

2022

Relatório Mensal

Outubro

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, ítem 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	3.479.429,52	3,27%	7.996.820.457,76	0,04%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.022.769,21	1,90%	6.120.033.935,05	0,03%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	403.051,49	0,38%	6.033.726.634,06	0,01%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	158.901,34	0,15%	4.097.105.311,76	0,00%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.162.034,01	2,03%	3.736.730.846,68	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.046.378,04	1,92%	4.086.335.709,28	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.973.862,08	1,85%	3.200.270.776,09	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.945.728,41	1,83%	734.034.559,46	0,27%	7º I b
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	595.206,37	0,56%	818.815.798,11	0,07%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.745.486,30	6,33%	8.449.071.998,91	0,08%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	19.160.428,81	17,99%	1.174.260.901,84	1,63%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.581.841,33	4,30%	3.862.167.779,60	0,12%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	205.252,25	0,19%	5.646.338.902,14	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.061.096,32	10,38%	1.708.413.632,69	0,65%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.334.900,34	9,70%	989.148.437,52	1,04%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.718.878,43	4,43%	238.189.235,75	1,98%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.779.862,00	1,67%	165.400.002,25	1,08%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA	5.130.289,28	4,82%	49.802.843,99	10,30%	7º I b
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.051.535,40	7,56%	684.563.920,03	1,18%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.338.791,36	4,07%	14.020.474.735,38	0,03%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	8.622.019,08	8,09%	1.650.722.847,59	0,52%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	123.398,55	0,12%	3.279.050.946,44	0,00%	7º III a
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	95.443,24	0,09%	22.202.742,11	0,43%	7º V a
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	551,44	0,00%	262.963,08	0,21%	7º V a
PREMIUM FIDC SÊNIOR	237.593,63	0,22%	30.845.683,20	0,77%	7º V a
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	5.596.986,05	5,25%	734.602.002,46	0,76%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	939.681,60	0,88%	2.030.078.847,62	0,05%	9º III


Investimentos

 106.511.395,88

Disponibilidades Financeiras

 87.791,95

Total Carteira

 106.599.187,83

Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
-------	-------------	------------	--------	------	-----

Investimentos

\$ 106.511.395,88


Disponibilidades Financeiras

\$ 87.791,95

Total Carteira

\$ 106.599.187,83

Governança (Pró Gestão)

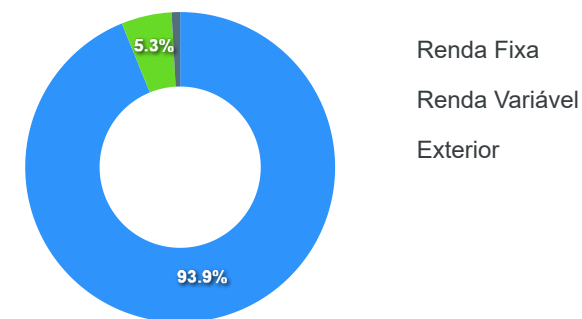
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	73,71%	28.006.000,35
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	19,84%	42.771.093,14
7º V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	0,31%	4.991.981,48
8º I - Fundos de Ações	30,00%	5,25%	26.356.432,71
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,88%	9.711.457,99

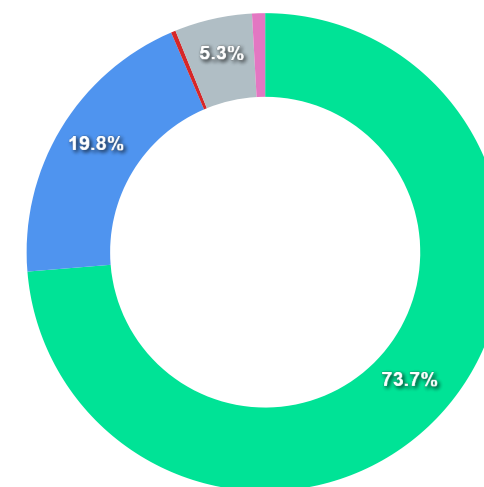
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos

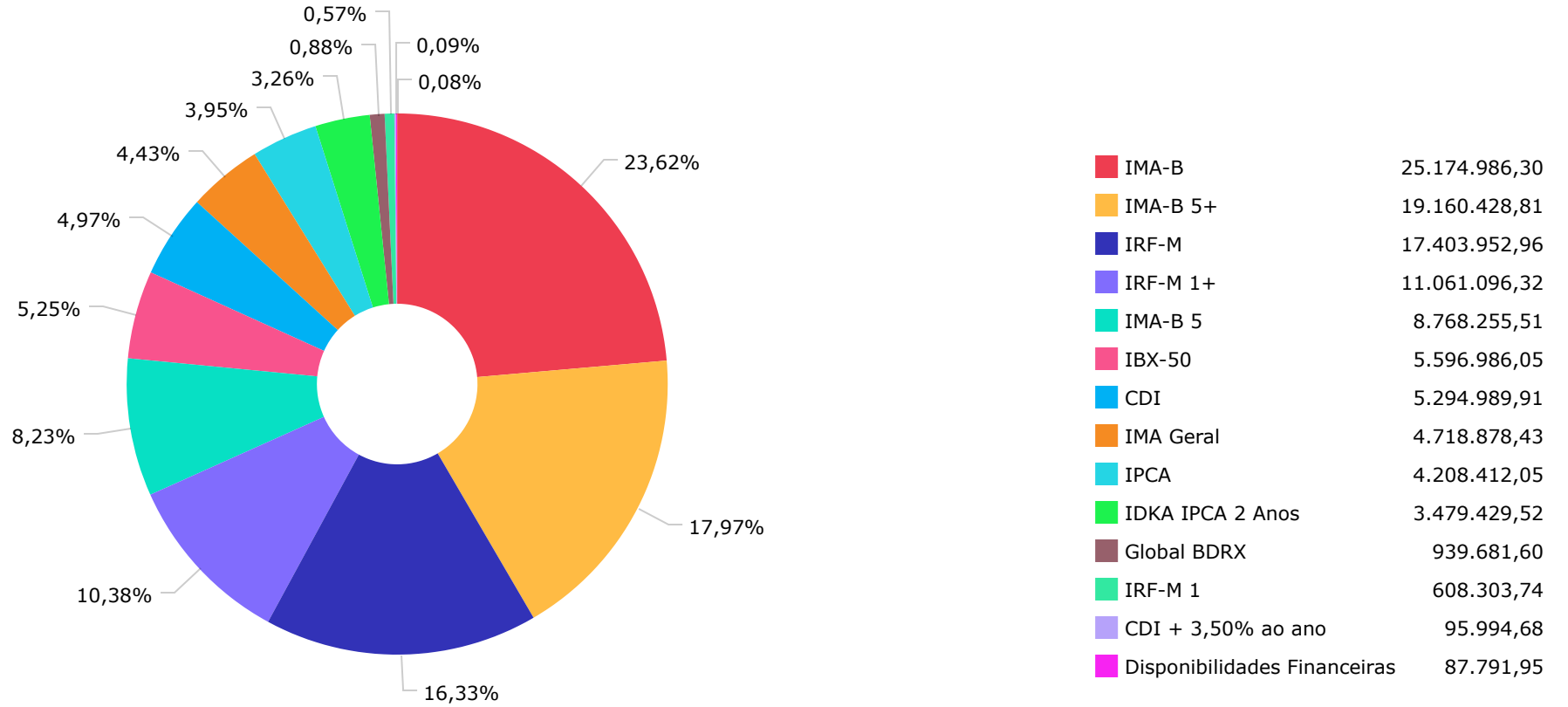


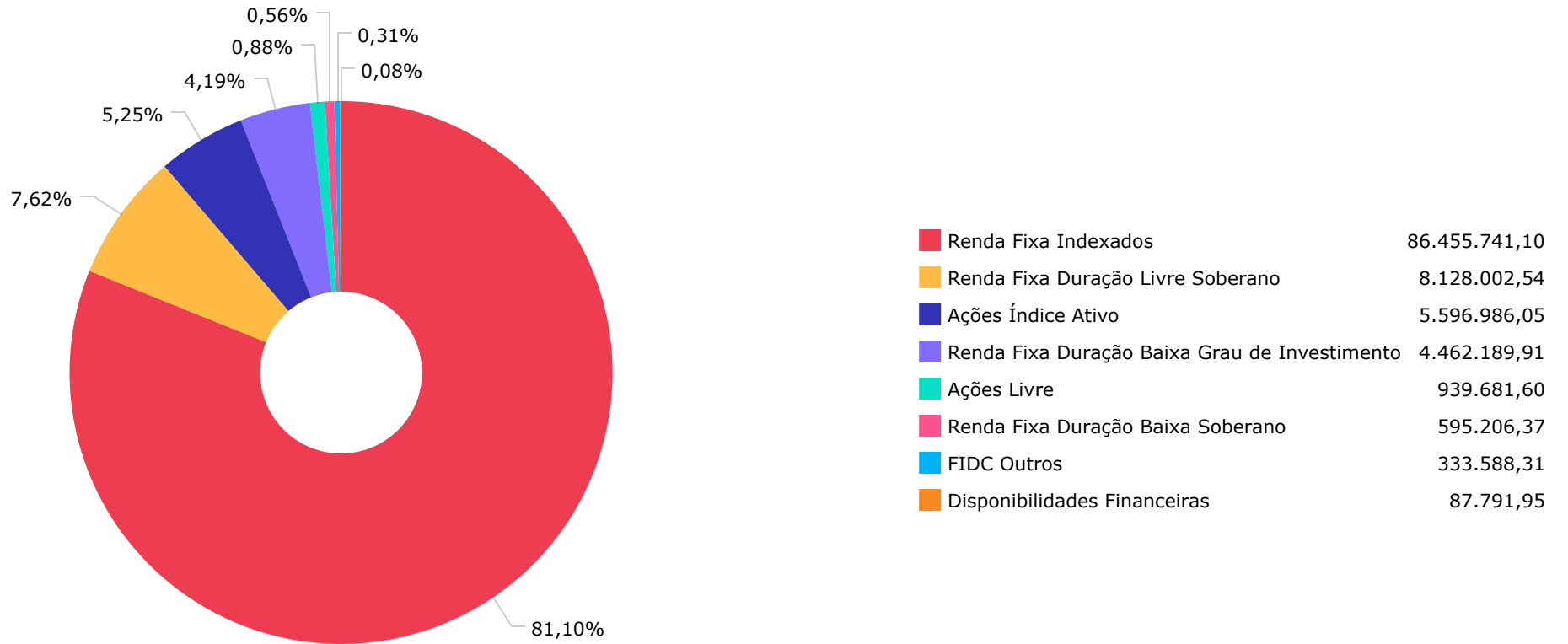
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	10,00%	100,00%	106.511.395,88
7° I b - FI 100% Títulos TN	73,71%	0,00%	29,00%	100,00%	28.006.000,35
7° III a - FI Referenciados RF	19,84%	0,00%	20,00%	60,00%	42.771.093,14
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,31%	0,00%	1,00%	5,00%	4.991.981,48

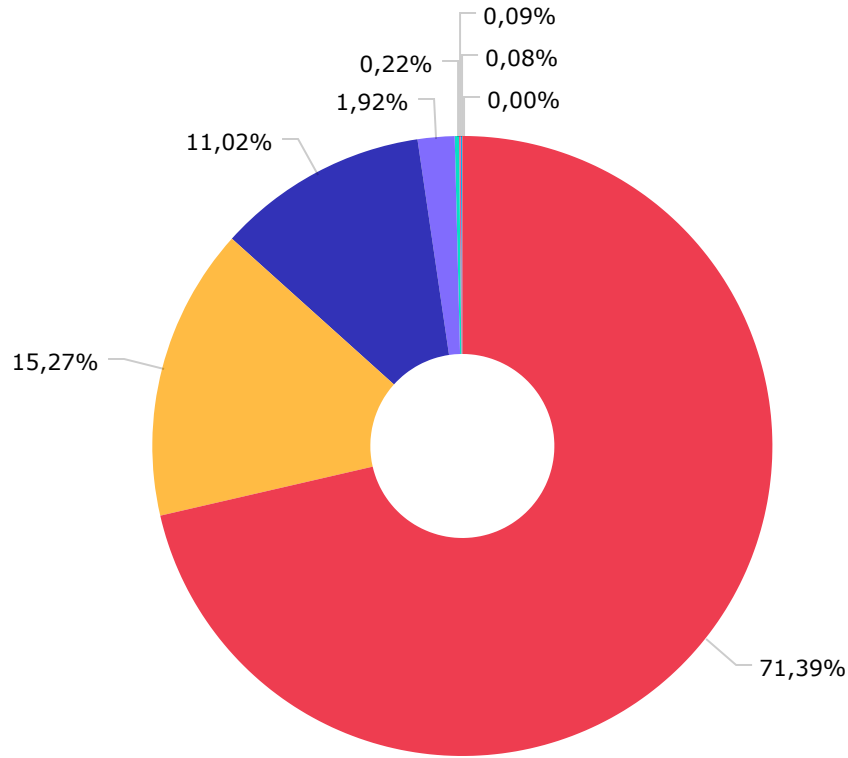
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8° I - Fundos de Ações	5,25%	0,00%	29,00%	30,00%	26.356.432,71
9° III - Ações - BDR Nível I	0,88%	0,00%	10,00%	10,00%	9.711.457,99
10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	10.651.139,59

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20		
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1,09	10,68	3,44	6,88	12,27	16,66	0,02	0,05
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03	10,25	3,36	6,65	11,77	15,91	0,02	0,04
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,89	8,56	2,87	5,64	9,77	12,33	0,00	0,00
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,42	-59,89	-1,56	-59,70	-60,22	-62,34	0,32	0,68
CDI + 3,50% AO ANO - BENCHMARK	1,30	13,19	4,19	8,36	15,39	23,40		
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,72	-39,31	1,31	-52,82	-44,87	-60,37		
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	8,22	-75,25	17,37	-71,30	-76,80	-88,20		
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	1,33	-29,86	-9,99	-6,55	-29,14	-2,97		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,70	-29,79	-9,82	-6,27	-29,23	-5,49	16,62	34,99
IBX-50 - BENCHMARK	5,32	10,92	12,53	7,34	13,01	26,17		
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	7,60	11,53	14,68	5,77	12,80	24,84	14,83	31,23
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,85	8,72	2,35	3,19	12,14	17,05	0,82	1,73
IMA GERAL - BENCHMARK	1,01	8,88	3,72	5,61	11,80	12,98		
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,21	7,23	3,80	3,45	11,15	12,91	1,56	3,29
IMA-B - BENCHMARK	1,23	7,43	3,86	3,57	11,40	13,44		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18	7,34	3,92	3,56	11,26	13,01	1,58	3,33
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,10	7,24	3,84	3,57	11,14	12,92	1,62	3,41
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,18	7,12	3,73	3,27	11,06	12,77	1,56	3,29
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,89	2,34	-0,81	-0,03	6,01	4,24	0,85	1,80

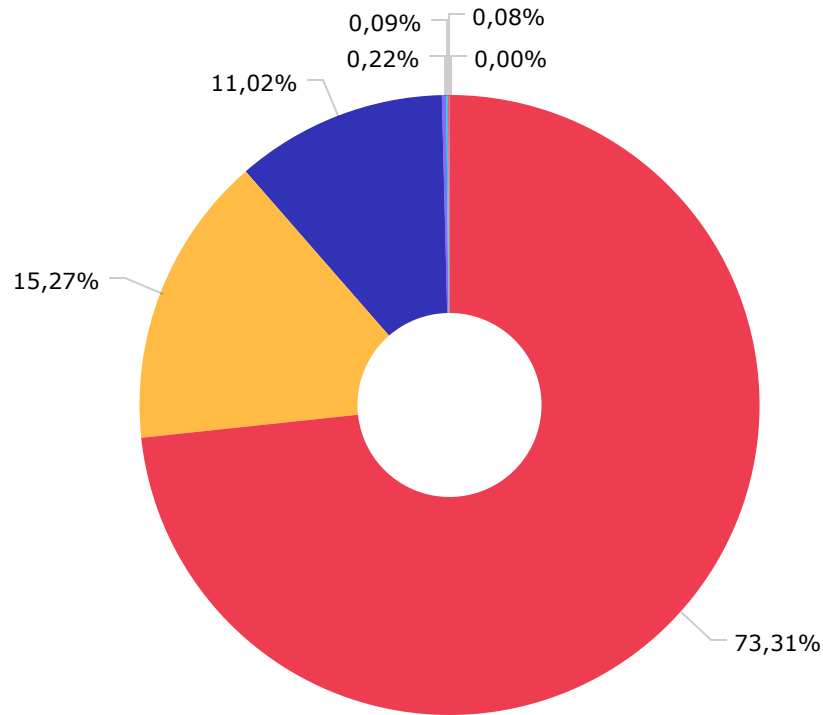
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,07	0,13	-1,21	-1,25	4,80	0,19	1,74	3,67
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,91	9,12	2,35	3,50	12,73	17,73		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,88	9,05	2,36	3,51	12,60	17,31	0,75	1,57
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,89	8,92	2,30	3,42	12,47	17,14	0,75	1,58
IMA-B 5+ - BENCHMARK	0,65	5,79	5,62	3,73	10,15	9,03		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,64	5,61	5,60	3,61	9,83	8,35	2,41	5,08
IPCA - BENCHMARK	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,24	9,55	2,18	3,12	12,46	18,19	0,53	1,12
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,24		2,18	-0,23			0,53	1,12
IRF-M - BENCHMARK	0,93	7,95	4,44	6,64	11,95	8,26		
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,94	7,84	4,40	6,56	11,84	7,91	0,96	2,02
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89	7,79	4,38	6,53	11,79	7,77	0,96	2,02
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA	0,90	7,70	4,37	6,48	11,62	7,71	0,96	2,02
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,00	9,56	3,38	6,37	11,43	13,21	0,03	0,07
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,00	9,68	3,38	6,44	11,52	13,50		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,98	9,45	3,32	6,31	11,24	12,97	0,03	0,07
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98	9,45	3,31	6,32	11,23	12,92	0,04	0,07
IRF-M 1+ - BENCHMARK	0,92	7,22	5,18	6,95	12,08	5,46		
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86	6,90	5,04	6,69	11,72	4,75	1,43	3,01







CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	76.101.280,30
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	16.277.720,97
ITAU UNIBANCO S.A.	11.752.428,26
CAIXA DTVM	2.046.378,04
PETRA CAPITAL GESTAO DE INVEST...	237.593,63
VILA RICA CAPITAL GESTORA DE R...	95.443,24
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	87.791,95
GENIAL GESTAO LTDA	551,44



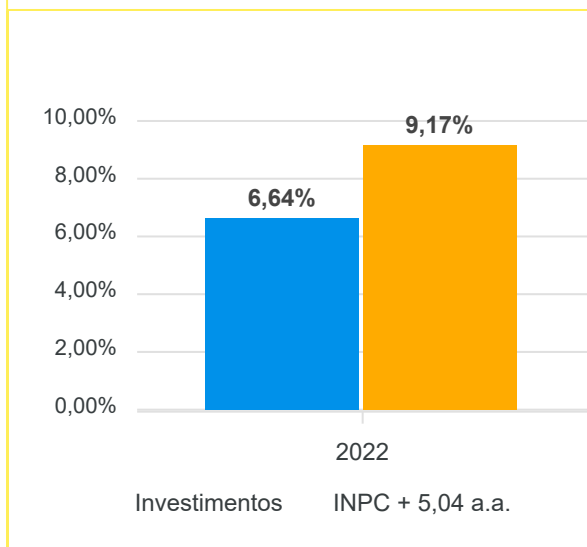
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	78.147.658,34
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	16.277.720,97
ITAU UNIBANCO S.A.	11.752.428,26
FINAXIS CORRETORA DE TITULOS E...	237.593,63
BRL TRUST DISTRIBUIDORA DE TIT...	95.443,24
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	87.791,95
GENIAL INVESTIMENTOS CORRETORA...	551,44

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%
Outubro	104.648.803,78	901.559,81	556.000,00	106.511.395,88	1.517.032,29	6.616.362,29	1,44% ▲	6,64%	0,86%	9,17%	72,41%	2,19%

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

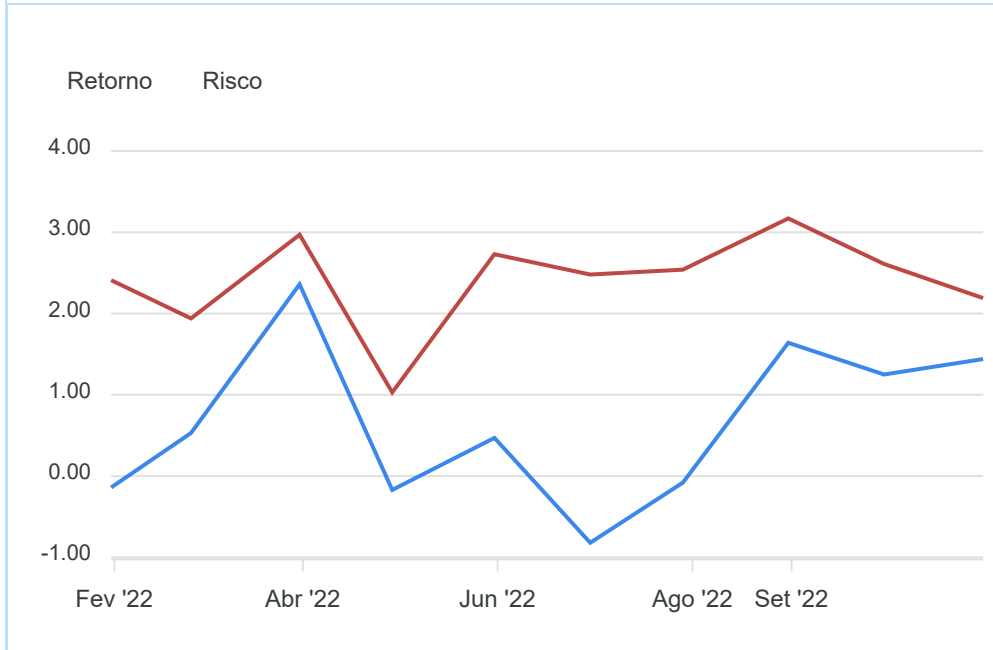
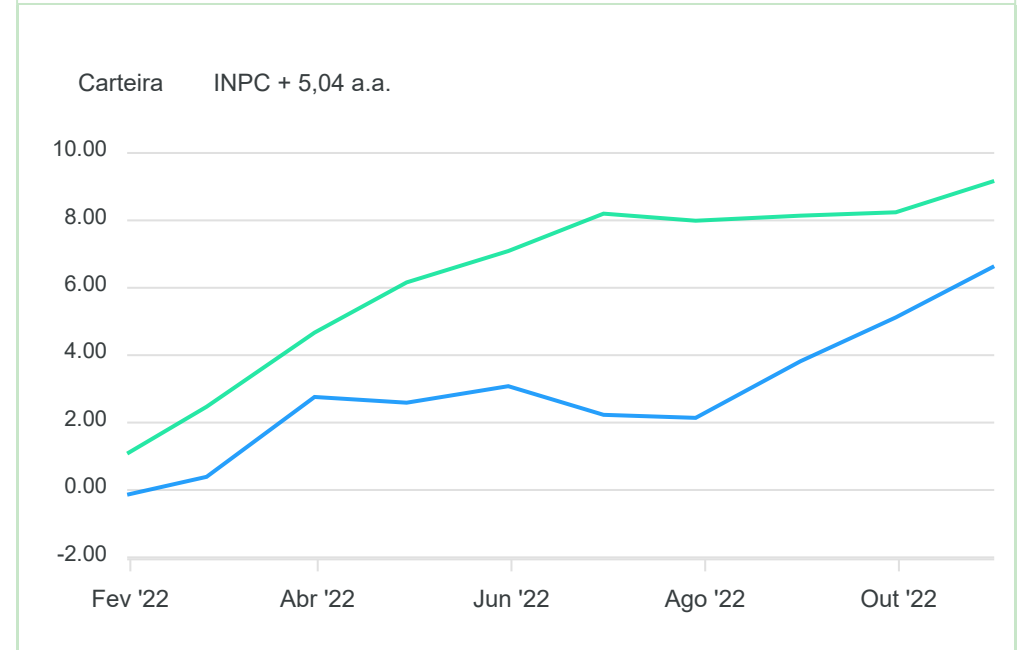


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.416.087,30	0,00	0,00	3.479.429,52	63.342,22	1,85% ▲	0,82%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.985.249,50	0,00	0,00	2.022.769,21	37.519,71	1,89% ▲	0,75%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.957.813,69	0,00	0,00	8.051.535,40	93.721,71	1,18% ▲	1,56%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	399.124,86	0,00	0,00	403.051,49	3.926,63	0,98% ▲	0,04%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	157.492,31	0,00	0,00	158.901,34	1.409,03	0,89% ▲	0,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.114.612,75	0,00	0,00	2.162.034,01	47.421,26	2,24% ▲	0,53%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.001.606,25	0,00	0,00	2.046.378,04	44.771,79	2,24% ▲	0,53%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.937.166,44	0,00	0,00	1.973.862,08	36.695,64	1,89% ▲	0,85%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.925.205,51	0,00	0,00	1.945.728,41	20.522,90	1,07% ▲	1,74%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	387.532,00	202.893,15	0,00	595.206,37	4.781,22	0,81% ▲	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.150.408,92	698.666,66	556.000,00	4.338.791,36	45.715,78	0,94% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.621.310,09	0,00	0,00	6.745.486,30	124.176,21	1,88% ▲	0,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	19.038.199,00	0,00	0,00	19.160.428,81	122.229,81	0,64% ▲	2,41%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.528.451,51	0,00	0,00	4.581.841,33	53.389,82	1,18% ▲	1,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	203.250,23	0,00	0,00	205.252,25	2.002,02	0,99% ▲	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.967.196,55	0,00	0,00	11.061.096,32	93.899,77	0,86% ▲	1,43%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.238.994,99	0,00	0,00	10.334.900,34	95.905,35	0,94% ▲	0,96%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	8.528.439,31	0,00	0,00	8.622.019,08	93.579,77	1,10% ▲	1,62%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	94.764,97	0,00	0,00	95.443,24	678,27	0,72% ▲	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	122.070,88	0,00	0,00	123.398,55	1.327,67	1,09% ▲	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.662.336,86	0,00	0,00	4.718.878,43	56.541,57	1,21% ▲	1,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.762.281,78	0,00	0,00	1.779.862,00	17.580,22	1,00% ▲	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA	5.084.471,69	0,00	0,00	5.130.289,28	45.817,59	0,90% ▲	0,96%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	509,56	0,00	0,00	551,44	41,88	8,22% ▲	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	238.598,87	0,00	0,00	237.593,63	-1.005,24	-0,42% ▼	0,32%
	98.523.175,82	901.559,81	556.000,00	99.974.728,23	1.105.992,60	1,12%	1,35%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	5.201.681,22	0,00	0,00	5.596.986,05	395.304,83	7,60% ▲	14,83%
-	5.201.681,22	0,00	0,00	5.596.986,05	395.304,83	7,60%	14,83%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	923.946,74	0,00	0,00	939.681,60	15.734,86	1,70% ▲	16,62%
	923.946,74	0,00	0,00	939.681,60	15.734,86	1,70%	0,00%