

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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.966.781,82	0,43%	1.050	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	26.070.324,14	5,67%	575	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	35.559.737,88	7,73%	336	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	18.689.213,25	4,06%	269	0,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	4.781.538,90	1,04%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	33.750.144,65	7,34%	247	1,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	62.620.549,00	13,61%	1.035	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	30.160.331,31	6,56%	295	0,43%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	30.471.855,66	6,62%	976	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	55.891.263,05	12,15%	296	1,71%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	474.670,03	0,10%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	12.605.510,89	2,74%	4.177	0,80%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	8.016.248,15	1,74%	1.678	0,91%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	8.707.071,16	1,89%	37.274	0,86%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	8.223.584,04	1,79%	622	3,89%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.586.835,53	1,21%	714	0,56%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	13.043.623,55	2,84%	155	2,64%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	10.760.600,63	2,34%	3.431	0,75%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	11.355.430,63	2,47%	44	1,87%	Artigo 8º, Inciso I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	7.238.865,72	1,57%	4.509	3,94%	Artigo 8º, Inciso I

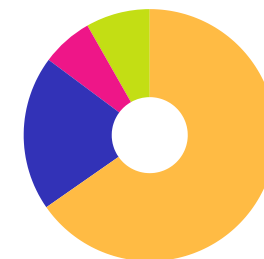
Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	5.890.709,44	1,28%	37	0,66%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	10.985.066,78	2,39%	62	0,94%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	2.494.385,90	0,54%	8.596	0,25%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	16.788.130,93	3,65%	644	1,54%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	8.537.169,13	1,86%	2.887	2,18%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	8.044.428,31	1,75%	8.044	0,96%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	13.568.537,28	2,95%	119	1,92%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.728.501,75	1,68%	33.964	0,73%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			460.011.109,51				



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%	1,00%	5,00%	10,00%	46.001.110,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	183.438.289,64	39,88%	20,00%	26,25%	60,00%	92.568.376,07
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	116.523.450,02	25,33%	15,00%	30,00%	50,00%	113.482.104,74
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	9.200.222,19
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	474.670,03	0,10%	0,00%	0,25%	0,50%	1.825.385,52
Total Renda Fixa	100,00%	300.436.409,69	65,31%	36,00%	61,50%	122,50%	

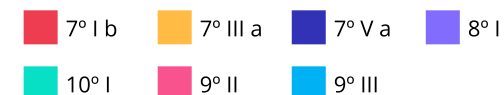
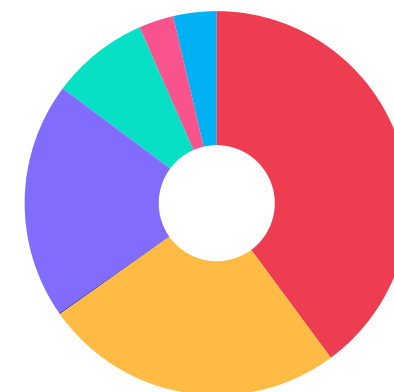




Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2022)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	91.428.479,74	19,88%	10,00%	20,00%	28,00%	37.374.630,92
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	37.878.636,47	8,23%	6,00%	9,50%	10,00%	8.122.474,48
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	129.307.116,21	28,11%	16,00%	29,50%	38,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	13.479.452,68	2,93%	0,00%	5,00%	7,00%	18.721.324,99
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	16.788.130,93	3,65%	0,00%	4,00%	6,00%	10.812.535,64
Total Exterior	10,00%	30.267.583,61	6,58%	0,00%	9,00%	13,00%	





Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	134.886.977,62	29,32	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	109.994.443,18	23,91	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	55.891.263,05	12,15	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	48.790.790,39	10,61	0,01
BANCO J. SAFRA S/A	30.356.668,21	6,60	0,02
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	19.297.769,76	4,20	0,01
AZ QUEST INVESTIMENTOS	12.605.510,89	2,74	0,04
ITAÚ DTVM	11.355.430,63	2,47	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	8.223.584,04	1,79	0,01
WESTERN ASSET	7.728.501,75	1,68	0,02
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	7.238.865,72	1,57	0,02
VINCI PARTNERS	5.890.709,44	1,28	0,01
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	4.781.538,90	1,04	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	2.494.385,90	0,54	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	474.670,03	0,10	0,13

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 %		

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%	-	-
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%
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,42%	7,07%	0,43%	3,14%	9,25%	15,75%	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,47%	-48,63%	-50,39%	-49,15%	-47,69%	-47,02%	1,44%	0,51%
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%
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%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,46%	-59,72%	-1,52%	-59,64%	-60,12%	-62,24%	0,06%	0,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	9,49%	3,40%	6,56%	11,70%	15,57%	0,01%	0,01%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	9,35%	3,44%	6,62%	11,58%	15,22%	0,01%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	9,12%	3,34%	6,40%	11,18%	14,86%	0,03%	0,01%
IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	-	-0,02%	2,35%	-	-	1,46%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	7,15%	0,02%	3,11%	8,79%	15,18%	0,75%	0,04%



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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	-8,56%	-19,58%	-2,60%	-17,10%	-9,29%	18,31%	11,60%	0,22%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,48%	10,32%	6,73%	3,66%	10,21%	16,28%	3,15%	0,07%

Ibovespa (Benchmark)	0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	0,02%	-2,31%	11,23%	-7,19%	-14,49%	-8,77%	10,81%	0,24%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-0,37%	8,09%	11,15%	-6,96%	0,10%	11,32%	10,70%	0,23%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,69%	1,63%	11,53%	-8,45%	-3,49%	7,37%	11,18%	0,22%
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	-1,35%	8,17%	13,87%	-3,35%	-1,15%	7,51%	11,50%	0,23%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-0,13%	3,58%	11,14%	-9,22%	-3,03%	14,00%	11,04%	0,23%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-2,86%	-4,12%	10,23%	-7,79%	-13,85%	0,36%	9,19%	0,21%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,31%	-0,74%	14,38%	-9,67%	-20,04%	-23,90%	9,85%	0,26%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,80%	6,29%	12,66%	-5,60%	-3,26%	7,77%	10,55%	0,21%

S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-9,34%	-24,77%	-5,28%	-20,85%	-16,76%	6,62%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-5,01%	-16,33%	1,41%	-13,84%	-5,35%	24,97%	10,37%	0,21%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-8,61%	-19,75%	-2,61%	-17,32%	-9,32%	18,56%	11,68%	0,22%

SMLL (Benchmark)	-1,84%	-8,06%	14,47%	-13,82%	-18,43%	-5,58%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-2,18%	-5,30%	7,57%	-10,89%	-13,12%	0,05%	9,77%	0,18%



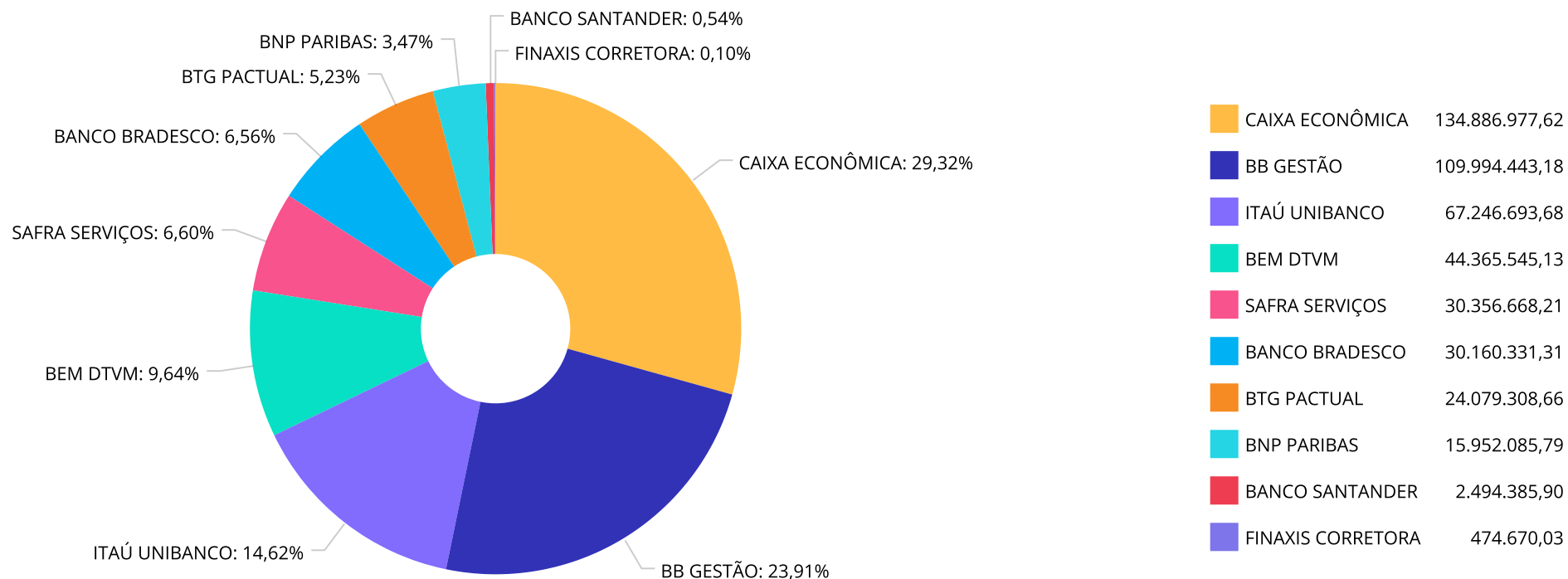
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-1,34%	-2,76%	11,58%	-13,01%	-14,44%	0,72%	12,51%	0,27%

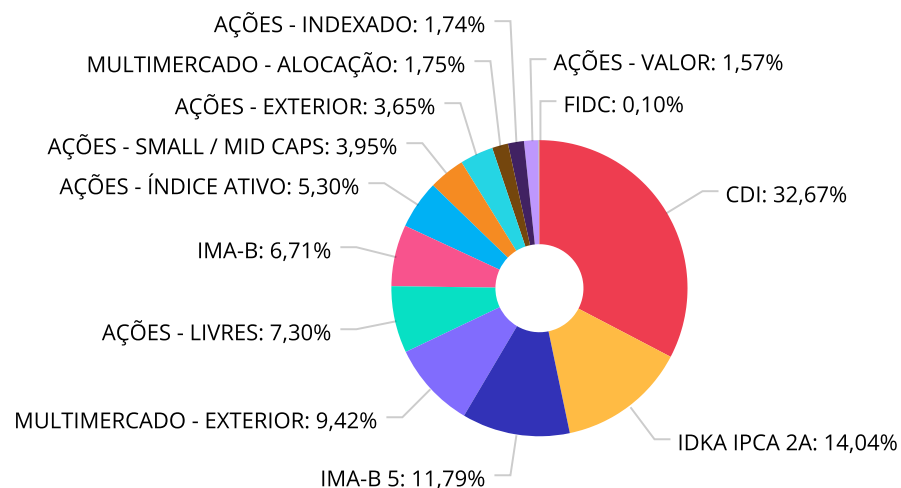
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,87%	-33,02%	-4,54%	-14,29%	-24,65%	-9,11%	9,93%	21,787%
MSCI WORLD (Benchmark)	-5,49%	-28,69%	-3,57%	-11,09%	-21,36%	-3,69%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-5,52%	-31,46%	-2,27%	-11,11%	-26,92%	-11,68%	7,50%	19,656%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-5,59%	-25,46%	0,08%	-9,77%	-17,90%	6,31%	9,17%	18,122%

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



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



■ CDI	150.273.594,67	■ IDKA IPCA 2A	64.587.330,82	■ IMA-B 5	54.248.951,13	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	43.313.660,84
■ AÇÕES - LIVRES	33.581.965,27	■ IMA-B	30.851.863,04	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	24.399.054,18	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	18.192.346,42
■ AÇÕES - EXTERIOR	16.788.130,93	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	8.044.428,31	■ AÇÕES - INDEXADO	8.016.248,15	■ AÇÕES - VALOR	7.238.865,72
■ FIDC	474.670,03						



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

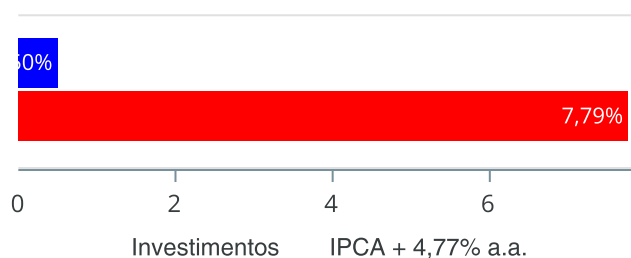
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------



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	512.360.495,33	54.764.190,49	48.908.092,39	517.097.570,08	-1.119.023,35	-1.119.023,35	-0,22%	-0,22%	0,93%	0,93%	-23,19%	3,65%
Fevereiro	517.097.570,08	36.175.402,09	47.416.852,35	504.367.078,90	-1.489.040,92	-2.608.064,27	-0,29%	-0,50%	1,37%	2,31%	-21,79%	3,52%
Março	504.367.078,90	64.038.546,21	69.077.566,51	510.262.626,03	10.934.567,43	8.326.503,16	2,17%	1,65%	2,03%	4,39%	37,67%	4,33%
Abril	510.262.626,03	29.444.116,08	33.564.108,38	495.952.605,71	-10.190.028,02	-1.863.524,86	-2,00%	-0,38%	1,42%	5,87%	-6,41%	3,71%
Mai	495.952.605,71	21.133.087,43	29.170.485,66	490.344.839,65	2.429.632,17	566.107,31	0,49%	0,11%	0,88%	6,80%	1,64%	4,39%
Junho	490.344.839,65	21.566.473,28	27.325.974,18	472.788.701,55	-11.796.637,20	-11.230.529,89	-2,41%	-2,30%	1,06%	7,93%	-28,95%	4,10%
Julho	472.788.701,55	84.505.500,12	100.143.992,17	468.013.786,87	10.863.577,37	-366.952,52	2,30%	-0,05%	-0,29%	7,62%	-0,68%	3,61%
Agosto	468.013.786,87	60.487.598,49	65.832.289,71	468.189.795,15	5.520.699,50	5.153.746,98	1,18%	1,13%	0,06%	7,69%	14,67%	5,05%
Setembro	468.189.795,15	62.284.013,17	67.552.519,86	460.011.109,51	-2.910.178,95	2.243.568,03	-0,62%	0,50%	0,10%	7,79%	6,40%	4,11%

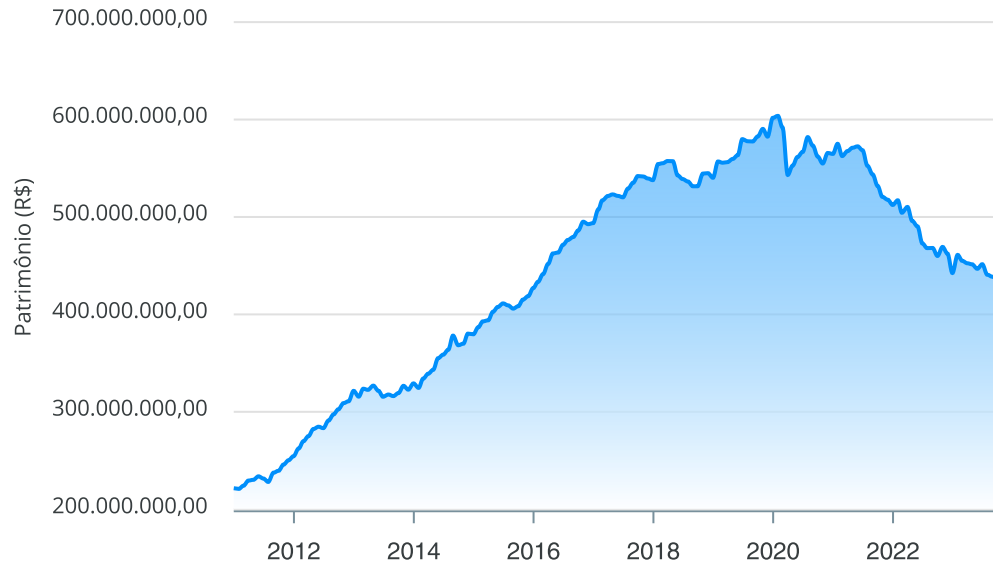
Investimentos x Meta de Rentabilidade





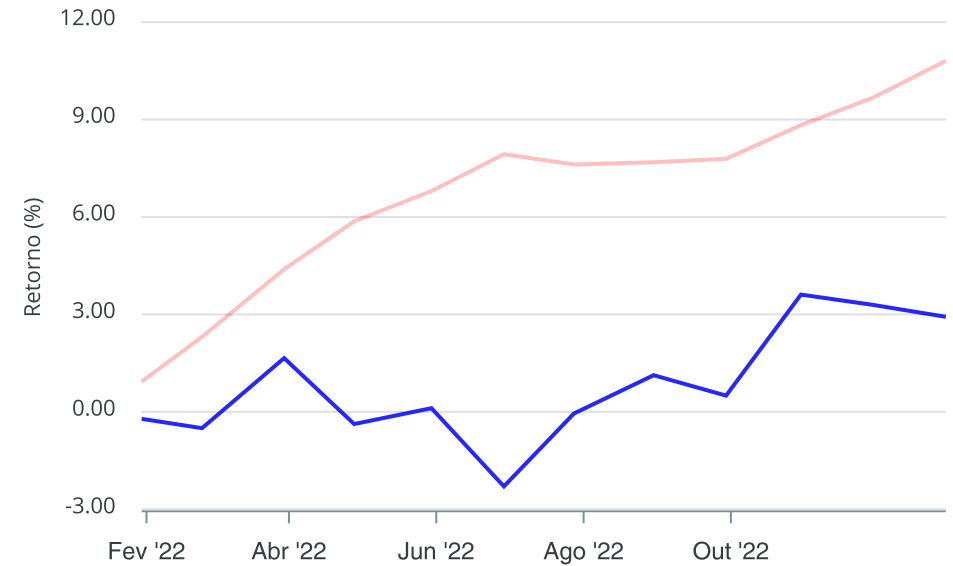
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- 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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	25.697.593,64	0,00	0,00	26.070.324,14	372.730,50	1,45%	1,45%	2,43%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	46.683.781,26	0,00	17.034.997,32	30.160.331,31	511.547,37	1,10%	1,12%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.176.262,39	24.151.029,07	150.000,00	30.471.855,66	294.564,20	0,97%	1,11%	0,03%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	10.214.117,20	0,00	10.310.302,94	0,00	96.185,74	0,94%	1,07%	0,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	33.523.300,17	21.909.150,57	0,00	55.891.263,05	458.812,31	0,83%	1,12%	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.569.483,08	386.570,58	0,00	1.966.781,82	10.728,16	0,55%	0,53%	1,42%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	33.586.268,52	0,00	0,00	33.750.144,65	163.876,13	0,49%	0,49%	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	18.598.952,79	0,00	0,00	18.689.213,25	90.260,46	0,49%	0,49%	1,46%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.758.973,20	0,00	0,00	4.781.538,90	22.565,70	0,47%	0,47%	1,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	50.790.223,86	15.837.262,95	4.307.342,90	62.620.549,00	300.405,09	0,45%	0,51%	1,50%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	24.073.019,53	0,00	24.151.029,07	0,00	78.009,54	0,32%	1,24%	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	35.530.020,98	0,00	0,00	35.559.737,88	29.716,90	0,08%	0,08%	0,75%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	476.849,67	0,00	0,00	474.670,03	-2.179,64	-0,46%	-0,46%	0,06%
Total Renda Fixa	291.678.846,29	62.284.013,17	55.953.672,23	300.436.409,69	2.427.222,46	0,81%		0,90%

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 RV 30 FI MULTIMERCADO LP	7.927.374,45	0,00	0,00	8.044.428,31	117.053,86	1,48%	1,48%	3,15%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	11.265.735,18	0,00	0,00	11.355.430,63	89.695,45	0,80%	0,80%	10,55%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5.850.374,31	0,00	0,00	5.890.709,44	40.335,13	0,69%	0,69%	11,18%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	6.591.921,33	0,00	6.598.847,63	0,00	6.926,30	0,11%	0,55%	0,50%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7.237.683,65	0,00	0,00	7.238.865,72	1.182,07	0,02%	0,02%	10,81%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	8.026.797,88	0,00	0,00	8.016.248,15	-10.549,73	-0,13%	-0,13%	11,04%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.794.509,00	0,00	0,00	10.760.600,63	-33.908,37	-0,31%	-0,31%	9,85%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8.253.915,82	0,00	0,00	8.223.584,04	-30.331,78	-0,37%	-0,37%	10,70%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	5.662.469,87	0,00	0,00	5.586.835,53	-75.634,34	-1,34%	-1,34%	12,51%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	13.222.716,82	0,00	0,00	13.043.623,55	-179.093,27	-1,35%	-1,35%	11,50%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	12.887.022,43	0,00	0,00	12.605.510,89	-281.511,54	-2,18%	-2,18%	9,77%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	8.963.444,94	0,00	0,00	8.707.071,16	-256.373,78	-2,86%	-2,86%	9,19%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	8.987.048,41	0,00	0,00	8.537.169,13	-449.879,28	-5,01%	-5,01%	10,37%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	14.838.514,09	0,00	0,00	13.568.537,28	-1.269.976,81	-8,56%	-8,56%	11,60%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8.456.741,79	0,00	0,00	7.728.501,75	-728.240,04	-8,61%	-8,61%	11,68%
Total Renda Variável	138.966.269,97	0,00	6.598.847,63	129.307.116,21	-3.060.306,13	-2,20%		10,29%



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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	7.884.070,05	0,00	5.000.000,00	2.494.385,90	-389.684,15	-4,94%	-5,52%	7,50%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	11.634.927,87	0,00	0,00	10.985.066,78	-649.861,09	-5,59%	-5,59%	9,17%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	18.025.680,97	0,00	0,00	16.788.130,93	-1.237.550,04	-6,87%	-6,87%	9,93%
Total Exterior	37.544.678,89	0,00	5.000.000,00	30.267.583,61	-2.277.095,28	-6,07%		9,46%

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
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	47.507.468,98	42.000.730,99	61.117.590,91	30.160.331,31	1.769.722,25	1,98%	3,44%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	48.395.162,90	0,00	49.151.029,07	0,00	755.866,17	1,56%	3,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	55.309.750,16	0,00	55.891.263,05	581.512,89	1,05%	3,40%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.341.089,82	24.151.029,07	450.000,00	30.471.855,66	429.736,77	1,41%	3,34%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	29.713.718,43	0,00	4.000.000,00	26.070.324,14	356.605,71	1,20%	1,63%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	24.004.713,99	0,00	24.310.302,94	0,00	305.588,95	1,27%	2,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	22.834.471,34	0,00	23.102.392,49	0,00	267.921,15	1,17%	2,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	9.226.627,97	0,00	9.366.785,49	0,00	140.157,52	1,52%	3,09%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.972.540,51	15.510.931,22	867.344,14	33.750.144,65	134.017,06	0,39%	-2,97%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.637.838,10	0,00	4.928.357,45	4.781.538,90	72.058,25	0,75%	-50,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	13.162.533,08	6.000.000,00	541.312,10	18.689.213,25	67.992,27	0,35%	-0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	45.671.734,35	47.043.590,04	30.159.070,16	62.620.549,00	64.294,77	0,07%	0,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	21.063.728,16	14.463.347,36	0,00	35.559.737,88	32.662,36	0,09%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	1.367.417,38	1.368.113,42	0,00	696,04	0,05%	3,35%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	481.983,01	0,00	0,00	474.670,03	-7.312,98	-1,52%	-1,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.222.820,73	1.430.315,56	12.567.655,94	1.966.781,82	-118.698,53	-0,81%	0,26%
Total Renda Fixa	310.236.431,37	207.277.111,78	221.929.954,11	300.436.409,69	4.852.820,65	0,94%	

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
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	11.454.736,03	0,00	0,00	13.043.623,55	1.588.887,52	13,87%	13,87%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.408.210,96	0,00	0,00	10.760.600,63	1.352.389,67	14,37%	14,37%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	10.079.091,95	0,00	0,00	11.355.430,63	1.276.338,68	12,66%	12,66%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	11.718.048,11	0,00	0,00	12.605.510,89	887.462,78	7,57%	7,57%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.398.773,82	0,00	0,00	8.223.584,04	824.810,22	11,15%	11,15%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	7.898.993,92	0,00	0,00	8.707.071,16	808.077,24	10,23%	10,23%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	7.212.888,20	0,00	0,00	8.016.248,15	803.359,95	11,14%	11,14%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	6.508.275,69	0,00	0,00	7.238.865,72	730.590,03	11,23%	11,23%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5.281.868,43	0,00	0,00	5.890.709,44	608.841,01	11,53%	11,53%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	5.007.102,78	0,00	0,00	5.586.835,53	579.732,75	11,58%	11,58%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	7.537.204,38	0,00	0,00	8.044.428,31	507.223,93	6,73%	6,73%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	8.418.527,92	0,00	0,00	8.537.169,13	118.641,21	1,41%	1,41%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	6.578.753,89	0,00	6.598.847,63	0,00	20.093,74	0,31%	0,75%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.935.532,45	0,00	0,00	7.728.501,75	-207.030,70	-2,61%	-2,61%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	13.930.094,37	0,00	0,00	13.568.537,28	-361.557,09	-2,60%	-2,60%
Total Renda Variável	126.368.102,90	0,00	6.598.847,63	129.307.116,21	9.537.860,94	7,55%	



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 GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	10.975.971,25	0,00	0,00	10.985.066,78	9.095,53	0,08%	0,08%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	7.622.321,92	0,00	5.000.000,00	2.494.385,90	-127.936,02	-1,68%	-2,27%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.585.874,11	0,00	0,00	16.788.130,93	-797.743,18	-4,54%	-4,54%
Total Exterior	36.184.167,28	0,00	5.000.000,00	30.267.583,61	-916.583,67	-2,53%	

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 CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. 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.

