

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2022

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

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	20.009.929,29	5,14%	520	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	24.059.888,84	6,18%	1.050	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	23.252.702,15	5,98%	796	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.597.387,23	1,70%	575	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	248.686,12	0,06%	96	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	28.805.996,65	7,40%	1.087	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	6.001.110,03	1,54%	336	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	3.035.821,70	0,78%	97	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	8.780.422,56	2,26%	269	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	5.997.704,30	1,54%	280	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	8.756.166,84	2,25%	247	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	2027-05-16	3.026.935,43	0,78%	58	1,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	29.635.395,22	7,62%	808	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	44.771.857,53	11,51%	1.035	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	22.028.828,05	5,66%	975	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	936.618,11	0,24%	253	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	8.529.410,81	2,19%	773	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	6.739.341,80	1,73%	156	1,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	18.982.889,43	4,88%	1.173	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	24.337.839,60	6,25%	1.028	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

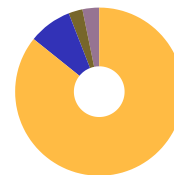


Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.403.607,74	2,42%	126	1,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	28.519.317,33	7,33%	976	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.257.673,57	0,32%	250	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	6.963.965,12	1,79%	29.074	0,53%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	11.416.738,54	2,93%	1.898	1,09%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.677.021,25	0,43%	37.274	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	264.779,86	0,07%	25.273	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.771.723,64	0,97%	188	0,59%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	8.323.593,05	2,14%	126	1,22%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	7.280.625,60	1,87%	157	0,56%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.199.164,07	0,82%	518	0,16%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	340.010,79	0,09%	53.451	0,01%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.586.763,78	1,95%	8.305	0,35%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	4.610.691,37	1,18%	10.270	0,27%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		2.509.494,97	0,64%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			389.150.607,40				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.509.494,97	Artigo 6º			
PL Total			391.660.102,37				

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%	30,00%	116.745.182,22
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	270.197.092,09	69,43%	40,00%	52,00%	80,00%	41.123.393,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	63.518.438,24	16,32%	15,00%	20,00%	60,00%	169.971.926,20
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	77.830.121,48
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	19.457.530,37
Total Renda Fixa	100,00%	333.715.530,33	85,75%	55,00%	80,00%	195,00%	

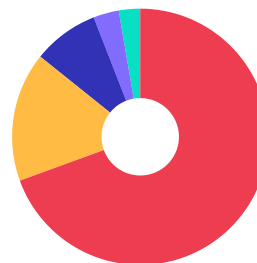


RENTA FIXA	333.715.530,33
RENTA VARIÁVEL	32.417.821,46
EXTERIOR	10.479.789,67
ESTRUTURADOS	12.537.465,94

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%	32.417.821,46	8,33%	7,00%	12,00%	30,00%	84.327.360,76
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	12.537.465,94	3,22%	1,00%	4,00%	10,00%	26.377.594,80
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	44.955.287,40	11,55%	8,00%	16,00%	40,00%	

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%	19.457.530,37
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	10.479.789,67	2,69%	1,00%	4,00%	10,00%	28.435.271,07
Total Exterior	10,00%	10.479.789,67	2,69%	1,00%	4,00%	15,00%	



7º I b 7º III a 8º I 10º I
9º III

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	216.077.682,07	55,53	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	173.072.925,33	44,47	-

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	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	270.197.092,09	69,43	40,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	63.518.438,24	16,32	15,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	32.417.821,46	8,33	7,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	10.479.789,67	2,69	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	12.537.465,94	3,22	1,00	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%
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%

IMA Geral (Benchmark)	1,26%	7,80%	3,17%	5,13%	9,24%	11,95%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,28%	7,52%	3,19%	5,08%	8,95%	10,97%	1,17%	0,03%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	7,49%	3,21%	5,05%	8,90%	10,80%	1,12%	0,03%

IMA-B 5+ (Benchmark)	2,39%	5,10%	3,01%	3,14%	5,19%	8,56%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,37%	4,93%	2,93%	3,00%	4,78%	7,89%	3,62%	0,08%

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	7,04%	0,50%	3,16%	9,15%	15,36%	1,26%	0,04%
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%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	-	-0,02%	2,35%	-	-	1,46%	-

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 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,43%	-	0,50%	-	-	-	2,06%	-

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%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,52%	6,08%	1,80%	3,22%	7,12%	11,92%	2,52%	0,06%
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%

CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	9,12%	3,34%	6,40%	11,18%	14,86%	0,03%	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%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	7,15%	0,02%	3,11%	8,79%	15,18%	0,75%	0,04%
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%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,28%	8,63%	3,51%	5,91%	10,29%	11,11%	1,00%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	-	0,44%	-	-	-	2,06%	-

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 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
S&P 500 (Benchmark)	-9,34%	-24,77%	-5,28%	-20,85%	-16,76%	6,62%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-8,03%	-20,16%	-2,85%	-17,28%	-10,39%	15,59%	11,08%	0,22%

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%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1,28%	9,36%	11,86%	-6,48%	2,62%	12,21%	11,13%	0,22%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-0,36%	1,67%	9,61%	-8,81%	-1,48%	22,12%	11,01%	0,21%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-2,86%	-4,12%	10,23%	-7,79%	-13,85%	0,36%	9,19%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,34%	-1,51%	7,67%	-9,41%	-4,02%	24,18%	10,89%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,22%	3,35%	7,24%	-4,09%	2,20%	30,94%	8,81%	0,18%

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%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,81%	9,18%	3,44%	5,42%	10,60%	14,70%	0,65%	0,02%

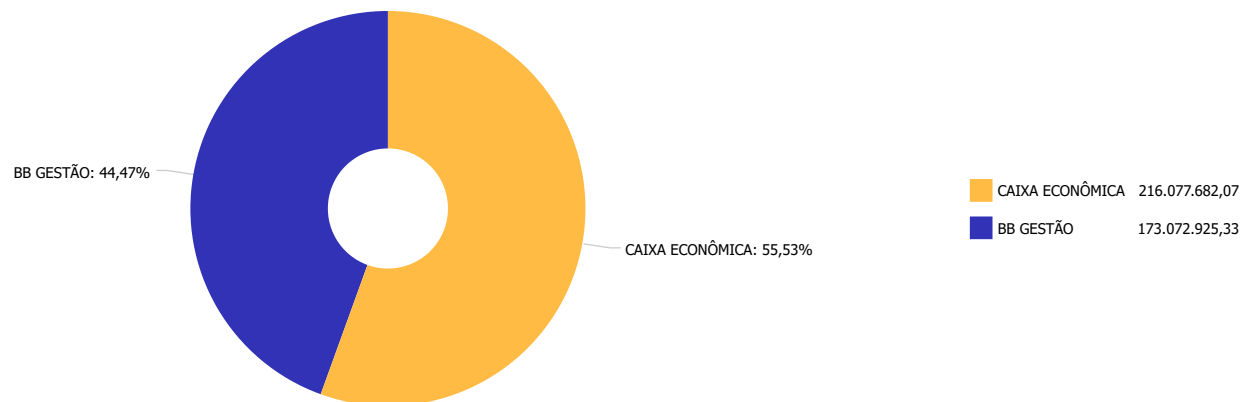
MSCI ACWI (Benchmark)	-5,78%	-28,97%	-4,29%	-11,25%	-22,48%	-6,15%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-8,63%	-19,76%	-2,65%	-17,23%	-9,27%	18,60%	11,70%	0,22%

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

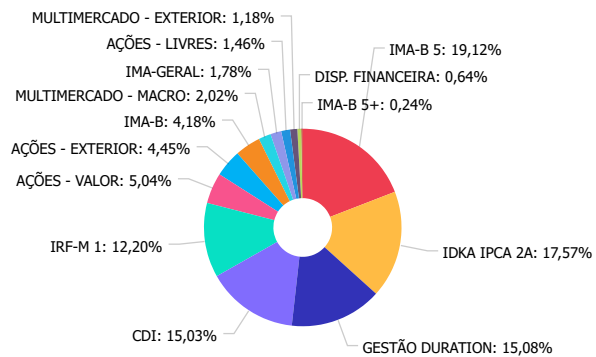
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-8,38%	-30,78%	-4,37%	-14,20%	-22,27%	-5,91%	-	-



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



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

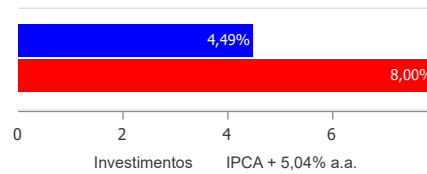


IMA-B 5	74.881.986,76	IDKA IPCA 2A	68.831.746,37	GESTÃO DURATION	59.048.932,25	CDI	58.854.861,23
IRF-M 1	47.788.886,08	AÇÕES - VALOR	19.740.331,59	AÇÕES - EXTERIOR	17.443.754,79	IMA-B	16.384.471,61
MULTIMERCADO - MACRO	7.926.774,57	IMA-GERAL	6.988.027,92	AÇÕES - LIVRES	5.713.524,75	MULTIMERCADO - EXTERIOR	4.610.691,37
DISP. FINANCEIRA	2.509.494,97	IMA-B 5+	936.618,11				

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	307.630.138,83	17.324.185,72	1.711.094,44	323.807.902,43	564.672,32	564.672,32	0,17%	0,17%	0,95%	0,95%	18,33%	2,11%
Fevereiro	323.807.902,43	5.168.183,50	1.588.828,10	328.633.959,32	1.246.701,49	1.811.373,81	0,38%	0,56%	1,39%	2,35%	23,65%	2,03%
Março	328.633.959,32	7.078.679,10	1.843.163,25	340.450.628,10	6.581.152,93	8.392.526,74	1,97%	2,54%	2,06%	4,46%	56,95%	2,42%
Abril	340.450.628,10	6.909.788,19	1.906.063,95	344.290.671,30	-1.163.681,04	7.228.845,70	-0,34%	2,19%	1,44%	5,96%	36,82%	2,10%
Maiο	344.290.671,30	8.207.993,46	1.632.135,36	354.165.264,76	3.298.735,36	10.527.581,06	0,94%	3,15%	0,90%	6,91%	45,63%	2,28%
Junho	354.165.264,76	8.105.084,11	1.806.999,98	357.725.687,59	-2.737.661,30	7.789.919,76	-0,76%	2,37%	1,08%	8,07%	29,37%	2,33%
Julho	357.725.687,59	8.265.319,28	1.964.495,06	368.154.201,56	4.127.689,75	11.917.609,51	1,13%	3,53%	-0,27%	7,78%	45,41%	1,96%
Agosto	368.154.201,56	53.923.951,72	47.536.653,28	377.221.749,17	2.680.249,17	14.597.858,68	0,72%	4,27%	0,09%	7,87%	54,27%	2,15%
Setembro	377.221.749,17	8.493.397,06	2.670.827,09	383.837.554,50	793.235,36	15.391.094,04	0,21%	4,49%	0,12%	8,00%	56,10%	2,14%

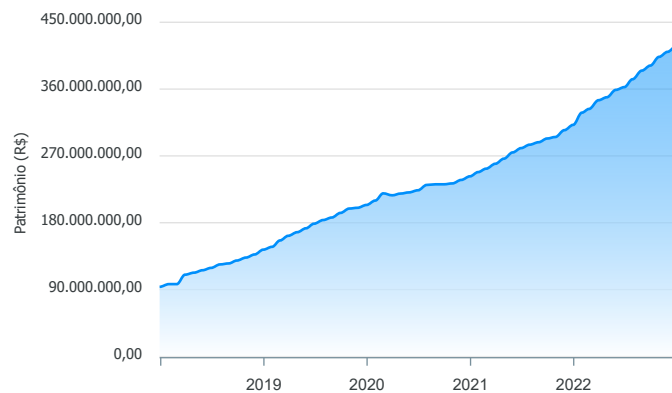
Investimentos x Meta de Rentabilidade



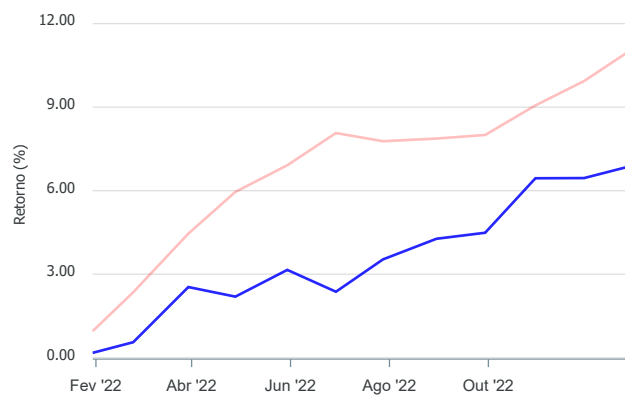


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	914.895,13	0,00	0,00	936.618,11	21.722,98	2,37%	2,37%	3,62%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.238.825,02	0,00	0,00	1.257.673,57	18.848,55	1,52%	1,52%	2,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.403.654,99	0,00	0,00	8.529.410,81	125.755,82	1,50%	1,50%	2,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.503.063,61	0,00	0,00	6.597.387,23	94.323,62	1,45%	1,45%	2,43%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	9.284.577,23	0,00	0,00	9.403.607,74	119.030,51	1,28%	1,28%	1,00%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	6.654.075,77	0,00	0,00	6.739.341,80	85.266,03	1,28%	1,28%	1,17%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	245.542,78	0,00	0,00	248.686,12	3.143,34	1,28%	1,28%	1,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	19.761.964,24	0,00	0,00	20.009.929,29	247.965,05	1,25%	1,25%	1,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	29.309.595,27	0,00	37.811,06	29.635.395,22	363.611,01	1,24%	1,24%	0,79%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	28.207.581,85	0,00	0,00	28.519.317,33	311.735,48	1,11%	1,11%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.778.606,00	0,00	0,00	18.982.889,43	204.283,43	1,09%	1,09%	0,13%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	26.537.077,56	0,00	2.463.580,86	24.337.839,60	264.342,90	1,00%	1,09%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	19.960.109,81	8.598.397,06	0,00	28.805.996,65	247.489,78	0,87%	1,09%	0,13%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	24.102.519,50	0,00	169.435,17	24.059.888,84	126.804,51	0,53%	0,53%	1,42%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	44.544.658,27	0,00	0,00	44.771.857,53	227.199,26	0,51%	0,51%	1,50%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.713.650,68	0,00	0,00	8.756.166,84	42.516,16	0,49%	0,49%	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	8.738.017,08	0,00	0,00	8.780.422,56	42.405,48	0,49%	0,49%	1,46%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.013.900,26	0,00	0,00	3.026.935,43	13.035,17	0,43%	0,43%	2,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.022.761,94	0,00	0,00	3.035.821,70	13.059,76	0,43%	0,43%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.935.134,83	0,00	0,00	22.028.828,05	93.693,22	0,43%	0,43%	1,26%

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 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	23.159.899,53	0,00	0,00	23.252.702,15	92.802,62	0,40%	0,40%	1,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	5.996.094,97	0,00	0,00	6.001.110,03	5.015,06	0,08%	0,08%	0,75%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.992.733,76	0,00	0,00	5.997.704,30	4.970,54	0,08%	0,08%	0,75%
Total Renda Fixa	325.018.940,08	8.598.397,06	2.670.827,09	333.715.530,33	2.769.020,28	0,84%		0,96%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável/Estruturados/Imobiliário	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.480.947,09	0,00	0,00	7.586.763,78	105.816,69	1,41%	1,41%	1,55%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	8.218.617,49	0,00	0,00	8.323.593,05	104.975,56	1,28%	1,28%	11,13%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	337.273,63	0,00	0,00	340.010,79	2.737,16	0,81%	0,81%	0,65%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	265.723,88	0,00	0,00	264.779,86	-944,02	-0,36%	-0,36%	11,01%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	11.571.564,18	0,00	0,00	11.416.738,54	-154.825,64	-1,34%	-1,34%	10,89%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.726.400,00	0,00	0,00	1.677.021,25	-49.378,75	-2,86%	-2,86%	9,19%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.897.017,31	0,00	0,00	3.771.723,64	-125.293,67	-3,22%	-3,22%	8,81%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	7.572.131,21	0,00	0,00	6.963.965,12	-608.166,09	-8,03%	-8,03%	11,08%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.045.883,67	0,00	0,00	4.610.691,37	-435.192,30	-8,62%	-8,62%	11,70%
Total Renda Variável	46.115.558,46	0,00	0,00	44.955.287,40	-1.160.271,06	-2,52%		9,16%



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	7.772.189,95	0,00	0,00	7.280.625,60	-491.564,35	-6,32%	-6,32%	9,65%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.466.794,36	0,00	0,00	3.199.164,07	-267.630,29	-7,72%	-7,72%	9,55%
Total Exterior	11.238.984,31	0,00	0,00	10.479.789,67	-759.194,64	-6,76%		9,62%

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	48.142.242,48	0,00	19.697.772,13	29.635.395,22	1.190.924,87	2,47%	3,54%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	27.598.730,99	0,00	0,00	28.519.317,33	920.586,34	3,34%	3,34%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	25.970.854,03	9.000.000,00	11.463.580,86	24.337.839,60	830.566,43	2,38%	3,35%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	28.304.583,28	0,00	9.000.000,00	20.009.929,29	705.346,01	2,49%	3,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.106.353,09	268.910,20	5.000,00	18.982.889,43	612.626,14	3,33%	3,37%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.785.782,48	25.550.147,14	2.616,67	28.805.996,65	472.683,70	1,67%	3,37%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	9.084.665,25	0,00	0,00	9.403.607,74	318.942,49	3,51%	3,51%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	6.567.248,08	0,00	35.992,00	6.739.341,80	208.085,72	3,17%	3,19%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.048.033,19	0,00	1.662.775,69	8.529.410,81	144.153,31	1,43%	1,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.920.163,17	0,00	0,00	22.028.828,05	108.664,88	0,50%	0,50%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.108.306,76	0,00	616.577,62	6.597.387,23	105.658,09	1,49%	1,63%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	23.014.558,57	143.784,63	0,00	23.252.702,15	94.358,95	0,41%	0,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	44.723.952,73	0,00	0,00	44.771.857,53	47.904,80	0,11%	0,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	33.190.256,72	0,00	9.169.435,17	24.059.888,84	39.067,29	0,12%	0,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	3.000.000,00	0,00	3.035.821,70	35.821,70	1,19%	0,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	9.000.000,00	254.315,09	8.780.422,56	34.737,65	0,39%	-0,02%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	3.000.000,00	0,00	3.026.935,43	26.935,43	0,90%	0,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	909.965,41	0,00	0,00	936.618,11	26.652,70	2,93%	2,93%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	9.000.000,00	268.910,20	8.756.166,84	25.077,04	0,28%	-2,97%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.235.487,35	0,00	0,00	1.257.673,57	22.186,22	1,80%	1,80%

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
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	240.942,83	0,00	0,00	248.686,12	7.743,29	3,21%	3,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	6.000.000,00	0,00	6.001.110,03	1.110,03	0,02%	0,02%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	6.000.000,00	0,00	5.997.704,30	-2.295,70	-0,04%	0,02%
Total Renda Fixa	308.952.126,41	70.962.841,97	52.176.975,43	333.715.530,33	5.977.537,38	1,82%	

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 EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	7.440.971,04	0,00	0,00	8.323.593,05	882.622,01	11,86%	11,86%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	10.603.335,15	0,00	0,00	11.416.738,54	813.403,39	7,67%	7,67%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.232.368,11	0,00	0,00	7.586.763,78	354.395,67	4,90%	4,90%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.517.165,56	0,00	0,00	3.771.723,64	254.558,08	7,24%	7,24%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.521.381,92	0,00	0,00	1.677.021,25	155.639,33	10,23%	10,23%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	241.557,68	0,00	0,00	264.779,86	23.222,18	9,61%	9,61%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	328.703,56	0,00	0,00	340.010,79	11.307,23	3,44%	3,44%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.736.178,56	0,00	0,00	4.610.691,37	-125.487,19	-2,65%	-2,65%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	7.168.135,67	0,00	0,00	6.963.965,12	-204.170,55	-2,85%	-2,85%
Total Renda Variável	42.789.797,25	0,00	0,00	44.955.287,40	2.165.490,15	5,06%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.344.598,33	0,00	0,00	3.199.164,07	-145.434,26	-4,35%	-4,35%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.510.237,31	0,00	0,00	7.280.625,60	-229.611,71	-3,06%	-3,06%
Total Exterior	10.854.835,64	0,00	0,00	10.479.789,67	-375.045,97	-3,46%	

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.

