

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

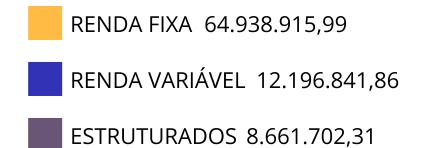
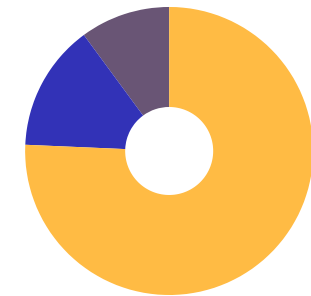
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			5.006.741,28	5,84%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	15.225.957,64	17,75%	520	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	9.557.817,82	11,14%	1.050	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	6.808.133,45	7,94%	796	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	181.107,60	0,21%	575	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.564.947,33	5,32%	1.087	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	13.657.936,54	15,92%	808	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.325.149,65	2,71%	773	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	233.601,08	0,27%	1.173	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	624.723,32	0,73%	868	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	916.928,93	1,07%	1.028	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.825.037,46	6,79%	289	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	10.833,89	0,01%	16.724	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.892.320,24	4,54%	1.898	0,37%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.648.987,14	3,09%	25.273	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	823.063,03	0,96%	12.871	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.877.420,98	3,35%	1.419	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.173.789,89	1,37%	18	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	781.260,58	0,91%	31	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.636.735,40	1,91%	183	0,54%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	782.861,16	0,91%	126	0,10%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.242.105,75	7,28%	8.044	0,74%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		296.176,52	0,35%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			85.797.460,16				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			296.176,52	Artigo 6º			
PL Total			86.093.636,68				

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

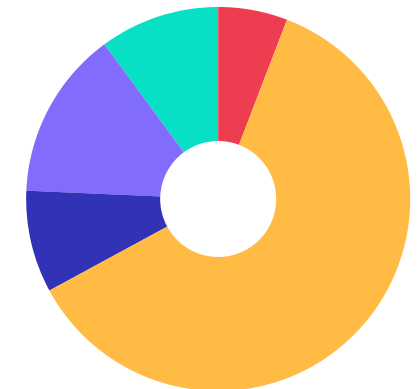
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	5.006.741,28	5,84%	0,00%	19,25%	59,24%	45.819.674,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	52.554.651,11	61,25%	14,81%	31,25%	65,00%	3.213.697,99
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	7.377.523,60	8,60%	13,13%	17,50%	50,00%	35.521.206,48
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,50%	20,00%	17.159.492,03
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,78%	5,00%	4.289.873,01
Total Renda Fixa	100,00%	64.938.915,99	75,69%	27,94%	76,28%	199,24%	



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%	12.196.841,86	14,22%	11,21%	12,70%	20,00%	4.962.650,17
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,24%	20,00%	17.159.492,03
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	8.661.702,31	10,10%	2,09%	3,78%	10,00%	-81.956,29
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	20.858.544,17	24,31%	13,30%	18,72%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	8.579.746,02
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	



■ 7º I a
 ■ 7º I b
 ■ 7º III a
 ■ 8º I
 ■ 10º I

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	46.880.721,90	54,64	-
CAIXA DTVM	31.954.946,51	37,24	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	5.006.741,28	5,84	-
TRÍGONO CAPITAL	1.955.050,47	2,28	0,04

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'	5.006.741,28	5,84	0,00	59,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	52.554.651,11	61,25	14,81	59,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	7.366.689,71	8,59	13,13	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	12.196.841,86	14,22	11,21	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso I	8.661.702,31	10,10	2,09	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%
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%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,40%	6,90%	0,40%	3,05%	8,97%	15,18%	1,27%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	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%	0,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45%	5,92%	1,63%	3,07%	6,95%	11,76%	2,43%	0,06%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,12%	9,26%	3,38%	6,42%	11,30%	14,99%	0,02%	0,01%
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%
IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-

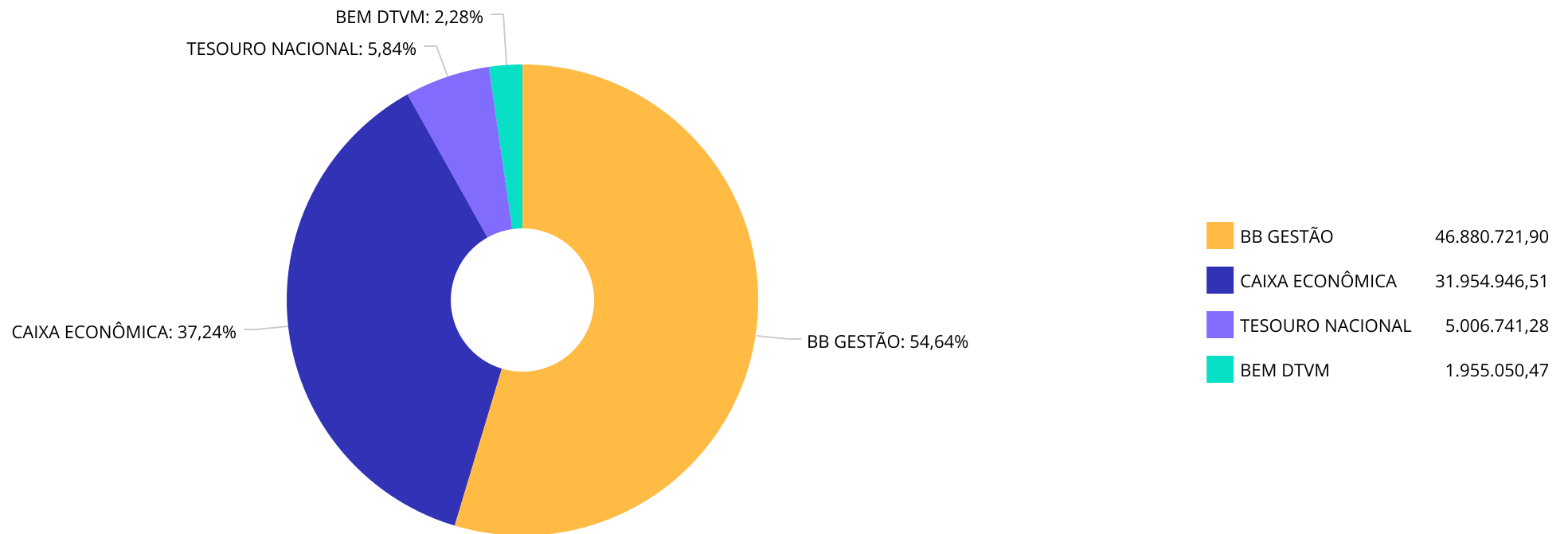
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,24%	8,29%	3,54%	5,84%	9,44%	10,38%	0,79%	0,02%
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%

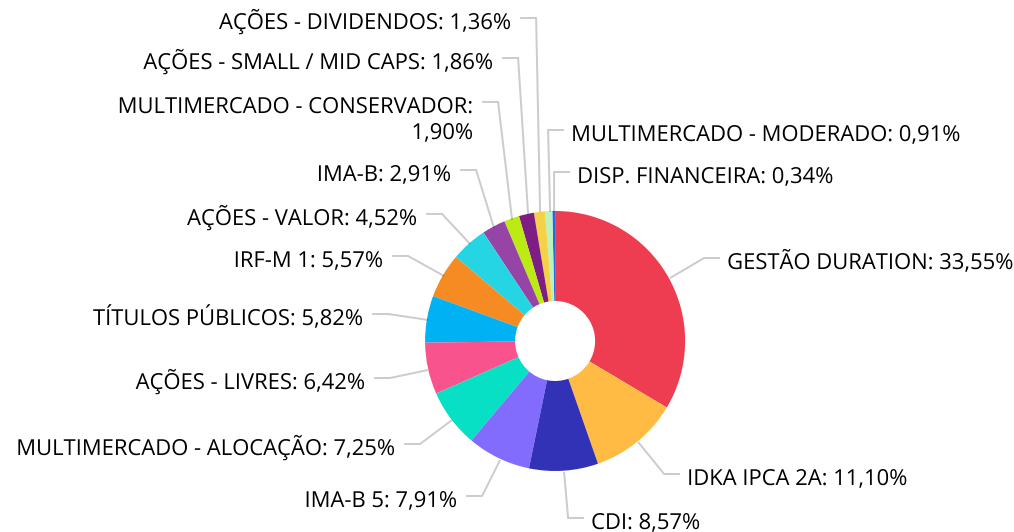
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	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 RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,48%	10,32%	6,73%	3,66%	10,21%	16,28%	3,15%	0,07%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,23%	11,46%	6,57%	6,55%	12,47%	18,77%	1,41%	0,05%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,24%	8,76%	3,65%	5,75%	10,85%	14,76%	0,40%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,69%	2,56%	11,57%	-6,47%	-8,05%	3,01%	10,03%	0,22%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-0,36%	1,67%	9,61%	-8,81%	-1,48%	22,12%	11,01%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,34%	-1,51%	7,67%	-9,41%	-4,02%	24,18%	10,89%	0,20%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,16%	8,47%	12,02%	7,96%	5,50%	-	8,47%	0,27%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,26%	2,68%	11,46%	2,83%	-3,53%	79,45%	8,68%	0,26%
SMLL (Benchmark)	-1,84%	-8,06%	14,47%	-13,82%	-18,43%	-5,58%	-	-
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-1,70%	-7,67%	14,32%	-14,39%	-18,76%	-9,54%	12,45%	0,29%

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



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



■ GESTÃO DURATION	28.883.894,18	■ IDKA IPCA 2A	9.557.817,82	■ CDI	7.377.523,60
■ IMA-B 5	6.808.133,45	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	6.242.105,75	■ AÇÕES - LIVRES	5.526.408,12
■ TÍTULOS PÚBLICOS	5.006.741,28	■ IRF-M 1	4.798.548,41	■ AÇÕES - VALOR	3.892.320,24
■ IMA-B	2.506.257,25	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.636.735,40	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.604.323,61
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.173.789,89	■ MULTIMERCADO - MODERADO	782.861,16	■ DISP. FINANCEIRA	296.176,52

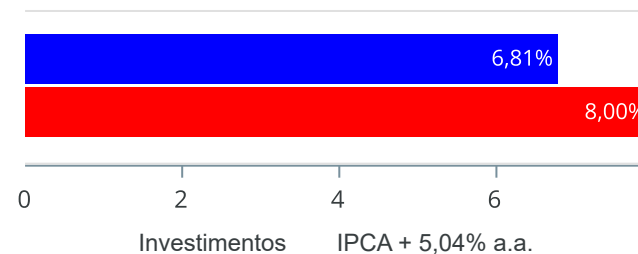
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2022)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	26/08/2022	1.236	4.045,0527380	4.050,760293	4.999.685,18	5.006.739,72	Curva

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	80.760.303,14	411,28	657.334,18	80.896.831,74	793.451,50	793.451,50	0,98%	0,98%	0,95%	0,95%	103,11%	2,33%
Fevereiro	80.896.831,74	284.430,78	741.059,47	80.873.870,70	433.667,65	1.227.119,15	0,54%	1,52%	1,39%	2,35%	64,81%	1,74%
Março	80.873.870,70	315.257,53	711.218,80	82.387.709,45	1.909.800,02	3.136.919,17	2,36%	3,92%	2,06%	4,46%	87,99%	2,67%
Abril	82.387.709,45	1.780.676,40	725.783,29	83.090.611,12	-351.991,44	2.784.927,73	-0,42%	3,48%	1,44%	5,96%	58,48%	2,02%
Maio	83.090.611,12	314.430,91	602.464,13	83.932.327,60	1.129.749,70	3.914.677,43	1,36%	4,89%	0,90%	6,91%	70,75%	2,41%
Junho	83.932.327,60	266.086,26	615.205,26	82.103.646,48	-1.479.562,12	2.435.115,31	-1,76%	3,04%	1,08%	8,07%	37,68%	2,34%
Julho	82.103.646,48	1.201.974,78	738.256,03	83.445.191,01	877.825,78	3.312.941,09	1,06%	4,14%	-0,27%	7,78%	53,19%	2,02%
Agosto	83.445.191,01	6.240.513,35	6.123.459,12	85.109.121,16	1.546.875,92	4.859.817,01	1,85%	6,06%	0,09%	7,87%	77,04%	2,36%
Setembro	85.109.121,16	860.749,57	771.028,25	85.797.460,16	598.617,68	5.458.434,69	0,70%	6,81%	0,12%	8,00%	85,12%	2,55%

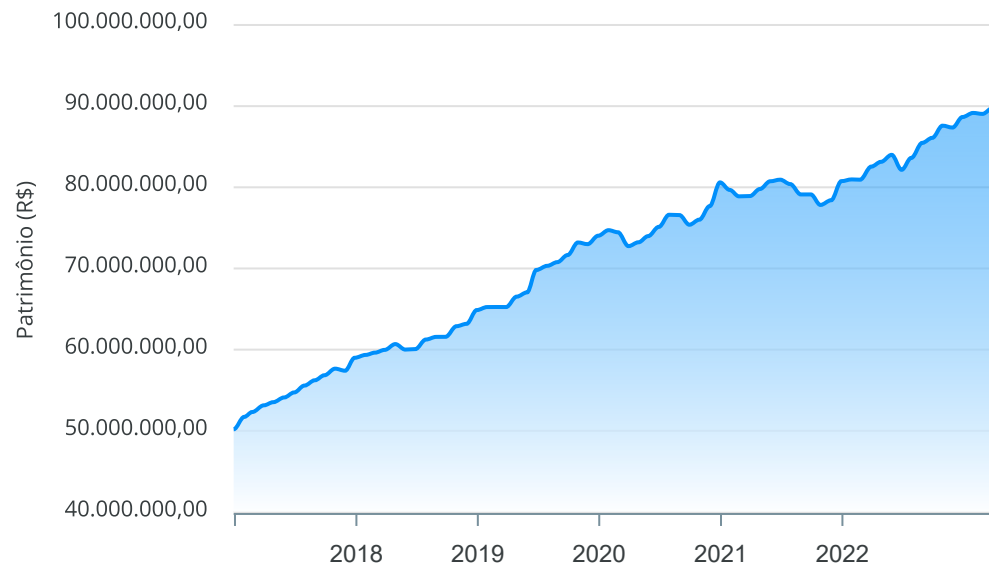
Investimentos x Meta de Rentabilidade



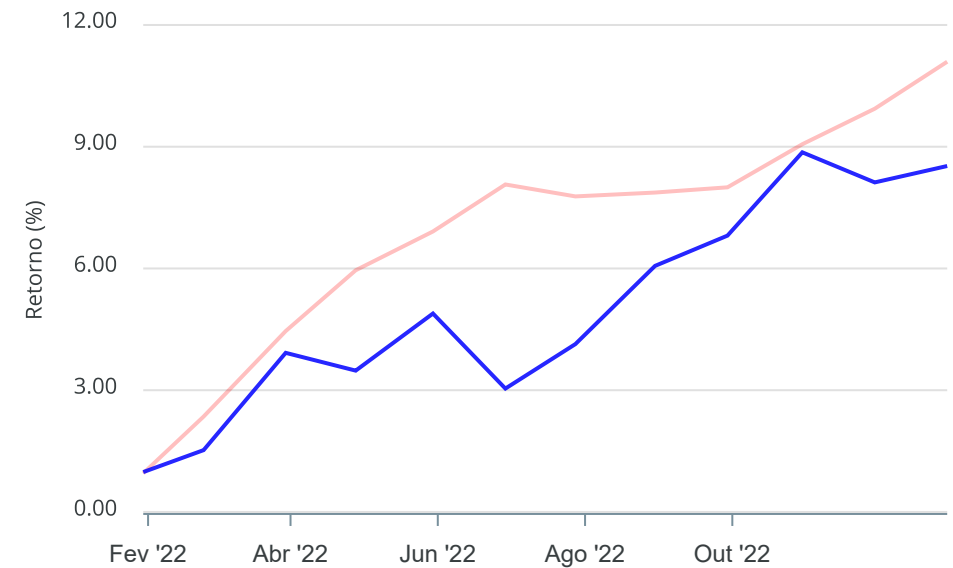
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.290.868,12	0,00	0,00	2.325.149,65	34.281,53	1,50%	1,50%	2,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	178.518,29	0,00	0,00	181.107,60	2.589,31	1,45%	1,45%	2,43%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	15.037.276,06	0,00	0,00	15.225.957,64	188.681,58	1,25%	1,25%	1,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	14.228.185,27	0,00	745.099,72	13.657.936,54	174.850,99	1,23%	1,24%	0,79%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	231.087,19	0,00	0,00	233.601,08	2.513,89	1,09%	1,09%	0,13%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.515.912,66	0,00	0,00	4.564.947,33	49.034,67	1,09%	1,09%	0,13%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	5.010.718,48	753.064,14	0,00	5.825.037,46	61.254,84	1,06%	1,11%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	840.055,28	67.342,85	0,00	916.928,93	9.530,80	1,05%	1,09%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	602.894,78	40.342,58	24.606,38	624.723,32	6.092,34	0,95%	0,99%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	12.056,89	0,00	1.322,15	10.833,89	99,15	0,82%	0,86%	0,00%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.762.545,30	0,00	0,00	6.808.133,45	45.588,15	0,67%	0,40%	1,27%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	9.507.472,68	0,00	0,00	9.557.817,82	50.345,14	0,53%	0,53%	1,42%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.999.685,18	0,00	0,00	5.006.741,28	7.056,10	0,14%	-	-
Total Renda Fixa	64.217.276,18	860.749,57	771.028,25	64.938.915,99	631.918,49	0,98%		0,95%

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	765.804,49	0,00	0,00	782.861,16	17.056,67	2,23%	2,23%	1,41%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	6.151.277,35	0,00	0,00	6.242.105,75	90.828,40	1,48%	1,48%	3,15%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.616.759,71	0,00	0,00	1.636.735,40	19.975,69	1,24%	1,24%	0,40%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.658.431,57	0,00	0,00	2.648.987,14	-9.444,43	-0,36%	-0,36%	11,01%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.897.512,40	0,00	0,00	2.877.420,98	-20.091,42	-0,69%	-0,69%	10,03%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.945.105,10	0,00	0,00	3.892.320,24	-52.784,86	-1,34%	-1,34%	10,89%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	837.292,35	0,00	0,00	823.063,03	-14.229,32	-1,70%	-1,70%	12,45%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.212.082,02	0,00	0,00	1.173.789,89	-38.292,13	-3,16%	-3,16%	8,47%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	807.579,99	0,00	0,00	781.260,58	-26.319,41	-3,26%	-3,26%	8,68%
Total Renda Variável	20.891.844,98	0,00	0,00	20.858.544,17	-33.300,81	-0,16%		7,14%

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
Total Exterior	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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	14.495.038,91	484.126,18	1.827.045,86	13.657.936,54	505.817,31	3,38%	3,54%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	14.736.962,27	35.292,91	0,00	15.225.957,64	453.702,46	3,07%	3,07%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.514.767,61	2.153.729,17	0,00	5.825.037,46	156.540,68	2,76%	3,38%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.416.153,81	0,00	0,00	4.564.947,33	148.793,52	3,37%	3,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.284.920,40	0,00	0,00	2.325.149,65	40.229,25	1,76%	1,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.780.751,48	0,00	0,00	6.808.133,45	27.381,97	0,40%	0,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	425.988,56	469.890,11	0,00	916.928,93	21.050,26	2,35%	3,35%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	506.203,20	160.514,15	59.611,38	624.723,32	17.617,35	2,64%	3,06%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	14.543.329,95	0,00	5.000.000,00	9.557.817,82	14.487,87	0,10%	0,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	225.991,42	0,00	0,00	233.601,08	7.609,66	3,37%	3,37%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	4.999.685,18	0,00	5.006.741,28	7.056,10	0,14%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	333.104,67	0,00	338.332,92	0,00	5.228,25	1,57%	3,09%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	178.195,78	0,00	0,00	181.107,60	2.911,82	1,63%	1,63%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	18.187,96	0,00	7.755,43	10.833,89	401,36	2,21%	2,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	402.271,79	0,00	399.997,81	0,00	-2.273,98	-0,57%	0,50%
Total Renda Fixa	62.861.867,81	8.303.237,70	7.632.743,40	64.938.915,99	1.406.553,88	2,21%	

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 RV 30 FI MULTIMERCADO LP	5.848.523,35	0,00	0,00	6.242.105,75	393.582,40	6,73%	6,73%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.579.046,74	0,00	0,00	2.877.420,98	298.374,24	11,57%	11,57%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.615.005,80	0,00	0,00	3.892.320,24	277.314,44	7,67%	7,67%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.416.661,09	0,00	0,00	2.648.987,14	232.326,05	9,61%	9,61%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.047.831,82	0,00	0,00	1.173.789,89	125.958,07	12,02%	12,02%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	719.991,41	0,00	0,00	823.063,03	103.071,62	14,32%	14,32%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	700.965,12	0,00	0,00	781.260,58	80.295,46	11,45%	11,45%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.579.125,44	0,00	0,00	1.636.735,40	57.609,96	3,65%	3,65%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	734.627,90	0,00	0,00	782.861,16	48.233,26	6,57%	6,57%
Total Renda Variável	19.241.778,67	0,00	0,00	20.858.544,17	1.616.765,50	8,40%	

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 CRÉDITO & MERCADO. As informações aqui contidas, tem por somente, 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 o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

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 (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º 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 MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, 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.

