

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

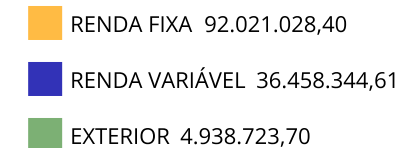
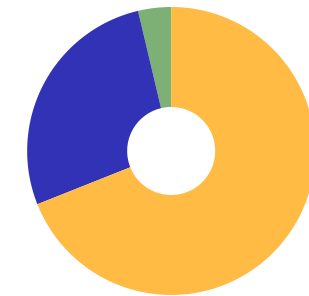
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	11.298.026,33	8,47%	520	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	7.396.279,78	5,54%	1.050	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	463 dias	8.134.012,40	6,10%	280	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	2.923.509,11	2,19%	247	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.892.636,70	4,42%	1.035	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.717.554,06	5,78%	975	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	109.381,37	0,08%	1.173	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	4.872.839,09	3,65%	281	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	14.195.738,11	10,64%	1.028	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	8.887.550,97	6,66%	295	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.773.501,63	5,83%	289	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	9.707.005,88	7,28%	241	0,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	1.518.705,63	1,14%	112	0,69%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	1.594.287,34	1,19%	1.293	0,68%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.314.751,91	2,48%	1.898	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.120.295,94	2,34%	3.616	1,01%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	5.204.912,00	3,90%	1.419	0,77%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	6.023.885,54	4,52%	188	0,95%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.900.184,06	1,42%	2.986	0,81%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.850.969,35	1,39%	7.558	0,29%	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
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.837.565,05	1,38%	1.988	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	2.886.624,66	2,16%	2.840	0,83%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL...	D+2 du	Não há	651.128,26	0,49%	2.460	1,00%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.031.486,84	0,77%	15.427	0,15%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.622.628,20	1,22%	518	0,08%	Artigo 9º, Inciso III
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5 du	Não há	1.633.480,40	1,22%	988	6,36%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	4.164.445,83	3,12%	183	1,38%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	6.154.710,27	4,61%	126	0,79%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			133.418.096,71				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA 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%	15,70%	59,24%	79.036.880,49
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	48.344.238,84	36,24%	19,65%	25,70%	59,24%	30.692.641,65
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	65,00%	40.563.796,59	30,40%	2,44%	17,25%	50,00%	26.145.251,77
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,25%	20,00%	26.683.619,34
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	5,00%	3.112.992,97	2,33%	0,00%	3,00%	5,00%	3.557.911,87
Total Renda Fixa	100,00%	92.021.028,40	68,97%	22,09%	64,90%	193,48%	



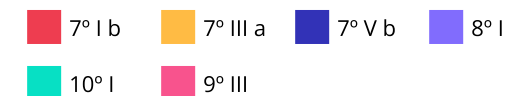
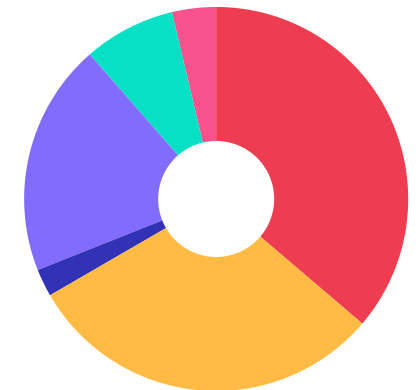
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	26.139.188,51	19,59%	15,00%	20,00%	25,00%	7.215.335,67
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,10%	20,00%	26.683.619,34
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	10.319.156,10	7,73%	3,75%	5,00%	10,00%	3.022.653,57
Total Renda Variável	35,00%	36.458.344,61	27,33%	18,75%	27,10%	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%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	6.670.904,84
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.938.723,70	3,70%	3,00%	5,00%	10,00%	8.403.085,97
Total Exterior	10,00%	4.938.723,70	3,70%	3,00%	7,00%	15,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	61.699.429,41	46,25	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	45.172.153,00	33,86	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	9.707.005,88	7,28	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	8.887.550,97	6,66	0,00
SOMMA INVESTIMENTOS	4.480.912,00	3,36	-
OCCAM BRASIL	1.837.565,05	1,38	0,01
GENIAL INVESTIMENTOS	1.633.480,40	1,22	-

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)

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	59,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	48.344.238,84	36,24	19,65	59,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	40.563.796,59	30,40	2,44	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	3.112.992,97	2,33	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	26.139.188,51	19,59	15,00	25,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	4.938.723,70	3,70	3,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	10.319.156,10	7,73	3,75	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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
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%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,51%	6,53%	0,11%	2,61%	8,47%	14,89%	1,50%	0,04%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,20%	8,74%	0,17%	3,87%	13,60%	32,72%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,56%	7,80%	0,93%	3,74%	9,33%	13,52%	1,11%	0,04%
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%
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%	0,04%
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%
IRF-M (Benchmark)	1,40%	6,96%	4,66%	5,53%	8,01%	6,91%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,37%	6,84%	4,60%	5,39%	7,88%	6,53%	1,56%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,09%	9,08%	3,35%	6,35%	11,18%	14,77%	0,02%	0,01%
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	9,35%	3,44%	6,62%	11,58%	15,22%	0,01%	0,01%

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
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,12%	9,26%	3,38%	6,42%	11,30%	14,99%	0,02%	0,01%
IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,26%	7,50%	3,07%	5,15%	9,00%	12,03%	1,12%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,53%	8,40%	2,97%	5,62%	10,74%	13,75%	2,07%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,30%	9,92%	3,79%	7,06%	12,18%	18,52%	0,05%	0,01%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,08%	-	0,02%	-0,25%	-	-	0,75%	-

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
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-5,60%	-28,67%	-2,27%	-10,43%	-19,81%	-0,31%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,40%	-29,77%	-3,31%	-12,80%	-21,19%	-6,54%	9,65%	0,21%
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%	0,22%
IDIV (Benchmark)	-1,80%	9,21%	4,42%	-5,43%	7,21%	28,20%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,87%	8,29%	4,08%	-5,75%	6,09%	22,82%	9,75%	0,18%
Ibovespa (Benchmark)	0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-0,82%	4,29%	9,27%	-7,40%	-2,92%	20,36%	9,88%	0,20%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,34%	-1,51%	7,67%	-9,41%	-4,02%	24,18%	10,89%	0,20%
OCCAM FIC AÇÕES	-0,13%	6,17%	10,62%	-5,03%	1,71%	13,78%	10,37%	0,19%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	0,37%	1,73%	11,80%	-8,19%	-6,04%	9,94%	10,96%	0,23%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,69%	2,56%	11,57%	-6,47%	-8,05%	3,01%	10,03%	0,22%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,22%	3,35%	7,24%	-4,09%	2,20%	30,94%	8,81%	0,18%
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%

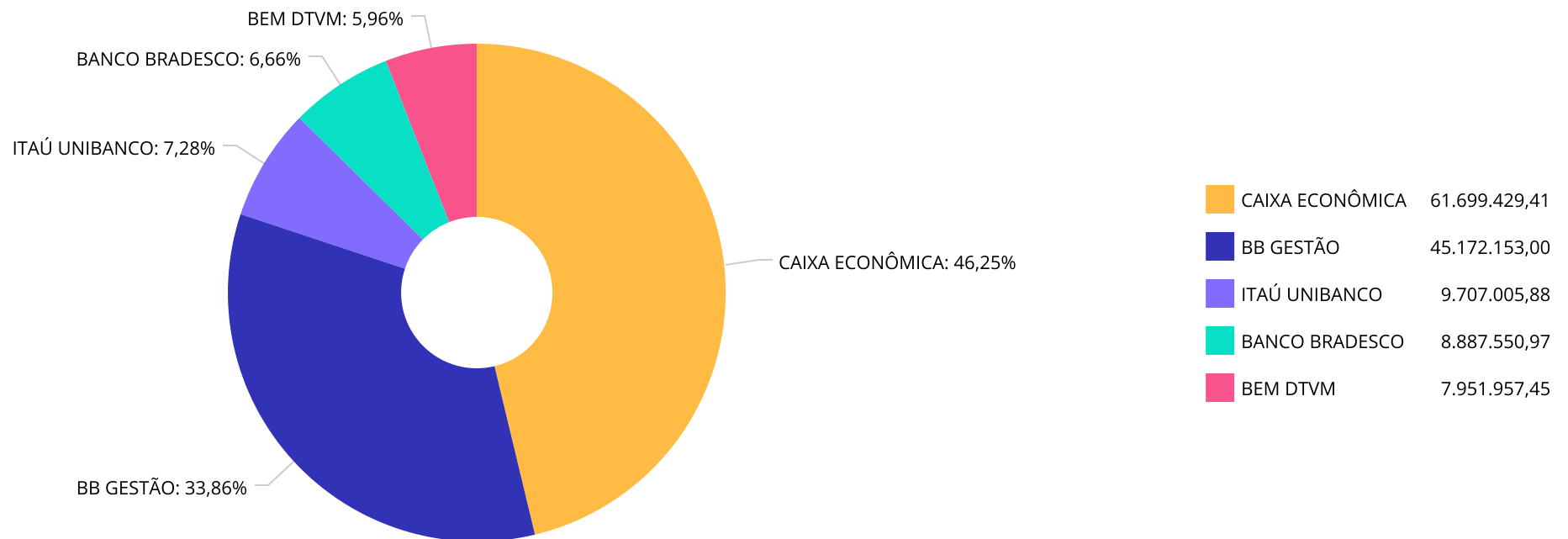
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,24%	8,76%	3,65%	5,75%	10,85%	14,76%	0,40%	0,01%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,23%	11,46%	6,57%	6,55%	12,47%	18,77%	1,41%	0,05%

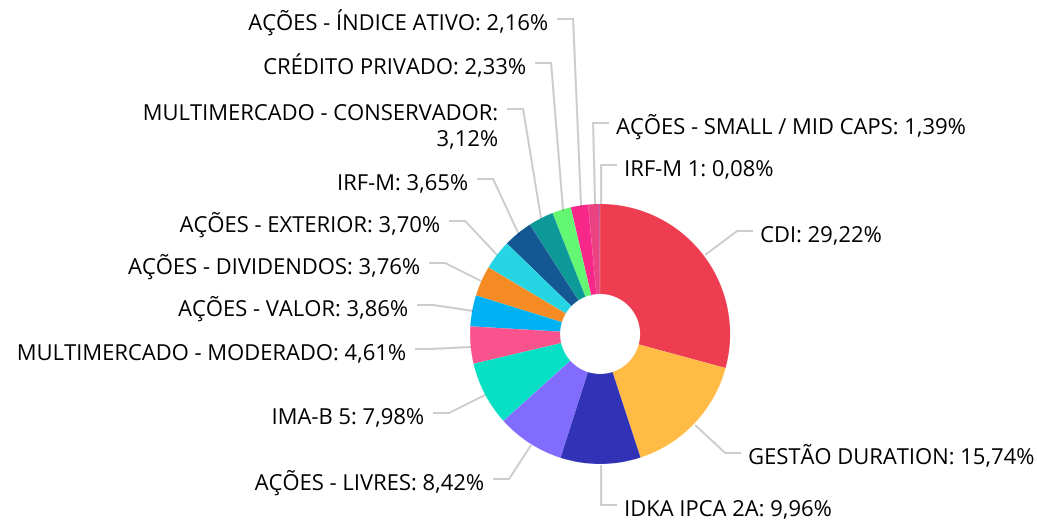
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-5,60%	-28,67%	-2,27%	-10,43%	-19,81%	-0,31%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,40%	-29,77%	-3,31%	-12,80%	-21,19%	-6,54%	9,65%	0,21%
MSCI AC Asia ex Japan (Benchmark)	-9,11%	-31,51%	-11,82%	-12,11%	-30,78%	-24,94%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL I FIC AÇÕES	-10,90%	-24,17%	-12,78%	-17,92%	-23,91%	-	8,26%	0,13%
Global BDRX (Benchmark)	-8,38%	-30,78%	-4,37%	-14,20%	-22,27%	-5,91%	-	-
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,74%	-30,09%	1,46%	-11,59%	-24,24%	-7,38%	9,29%	0,23%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,72%	-30,97%	-4,35%	-14,12%	-22,81%	-8,72%	9,55%	0,22%

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



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

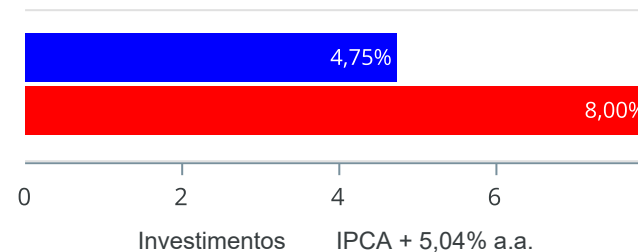


CDI	38.990.803,11	GESTÃO DURATION	21.005.032,21	IDKA IPCA 2A	13.288.916,48
AÇÕES - LIVRES	11.228.797,54	IMA-B 5	10.641.063,17	MULTIMERCADO - MODERADO	6.154.710,27
AÇÕES - VALOR	5.152.316,96	AÇÕES - DIVIDENDOS	5.020.480,00	AÇÕES - EXTERIOR	4.938.723,70
IRF-M	4.872.839,09	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	4.164.445,83	CRÉDITO PRIVADO	3.112.992,97
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.886.624,66	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.850.969,35	IRF-M 1	109.381,37

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	130.137.050,42	336.727,91	952.722,79	130.480.156,03	959.100,49	959.100,49	0,74%	0,74%	0,95%	0,95%	77,35%	2,70%
Fevereiro	130.480.156,03	9.151.435,68	8.525.208,08	131.366.480,52	260.096,89	1.219.197,38	0,20%	0,94%	1,39%	2,35%	39,85%	2,42%
Março	131.366.480,52	7.119.754,62	7.431.280,81	133.975.742,06	2.920.787,73	4.139.985,11	2,22%	3,18%	2,06%	4,46%	71,38%	3,15%
Abril	133.975.742,06	2.523.375,72	2.512.762,98	132.785.064,00	-1.201.290,80	2.938.694,31	-0,90%	2,26%	1,44%	5,96%	37,88%	2,38%
Mai	132.785.064,00	12.601.735,43	12.677.655,39	134.040.532,92	1.331.388,88	4.270.083,19	1,00%	3,28%	0,90%	6,91%	47,47%	2,87%
Junho	134.040.532,92	5.560.676,12	6.061.304,88	131.116.561,16	-2.423.343,00	1.846.740,19	-1,81%	1,41%	1,08%	8,07%	17,52%	2,60%
Julho	131.116.561,16	3.982.209,92	4.010.550,68	132.921.080,08	1.832.859,68	3.679.599,87	1,40%	2,83%	-0,27%	7,78%	36,42%	2,38%
Agosto	132.921.080,08	11.858.560,91	11.762.009,65	135.219.677,27	2.202.045,93	5.881.645,80	1,66%	4,53%	0,09%	7,87%	57,60%	2,80%
Setembro	135.219.677,27	3.849.013,02	5.933.155,16	133.418.096,71	282.561,58	6.164.207,38	0,21%	4,75%	0,12%	8,00%	59,41%	3,01%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



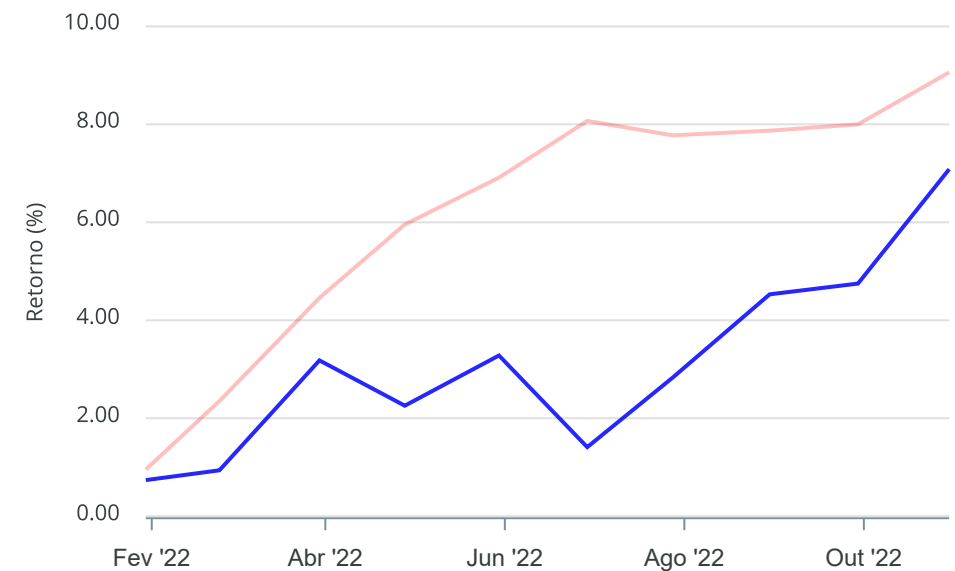
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	9.560.514,63	0,00	0,00	9.707.005,88	146.491,25	1,53%	1,53%	2,07%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1.573.890,65	0,00	0,00	1.594.287,34	20.396,69	1,30%	1,30%	0,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	11.158.020,06	0,00	0,00	11.298.026,33	140.006,27	1,25%	1,25%	1,12%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.007.208,91	809.059,87	0,00	4.872.839,09	56.570,31	1,17%	1,37%	1,56%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.789.543,79	0,00	0,00	8.887.550,97	98.007,18	1,12%	1,12%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	7.687.802,70	0,00	0,00	7.773.501,63	85.698,93	1,11%	1,11%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	11.572.506,75	2.485.295,07	0,00	14.195.738,11	137.936,29	0,98%	1,09%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	153.515,25	42.977,13	88.545,97	109.381,37	1.434,96	0,73%	1,09%	0,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.021.530,42	0,00	2.034.715,14	0,00	13.184,72	0,65%	1,05%	0,00%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1.510.265,99	0,00	0,00	1.518.705,63	8.439,64	0,56%	0,56%	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.357.320,39	0,00	0,00	7.396.279,78	38.959,39	0,53%	0,53%	1,42%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.909.313,81	0,00	0,00	2.923.509,11	14.195,30	0,49%	0,49%	1,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.781.933,27	0,00	921.667,22	5.892.636,70	32.370,65	0,48%	0,51%	1,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.726.664,00	0,00	42.010,06	7.717.554,06	32.900,12	0,43%	0,43%	1,26%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	511.680,95	512.263,59	0,00	582,64	0,11%	0,99%	0,00%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.127.271,41	0,00	0,00	8.134.012,40	6.740,99	0,08%	0,08%	0,75%
Total Renda Fixa	90.937.302,03	3.849.013,02	3.599.201,98	92.021.028,40	833.915,33	0,91%		0,89%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	6.020.613,89	0,00	0,00	6.154.710,27	134.096,38	2,23%	2,23%	1,41%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	4.113.620,45	0,00	0,00	4.164.445,83	50.825,38	1,24%	1,24%	0,40%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.313.210,65	0,00	2.333.953,18	0,00	20.742,53	0,90%	1,41%	1,55%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	2.875.979,58	0,00	0,00	2.886.624,66	10.645,08	0,37%	0,37%	10,96%
OCCAM FIC AÇÕES	1.839.886,38	0,00	0,00	1.837.565,05	-2.321,33	-0,13%	-0,13%	10,37%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5.241.254,92	0,00	0,00	5.204.912,00	-36.342,92	-0,69%	-0,69%	10,03%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.146.082,64	0,00	0,00	3.120.295,94	-25.786,70	-0,82%	-0,82%	9,88%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.359.704,20	0,00	0,00	3.314.751,91	-44.952,29	-1,34%	-1,34%	10,89%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.936.381,26	0,00	0,00	1.900.184,06	-36.197,20	-1,87%	-1,87%	9,75%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.887.514,29	0,00	0,00	1.850.969,35	-36.544,94	-1,94%	-1,94%	12,05%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6.223.994,27	0,00	0,00	6.023.885,54	-200.108,73	-3,22%	-3,22%	8,81%
Total Renda Variável	38.958.242,53	0,00	2.333.953,18	36.458.344,61	-165.944,74	-0,43%		7,52%

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
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.732.956,67	0,00	0,00	1.633.480,40	-99.476,27	-5,74%	-5,74%	9,29%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.102.052,56	0,00	0,00	1.031.486,84	-70.565,72	-6,40%	-6,40%	9,65%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.758.371,30	0,00	0,00	1.622.628,20	-135.743,10	-7,72%	-7,72%	9,55%
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL I...	730.752,18	0,00	0,00	651.128,26	-79.623,92	-10,90%	-10,90%	8,26%
Total Exterior	5.324.132,71	0,00	0,00	4.938.723,70	-385.409,01	-7,24%		9,32%

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
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	8.189.306,34	5.773.290,58	108.557,40	14.195.738,11	341.698,59	2,45%	3,35%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	10.961.381,28	0,00	0,00	11.298.026,33	336.645,05	3,07%	3,07%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.591.924,79	0,00	0,00	8.887.550,97	295.626,18	3,44%	3,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	9.426.936,34	0,00	0,00	9.707.005,88	280.069,54	2,97%	2,97%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	9.722.778,92	800.369,19	3.000.000,00	7.773.501,63	250.353,52	2,38%	3,38%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	4.809.059,87	0,00	4.872.839,09	63.779,22	1,33%	4,60%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1.536.119,50	0,00	0,00	1.594.287,34	58.167,84	3,79%	3,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.981.134,31	0,00	2.034.715,14	0,00	53.580,83	2,70%	3,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	2.944.529,16	0,00	2.986.422,96	0,00	41.893,80	1,42%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.721.390,23	0,00	42.010,06	7.717.554,06	38.173,89	0,49%	0,50%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.376.895,33	0,00	0,00	7.396.279,78	19.384,45	0,26%	0,26%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1.504.761,71	0,00	0,00	1.518.705,63	13.943,92	0,93%	0,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	281.647,18	42.977,13	221.568,12	109.381,37	6.325,18	1,95%	3,37%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.858,75	4.341.859,74	4.346.197,51	0,00	2.479,02	0,06%	3,06%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.132.767,57	0,00	0,00	8.134.012,40	1.244,83	0,02%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	11.379.983,25	0,00	5.482.291,12	5.892.636,70	-5.055,43	-0,04%	0,11%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	3.000.000,00	0,00	2.923.509,11	-76.490,89	-2,55%	-2,97%
Total Renda Fixa	89.753.414,66	18.767.556,51	18.221.762,31	92.021.028,40	1.721.819,54	1,91%	

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
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	4.665.188,47	0,00	0,00	5.204.912,00	539.723,53	11,57%	11,57%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	5.775.509,29	0,00	0,00	6.154.710,27	379.200,98	6,57%	6,57%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.813.635,38	890.774,82	0,00	6.023.885,54	319.475,34	5,60%	7,24%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	2.581.947,10	0,00	0,00	2.886.624,66	304.677,56	11,80%	11,80%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2.855.500,05	0,00	0,00	3.120.295,94	264.795,89	9,27%	9,27%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.050.478,71	31.452,52	0,00	3.314.751,91	232.820,68	7,55%	7,67%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.624.565,21	0,00	0,00	1.850.969,35	226.404,14	13,94%	13,94%
OCCAM FIC AÇÕES	1.661.211,44	0,00	0,00	1.837.565,05	176.353,61	10,62%	10,62%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	4.802.680,30	0,00	800.000,00	4.164.445,83	161.765,53	3,37%	3,65%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.587.027,36	0,00	2.683.953,18	0,00	96.925,82	3,75%	4,90%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.825.731,67	0,00	0,00	1.900.184,06	74.452,39	4,08%	4,08%
Total Renda Variável	36.243.474,98	922.227,34	3.483.953,18	36.458.344,61	2.776.595,47	7,47%	

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
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.609.986,23	0,00	0,00	1.633.480,40	23.494,17	1,46%	1,46%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.066.767,64	0,00	0,00	1.031.486,84	-35.280,80	-3,31%	-3,31%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.696.393,01	0,00	0,00	1.622.628,20	-73.764,81	-4,35%	-4,35%
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL I...	746.524,64	0,00	0,00	651.128,26	-95.396,38	-12,78%	-12,78%
Total Exterior	5.119.671,52	0,00	0,00	4.938.723,70	-180.947,82	-3,53%	

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.