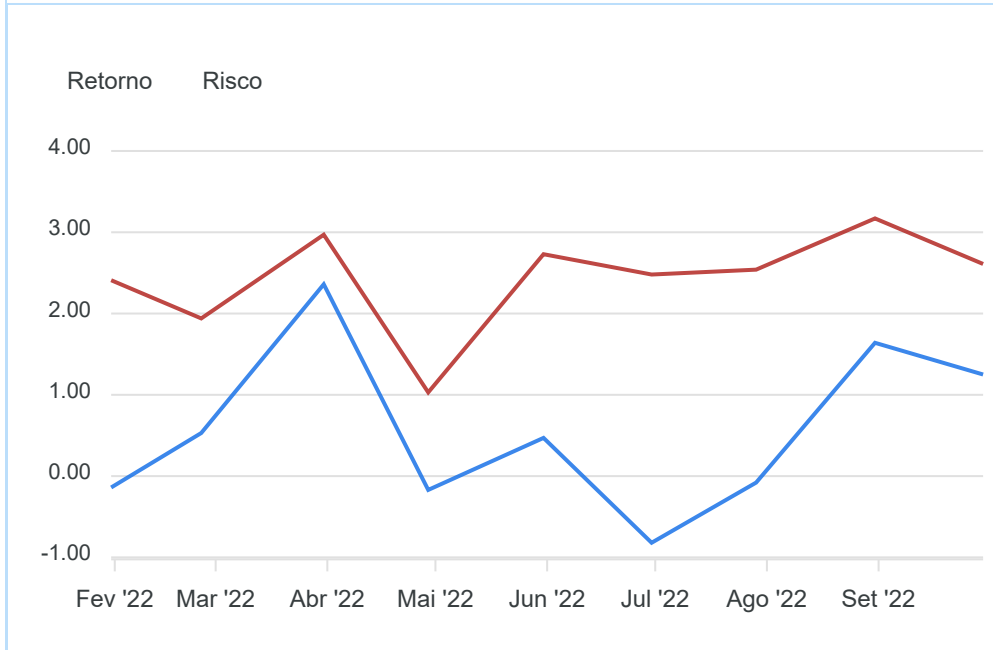
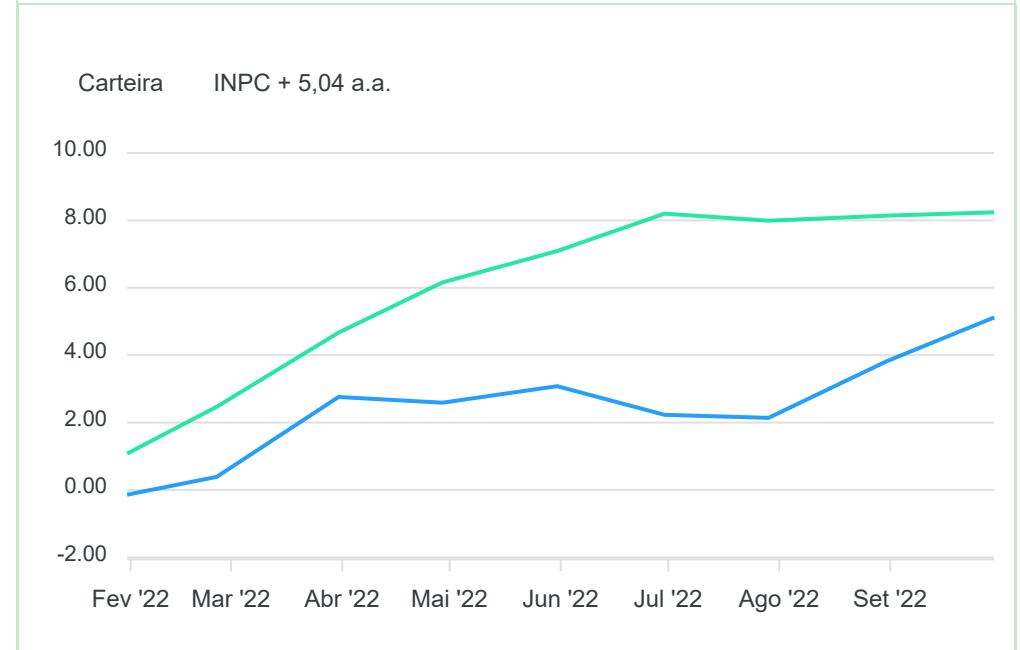


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



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