

2022

Relatório

Mensal e 3º trimestre de 2022

Setembro

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MPS nº 519 de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V, e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.2, ítem 3.2.6, aprovado pela Portaria SPREV nº 3030, de 15 de Março de 2021.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.714.910,69	7,06%	4.594.008.809,74	0,78%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.879.837,98	1,56%	8.749.817.040,89	0,09%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	43.728.145,15	8,65%	6.260.416.458,58	0,70%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.134.687,57	0,22%	827.244.788,64	0,14%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.889.853,07	4,53%	6.071.749.354,31	0,38%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.979.300,66	5,93%	3.601.305.672,83	0,83%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	404.513,67	0,08%	178.762.226,88	0,23%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	573.765,94	0,11%	199.903.755,16	0,29%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	89.232.245,44	17,64%	2.223.594.947,35	4,01%	7º I b
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.274.925,92	2,03%	3.960.240.224,82	0,26%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	518.634,46	0,10%	462.016.175,66	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.451.194,69	0,68%	229.176.559,56	1,51%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	83.412.266,37	16,49%	2.902.138.561,58	2,87%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	68.793,67	0,01%	5.850.800.339,33	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.106.569,62	1,01%	8.482.726.221,67	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.269.907,95	1,04%	8.885.835.879,64	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.065.478,36	1,59%	1.171.846.641,79	0,69%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	497.733,27	0,10%	3.871.147.074,69	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	324.437,10	0,06%	5.416.816.231,94	0,01%	7º I b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.015.090,76	6,92%	3.121.665.296,26	1,12%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	34.636.950,51	6,85%	11.894.605.297,71	0,29%	7º III a
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	13.614.805,93	2,69%	801.217.889,04	1,70%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.402.082,41	0,28%	1.761.108.354,50	0,08%	7º III a
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.779.782,63	0,55%	348.188.196,97	0,80%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.211.628,50	1,03%	2.713.701.445,40	0,19%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	3.253.508,90	0,64%	374.429.452,36	0,87%	7º III a
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.562.568,05	1,30%	550.126.022,42	1,19%	7º V b

Investimentos

\$ 505.749.905,74

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 505.749.905,74

Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.034.485,58	0,20%	218.581.305,61	0,47%	7º V b
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3.741.967,07	0,74%	395.899.076,59	0,95%	8º I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.643.061,56	0,92%	1.044.236.872,39	0,44%	8º I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	5.100.153,36	1,01%	1.013.771.799,24	0,50%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.405.148,93	0,48%	234.755.585,42	1,02%	8º I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.410.517,04	0,28%	643.251.684,47	0,22%	8º I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	8.021.885,99	1,59%	697.883.990,12	1,15%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.228.091,70	1,82%	2.057.509.929,37	0,45%	9º III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	3.336.602,58	0,66%	119.169.735,24	2,80%	10º I
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	7.241.606,64	1,43%	538.561.067,05	1,34%	10º I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.071.785,26	0,41%	302.751.174,65	0,68%	10º I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.021.475,85	0,40%	2.801.089.828,19	0,07%	10º I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.389.547,05	0,47%	779.065.247,30	0,31%	10º I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.260.797,86	0,25%	839.545.439,04	0,15%	10º I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	839.160,00	0,17%	110.192.896,80	0,76%	11º

Investimentos

\$ 505.749.905,74

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 505.749.905,74

Governança (Pró Gestão)

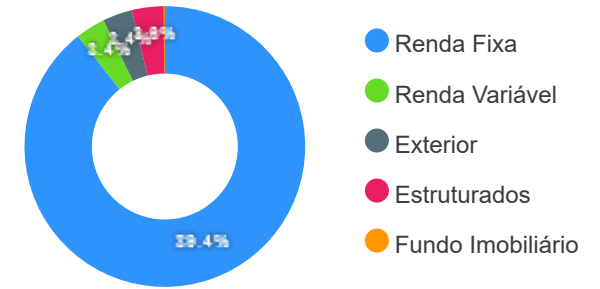
Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	69,00%	31,00%
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	18,99%	41,01%
7° V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	1,50%	3,50%
8° I - Fundos de Ações	30,00%	3,43%	26,57%
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,42%	6,58%
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	3,63%	6,37%
11° - Fundos Imobiliários	5,00%	0,17%	4,83%

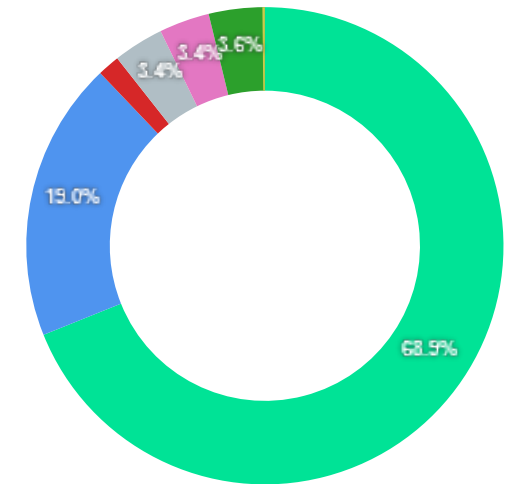
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos

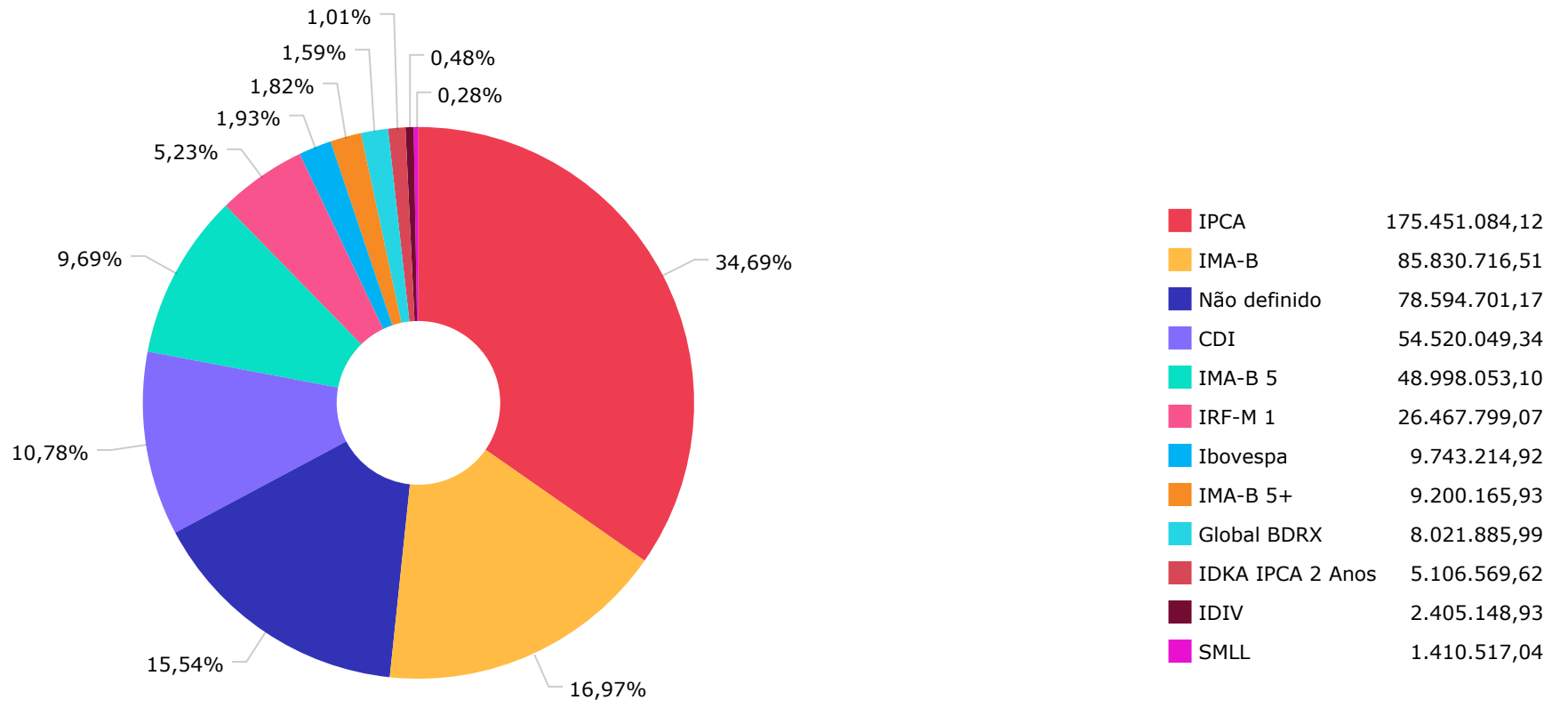


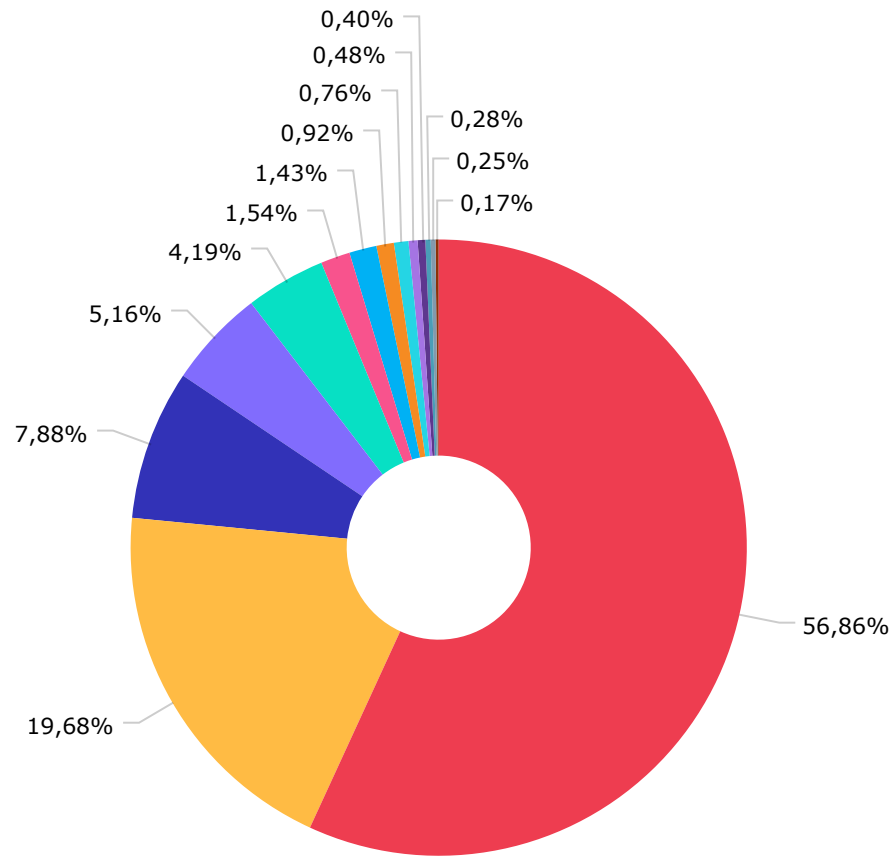
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	151.528.596,78	8° I - Fundos de Ações	3,43%	0,00%	6,50%	30,00%	134.227.748,82
7° I b - FI 100% Títulos TN	69,00%	14,00%	56,00%	80,00%	55.549.056,50	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	1,50%	5,00%	25.254.766,13
7° III a - FI Referenciados RF	18,99%	0,00%	12,00%	50,00%	156.633.811,66	9° III - Ações - BDR Nível I	3,42%	0,00%	7,50%	10,00%	33.259.554,57
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	101.019.064,52	10° I - Fundos Multimercados	3,63%	0,00%	5,00%	10,00%	32.187.717,02
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	1,50%	0,00%	2,00%	5,00%	17.657.712,50	11° - Fundos Imobiliários	0,17%	0,00%	0,50%	1,00%	4.211.793,23
						12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.254.766,13

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,23	11,46	6,57	6,55	12,47	18,77	1,41	2,97
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,48	10,32	6,73	3,66	10,21	16,28	3,15	6,63
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,56	7,80	0,93	3,74	9,33	13,52	1,11	2,35
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1,07	7,15	2,71	5,10	8,83	11,44	0,90	1,90
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
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,15	3,43	-2,15	2,13	8,19	19,47	0,14	0,30
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,24	6,69	2,87	4,60	7,75	9,64	1,12	2,37
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-1,71	5,56	11,15	-6,34	-0,17	14,77	10,10	21,27
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,48	2,48	10,51	8,13	-2,90	-62,20	5,02	10,57
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,72	-30,97	-4,35	-14,12	-22,81	-8,72	9,55	20,12
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,08		0,02	-0,25			0,75	1,57
CDI - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21		
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12	9,30	3,41	6,53	11,54	15,48	0,02	0,03
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,09	9,08	3,35	6,35	11,18	14,77	0,02	0,04
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,24	8,76	3,65	5,75	10,85	14,76	0,40	0,85
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,81	9,18	3,44	5,42	10,60	14,70	0,65	1,38
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,04	8,05	2,81	4,58	10,11	11,71	0,68	1,43
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	0,71	7,14	2,59	4,09	8,62	10,94	0,46	0,97
GLOBAL BDRX - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
	-8,38	-30,78	-4,37	-14,20	-22,27	-5,91		
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,40	-29,77	-3,31	-12,80	-21,19	-6,54	9,65	20,32
IBOVESPA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31		
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,34	-1,51	7,67	-9,41	-4,02	24,18	10,89	22,94
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-2,86	-4,12	10,23	-7,79	-13,85	0,36	9,19	19,35

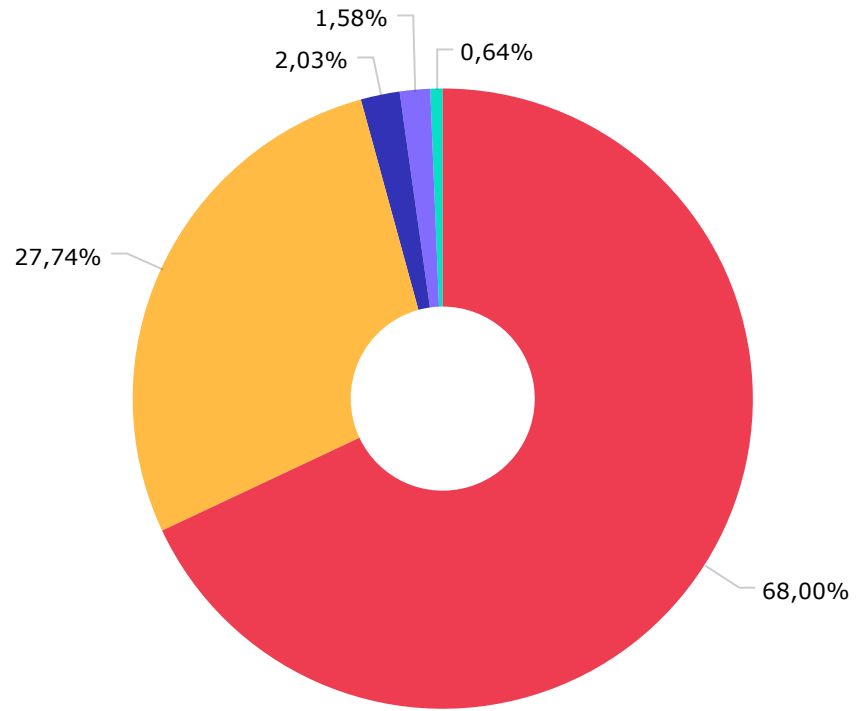
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IDIV - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-1,80	9,21	4,42	-5,43	7,21	28,20		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,87	8,29	4,08	-5,75	6,09	22,82	9,75	20,54
IDKA IPCA 2 ANOS - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	0,62	6,94	0,09	2,94	8,91	15,68		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,51	6,53	0,11	2,60	8,47	14,89	1,50	3,17
IMA-B - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	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
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
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48	0,39	-2,79	-0,49	2,43	2,04	1,46	3,07
IMA-B 5 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	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+ - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	2,39	5,10	3,01	3,14	5,19	8,56		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,36	4,82	2,92	2,95	4,83	7,86	3,63	7,65
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 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-0,29	4,09	-1,32	0,86	7,17	18,15		
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,28	8,63	3,51	5,91	10,29	11,11	1,00	2,11
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48	7,72	0,79	3,64	9,75	17,26	1,45	3,05
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,24	8,29	3,54	5,84	9,44	10,38	0,79	1,66
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48	7,34	0,58	3,32	9,40	16,40	1,45	3,06
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,45	6,72	0,33	2,85	9,19	15,17	1,29	2,71

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25	7,50	3,07	5,15	9,00	12,03	1,12	2,36
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08	7,15	0,02	3,10	8,79	15,18	0,75	1,57
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49		-0,02	2,35			1,46	3,07
IRF-M 1 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	1,11	8,59	3,43	6,17	9,81	12,55		
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1,12	8,76	3,47	6,15	10,15	12,92	0,12	0,26
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
SMLL - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-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	25,39

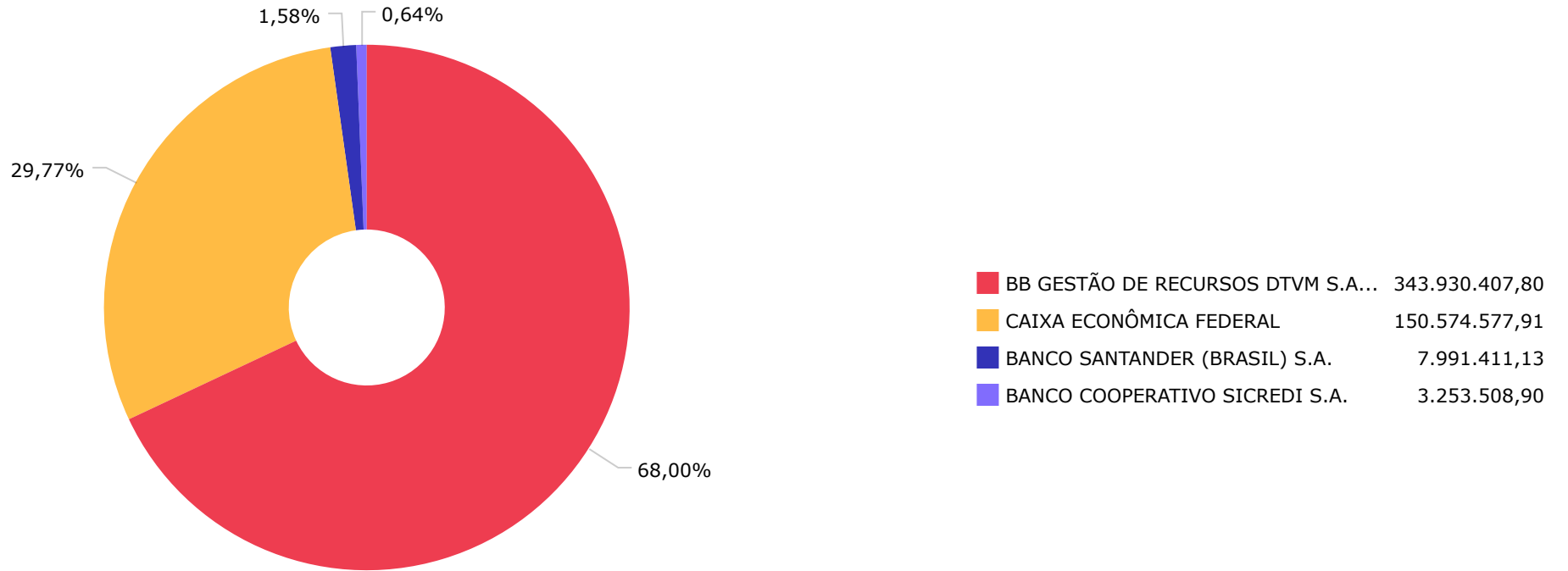




Renda Fixa Duração Livre Soberano	287.569.716,54
Renda Fixa Indexados	99.552.241,38
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	39.848.579,01
Ações Livre	26.092.098,12
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	21.211.859,56
Multimercados Livre	7.797.934,89
Multimercados Trading	7.241.606,64
Ações Valor/Crescimento	4.643.061,56
Não classificado	3.855.708,36
Ações Dividendos	2.405.148,93
Multimercados Macro	2.021.475,85
Ações Small Caps	1.410.517,04
Multimercados Balanceados	1.260.797,86
FII TVM Gestão Ativa	839.160,00



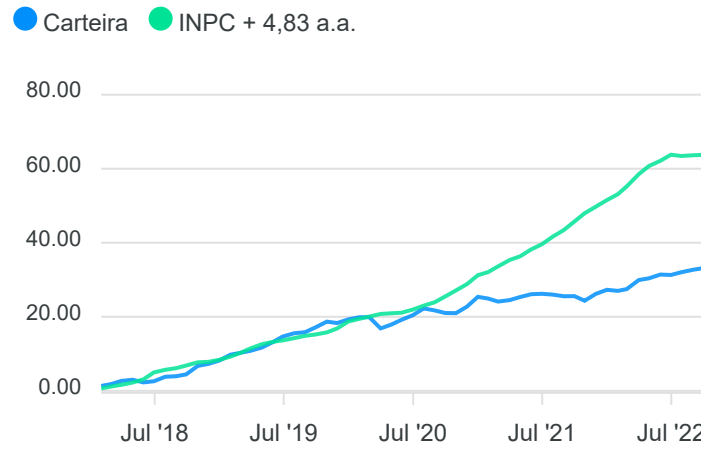
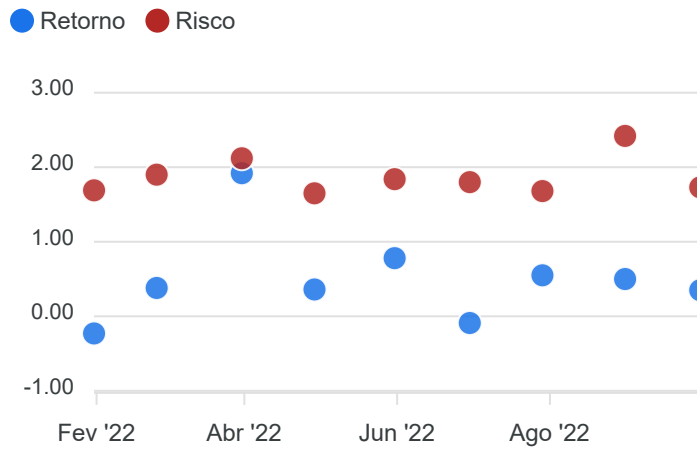
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	343.930.407,80
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	140.299.651,99
CAIXA DTVM	10.274.925,92
SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...	7.991.411,13
CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ...	3.253.508,90



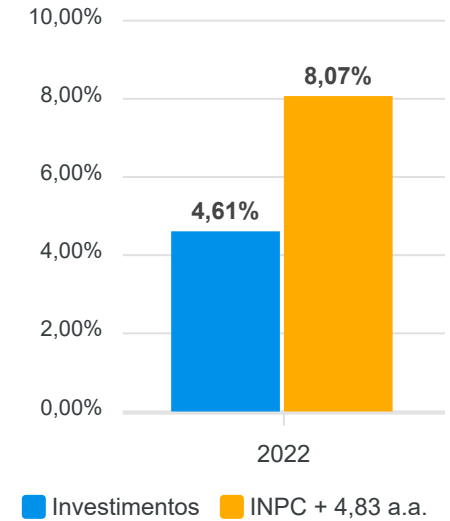
Retorno da Carteira de Investimentos - PREVIDENCIÁRIO

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	480.241.025,44	48.646.335,80	47.850.000,00	479.933.926,35	-1.103.434,89	-0,23% ▼	1,07%	1,69%
Fevereiro	479.933.926,35	31.464.329,76	31.583.045,58	481.616.714,48	1.801.503,95	0,38% ▲	1,36%	1,90%
Março	481.616.714,48	4.265.508,75	2.750.000,00	492.395.159,40	9.262.936,17	1,92% ▲	2,13%	2,12%
Abril	492.395.159,40	3.355.254,54	3.200.000,00	494.340.740,00	1.790.326,06	0,36% ▲	1,40%	1,65%
Mai	494.340.740,00	59.845.811,42	59.314.790,51	498.737.834,97	3.866.074,06	0,78% ▲	0,86%	1,84%
Junho	498.737.834,97	109.753.471,79	110.878.373,77	497.178.724,58	-434.208,41	-0,09% ▼	1,02%	1,80%
Julho	497.178.724,58	10.400.000,00	10.000.000,00	500.333.410,79	2.754.686,21	0,55% ▲	-0,21%	1,68%
Agosto	500.333.410,79	21.247.912,15	20.381.414,01	503.714.563,12	2.514.654,19	0,50% ▲	0,12%	2,42%
Setembro	503.714.563,12	3.319.000,00	3.070.000,00	505.749.905,74	1.786.342,62	0,35% ▲	0,07%	1,73%
Acumulado					22.238.879,96	4,61% ▲	8,07%	

Retorno Acumulado			
Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	9.961.005,23	2,07%	4,62%
2º Trim	5.222.191,71	1,06%	3,32%
1º Sem	15.183.196,94	3,15%	8,09%
3º Trim	7.055.683,02	1,42%	-0,02%



Retorno e Meta Acumulado



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.278.220,70	0,00	0,00	35.714.910,69	436.689,99	1,24% ▲	1,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.581.180,24	0,00	0,00	35.015.090,76	433.910,52	1,25% ▲	1,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.838.331,48	0,00	0,00	7.879.837,98	41.506,50	0,53% ▲	1,42%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	43.553.624,08	0,00	0,00	43.728.145,15	174.521,07	0,40% ▲	1,27%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.108.557,06	0,00	0,00	1.134.687,57	26.130,51	2,36% ▲	3,63%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.533.219,33	0,00	0,00	6.562.568,05	29.348,72	0,45% ▲	1,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.643.980,26	0,00	0,00	22.889.853,07	245.872,81	1,09% ▲	0,13%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	33.987.199,47	3.319.000,00	3.070.000,00	34.636.950,51	400.751,04	1,07% ▲	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.954.247,28	0,00	0,00	29.979.300,66	25.053,38	0,08% ▲	0,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	402.567,38	0,00	0,00	404.513,67	1.946,29	0,48% ▲	1,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	571.009,28	0,00	0,00	573.765,94	2.756,66	0,48% ▲	1,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	88.801.293,99	0,00	0,00	89.232.245,44	430.951,45	0,49% ▲	1,46%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.266.410,68	0,00	0,00	10.274.925,92	8.515,24	0,08% ▲	0,75%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	516.132,75	0,00	0,00	518.634,46	2.501,71	0,48% ▲	1,46%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.446.043,29	0,00	0,00	3.451.194,69	5.151,40	0,15% ▲	0,14%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	83.007.252,40	0,00	0,00	83.412.266,37	405.013,97	0,49% ▲	1,46%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	13.442.470,24	0,00	0,00	13.614.805,93	172.335,69	1,28% ▲	1,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	67.950,07	0,00	0,00	68.793,67	843,60	1,24% ▲	0,79%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.080.655,82	0,00	0,00	5.106.569,62	25.913,80	0,51% ▲	1,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.247.493,92	0,00	0,00	5.269.907,95	22.414,03	0,43% ▲	1,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.878.415,74	0,00	0,00	8.065.478,36	187.062,62	2,37% ▲	3,62%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	490.394,80	0,00	0,00	497.733,27	7.338,47	1,50% ▲	2,47%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.028.736,81	0,00	0,00	1.034.485,58	5.748,77	0,56% ▲	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	320.945,69	0,00	0,00	324.437,10	3.491,41	1,09% ▲	0,13%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.381.069,63	0,00	0,00	1.402.082,41	21.012,78	1,52% ▲	2,52%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.750.300,78	0,00	0,00	2.779.782,63	29.481,85	1,07% ▲	0,90%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.153.900,56	0,00	0,00	5.211.628,50	57.727,94	1,12% ▲	0,02%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	3.217.440,19	0,00	0,00	3.253.508,90	36.068,71	1,12% ▲	0,12%
	448.549.043,92	3.319.000,00	3.070.000,00	452.038.104,85	3.240.060,93	0,72%	1,14%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3.807.177,59	0,00	0,00	3.741.967,07	-65.210,52	-1,71% ▼	10,10%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.706.027,44	0,00	0,00	4.643.061,56	-62.965,88	-1,34% ▼	10,89%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	3.302.161,31	0,00	0,00	3.336.602,58	34.441,27	1,04% ▲	0,68%
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	7.190.902,30	0,00	0,00	7.241.606,64	50.704,34	0,71% ▲	0,46%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.046.499,96	0,00	0,00	2.071.785,26	25.285,30	1,24% ▲	0,40%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.005.202,50	0,00	0,00	2.021.475,85	16.273,35	0,81% ▲	0,65%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	5.250.323,90	0,00	0,00	5.100.153,36	-150.170,54	-2,86% ▼	9,19%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.337.484,55	0,00	0,00	2.389.547,05	52.062,50	2,23% ▲	1,41%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.450.965,37	0,00	0,00	2.405.148,93	-45.816,44	-1,87% ▼	9,75%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	817.200,00	0,00	0,00	839.160,00	21.960,00	2,69% ▲	5,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.242.452,09	0,00	0,00	1.260.797,86	18.345,77	1,48% ▲	3,15%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.438.365,84	0,00	0,00	1.410.517,04	-27.848,80	-1,94% ▼	12,05%
-	36.594.762,85	0,00	0,00	36.461.823,20	-132.939,65	-0,36%	5,35%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	8.570.676,47	0,00	0,00	8.021.885,99	-548.790,48	-6,40% ▼	9,65%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.000.079,88	0,00	0,00	9.228.091,70	-771.988,18	-7,72% ▼	9,55%
	18.570.756,35	0,00	0,00	17.249.977,69	-1.320.778,66	-7,11%	4,49%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.717.449,10	0,00	0,00	35.714.910,69	997.461,59	2,87% ▲
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.971.753,03	0,00	0,00	35.015.090,76	1.043.337,73	3,07% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.859.186,21	0,00	0,00	7.879.837,98	20.651,77	0,26% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	43.552.272,70	0,00	0,00	43.728.145,15	175.872,45	0,40% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.102.535,27	0,00	0,00	1.134.687,57	32.152,30	2,92% ▲
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.540.932,81	0,00	0,00	6.562.568,05	21.635,24	0,33% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.120.861,50	0,00	5.000.000,00	22.889.853,07	768.991,57	2,84% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	32.033.668,51	11.051.775,44	9.620.000,00	34.636.950,51	1.171.506,56	2,72% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.973.285,27	0,00	0,00	29.979.300,66	6.015,39	0,02% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.383.972,47	0,00	993.409,69	404.513,67	13.950,89	1,01% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.361.322,93	0,00	7.466.057,42	0,00	104.734,49	1,42% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.100.805,23	0,00	2.131.655,54	0,00	30.850,31	1,47% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.292.746,65	0,00	728.973,65	573.765,94	9.992,94	0,77% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	735.006,53	0,00	745.779,15	0,00	10.772,62	1,47% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	75.168.857,88	16.238.599,48	2.172.724,03	89.232.245,44	-2.487,89	0,00% ▼
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.273.353,45	0,00	0,00	10.274.925,92	1.572,47	0,02% ▲
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	533.532,60	0,00	14.862,51	518.634,46	-35,63	-0,01% ▼
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.526.905,87	0,00	98.486,57	3.451.194,69	22.775,39	0,65% ▲
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	81.187.205,28	4.676.537,23	2.479.465,45	83.412.266,37	27.989,31	0,03% ▲
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	13.153.032,09	0,00	0,00	13.614.805,93	461.773,84	3,51% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	66.441,65	0,00	0,00	68.793,67	2.352,02	3,54% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.101.105,71	0,00	0,00	5.106.569,62	5.463,91	0,11% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.243.912,28	0,00	0,00	5.269.907,95	25.995,67	0,50% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.835.964,57	0,00	0,00	8.065.478,36	229.513,79	2,93% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	489.121,59	0,00	0,00	497.733,27	8.611,68	1,76% ▲
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.024.987,50	0,00	0,00	1.034.485,58	9.498,08	0,93% ▲

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.304.984,54	0,00	2.000.000,00	324.437,10	19.452,56	0,84% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.377.348,75	0,00	0,00	1.402.082,41	24.733,66	1,80% ▲
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.706.440,76	0,00	0,00	2.779.782,63	73.341,87	2,71% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.056.236,39	3.000.000,00	0,00	5.211.628,50	155.392,11	3,07% ▲
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	3.144.275,80	0,00	0,00	3.253.508,90	109.233,10	3,47% ▲
	444.939.504,92	34.966.912,15	33.451.414,01	452.038.104,85	5.583.101,79	1,25%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3.366.741,54	0,00	0,00	3.741.967,07	375.225,53	11,15% ▲
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.312.259,38	0,00	0,00	4.643.061,56	330.802,18	7,67% ▲
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	3.245.551,94	0,00	0,00	3.336.602,58	91.050,64	2,81% ▲
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	7.058.980,56	0,00	0,00	7.241.606,64	182.626,08	2,59% ▲
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.998.862,36	0,00	0,00	2.071.785,26	72.922,90	3,65% ▲
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.954.250,63	0,00	0,00	2.021.475,85	67.225,22	3,44% ▲
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	4.626.823,38	0,00	0,00	5.100.153,36	473.329,98	10,23% ▲
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.242.323,46	0,00	0,00	2.389.547,05	147.223,59	6,57% ▲
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.310.911,18	0,00	0,00	2.405.148,93	94.237,75	4,08% ▲
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	759.360,00	0,00	0,00	839.160,00	79.800,00	10,51% ▲
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.181.301,00	0,00	0,00	1.260.797,86	79.496,86	6,73% ▲
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.237.987,50	0,00	0,00	1.410.517,04	172.529,54	13,94% ▲
	34.295.352,93	0,00	0,00	36.461.823,20	2.166.470,27	6,32%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	8.296.265,24	0,00	0,00	8.021.885,99	-274.379,25	-3,31% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.647.601,49	0,00	0,00	9.228.091,70	-419.509,79	-4,35% ▼
	17.943.866,73	0,00	0,00	17.249.977,69	-693.889,04	-3,87%

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