

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
TÍTULOS PÚBLICOS			670.361,28	3,31%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.955.577,09	9,66%	1.087	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.438.838,29	16,99%	461	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.920.704,49	14,43%	808	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.479.875,62	17,19%	975	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.260.347,94	6,23%	1.173	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.477.668,45	17,18%	623	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.985.628,15	9,81%	1.028	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.050.912,69	5,19%	250	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		30.321,08	0,15%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			20.239.914,00				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			30.321,08				Artigo 6º
PL Total			20.270.235,08				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

⚠ ATENÇÃO! Política de Investimentos de **2022** não está cadastrada !!!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	12.189.509,19	60,23	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.380.043,53	36,46	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	670.361,28	3,31	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

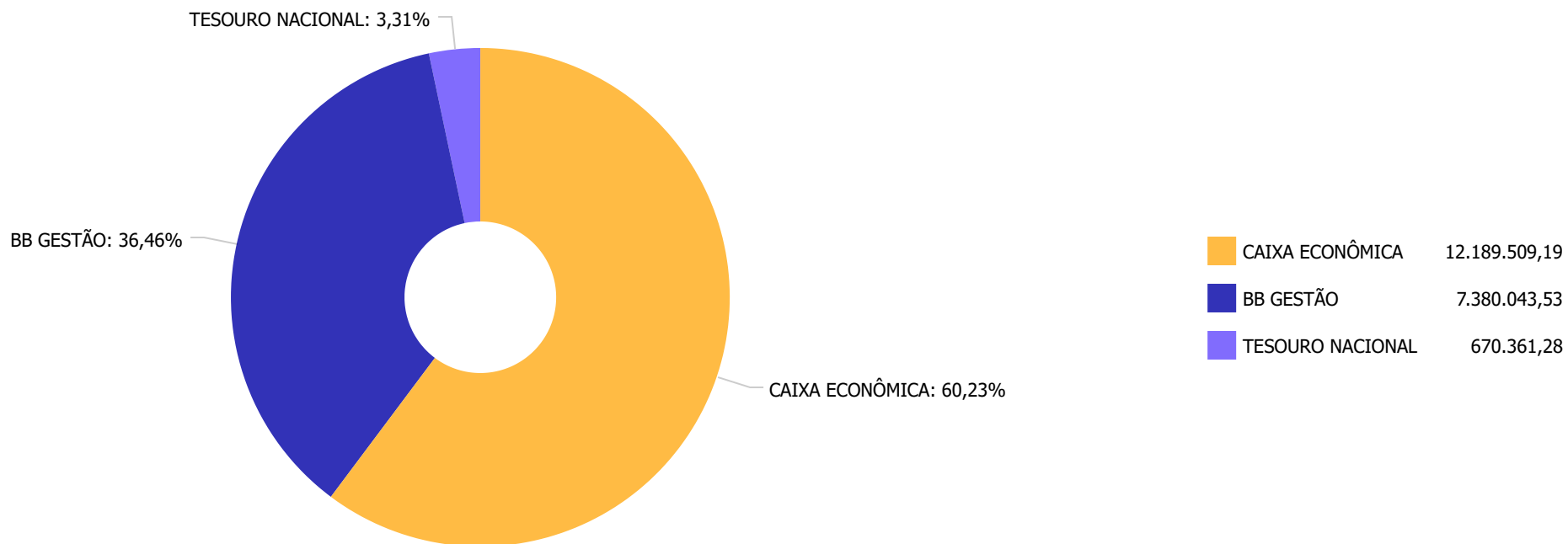
Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico,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

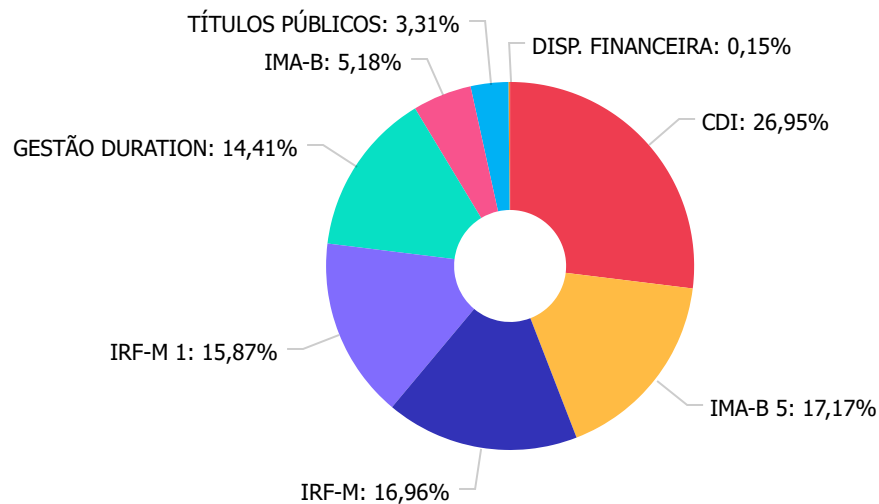
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1 (Benchmark)	1,11%	8,59%	3,43%	6,17%	9,81%	12,55%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,09%	8,39%	3,37%	6,04%	9,57%	12,03%	0,13%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	8,39%	3,37%	6,02%	9,57%	11,94%	0,13%	0,02%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,42%	7,07%	0,43%	3,14%	9,25%	15,75%	-	-
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%
IMA-B (Benchmark)	1,48%	6,12%	1,70%	3,16%	7,25%	12,30%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,52%	6,08%	1,80%	3,22%	7,12%	11,92%	2,52%	0,06%
IRF-M (Benchmark)	1,40%	6,96%	4,66%	5,53%	8,01%	6,91%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,38%	6,84%	4,63%	5,48%	7,83%	6,48%	1,56%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09%	9,03%	3,33%	6,29%	11,10%	14,29%	0,02%	0,01%
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%
IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,24%	8,29%	3,54%	5,84%	9,44%	10,38%	0,79%	0,02%



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



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



■ CDI	5.463.296,60	■ IMA-B 5	3.479.875,62	■ IRF-M	3.438.838,29	■ IRF-M 1	3.215.925,03
■ GESTÃO DURATION	2.920.704,49	■ IMA-B	1.050.912,69	■ TÍTULOS PÚBLICOS	670.361,28	■ DISP. FINANCEIRA	30.321,08



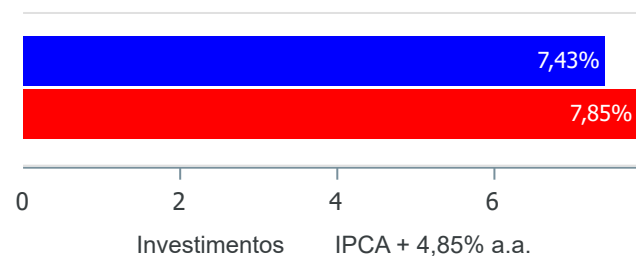
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2022)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	09/12/2003	170	1401,76958824	3.943,301639	238.300,83	670.361,28	Mercado

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	18.203.646,74	0,00	105.000,00	18.164.033,09	65.386,35	65.386,35	0,36%	0,36%	0,94%	0,94%	38,31%	0,71%
Fevereiro	18.164.033,09	191.033,61	105.000,00	18.375.620,81	125.554,11	190.940,46	0,69%	1,05%	1,37%	2,32%	45,21%	0,62%
Março	18.375.620,81	190.959,99	110.000,00	18.700.274,77	243.693,97	434.634,43	1,32%	2,38%	2,04%	4,41%	54,05%	0,84%
Abril	18.700.274,77	200.026,85	110.000,00	18.934.187,65	143.886,03	578.520,46	0,77%	3,17%	1,42%	5,89%	53,74%	0,68%
Mai	18.934.187,65	200.893,60	110.000,00	19.193.661,92	168.580,67	747.101,13	0,89%	4,08%	0,89%	6,83%	59,74%	0,81%
Junho	19.193.661,92	148.753,03	0,00	19.447.994,61	105.579,66	852.680,79	0,55%	4,65%	1,07%	7,97%	58,32%	0,91%
Julho	19.447.994,61	155.612,18	80.000,00	19.648.133,51	124.526,72	977.207,51	0,64%	5,32%	-0,29%	7,66%	69,39%	0,80%
Agosto	19.648.133,51	223.877,89	110.000,00	19.949.055,01	187.043,61	1.164.251,12	0,95%	6,31%	0,07%	7,74%	81,57%	0,78%
Setembro	19.949.055,01	203.561,76	122.110,29	20.239.914,00	209.407,52	1.373.658,64	1,05%	7,43%	0,10%	7,85%	94,56%	0,78%

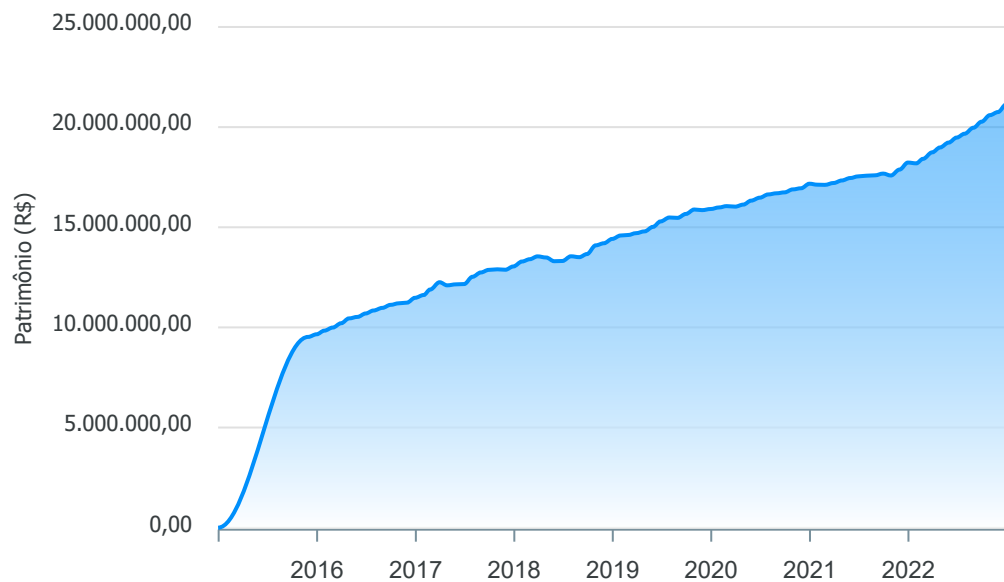
Investimentos x Meta de Rentabilidade



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

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
TÍTULOS PÚBLICOS	667.008,53	0,00	12.110,29	670.361,28	15.463,04	2,32%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.035.162,83	0,00	0,00	1.050.912,69	15.749,86	1,52%	1,52%	2,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.884.888,54	0,00	0,00	2.920.704,49	35.815,95	1,24%	1,24%	0,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.964.166,69	0,00	0,00	1.985.628,15	21.461,46	1,09%	1,09%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.246.784,77	0,00	0,00	1.260.347,94	13.563,17	1,09%	1,09%	0,13%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.934.571,13	0,00	0,00	1.955.577,09	21.005,96	1,09%	1,09%	0,13%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.419.009,33	130.472,63	110.000,00	3.477.668,45	38.186,49	1,08%	1,09%	0,02%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.399.466,20	6.000,00	0,00	3.438.838,29	33.372,09	0,98%	1,38%	1,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.397.996,99	67.089,13	0,00	3.479.875,62	14.789,50	0,43%	0,43%	1,26%
Total Renda Fixa	19.949.055,01	203.561,76	122.110,29	20.239.914,00	209.407,52	1,05%		0,78%



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
Total Renda Variável	0,00	0,00	0,00	0,00	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
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.228.777,75	436.691,21	300.000,00	3.477.668,45	112.199,49	3,06%	3,33%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.320.750,78	6.000,00	0,00	3.438.838,29	112.087,51	3,37%	4,63%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.820.847,03	0,00	0,00	2.920.704,49	99.857,46	3,54%	3,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.921.287,76	0,00	0,00	1.985.628,15	64.340,39	3,35%	3,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.891.835,45	0,00	0,00	1.955.577,09	63.741,64	3,37%	3,37%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.219.291,56	0,00	0,00	1.260.347,94	41.056,38	3,37%	3,37%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.032.373,91	0,00	0,00	1.050.912,69	18.538,78	1,80%	1,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.322.816,67	140.360,62	0,00	3.479.875,62	16.698,33	0,48%	0,50%
TÍTULOS PÚBLICOS	690.013,70	0,00	12.110,29	670.361,28	-7.542,13	-1,09%	-
Total Renda Fixa	19.447.994,61	583.051,83	312.110,29	20.239.914,00	520.977,85	2,64%	

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.

