

# 2022

## Relatório Mensal

# Outubro

## Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.

| Ativo                                                         | Saldo Atual   | % Carteira | PL R\$            | % PL  | Lei      |
|---------------------------------------------------------------|---------------|------------|-------------------|-------|----------|
| TÍTULOS PÚBLICOS                                              | 10.237.523,51 | 13,51%     | 0,00              |       | 7º I a   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 319.915,07    | 0,42%      | 5.996.659.178,04  | 0,01% | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 778.520,60    | 1,03%      | 359.788.502,29    | 0,22% | 7º I b   |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA                                  | 1.385.009,70  | 1,83%      | 186.408.879,03    | 0,74% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA              | 554.125,81    | 0,73%      | 4.086.335.709,28  | 0,01% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                | 535.405,18    | 0,71%      | 5.839.461.409,01  | 0,01% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 665.845,83    | 0,88%      | 8.108.886.938,29  | 0,01% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 5.234.491,36  | 6,91%      | 8.449.071.998,91  | 0,06% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 7.336.502,21  | 9,68%      | 3.862.167.779,60  | 0,19% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 1.054.200,51  | 1,39%      | 5.646.338.902,14  | 0,02% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                | 31.774,88     | 0,04%      | 18.643.982.158,94 | 0,00% | 7º I b   |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 459.058,03    | 0,61%      | 3.173.943.781,02  | 0,01% | 7º III a |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                     | 4.253.007,55  | 5,61%      | 738.624.379,05    | 0,58% | 7º III a |
| BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI          | 2.214.504,79  | 2,92%      | 8.873.771.944,79  | 0,02% | 7º III a |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA                | 8.724.372,06  | 11,52%     | 142.404.110,99    | 6,13% | 7º III a |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA               | 1.680.006,92  | 2,22%      | 221.384.019,07    | 0,76% | 7º III a |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP        | 1.153.591,47  | 1,52%      | 1.650.722.847,59  | 0,07% | 7º III a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA           | 2.676.008,78  | 3,53%      | 2.434.245.468,97  | 0,11% | 7º III a |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA                                | 636.648,20    | 0,84%      | 334.163.614,50    | 0,19% | 7º III a |
| SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI        | 8.134,12      | 0,01%      | 2.800.691.599,83  | 0,00% | 7º III a |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES                                        | 1.590.533,04  | 2,10%      | 907.112.837,29    | 0,18% | 8º I     |
| BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES                               | 2.639.676,04  | 3,48%      | 363.996.306,82    | 0,73% | 8º I     |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                                   | 1.919.419,06  | 2,53%      | 520.825.145,72    | 0,37% | 8º I     |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES                  | 945.691,33    | 1,25%      | 1.534.595.167,72  | 0,06% | 8º I     |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                             | 3.404.871,19  | 4,49%      | 727.308.936,83    | 0,47% | 8º I     |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES                                     | 1.855.016,04  | 2,45%      | 241.413.999,35    | 0,77% | 8º I     |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES                                | 1.247.206,64  | 1,65%      | 1.326.372.993,27  | 0,09% | 8º I     |

## Investimentos

\$ 75.761.653,87

## Disponibilidades Financeiras

\$ 808.367,75

## Total Carteira

\$ 76.570.021,62

## Governança (Pró Gestão)

Não possui

| Ativo                                                                | Saldo Atual  | % Carteira | PL R\$           | % PL  | Lei    |
|----------------------------------------------------------------------|--------------|------------|------------------|-------|--------|
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                               | 1.689.971,53 | 2,23%      | 2.673.080.510,36 | 0,06% | 8º I   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES                   | 798.115,01   | 1,05%      | 218.835.492,20   | 0,36% | 8º I   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                                 | 420.818,48   | 0,56%      | 596.240.734,23   | 0,07% | 8º I   |
| SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES                                         | 206.675,73   | 0,27%      | 194.625.573,11   | 0,11% | 8º I   |
| ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES                | 967.024,39   | 1,28%      | 50.200.894,31    | 1,93% | 9º II  |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ... | 594.330,70   | 0,78%      | 529.565.364,86   | 0,11% | 9º II  |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ... | 993.095,19   | 1,31%      | 256.882.795,89   | 0,39% | 9º II  |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                             | 1.299.415,42 | 1,72%      | 2.030.078.847,62 | 0,06% | 9º III |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I                                           | 1.218.365,00 | 1,61%      | 134.239.582,59   | 0,91% | 9º III |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                             | 476.741,91   | 0,63%      | 2.170.160.001,28 | 0,02% | 10º I  |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP                      | 3.556.040,59 | 4,69%      | 1.767.351.817,15 | 0,20% | 10º I  |

#### Investimentos

 75.761.653,87

#### Disponibilidades Financeiras

 808.367,75

#### Total Carteira

 76.570.021,62

#### Governança (Pró Gestão)

 Não possui

| Título             | Data Compra | Marcacao              | Qtde | PU           | Valor \$     |
|--------------------|-------------|-----------------------|------|--------------|--------------|
| NTN-B - 15/08/2030 | 10/12/2021  | Curva - Taxa: 5,0200% | 29   | 4.249,174796 | 123.226,07   |
| NTN-B - 15/05/2035 | 10/09/2021  | Curva - Taxa: 4,6800% | 20   | 4.548,218040 | 90.964,36    |
| NTN-B - 15/08/2040 | 10/09/2021  | Curva - Taxa: 4,7500% | 49   | 4.586,347249 | 224.731,02   |
| NTN-B - 15/05/2045 | 26/03/2020  | Curva - Taxa: 4,5500% | 146  | 4.857,458860 | 709.188,99   |
| NTN-B - 15/05/2045 | 09/09/2021  | Curva - Taxa: 4,8600% | 351  | 4.671,648654 | 1.639.748,68 |
| NTN-B - 15/05/2045 | 10/09/2021  | Curva - Taxa: 4,7600% | 72   | 4.730,441894 | 340.591,82   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 29/03/2019  | Curva - Taxa: 4,4000% | 122  | 5.001,842152 | 610.224,74   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 31/03/2020  | Curva - Taxa: 4,4600% | 71   | 4.958,398657 | 352.046,30   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 02/04/2020  | Curva - Taxa: 4,5900% | 146  | 4.866,177610 | 710.461,93   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 06/04/2020  | Curva - Taxa: 4,6800% | 123  | 4.803,813834 | 590.869,10   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 08/04/2020  | Curva - Taxa: 4,6300% | 122  | 4.838,313196 | 590.274,21   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 09/04/2020  | Curva - Taxa: 4,7300% | 124  | 4.769,682201 | 591.440,59   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 15/05/2020  | Curva - Taxa: 4,6400% | 147  | 4.831,381691 | 710.213,11   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 23/11/2020  | Curva - Taxa: 4,3400% | 3    | 5.045,847128 | 15.137,54    |
| NTN-B - 15/08/2050 | 10/03/2021  | Curva - Taxa: 4,1500% | 19   | 5.189,016517 | 98.591,31    |
| NTN-B - 15/08/2050 | 10/09/2021  | Curva - Taxa: 4,7800% | 69   | 4.735,914343 | 326.778,09   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 15/08/2022  | Curva - Taxa: 5,8600% | 29   | 4.086,658085 | 118.513,08   |
| NTN-B - 15/05/2055 | 01/09/2021  | Curva - Taxa: 4,7600% | 359  | 4.865,003248 | 1.746.536,17 |
| NTN-B - 15/05/2055 | 10/09/2021  | Curva - Taxa: 4,8000% | 134  | 4.835,719319 | 647.986,39   |

## Investimentos

\$ 75.761.653,87

## Disponibilidades Financeiras

\$ 808.367,75

## Total Carteira

\$ 76.570.021,62

## Governança (Pró Gestão)

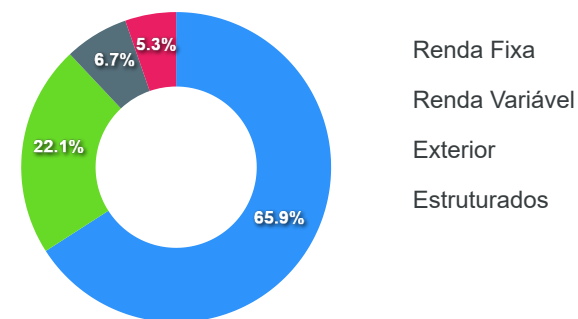
Não possui

| Artigos                        | Limite (%) | Utilizado | Livre                |
|--------------------------------|------------|-----------|----------------------|
| 7º I a - Títulos TN SELIC      | 100,00%    | 13,37%    | 10.237.523,51 86,63% |
| 7º I b - FI 100% Títulos TN    | 100,00%    | 23,37%    | 17.895.791,15 76,63% |
| 7º III a - FI Referenciados RF | 60,00%     | 28,48%    | 21.805.331,92 31,52% |
| 8º I - Fundos de Ações         | 30,00%     | 21,83%    | 16.717.994,09 8,17%  |
| 9º II - Constituídos no Brasil | 10,00%     | 3,34%     | 2.554.450,28 6,66%   |
| 9º III - Ações - BDR Nível I   | 10,00%     | 3,29%     | 2.517.780,42 6,71%   |
| 10º I - Fundos Multimercados   | 10,00%     | 5,27%     | 4.032.782,50 4,73%   |

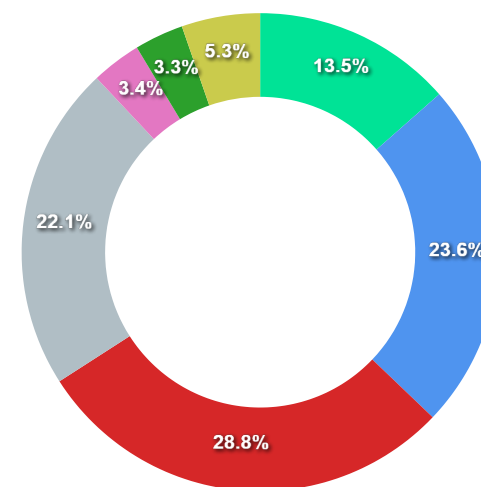
### Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

### Segmentos



### Artigos



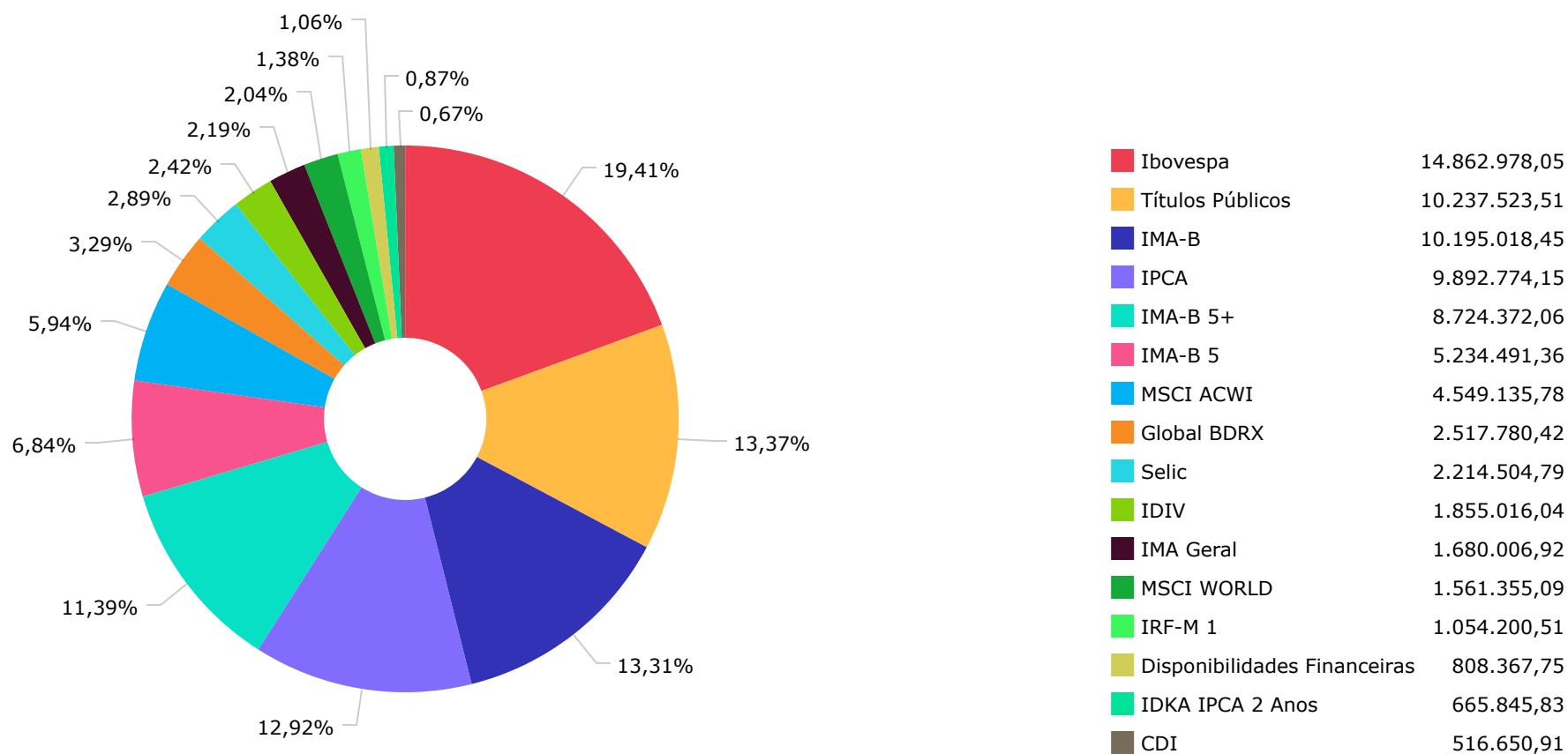
| Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo   | Superior | GAP Superior  | Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo  | Superior | GAP Superior  |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|---------------|-----------------------------------|--------|----------|-------|----------|---------------|
| 7º I a - Títulos TN SELIC         | 13,37% | 0,00%    | 15,00% | 100,00%  | 66.332.498,11 | 8º I - Fundos de Ações            | 21,83% | 0,00%    | 7,00% | 30,00%   | 6.253.012,40  |
| 7º I b - FI 100% Títulos TN       | 23,37% | 0,00%    | 50,00% | 100,00%  | 58.674.230,47 | 8º II - ETF de Ações              | 0,00%  | 0,00%    | 2,00% | 30,00%   | 22.971.006,49 |
| 7º II - Operações Compromissad... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 3.828.501,08  | 9º I - Renda Fixa - Dívida Ext... | 0,00%  | 0,00%    | 1,00% | 10,00%   | 7.657.002,16  |
| 7º III a - FI Referenciados RF    | 28,48% | 0,00%    | 11,00% | 60,00%   | 24.136.681,05 | 9º II - Constituídos no Brasil    | 3,34%  | 0,00%    | 1,00% | 10,00%   | 5.102.551,88  |
| 7º III b - FI de Índices Refer... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 60,00%   | 45.942.012,97 | 9º III - Ações - BDR Nível I      | 3,29%  | 0,00%    | 4,00% | 10,00%   | 5.139.221,74  |
| 7º IV - Ativos Financeiros de ... | 0,00%  | 0,00%    | 3,00%  | 20,00%   | 15.314.004,32 | 10º I - Fundos Multimercados      | 5,27%  | 0,00%    | 5,00% | 10,00%   | 3.624.219,66  |
| 7º V a - FIDC Cota Sênior         | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 3.828.501,08  | 10º II - Fundos em Participaçõ... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 5,00%    | 3.828.501,08  |
| 7º V b - Fundos de RF - Crédit... | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 5,00%    | 3.828.501,08  | 10º III - Fundos de Ações - Me... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 5,00%    | 3.828.501,08  |
| 7º V c - Fundos de Debentures ... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 3.828.501,08  | 11º - Fundos Imobiliários         | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 5,00%    | 3.828.501,08  |
|                                   |        |          |        |          |               | 12º - Empréstimos Consignados     | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 5,00%    | 3.828.501,08  |

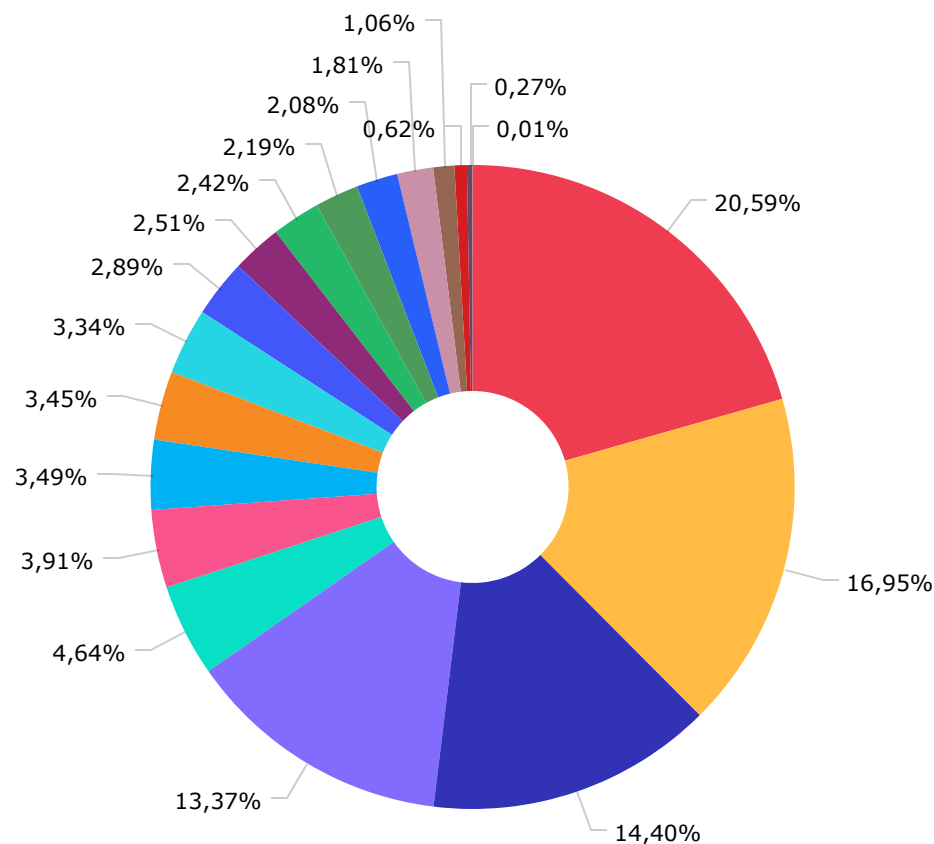
|                                                             | Mês         | Ano           | 3M           | 6M           | 12M           | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-------------------------------------------------------------|-------------|---------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>CDI - BENCHMARK</b>                                      | <b>1,02</b> | <b>10,00</b>  | <b>3,30</b>  | <b>6,51</b>  | <b>11,49</b>  | <b>15,20</b> |           |                    |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                    | 1,88        | 11,16         | 5,61         | 6,99         | 13,11         | 17,94        | 2,04      | 4,29               |
| SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI      | 1,05        | 10,45         | 3,41         | 6,76         | 12,04         | 16,48        | 0,02      | 0,05               |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP              | 1,01        | 10,13         | 3,32         | 6,57         | 11,65         | 15,31        | 0,02      | 0,03               |
| <b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>                              | <b>1,33</b> | <b>-29,86</b> | <b>-9,99</b> | <b>-6,55</b> | <b>-29,14</b> | <b>-2,97</b> |           |                    |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I                                  | 6,44        | -16,20        | -3,47        | 2,69         | -16,39        | 17,43        | 15,40     | 32,44              |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                    | 1,70        | -29,79        | -9,82        | -6,27        | -29,23        | -5,49        | 16,62     | 34,99              |
| <b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>                                 | <b>5,45</b> | <b>10,70</b>  | <b>12,48</b> | <b>7,57</b>  | <b>12,11</b>  | <b>23,51</b> |           |                    |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES                              | 5,41        | 13,80         | 11,43        | 6,85         | 16,82         | 29,56        | 13,41     | 28,24              |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                                 | 5,78        | 14,43         | 13,32        | 10,57        | 14,43         | 10,06        | 14,75     | 31,07              |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                      | 10,60       | 12,92         | 16,65        | 14,07        | 12,37         | 23,30        | 12,57     | 26,47              |
| BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES                             | 5,42        | 10,57         | 12,44        | 7,52         | 12,02         | 22,99        | 14,15     | 29,80              |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES                                      | 5,63        | 9,42          | 12,43        | 6,59         | 11,18         | 21,41        | 14,23     | 29,97              |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                           | 7,88        | 10,63         | 14,51        | 9,41         | 10,38         | 13,28        | 13,53     | 28,50              |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES          | 7,28        | 8,46          | 14,31        | 9,46         | 6,39          | 2,82         | 13,87     | 29,21              |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                        | 6,95        | 7,34          | 13,29        | 7,65         | 4,78          | 9,46         | 14,54     | 30,62              |
| SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES                                | 6,91        | 4,44          | 13,89        | 9,19         | 3,38          | 1,16         | 14,45     | 30,43              |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES                | 7,78        | 6,99          | 13,61        | 9,35         | -0,87         | -16,53       | 14,77     | 31,12              |
| <b>IDIV - BENCHMARK</b>                                     | <b>4,03</b> | <b>13,61</b>  | <b>6,51</b>  | <b>3,76</b>  | <b>16,46</b>  | <b>32,51</b> |           |                    |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES                                   | 3,84        | 12,45         | 6,12         | 3,09         | 15,09         | 27,50        | 13,26     | 27,92              |
| <b>IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK</b>                         | <b>1,78</b> | <b>8,84</b>   | <b>2,04</b>  | <b>3,22</b>  | <b>12,50</b>  | <b>17,69</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,83        | 8,48          | 2,24         | 3,04         | 11,90         | 16,82        | 0,85      | 1,79               |

|                                                               | Mês         | Ano         | 3M           | 6M          | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---------------------------------------------------------------|-------------|-------------|--------------|-------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>IMA GERAL - BENCHMARK</b>                                  | <b>1,01</b> | <b>8,88</b> | <b>3,72</b>  | <b>5,61</b> | <b>11,80</b> | <b>12,98</b> |           |                    |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA               | 0,99        | 8,62        | 3,65         | 5,35        | 11,64        | 11,91        | 0,71      | 1,49               |
| <b>IMA-B - BENCHMARK</b>                                      | <b>1,23</b> | <b>7,43</b> | <b>3,86</b>  | <b>3,57</b> | <b>11,40</b> | <b>13,44</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 1,18        | 7,34        | 3,92         | 3,56        | 11,26        | 13,01        | 1,58      | 3,33               |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP        | 1,10        | 7,24        | 3,84         | 3,57        | 11,14        | 12,92        | 1,62      | 3,41               |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 1,19        | 7,18        | 3,77         | 3,47        | 11,09        | 12,87        | 1,55      | 3,26               |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA                                  | 1,26        | 7,36        | 3,65         | 3,44        | 11,02        | 12,72        | 1,42      | 3,00               |
| <b>IMA-B 5 - BENCHMARK</b>                                    | <b>1,91</b> | <b>9,12</b> | <b>2,35</b>  | <b>3,50</b> | <b>12,73</b> | <b>17,73</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 1,88        | 9,05        | 2,36         | 3,51        | 12,60        | 17,31        | 0,75      | 1,57               |
| <b>IMA-B 5+ - BENCHMARK</b>                                   | <b>0,65</b> | <b>5,79</b> | <b>5,62</b>  | <b>3,73</b> | <b>10,15</b> | <b>9,03</b>  |           |                    |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA                | 0,62        | 5,53        | 5,55         | 3,58        | 9,54         | 8,03         | 2,42      | 5,10               |
| <b>IPCA - BENCHMARK</b>                                       | <b>0,59</b> | <b>4,70</b> | <b>-0,06</b> | <b>0,39</b> | <b>6,47</b>  | <b>17,83</b> |           |                    |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA           | 0,88        | 9,36        | 3,05         | 5,73        | 12,11        | 14,66        | 1,08      | 2,28               |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                | 0,99        | 9,36        | 3,75         | 5,92        | 11,26        | 11,59        | 0,47      | 0,98               |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,01        | 8,59        | 3,46         | 5,57        | 11,11        | 13,25        | 0,73      | 1,54               |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                     | 1,09        | 8,33        | 3,73         | 5,30        | 10,77        | 11,72        | 0,89      | 1,87               |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA                                | 0,88        | 8,09        | 2,96         | 5,21        | 10,39        | 12,42        | 0,57      | 1,19               |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,46        |             | 2,43         |             |              |              | 1,31      | 2,77               |
| CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA              | 2,24        |             | 2,18         | -0,23       |              |              | 0,53      | 1,12               |
| <b>IRF-M 1 - BENCHMARK</b>                                    | <b>1,00</b> | <b>9,68</b> | <b>3,38</b>  | <b>6,44</b> | <b>11,52</b> | <b>13,50</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 0,98        | 9,45        | 3,32         | 6,31        | 11,24        | 12,97        | 0,03      | 0,07               |

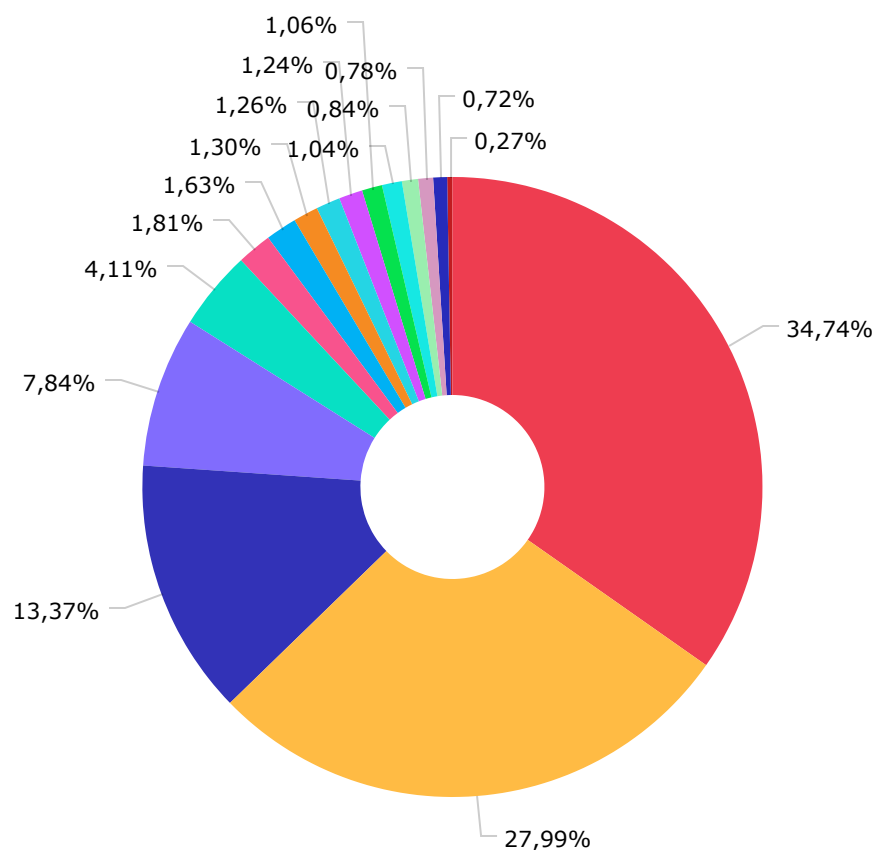


|                                                                            | Mês         | Ano           | 3M           | 6M           | 12M           | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|----------------------------------------------------------------------------|-------------|---------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>SELIC - BENCHMARK</b>                                                   | <b>1,02</b> | <b>10,00</b>  | <b>3,30</b>  | <b>6,51</b>  | <b>11,49</b>  | <b>15,20</b> |           |                    |
| BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                        | 1,01        | 9,75          | 3,25         | 6,41         | 11,18         | 14,81        | 0,00      | 0,01               |
| <b>MSCI WORLD - BENCHMARK</b>                                              | <b>4,14</b> | <b>-25,74</b> | <b>-6,01</b> | <b>-2,61</b> | <b>-25,24</b> | <b>1,20</b>  |           |                    |
| ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES                      | 3,32        | -22,85        | -5,97        | -3,28        | -21,60        | -0,32        | 12,80     | 26,97              |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES        | -1,68       | -47,14        | -10,60       | -14,70       | -49,97        | -41,16       | 24,57     | 51,75              |
| <b>MSCI ACWI - BENCHMARK</b>                                               | <b>3,03</b> | <b>-26,82</b> | <b>-6,84</b> | <b>-4,13</b> | <b>-26,70</b> | <b>-3,07</b> |           |                    |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP                            | 8,77        | -12,72        | -3,83        | -1,40        | -8,31         | 32,33        | 13,19     | 27,78              |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES | 1,76        | -28,26        | -8,32        | -6,85        | -28,78        | -3,07        | 20,48     | 43,12              |

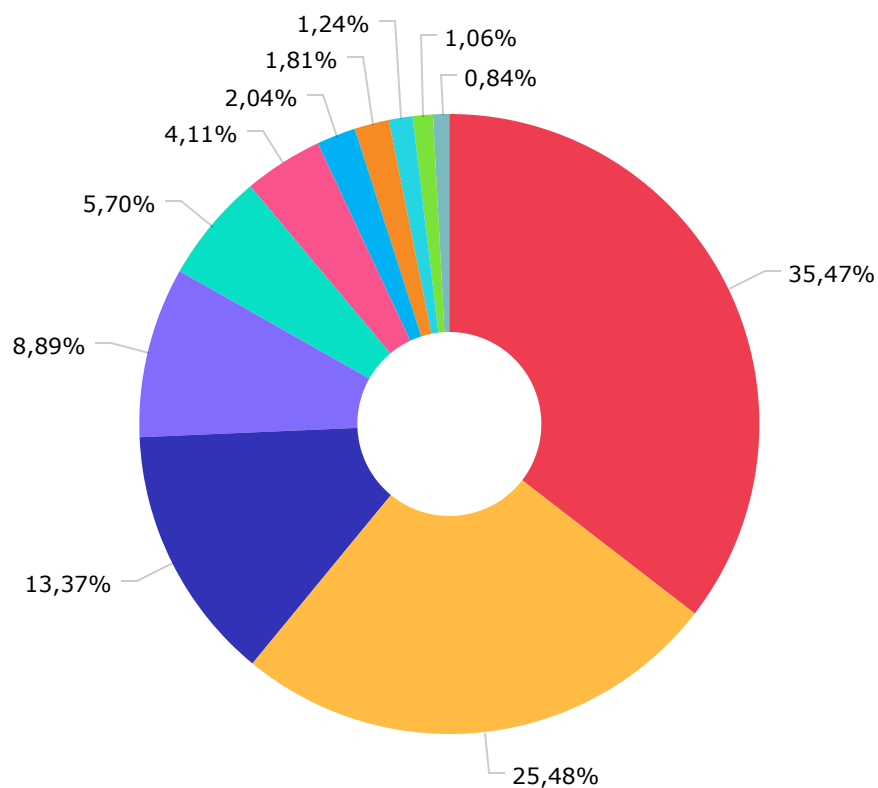




|                                               |               |
|-----------------------------------------------|---------------|
| Renda Fixa Indexados                          | 15.764.546,45 |
| Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento  | 12.977.379,61 |
| Ações Livre                                   | 11.024.454,60 |
| Títulos Públicos                              | 10.237.523,51 |
| Multimercados Livre                           | 3.556.040,59  |
| Renda Fixa Duração Livre Soberano             | 2.995.532,70  |
| Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre        | 2.676.008,78  |
| Ações Indexados                               | 2.639.676,04  |
| Ações Investimento no Exterior                | 2.554.450,28  |
| Renda Fixa Duração Baixa Soberano             | 2.214.504,79  |
| Ações Índice Ativo                            | 1.919.419,06  |
| Ações Dividendos                              | 1.855.016,04  |
| Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento | 1.680.006,92  |
| Ações Sustentabilidade/Governança             | 1.590.533,04  |
| Renda Fixa Duração Alta Soberano              | 1.385.009,70  |
| Disponibilidades Financeiras                  | 808.367,75    |
| Multimercados Macro                           | 476.741,91    |
| Ações Valor/Crescimento                       | 206.675,73    |
| Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento | 8.134,12      |



|                                    |               |
|------------------------------------|---------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL            | 26.603.896,59 |
| BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN... | 21.430.986,42 |
| TESOURO NACIONAL                   | 10.237.523,51 |
| ITAU UNIBANCO S.A.                 | 6.005.163,79  |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...  | 3.148.026,74  |
| BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA     | 1.385.009,70  |
| CONSTANCIA INVESTIMENTOS LTDA.     | 1.247.206,64  |
| SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...  | 993.095,19    |
| BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT B...  | 967.024,39    |
| BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...  | 945.691,33    |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA         | 808.367,75    |
| ITAÚ DTVM S.A.                     | 798.115,01    |
| SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...  | 644.782,32    |
| XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT...  | 594.330,70    |
| CAIXA DTVM                         | 554.125,81    |
| SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...  | 206.675,73    |



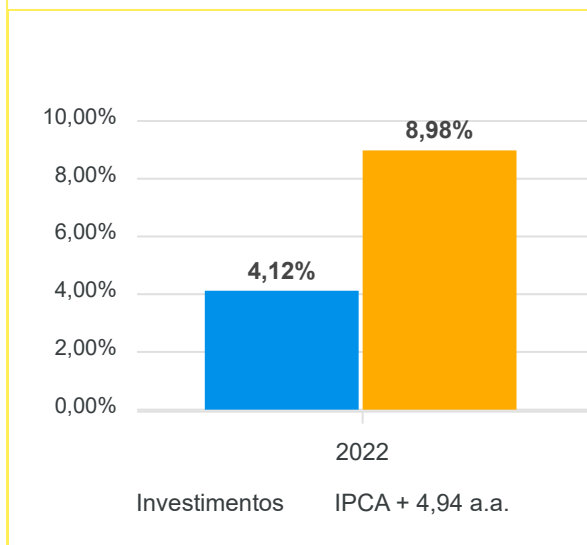
|                                   |               |
|-----------------------------------|---------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 27.158.022,40 |
| BANCO BRADESCO S.A.               | 19.511.567,36 |
| TESOURO NACIONAL                  | 10.237.523,51 |
| ITAU UNIBANCO S.A.                | 6.803.278,80  |
| BEM DTVM                          | 4.366.396,62  |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 3.148.026,74  |
| BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.     | 1.561.355,09  |
| SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S... | 1.385.009,70  |
| BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR... | 945.691,33    |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA        | 808.367,75    |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.     | 644.782,32    |

| Mês       | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual   | Retorno \$    | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|--------------|--------------|---------------|---------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro   | 66.118.674,40  | 90.761,29    | 461.700,00   | 65.892.097,87 | 144.362,18    | 144.362,18           | 0,22% ▲   | 0,22%               | 0,94%  | 0,94%            | 23,40%                     | 3,98%       |
| Fevereiro | 65.892.097,87  | 551.931,79   | 0,00         | 66.253.446,38 | -190.583,28   | -46.221,10           | -0,29% ▼  | -0,07%              | 1,38%  | 2,34%            | -2,99%                     | 3,38%       |
| Março     | 66.253.446,38  | 7.609.551,74 | 6.504.000,00 | 68.710.913,19 | 1.351.915,07  | 1.305.693,97         | 2,01% ▲   | 1,94%               | 2,05%  | 4,43%            | 43,79%                     | 4,50%       |
| Abril     | 68.710.913,19  | 1.030.658,62 | 361.000,00   | 67.922.705,36 | -1.457.866,45 | -152.172,48          | -2,10% ▼  | -0,21%              | 1,43%  | 5,92%            | -3,55%                     | 2,97%       |
| Mai       | 67.922.705,36  | 1.181.885,38 | 602.126,32   | 69.098.265,46 | 595.801,04    | 443.628,56           | 0,87% ▲   | 0,66%               | 0,89%  | 6,87%            | 9,61%                      | 4,30%       |
| Junho     | 69.098.265,46  | 2.537.512,41 | 1.646.389,74 | 68.278.597,03 | -1.710.791,10 | -1.267.162,54        | -2,44% ▼  | -1,80%              | 1,08%  | 8,02%            | -22,44%                    | 3,91%       |
| Julho     | 68.278.597,03  | 7.233.091,24 | 6.522.272,67 | 70.471.192,23 | 1.481.776,63  | 214.614,09           | 2,15% ▲   | 0,31%               | -0,28% | 7,72%            | 4,02%                      | 3,82%       |
| Agosto    | 70.471.192,23  | 1.693.155,31 | 785.217,66   | 72.429.285,47 | 1.050.155,59  | 1.264.769,68         | 1,47% ▲   | 1,79%               | 0,08%  | 7,80%            | 22,95%                     | 4,31%       |
| Setembro  | 72.429.285,47  | 1.264.287,95 | 476.900,00   | 72.935.129,50 | -281.543,92   | 983.225,76           | -0,38% ▼  | 1,40%               | 0,11%  | 7,92%            | 17,68%                     | 4,39%       |
| Outubro   | 72.935.129,50  | 6.390.229,78 | 5.544.350,38 | 75.761.653,87 | 1.980.644,97  | 2.963.870,73         | 2,68% ▲   | 4,12%               | 0,98%  | 8,98%            | 45,88%                     | 5,52%       |

## Retorno Acumulado (Períodos)

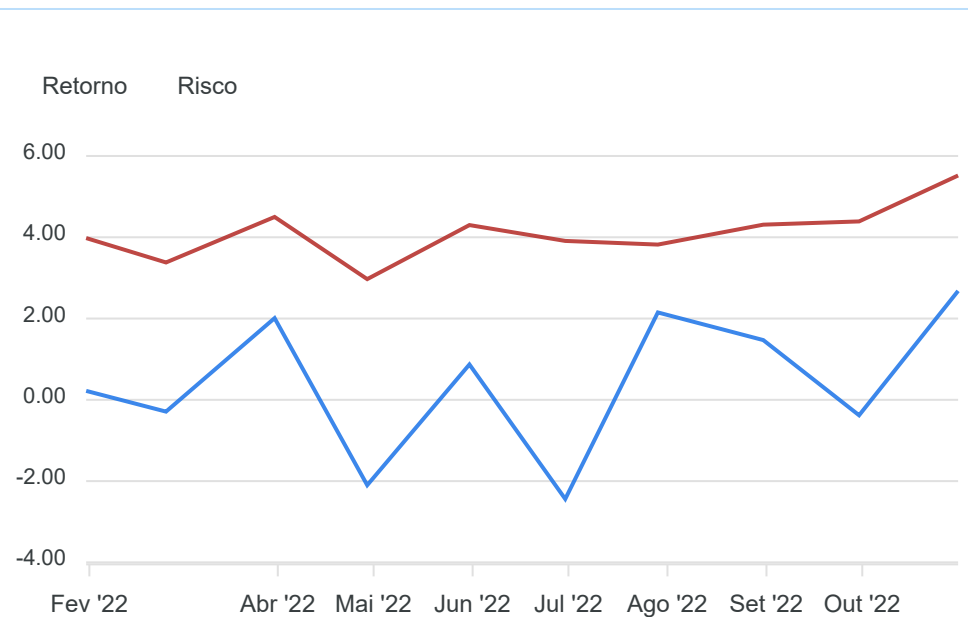
| Período | Retorno \$    | Retorno % | Meta % |
|---------|---------------|-----------|--------|
| 1º Trim | 1.305.693,97  | 1,94%     | 4,43%  |
| 2º Trim | -2.572.856,51 | -3,66%    | 3,44%  |
| 1º Sem  | -1.267.162,54 | -1,80%    | 8,02%  |
| 3º Trim | 2.250.388,30  | 3,25%     | -0,09% |

## Gráfico Retorno e Meta Acumulado

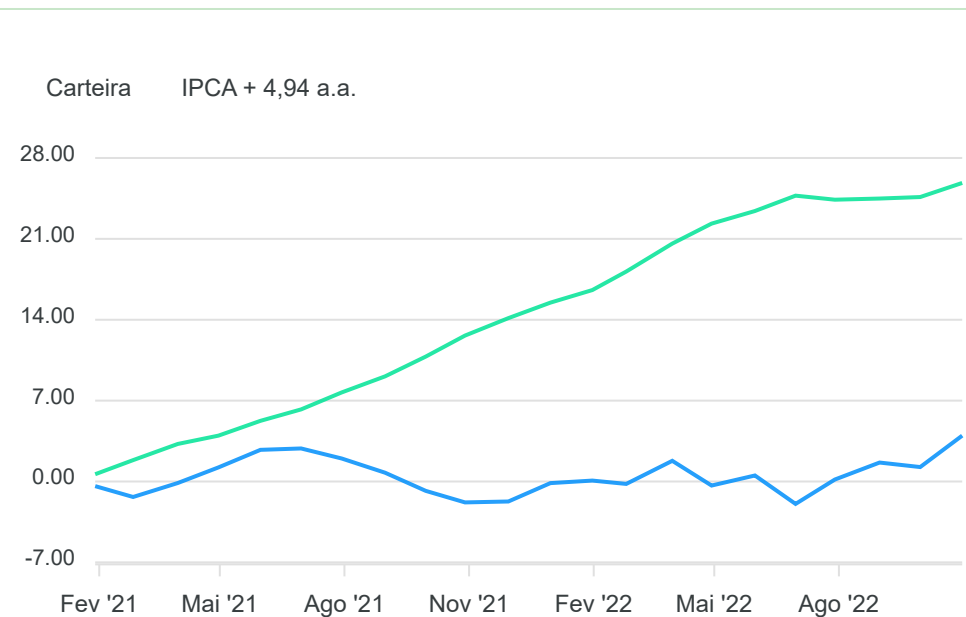


## Gráficos

**Gráfico Risco x Retorno**



**Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade**



| RENDA FIXA                                                    | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual   | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---------------------------------------------------------------|----------------|--------------|--------------|---------------|------------|-----------|-------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS                                              | 10.190.334,00  | 0,00         | 0,00         | 10.237.523,51 | 47.189,51  | 0,46% ▲   | -           |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 454.448,49     | 0,00         | 0,00         | 459.058,03    | 4.609,54   | 1,01% ▲   | 0,73%       |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 316.142,24     | 0,00         | 0,00         | 319.915,07    | 3.772,83   | 1,19% ▲   | 1,55%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 767.338,35     | 0,00         | 0,00         | 778.520,60    | 11.182,25  | 1,46% ▲   | 1,31%       |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA                                  | 1.367.835,07   | 0,00         | 0,00         | 1.385.009,70  | 17.174,63  | 1,26% ▲   | 1,42%       |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                     | 4.207.302,31   | 0,00         | 0,00         | 4.253.007,55  | 45.705,24  | 1,09% ▲   | 0,89%       |
| BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI          | 2.198.395,59   | 29.450,00    | 35.618,32    | 2.214.504,79  | 22.277,52  | 1,00% ▲   | 0,00%       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA                | 7.843.154,69   | 820.000,00   | 0,00         | 8.724.372,06  | 61.217,37  | 0,71% ▲   | 2,42%       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA               | 1.663.542,59   | 0,00         | 0,00         | 1.680.006,92  | 16.464,33  | 0,99% ▲   | 0,71%       |
| CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA              | 542.002,34     | 0,00         | 0,00         | 554.125,81    | 12.123,47  | 2,24% ▲   | 0,53%       |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                | 3.512.884,58   | 0,00         | 3.000.000,77 | 535.405,18    | 22.521,37  | 0,64% ▲   | 0,47%       |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 2.639.742,25   | 0,00         | 2.000.000,00 | 665.845,83    | 26.103,58  | 0,99% ▲   | 0,85%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 5.138.130,72   | 0,00         | 0,00         | 5.234.491,36  | 96.360,64  | 1,88% ▲   | 0,75%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 2.258.016,02   | 5.000.000,00 | 0,00         | 7.336.502,21  | 78.486,19  | 1,08% ▲   | 1,58%       |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 1.043.917,87   | 0,00         | 0,00         | 1.054.200,51  | 10.282,64  | 0,99% ▲   | 0,03%       |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                | 31.456,22      | 0,00         | 0,00         | 31.774,88     | 318,66     | 1,01% ▲   | 0,02%       |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP        | 1.141.070,87   | 0,00         | 0,00         | 1.153.591,47  | 12.520,60  | 1,10% ▲   | 1,62%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA           | 2.652.680,50   | 0,00         | 0,00         | 2.676.008,78  | 23.328,28  | 0,88% ▲   | 1,08%       |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA                                | 602.760,39     | 28.420,00    | 0,00         | 636.648,20    | 5.467,81   | 0,87% ▲   | 0,57%       |
| SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI        | 2.004,17       | 512.359,78   | 508.731,29   | 8.134,12      | 2.501,46   | 0,49% ▲   | 0,02%       |
|                                                               | 48.573.159,26  | 6.390.229,78 | 5.544.350,38 | 49.938.646,58 | 519.607,92 | 1,05%     | 1,04%       |



| RENDA VARIÁVEL                                     | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$   | Retorno % | Risco - VaR |
|----------------------------------------------------|----------------|------------|----------|---------------|--------------|-----------|-------------|
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES                             | 1.505.727,13   | 0,00       | 0,00     | 1.590.533,04  | 84.805,91    | 5,63% ▲   | 14,23%      |
| BRADERCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES                    | 2.503.887,22   | 0,00       | 0,00     | 2.639.676,04  | 135.788,82   | 5,42% ▲   | 14,15%      |
| BRADERCO SELECTION FI AÇÕES                        | 1.814.458,35   | 0,00       | 0,00     | 1.919.419,06  | 104.960,71   | 5,78% ▲   | 14,75%      |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES       | 877.401,43     | 0,00       | 0,00     | 945.691,33    | 68.289,90    | 7,78% ▲   | 14,77%      |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                  | 3.156.219,44   | 0,00       | 0,00     | 3.404.871,19  | 248.651,75   | 7,88% ▲   | 13,53%      |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP           | 467.945,86     | 0,00       | 0,00     | 476.741,91    | 8.796,05     | 1,88% ▲   | 2,04%       |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES                          | 1.786.350,41   | 0,00       | 0,00     | 1.855.016,04  | 68.665,63    | 3,84% ▲   | 13,26%      |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP    | 3.269.246,26   | 0,00       | 0,00     | 3.556.040,59  | 286.794,33   | 8,77% ▲   | 13,19%      |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES                     | 1.183.229,38   | 0,00       | 0,00     | 1.247.206,64  | 63.977,26    | 5,41% ▲   | 13,41%      |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                             | 1.528.036,89   | 0,00       | 0,00     | 1.689.971,53  | 161.934,64   | 10,60% ▲  | 12,57%      |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES | 743.967,96     | 0,00       | 0,00     | 798.115,01    | 54.147,05    | 7,28% ▲   | 13,87%      |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES               | 393.486,66     | 0,00       | 0,00     | 420.818,48    | 27.331,82    | 6,95% ▲   | 14,54%      |
| SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES                       | 193.320,61     | 0,00       | 0,00     | 206.675,73    | 13.355,12    | 6,91% ▲   | 14,45%      |
| -                                                  | 19.423.277,60  | 0,00       | 0,00     | 20.750.776,59 | 1.327.498,99 | 6,83%     | 13,44%      |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR                                                  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual  | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|----------------------------------------------------------------------------|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES                      | 935.944,81     | 0,00       | 0,00     | 967.024,39   | 31.079,58  | 3,32% ▲   | 12,80%      |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                                   | 1.277.656,86   | 0,00       | 0,00     | 1.299.415,42 | 21.758,56  | 1,70% ▲   | 16,62%      |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I                                                 | 1.144.669,25   | 0,00       | 0,00     | 1.218.365,00 | 73.695,75  | 6,44% ▲   | 15,40%      |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES        | 604.494,27     | 0,00       | 0,00     | 594.330,70   | -10.163,57 | -1,68% ▼  | 24,57%      |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES | 975.927,45     | 0,00       | 0,00     | 993.095,19   | 17.167,74  | 1,76% ▲   | 20,48%      |
|                                                                            | 4.938.692,64   | 0,00       | 0,00     | 5.072.230,70 | 133.538,06 | 2,70%     | 13,28%      |

