

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	3.032.021,08	5,10%	520	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	3.351.395,66	5,64%	1.050	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.394.225,91	7,39%	796	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.241.616,13	2,09%	575	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.975.047,97	3,32%	1.087	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	3.765.943,82	6,34%	336	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	1.460.213,02	2,46%	269	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	463 dias	4.631.674,76	7,79%	280	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.465.197,29	9,19%	808	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.847.285,12	6,47%	1.035	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.637.864,36	2,76%	3.243	0,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.470.522,49	4,16%	868	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	304.272,82	0,51%	1.028	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	953.328,14	1,60%	241	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.411.009,68	2,37%	28	1,98%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	385.628,33	0,65%	26	0,72%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	346.706,63	0,58%	31	0,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.359.041,58	2,29%	33	1,05%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	Não se ...	Não se aplica	57.148,26	0,10%	20	0,75%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	102.655,03	0,17%	70	0,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	8.003,95	0,01%	98	0,03%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.689.557,67	2,84%	25.273	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.447.672,92	2,44%	188	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	191.061,53	0,32%	90	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.149.745,96	3,62%	3.960	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	D+4	Não há	527.393,78	0,89%	7	1,36%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	D+3	Não há	544.094,59	0,92%	394	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	407.310,59	0,69%	15.302	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.401.938,46	4,04%	184	0,92%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.046.485,55	1,76%	18	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	704.343,55	1,18%	31	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	408.479,16	0,69%	59	0,07%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	415.729,37	0,70%	29.600	0,10%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	773.541,74	1,30%	157	0,06%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	408.629,46	0,69%	518	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.171.028,49	1,97%	53.451	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.386.112,65	2,33%	8.305	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	656.265,57	1,10%	10.270	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	475.346,60	0,80%	887	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	437.073,86	0,74%		0,23%	Desenquadrado - RV

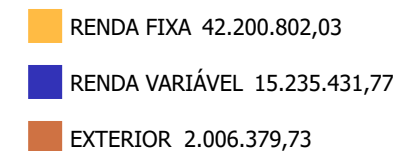
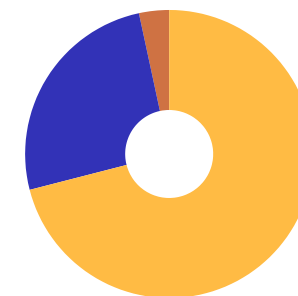


Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			59.442.613,53				

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

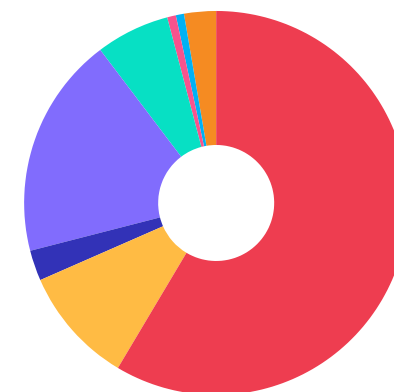
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	40,00%	23.777.045,41
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	34.802.485,12	58,55%	15,00%	36,00%	80,00%	12.751.605,70
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	5.871.468,09	9,88%	5,00%	20,00%	60,00%	29.794.100,03
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	11.888.522,71
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	1.526.848,82	2,57%	0,00%	3,00%	5,00%	1.445.281,86
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.972.130,68
Total Renda Fixa	100,00%	42.200.802,03	70,99%	20,00%	67,00%	210,00%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	11.109.604,60	18,69%	13,00%	20,00%	30,00%	6.723.179,46
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	3.688.753,31	6,21%	4,00%	7,00%	10,00%	2.255.508,04
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.972.130,68
Desenquadrado - RV	0,00%	437.073,86	0,74%	0,00%	0,00%	0,00%	-437.073,86
Total Renda Variável	30,00%	15.235.431,77	25,63%	17,00%	28,00%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	408.479,16	0,69%	0,00%	1,00%	10,00%	5.535.782,19
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.597.900,57	2,69%	0,00%	4,00%	10,00%	4.346.360,78
Total Exterior	10,00%	2.006.379,73	3,38%	0,00%	5,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	26.453.595,33	44,50	-
CAIXA DTVM	18.033.899,30	30,34	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.872.706,29	4,83	0,79
META ASSET MANAGEMENT	2.401.938,46	4,04	0,90
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.149.745,96	3,62	0,13
ITAÚ UNIBANCO	1.954.145,56	3,29	0,00
TRÍGONO CAPITAL	1.750.829,10	2,95	0,04
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	1.637.864,36	2,76	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	953.328,14	1,60	-
CADENCE GESTORA	437.073,86	0,74	-
PLURAL	403.854,89	0,68	0,01
RJI CORRETORA DE VALORES	385.628,33	0,65	0,07
PETRA CAPITAL	8.003,95	0,01	0,00

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 '	34.802.485,12	58,55	15,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	5.871.468,09	9,88	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	1.526.848,82	2,57	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	11.109.604,60	18,69	13,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	408.479,16	0,69	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	1.597.900,57	2,69	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	3.688.753,31	6,21	4,00	10,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,62%	6,94%	0,09%	2,94%	8,91%	15,68%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	6,74%	0,26%	2,81%	8,72%	15,30%	1,42%	0,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,51%	6,53%	0,11%	2,61%	8,47%	14,89%	1,50%	0,04%
IPCA + 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%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	-	-0,02%	2,35%	-	-	1,46%	-
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,46%	6,65%	0,55%	3,07%	8,60%	13,91%	1,19%	0,04%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-13,35%	-20,09%	-16,20%	-14,68%	-20,39%	-73,56%	22,60%	0,14%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,03%	2,35%	-0,22%	0,85%	1,82%	-21,19%	0,36%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	1,48%	6,12%	1,70%	3,16%	7,25%	12,30%	-	-
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%

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
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,96%	4,78%	1,47%	2,84%	2,42%	1,86%	0,63%	0,02%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,09%	9,08%	3,35%	6,35%	11,18%	14,77%	0,02%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,99%	8,08%	3,06%	5,77%	9,78%	11,85%	0,00%	0,01%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	-0,35%	-4,25%	-0,11%	-3,39%	-5,96%	4.860.411.271.160,00%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,46%	-59,72%	-1,52%	-59,64%	-60,12%	-62,24%	0,06%	0,58%
IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	7,15%	0,02%	3,11%	8,79%	15,18%	0,75%	0,04%
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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,24%	8,29%	3,54%	5,84%	9,44%	10,38%	0,79%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,53%	8,40%	2,97%	5,62%	10,74%	13,75%	2,07%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
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
S&P 500 (Benchmark)	-9,34%	-24,77%	-5,28%	-20,85%	-16,76%	6,62%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-8,62%	-19,75%	-2,62%	-17,18%	-9,30%	18,63%	11,67%	0,22%
Global BDRX (Benchmark)	-8,38%	-30,78%	-4,37%	-14,20%	-22,27%	-5,91%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,72%	-30,97%	-4,35%	-14,12%	-22,81%	-8,72%	9,55%	0,22%
IBX-50 (Benchmark)	0,48%	5,31%	11,70%	-8,80%	0,58%	19,15%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	0,32%	3,65%	11,39%	-10,01%	-2,13%	15,01%	10,35%	0,22%
IBX (Benchmark)	-0,05%	4,43%	10,77%	-9,10%	-1,33%	16,26%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	1,82%	2,77%	14,94%	-10,96%	-1,38%	-7,63%	11,57%	0,26%
Ibovespa (Benchmark)	0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,36%	1,67%	9,61%	-8,81%	-1,48%	22,12%	11,01%	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%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	0,48%	5,19%	11,74%	-8,15%	-0,56%	16,59%	11,18%	0,22%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FIC AÇÕES	-0,21%	3,95%	11,19%	-9,17%	-2,56%	14,90%	11,16%	0,23%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	-1,08%	7,96%	10,66%	-2,51%	3,16%	20,85%	8,90%	0,19%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,26%	2,68%	11,46%	2,83%	-3,53%	79,45%	8,68%	0,26%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,16%	8,47%	12,02%	7,96%	5,50%	-	8,47%	0,27%

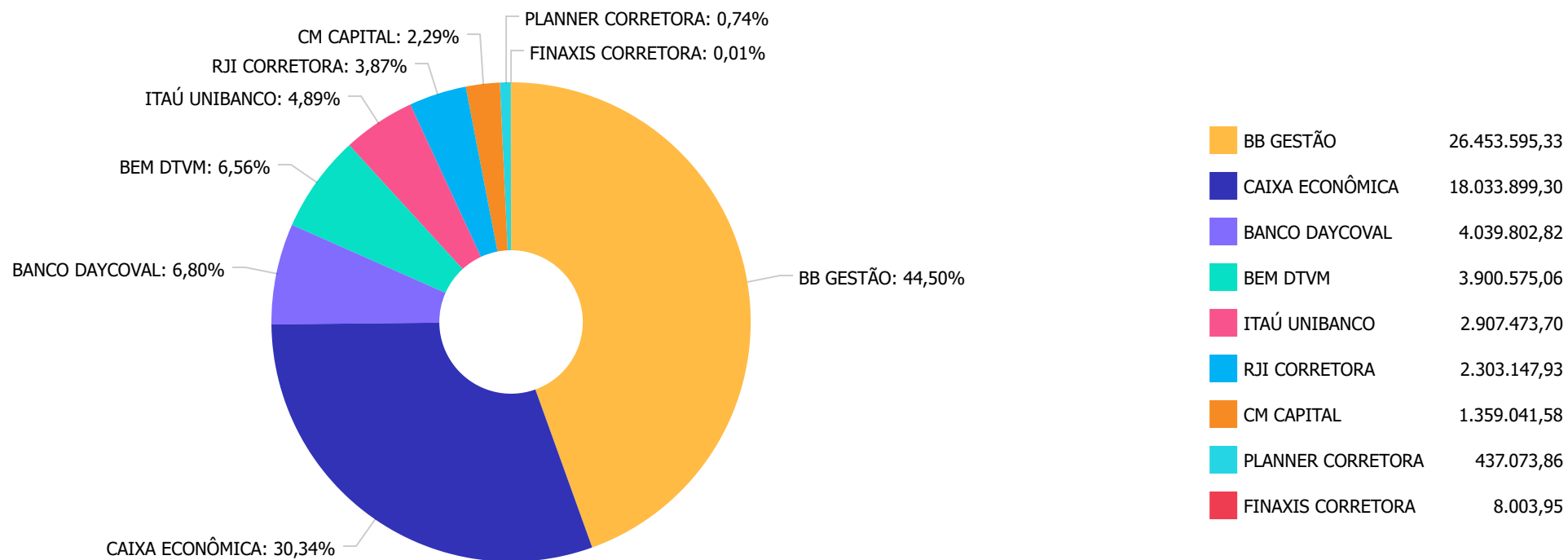
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	-1,84%	-8,06%	14,47%	-13,82%	-18,43%	-5,58%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-1,28%	-3,00%	13,28%	-10,06%	-12,71%	6,31%	9,61%	0,25%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,81%	9,18%	3,44%	5,42%	10,60%	14,70%	0,65%	0,02%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,41%	9,11%	4,90%	4,84%	10,04%	15,37%	1,55%	0,03%
MSCI ACWI (Benchmark)	-5,78%	-28,97%	-4,29%	-11,25%	-22,48%	-6,15%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-8,63%	-19,76%	-2,65%	-17,23%	-9,27%	18,60%	11,70%	0,22%
IFIX (Benchmark)	0,49%	6,63%	6,98%	7,58%	10,13%	7,01%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	0,07%	-0,41%	-0,07%	-0,25%	-0,65%	2,40%	-	-

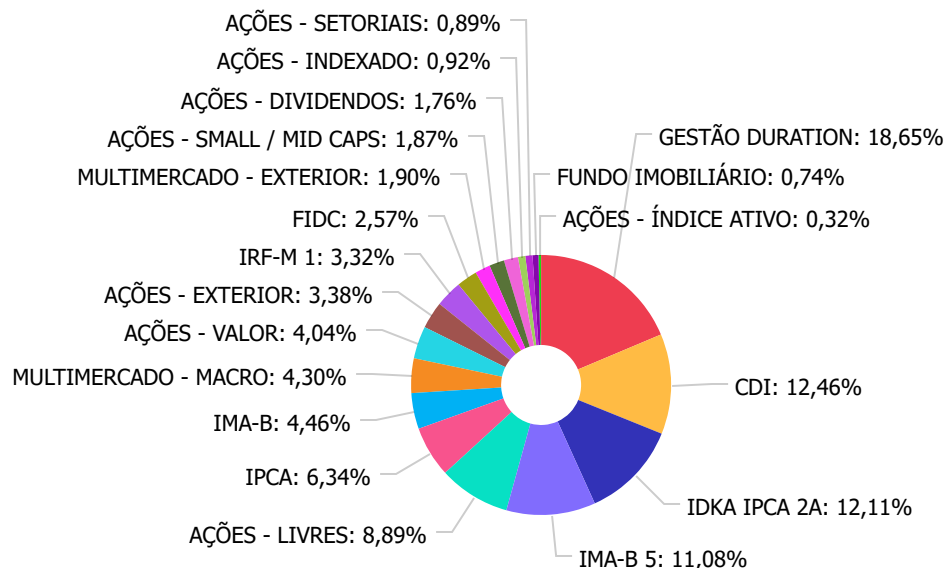
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-8,38%	-30,78%	-4,37%	-14,20%	-22,27%	-5,91%	-	-
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,33%	-29,24%	-3,06%	-12,36%	-20,40%	-4,58%	9,65%	0,21%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,95%	-20,44%	-5,71%	-17,76%	-13,90%	-	10,57%	0,18%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,72%	-30,97%	-4,35%	-14,12%	-22,81%	-8,72%	9,55%	0,22%
MSCI WORLD (Benchmark)	-5,49%	-28,69%	-3,57%	-11,09%	-21,36%	-3,69%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-6,84%	-29,57%	-1,27%	-9,02%	-21,78%	1,33%	10,40%	0,22%

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



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

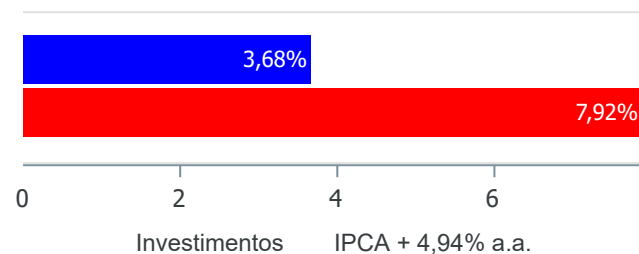


■ GESTÃO DURATION	11.088.410,87	■ CDI	7.406.470,07	■ IDKA IPCA 2A	7.198.680,78	■ IMA-B 5	6.586.773,89
■ AÇÕES - LIVRES	5.286.976,55	■ IPCA	3.765.943,82	■ IMA-B	2.652.625,81	■ MULTIMERCADO - MACRO	2.557.141,14
■ AÇÕES - VALOR	2.401.938,46	■ AÇÕES - EXTERIOR	2.006.379,73	■ IRF-M 1	1.975.047,97	■ FIDC	1.526.848,82
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.131.612,17	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.111.654,14	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.046.485,55	■ AÇÕES - INDEXADO	544.094,59
■ AÇÕES - SETORIAIS	527.393,78	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	437.073,86	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	191.061,53		

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	55.168.624,82	156.267,19	731.697,17	54.828.859,22	235.664,38	235.664,38	0,43%	0,43%	0,94%	0,94%	45,21%	3,34%
Fevereiro	54.828.859,22	7.226.258,41	7.217.846,13	54.884.378,32	47.106,82	282.771,20	0,09%	0,51%	1,38%	2,34%	21,98%	2,83%
Março	54.884.378,32	1.232.023,34	707.092,84	56.822.071,70	1.412.762,88	1.695.534,08	2,55%	3,08%	2,05%	4,43%	69,41%	3,65%
Abril	56.822.071,70	1.604.645,32	1.182.401,74	56.821.863,54	-422.451,74	1.273.082,34	-0,74%	2,32%	1,43%	5,92%	39,09%	3,01%
Mai	56.821.863,54	1.690.785,21	1.299.595,09	57.839.197,72	626.144,06	1.899.226,40	1,09%	3,44%	0,89%	6,87%	50,00%	3,89%
Junho	57.839.197,72	3.893.688,03	3.483.451,77	56.808.267,02	-1.441.166,96	458.059,44	-2,47%	0,88%	1,08%	8,02%	10,93%	3,25%
Julho	56.808.267,02	1.198.123,36	810.515,06	57.975.911,26	780.035,94	1.238.095,38	1,36%	2,25%	-0,28%	7,72%	29,18%	2,83%
Agosto	57.975.911,26	1.262.676,41	886.610,20	59.218.007,86	866.030,39	2.104.125,77	1,48%	3,77%	0,08%	7,80%	48,31%	3,12%
Setembro	59.218.007,86	2.129.559,54	1.853.633,93	59.442.613,53	-51.319,94	2.052.805,83	-0,09%	3,68%	0,11%	7,92%	46,45%	3,40%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



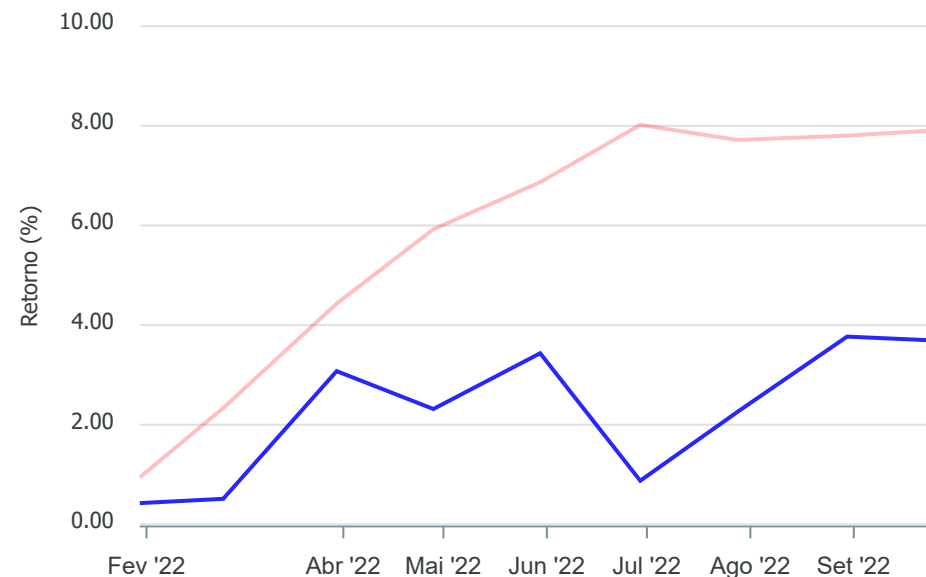
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B

IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1

IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	938.941,18	0,00	0,00	953.328,14	14.386,96	1,53%	1,53%	2,07%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.223.864,60	0,00	0,00	1.241.616,13	17.751,53	1,45%	1,45%	2,43%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.994.447,97	0,00	0,00	3.032.021,08	37.573,11	1,25%	1,25%	1,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.398.178,81	0,00	0,00	5.465.197,29	67.018,48	1,24%	1,24%	0,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	300.984,12	0,00	0,00	304.272,82	3.288,70	1,09%	1,09%	0,02%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.397.619,57	0,00	0,00	1.411.009,68	13.390,11	0,96%	0,96%	0,63%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.102.705,34	1.129.559,54	1.798.651,80	2.470.522,49	36.909,41	0,87%	0,99%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	964.574,43	1.000.000,00	0,00	1.975.047,97	10.473,54	0,53%	1,09%	0,13%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.333.742,42	0,00	0,00	3.351.395,66	17.653,24	0,53%	0,53%	1,42%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.827.761,68	0,00	0,00	3.847.285,12	19.523,44	0,51%	0,51%	1,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.453.160,85	0,00	0,00	1.460.213,02	7.052,17	0,49%	0,49%	1,46%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.630.384,60	0,00	0,00	1.637.864,36	7.479,76	0,46%	0,46%	1,19%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.376.688,34	0,00	0,00	4.394.225,91	17.537,57	0,40%	0,40%	1,27%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	400.112,01	0,00	54.982,13	346.706,63	1.576,75	0,39%	-13,35%	22,60%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	102.386,31	0,00	0,00	102.655,03	268,72	0,26%	0,26%	0,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.762.796,66	0,00	0,00	3.765.943,82	3.147,16	0,08%	0,08%	0,75%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.627.836,31	0,00	0,00	4.631.674,76	3.838,45	0,08%	0,08%	0,75%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	385.752,33	0,00	0,00	385.628,33	-124,00	-0,03%	-0,03%	0,36%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.362.566,59	0,00	0,00	1.359.041,58	-3.525,01	-0,26%	-	-
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	57.345,84	0,00	0,00	57.148,26	-197,58	-0,34%	-	-



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
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	8.040,70	0,00	0,00	8.003,95	-36,75	-0,46%	-0,46%	0,06%
Total Renda Fixa	41.649.890,66	2.129.559,54	1.853.633,93	42.200.802,03	274.985,76	0,66%		1,18%

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
META VALOR FI AÇÕES	2.358.921,59	0,00	0,00	2.401.938,46	43.016,87	1,82%	1,82%	11,57%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.366.779,78	0,00	0,00	1.386.112,65	19.332,87	1,41%	1,41%	1,55%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.161.601,45	0,00	0,00	1.171.028,49	9.427,04	0,81%	0,81%	0,65%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	541.503,81	0,00	0,00	544.094,59	2.590,78	0,48%	0,48%	11,18%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	190.447,06	0,00	0,00	191.061,53	614,47	0,32%	0,32%	10,35%
OSASCO PROPERTIES FII	437.352,73	0,00	0,00	437.073,86	-278,87	-0,06%	0,00%	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	528.517,53	0,00	0,00	527.393,78	-1.123,75	-0,21%	-0,21%	11,16%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.695.581,45	0,00	0,00	1.689.557,67	-6.023,78	-0,36%	-0,36%	11,01%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.173.272,82	0,00	0,00	2.149.745,96	-23.526,86	-1,08%	-1,08%	8,90%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	412.606,71	0,00	0,00	407.310,59	-5.296,12	-1,28%	-1,28%	9,61%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.080.624,67	0,00	0,00	1.046.485,55	-34.139,12	-3,16%	-3,16%	8,47%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.495.763,47	0,00	0,00	1.447.672,92	-48.090,55	-3,22%	-3,22%	8,81%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	728.071,76	0,00	0,00	704.343,55	-23.728,21	-3,26%	-3,26%	8,68%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	520.180,07	0,00	0,00	475.346,60	-44.833,47	-8,62%	-8,62%	11,67%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	718.208,94	0,00	0,00	656.265,57	-61.943,37	-8,62%	-8,62%	11,70%
Total Renda Variável	15.409.433,84	0,00	0,00	15.235.431,77	-174.002,07	-1,13%		8,60%

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
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	825.768,79	0,00	0,00	773.541,74	-52.227,05	-6,32%	-6,32%	9,65%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	438.454,09	0,00	0,00	408.479,16	-29.974,93	-6,84%	-6,84%	10,40%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	442.813,89	0,00	0,00	408.629,46	-34.184,43	-7,72%	-7,72%	9,55%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	451.646,59	0,00	0,00	415.729,37	-35.917,22	-7,95%	-7,95%	10,57%
Total Exterior	2.158.683,36	0,00	0,00	2.006.379,73	-152.303,63	-7,06%		9,97%

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	5.278.344,88	0,00	0,00	5.465.197,29	186.852,41	3,54%	3,54%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.154.253,01	3.590.359,31	3.371.919,62	2.470.522,49	97.829,79	1,70%	3,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.941.676,55	0,00	0,00	3.032.021,08	90.344,53	3,07%	3,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	943.266,48	1.000.000,00	0,00	1.975.047,97	31.781,49	1,64%	3,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	925.822,42	0,00	0,00	953.328,14	27.505,72	2,97%	2,97%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.390.637,63	0,00	0,00	1.411.009,68	20.372,05	1,46%	1,46%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.221.653,65	0,00	0,00	1.241.616,13	19.962,48	1,63%	1,63%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.376.552,54	0,00	0,00	4.394.225,91	17.673,37	0,40%	0,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	294.413,46	0,00	0,00	304.272,82	9.859,36	3,35%	3,35%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.628.861,31	0,00	0,00	1.637.864,36	9.003,05	0,55%	0,55%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.342.612,20	0,00	0,00	3.351.395,66	8.783,46	0,26%	0,26%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.843.168,60	0,00	0,00	3.847.285,12	4.116,52	0,11%	0,11%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	413.746,92	0,00	68.196,19	346.706,63	1.155,90	0,28%	-16,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.765.188,18	0,00	0,00	3.765.943,82	755,64	0,02%	0,02%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.630.965,93	0,00	0,00	4.631.674,76	708,83	0,02%	0,02%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	102.397,51	0,00	0,00	102.655,03	257,52	0,25%	0,25%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	57.208,24	0,00	0,00	57.148,26	-59,98	-0,10%	-0,10%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	8.127,26	0,00	0,00	8.003,95	-123,31	-1,52%	-1,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.502.633,41	0,00	42.293,43	1.460.213,02	-126,96	-0,01%	-0,02%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	386.490,22	0,00	0,00	385.628,33	-861,89	-0,22%	-0,22%



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
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.484.577,95	0,00	68.349,95	1.359.041,58	-57.186,42	-3,85%	-8,46%
Total Renda Fixa	40.692.598,35	4.590.359,31	3.550.759,19	42.200.802,03	468.603,56	1,12%	

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
META VALOR FI AÇÕES	2.089.685,41	0,00	0,00	2.401.938,46	312.253,05	14,94%	14,94%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.942.668,82	0,00	0,00	2.149.745,96	207.077,14	10,66%	10,66%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.541.377,17	0,00	0,00	1.689.557,67	148.180,50	9,61%	9,61%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	934.188,36	0,00	0,00	1.046.485,55	112.297,19	12,02%	12,02%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.349.967,78	0,00	0,00	1.447.672,92	97.705,14	7,24%	7,24%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	631.953,38	0,00	0,00	704.343,55	72.390,17	11,45%	11,45%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.321.364,04	0,00	0,00	1.386.112,65	64.748,61	4,90%	4,90%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	486.918,79	0,00	0,00	544.094,59	57.175,80	11,74%	11,74%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	474.337,69	0,00	0,00	527.393,78	53.056,09	11,19%	11,19%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	359.563,98	0,00	0,00	407.310,59	47.746,61	13,28%	13,28%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.132.085,34	0,00	0,00	1.171.028,49	38.943,15	3,44%	3,44%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	171.523,10	0,00	0,00	191.061,53	19.538,43	11,39%	11,39%
OSASCO PROPERTIES FII	437.955,27	0,00	0,00	437.073,86	-881,41	-0,20%	-0,07%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	488.157,32	0,00	0,00	475.346,60	-12.810,72	-2,62%	-2,62%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	674.126,88	0,00	0,00	656.265,57	-17.861,31	-2,65%	-2,65%
Total Renda Variável	14.035.873,33	0,00	0,00	15.235.431,77	1.199.558,44	8,55%	



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 NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	413.728,07	0,00	0,00	408.479,16	-5.248,91	-1,27%	-1,27%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	427.205,79	0,00	0,00	408.629,46	-18.576,33	-4,35%	-4,35%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	797.937,21	0,00	0,00	773.541,74	-24.395,47	-3,06%	-3,06%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	440.924,27	0,00	0,00	415.729,37	-25.194,90	-5,71%	-5,71%
Total Exterior	2.079.795,34	0,00	0,00	2.006.379,73	-73.415,61	-3,53%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

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

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.