

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

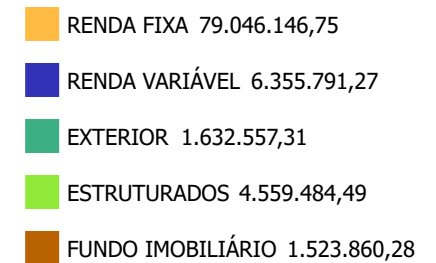
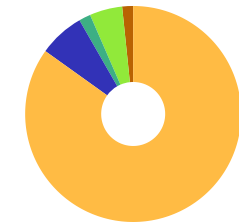
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.135.306,22	1,22%	389	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	13.707.225,48	14,72%	1.050	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	711.762,24	0,76%	1.087	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	10.043.205,58	10,79%	280	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	1.948.592,67	2,09%	247	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	10.530.035,12	11,31%	322	1,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.735.378,80	8,31%	808	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	13.759.066,05	14,78%	1.035	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.834.540,24	7,34%	1.173	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.945.573,13	6,38%	623	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	42.589,33	0,05%	868	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.131.013,56	1,21%	1.028	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.306.966,23	2,48%	163	0,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	182.170,37	0,20%	26	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	163.783,81	0,18%	31	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	Não pos...	Não há	1.158.080,99	1,24%	8	5,97%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	963.336,58	1,03%	33	0,75%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	747.520,35	0,80%	70	1,01%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	343.985,10	0,37%	702	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.588.378,95	1,71%	188	0,25%	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
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.330.043,64	2,50%	44.382	0,68%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	2.093.383,58	2,25%	31	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	825.157,79	0,89%	15.427	0,12%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	807.399,52	0,87%	518	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.190.406,69	1,28%	8.305	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	17.222,81	0,02%	12	1,16%	Artigo 10º, Inciso I
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou...	Não há	1.084.175,81	1,16%	14	0,62%	Artigo 10º, Inciso I
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.267.679,18	2,44%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	411.867,75	0,44%		0,29%	Artigo 11º
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.111.992,53	1,19%		1,48%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		1,83	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			93.117.840,10				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1,83	Artigo 6º			
PL Total			93.117.841,93				

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

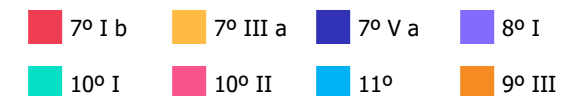
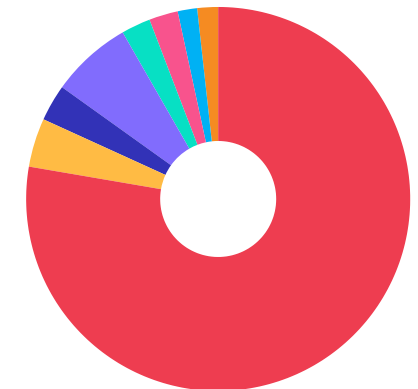
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	40,00%	37.247.136,04
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	72.350.685,53	77,70%	15,00%	40,00%	90,00%	11.455.370,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	3.826.523,30	4,11%	5,00%	20,00%	60,00%	52.044.180,76
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	2.793.535,20
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	2.868.937,92	3,08%	0,00%	3,50%	5,00%	1.786.954,09
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.655.892,01
Total Renda Fixa	100,00%	79.046.146,75	84,89%	20,00%	71,00%	203,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	6.355.791,27	6,83%	5,00%	15,00%	30,00%	21.579.560,76
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.291.805,31	2,46%	1,00%	4,00%	10,00%	7.019.978,70
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	2.267.679,18	2,44%	0,00%	3,00%	5,00%	2.388.212,83
Artigo 11º	5,00%	1.523.860,28	1,64%	0,00%	1,50%	5,00%	3.132.031,73
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	12.439.136,04	13,36%	6,00%	23,50%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.655.892,01
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.632.557,31	1,75%	1,00%	5,50%	10,00%	7.679.226,70
Total Exterior	10,00%	1.632.557,31	1,75%	1,00%	5,50%	15,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	60.382.576,75	64,85	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.897.039,72	19,22	-
TRÍGONO CAPITAL	4.423.427,22	4,75	0,10
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.998.153,26	4,29	1,10
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.306.966,23	2,48	0,00
KPTL	2.267.679,18	2,44	1,02
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.084.175,81	1,16	-
ZION INVEST	411.867,75	0,44	-
RJI CORRETORA DE VALORES	182.170,37	0,20	0,03
PLURAL	163.783,81	0,18	0,00

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	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	72.350.685,53	77,70	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	3.826.523,30	4,11	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	2.868.937,92	3,08	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	6.355.791,27	6,83	5,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	1.632.557,31	1,75	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.291.805,31	2,46	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	2.267.679,18	2,44	0,00	5,00
Artigo 11º	1.523.860,28	1,64	0,00	5,00
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
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,35%	10,27%	0,65%	4,85%	15,74%	37,77%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	-0,10%	3,14%	-0,86%	-0,53%	19,73%	-48,01%	-	0,10%
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 + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,27%	9,51%	0,41%	4,36%	14,67%	35,23%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,26%	-10,81%	-8,46%	-6,67%	-13,63%	-16,99%	-	0,07%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,26%	2,95%	0,25%	1,46%	3,77%	3,21%	0,19%	0,01%
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%	0,02%
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 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	0,44%	-2,97%	-0,67%	2,48%	2,12%	1,46%	0,06%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,03%	2,35%	-0,22%	0,85%	1,82%	-21,19%	0,36%	0,02%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-13,35%	-20,09%	-16,20%	-14,68%	-20,39%	-73,56%	22,60%	0,14%

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
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,24%	6,69%	2,87%	4,60%	7,75%	9,64%	1,12%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,99%	8,08%	3,06%	5,77%	9,78%	11,85%	0,00%	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%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09%	9,03%	3,33%	6,29%	11,10%	14,29%	0,02%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,93%	7,61%	2,89%	5,46%	9,21%	11,44%	0,00%	0,01%
IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,29%	7,17%	2,97%	4,71%	8,80%	10,21%	1,39%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,24%	8,29%	3,54%	5,84%	9,44%	10,38%	0,79%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
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
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,41%	9,11%	4,90%	4,84%	10,04%	15,37%	1,55%	0,03%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,34%	-4,17%	-1,03%	-2,26%	-5,41%	-9,86%	0,00%	0,01%
Global BDRX (Benchmark)	-8,38%	-30,78%	-4,37%	-14,20%	-22,27%	-5,91%	-	-
Ibovespa (Benchmark)	0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-1,71%	5,56%	11,15%	-6,34%	-0,17%	14,77%	10,10%	0,21%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,22%	3,35%	7,24%	-4,09%	2,20%	30,94%	8,81%	0,18%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,26%	2,68%	11,46%	2,83%	-3,53%	79,45%	8,68%	0,26%
IDIV (Benchmark)	-1,80%	9,21%	4,42%	-5,43%	7,21%	28,20%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	-2,98%	7,52%	11,58%	6,85%	4,73%	106,62%	8,35%	0,26%
IFIX (Benchmark)	0,49%	6,63%	6,98%	7,58%	10,13%	7,01%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-2,21%	44,04%	-4,09%	2,84%	24,69%	411,54%	9,65%	0,98%
HAZ FII - ATCR11	0,09%	3,16%	0,28%	3,11%	3,06%	3,91%	-	-
IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,16%	-0,60%	-1,24%	0,30%	-1,75%	-3,26%	0,47%	0,03%

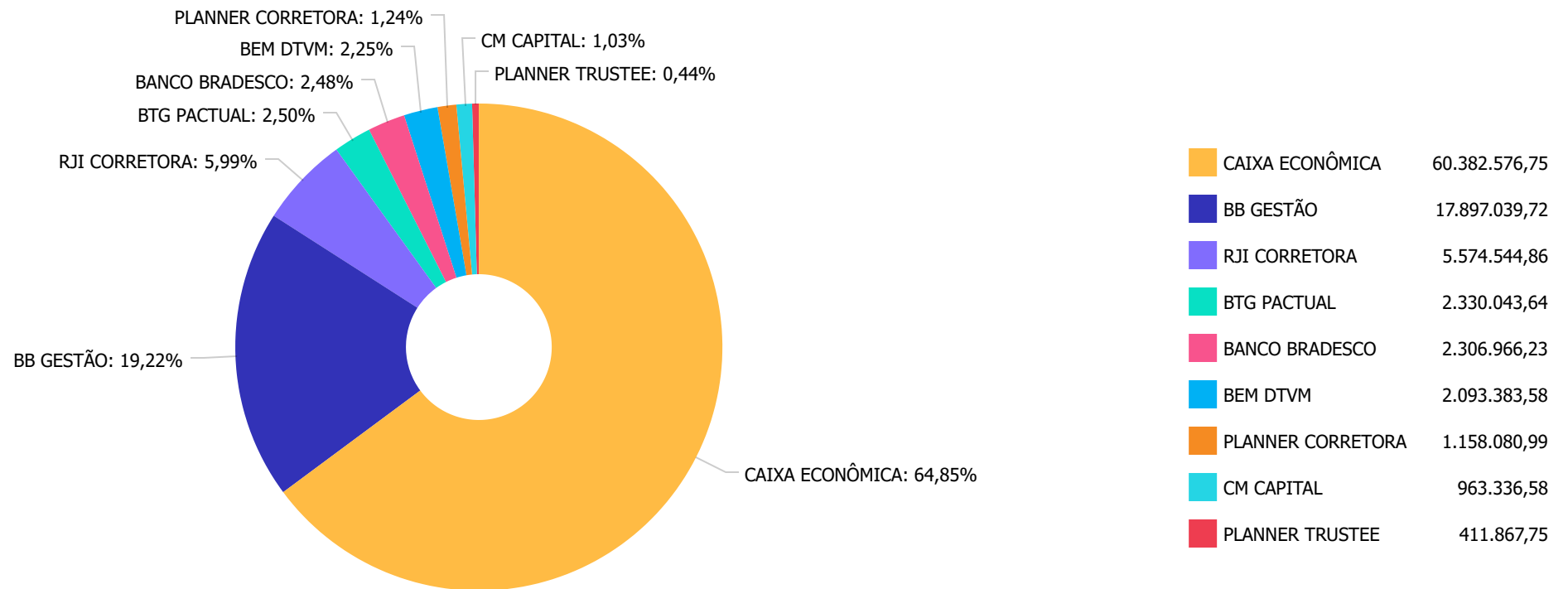
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,54%	12,18%	1,25%	6,07%	18,42%	44,21%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-5,60%	-28,67%	-2,27%	-10,43%	-19,81%	-0,31%	-	-

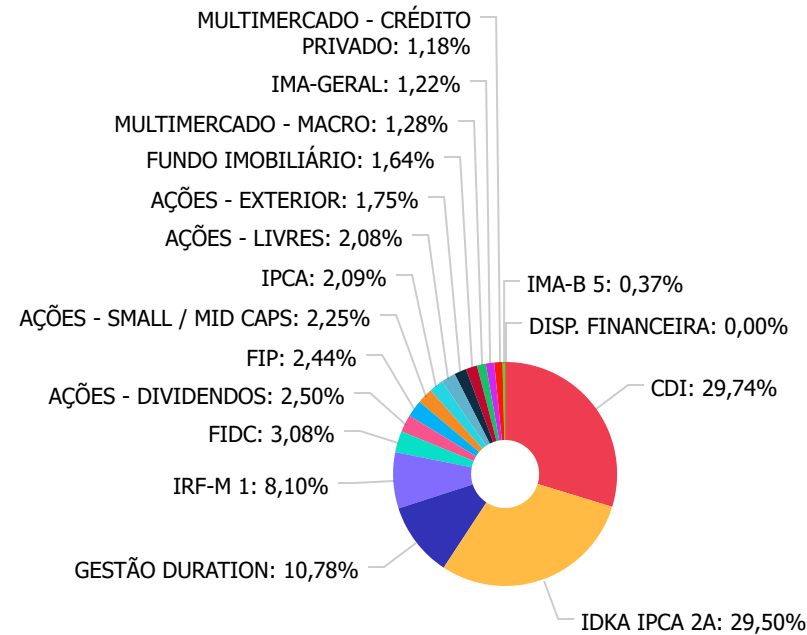
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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	-5,39%	-29,77%	-3,31%	-14,12%	-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	-6,44%	-30,97%	-4,35%	-15,65%	-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)

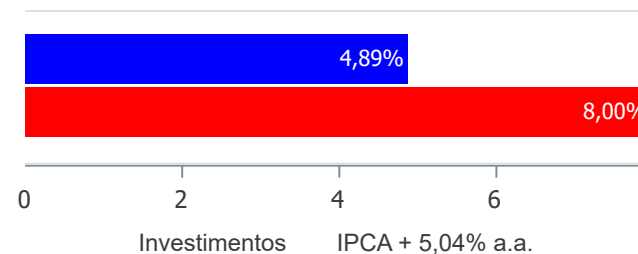


CDI	27.692.416,72	IDKA IPCA 2A	27.466.291,53	GESTÃO DURATION	10.042.345,03
IRF-M 1	7.546.302,48	FIDC	2.868.937,92	AÇÕES - DIVIDENDOS	2.330.043,64
FIP	2.267.679,18	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	2.093.383,58	IPCA	1.948.592,67
AÇÕES - LIVRES	1.932.364,05	AÇÕES - EXTERIOR	1.632.557,31	FUNDO IMOBILIÁRIO	1.523.860,28
MULTIMERCADO - MACRO	1.190.406,69	IMA-GERAL	1.135.306,22	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	1.101.398,62
IMA-B 5	345.954,18	DISP. FINANCEIRA	1,83		

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	78.803.158,54	1.213.533,89	374.850,79	79.485.397,05	-156.444,59	-156.444,59	-0,20%	-0,20%	0,95%	0,95%	-20,62%	1,94%
Fevereiro	79.485.397,05	2.116.356,33	724.498,45	81.281.473,66	404.218,73	247.774,14	0,50%	0,30%	1,39%	2,35%	12,86%	1,63%
Março	81.281.473,66	2.235.244,02	1.208.731,84	83.733.035,48	1.425.049,64	1.672.823,78	1,73%	2,04%	2,06%	4,46%	45,75%	2,00%
Abril	83.733.035,48	1.457.068,15	409.851,53	85.370.390,68	590.138,58	2.262.962,36	0,70%	2,75%	1,44%	5,96%	46,16%	1,69%
Maio	85.370.390,68	13.525.169,85	12.378.064,20	87.546.362,14	1.028.865,81	3.291.828,17	1,19%	3,97%	0,90%	6,91%	57,45%	2,47%
Junho	87.546.362,14	1.587.904,06	425.807,23	88.175.414,22	-533.044,75	2.758.783,42	-0,60%	3,35%	1,08%	8,07%	41,47%	1,91%
Julho	88.175.414,22	1.695.090,46	386.800,75	90.111.348,61	627.644,68	3.386.428,10	0,70%	4,07%	-0,27%	7,78%	52,36%	1,75%
Agosto	90.111.348,61	1.738.438,62	685.399,81	91.845.060,37	680.672,95	4.067.101,05	0,75%	4,85%	0,09%	7,87%	61,60%	1,77%
Setembro	91.845.060,37	9.672.621,91	8.439.891,79	93.117.840,10	40.049,61	4.107.150,66	0,04%	4,89%	0,12%	8,00%	61,17%	1,63%

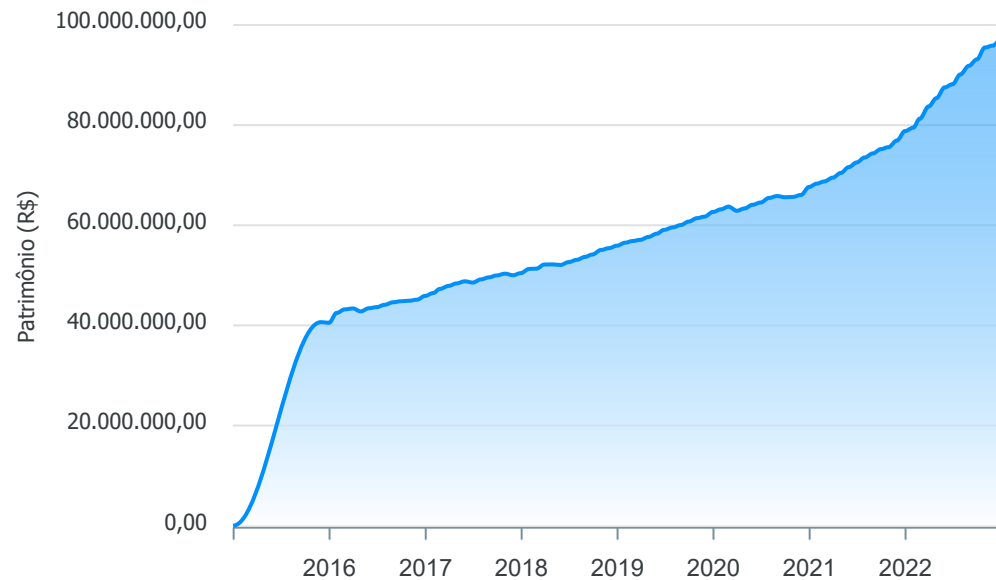
Investimentos x Meta de Rentabilidade



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
- 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
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.277.617,78	0,00	0,00	2.306.966,23	29.348,45	1,29%	1,29%	1,39%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.640.521,60	0,00	0,00	7.735.378,80	94.857,20	1,24%	1,24%	0,79%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.121.424,71	0,00	0,00	1.135.306,22	13.881,51	1,24%	1,24%	1,12%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.881.293,11	0,00	0,00	5.945.573,13	64.280,02	1,09%	1,09%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.118.789,12	0,00	0,00	1.131.013,56	12.224,44	1,09%	1,09%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.760.990,66	0,00	0,00	6.834.540,24	73.549,58	1,09%	1,09%	0,13%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	704.116,80	0,00	0,00	711.762,24	7.645,44	1,09%	1,09%	0,13%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	37.157,96	5.023,92	0,00	42.589,33	407,45	0,97%	0,99%	0,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.635.023,62	0,00	0,00	13.707.225,48	72.201,86	0,53%	0,53%	1,42%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	13.689.244,30	0,00	0,00	13.759.066,05	69.821,75	0,51%	0,51%	1,50%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.939.131,15	0,00	0,00	1.948.592,67	9.461,52	0,49%	0,49%	1,46%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	189.012,45	0,00	25.973,49	163.783,81	744,85	0,39%	-13,35%	22,60%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	9.202.979,19	9.667.597,99	8.413.918,30	10.530.035,12	73.376,24	0,39%	0,93%	0,00%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	745.563,55	0,00	0,00	747.520,35	1.956,80	0,26%	0,26%	0,19%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.034.882,38	0,00	0,00	10.043.205,58	8.323,20	0,08%	0,08%	0,75%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	182.228,95	0,00	0,00	182.170,37	-58,58	-0,03%	-0,03%	0,36%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	1.159.259,45	0,00	0,00	1.158.080,99	-1.178,46	-0,10%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	965.835,23	0,00	0,00	963.336,58	-2.498,65	-0,26%	-	-
Total Renda Fixa	77.285.072,01	9.672.621,91	8.439.891,79	79.046.146,75	528.344,62	0,67%		0,86%

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
HAZ FII - ATCR11	1.110.967,88	0,00	0,00	1.111.992,53	1.024,65	0,09%	0,24%	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	349.979,66	0,00	0,00	343.985,10	-5.994,56	-1,71%	-1,71%	10,10%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	421.158,00	0,00	0,00	411.867,75	-9.290,25	-2,21%	-2,21%	9,65%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	2.401.576,83	0,00	0,00	2.330.043,64	-71.533,19	-2,98%	-2,98%	8,35%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.641.143,64	0,00	0,00	1.588.378,95	-52.764,69	-3,22%	-3,22%	8,81%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	2.163.906,30	0,00	0,00	2.093.383,58	-70.522,72	-3,26%	-3,26%	8,68%
Total Renda Variável	8.088.732,31	0,00	0,00	7.879.651,55	-209.080,76	-2,58%		8,73%

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
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.173.803,44	0,00	0,00	1.190.406,69	16.603,25	1,41%	1,41%	1,55%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.085.868,94	0,00	0,00	1.084.175,81	-1.693,13	-0,16%	-0,16%	0,47%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	17.281,83	0,00	0,00	17.222,81	-59,02	-0,34%	-0,34%	0,00%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	881.608,20	0,00	0,00	825.157,79	-56.450,41	-6,40%	-6,40%	9,65%
W7 FIP MULTIELAB	2.437.750,04	0,00	0,00	2.267.679,18	-170.070,86	-6,98%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	874.943,60	0,00	0,00	807.399,52	-67.544,08	-7,72%	-7,72%	9,55%
Total Exterior	6.471.256,05	0,00	0,00	6.192.041,80	-279.214,25	-4,31%		4,59%

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.470.910,00	0,00	0,00	7.735.378,80	264.468,80	3,54%	3,54%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	6.643.631,52	13.091.079,23	9.430.476,41	10.530.035,12	225.800,78	1,14%	2,89%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.611.902,14	0,00	0,00	6.834.540,24	222.638,10	3,37%	3,37%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.754.221,26	0,00	0,00	5.945.573,13	191.351,87	3,33%	3,33%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.240.401,83	0,00	0,00	2.306.966,23	66.564,40	2,97%	2,97%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.094.365,29	0,00	0,00	1.131.013,56	36.648,27	3,35%	3,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.671.301,07	0,00	0,00	13.707.225,48	35.924,41	0,26%	0,26%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.103.598,89	0,00	0,00	1.135.306,22	31.707,33	2,87%	2,87%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	688.562,50	0,00	0,00	711.762,24	23.199,74	3,37%	3,37%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	13.744.344,18	0,00	0,00	13.759.066,05	14.721,87	0,11%	0,11%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	745.645,11	0,00	0,00	747.520,35	1.875,24	0,25%	0,25%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.041.668,57	0,00	0,00	10.043.205,58	1.537,01	0,02%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	26.436,62	15.071,76	0,00	42.589,33	1.080,95	2,60%	3,06%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	195.453,56	0,00	32.215,79	163.783,81	546,04	0,28%	-16,20%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	182.577,53	0,00	0,00	182.170,37	-407,16	-0,22%	-0,22%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	1.168.064,50	0,00	0,00	1.158.080,99	-9.983,51	-0,85%	-0,85%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.052.321,18	0,00	48.448,85	963.336,58	-40.535,75	-3,85%	-8,46%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.008.240,95	0,00	0,00	1.948.592,67	-59.648,28	-2,97%	-2,97%
Total Renda Fixa	74.443.646,70	13.106.150,99	9.511.141,05	79.046.146,75	1.007.490,11	1,29%	

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
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	1.878.232,31	0,00	0,00	2.093.383,58	215.151,27	11,45%	11,45%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	2.134.630,69	0,00	0,00	2.330.043,64	195.412,95	9,15%	11,58%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.481.177,38	0,00	0,00	1.588.378,95	107.201,57	7,24%	7,24%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.134.799,98	0,00	0,00	1.190.406,69	55.606,71	4,90%	4,90%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	309.492,01	0,00	0,00	343.985,10	34.493,09	11,15%	11,15%
HAZ FII - ATCR11	1.108.901,92	0,00	951,30	1.111.992,53	4.041,91	0,36%	0,28%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	17.401,88	0,00	0,00	17.222,81	-179,07	-1,03%	-1,03%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.097.828,72	0,00	0,00	1.084.175,81	-13.652,91	-1,24%	-1,24%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	429.416,00	0,00	0,00	411.867,75	-17.548,25	-4,09%	-4,09%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.442.401,31	0,00	0,00	2.267.679,18	-174.722,13	-7,15%	-
Total Renda Variável	12.034.282,20	0,00	951,30	12.439.136,04	405.805,14	3,37%	

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
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	853.381,35	0,00	0,00	825.157,79	-28.223,56	-3,31%	-3,31%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	844.103,97	0,00	0,00	807.399,52	-36.704,45	-4,35%	-4,35%
Total Exterior	1.697.485,32	0,00	0,00	1.632.557,31	-64.928,01	-3,82%	

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.

