

2022

Relatório Mensal e 3º trimestre de 2022

Setembro

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	10.190.334,00	13,97%	0,00		7º I a
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	316.142,24	0,43%	5.858.339.074,80	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	767.338,35	1,05%	333.772.907,97	0,23%	7º I b
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1.367.835,07	1,88%	185.371.118,62	0,74%	7º I b
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	542.002,34	0,74%	3.960.240.224,82	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.512.884,58	4,82%	5.850.800.339,33	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.639.742,25	3,62%	8.482.726.221,67	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.138.130,72	7,04%	8.885.835.879,64	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.258.016,02	3,10%	3.871.147.074,69	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.043.917,87	1,43%	5.416.816.231,94	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	31.456,22	0,04%	17.792.135.878,61	0,00%	7º I b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	454.448,49	0,62%	3.121.665.296,26	0,01%	7º III a
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.207.302,31	5,77%	732.828.718,65	0,57%	7º III a
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.198.395,59	3,01%	8.586.212.412,21	0,03%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	7.843.154,69	10,75%	139.890.494,25	5,61%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1.663.542,59	2,28%	219.512.384,08	0,76%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.141.070,87	1,56%	1.761.108.354,50	0,06%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.652.680,50	3,64%	2.451.788.610,47	0,11%	7º III a
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	602.760,39	0,83%	348.188.196,97	0,17%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.004,17	0,00%	2.713.701.445,40	0,00%	7º III a
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.505.727,13	2,06%	882.000.687,94	0,17%	8º I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.503.887,22	3,43%	360.078.231,51	0,70%	8º I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.814.458,35	2,49%	493.369.883,54	0,37%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	877.401,43	1,20%	1.434.580.736,08	0,06%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.156.219,44	4,33%	678.381.558,66	0,47%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.786.350,41	2,45%	234.755.585,42	0,76%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.183.229,38	1,62%	1.247.768.059,62	0,09%	8º I

Investimentos

\$ 72.935.129,50

Disponibilidades Financeiras

\$ 1.172.962,84

Total Carteira

\$ 74.108.092,34

Governança (Pró Gestão)

Não possui

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.528.036,89	2,10%	2.441.913.855,38	0,06%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	743.967,96	1,02%	203.988.888,32	0,36%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	393.486,66	0,54%	561.410.693,77	0,07%	8º I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	193.320,61	0,27%	183.604.301,61	0,11%	8º I
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	935.944,81	1,28%	61.786.349,11	1,51%	9º II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	604.494,27	0,83%	551.200.355,41	0,11%	9º II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	975.927,45	1,34%	263.717.596,44	0,37%	9º II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.277.656,86	1,75%	2.057.509.929,37	0,06%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.144.669,25	1,57%	134.195.082,89	0,85%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	467.945,86	0,64%	2.178.950.672,02	0,02%	10º I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.269.246,26	4,48%	1.721.873.439,88	0,19%	10º I

Investimentos

 72.935.129,50

Disponibilidades Financeiras

 1.172.962,84

Total Carteira

 74.108.092,34

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	4.228,588703	122.629,07
NTN-B - 15/05/2035	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,6800%	20	4.527,346120	90.546,92
NTN-B - 15/08/2040	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7500%	49	4.565,059158	223.687,90
NTN-B - 15/05/2045	26/03/2020	Curva - Taxa: 4,5500%	146	4.835,643391	706.003,94
NTN-B - 15/05/2045	09/09/2021	Curva - Taxa: 4,8600%	351	4.649,578710	1.632.002,13
NTN-B - 15/05/2045	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	72	4.708,449288	339.008,35
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2019	Curva - Taxa: 4,4000%	122	4.979,946029	607.553,42
NTN-B - 15/08/2050	31/03/2020	Curva - Taxa: 4,4600%	71	4.936,469576	350.489,34
NTN-B - 15/08/2050	02/04/2020	Curva - Taxa: 4,5900%	146	4.844,175932	707.249,69
NTN-B - 15/08/2050	06/04/2020	Curva - Taxa: 4,6800%	123	4.781,769880	588.157,70
NTN-B - 15/08/2050	08/04/2020	Curva - Taxa: 4,6300%	122	4.816,291116	587.587,52
NTN-B - 15/08/2050	09/04/2020	Curva - Taxa: 4,7300%	124	4.747,616018	588.704,39
NTN-B - 15/08/2050	15/05/2020	Curva - Taxa: 4,6400%	147	4.809,358427	706.975,69
NTN-B - 15/08/2050	23/11/2020	Curva - Taxa: 4,3400%	3	5.023,987367	15.071,96
NTN-B - 15/08/2050	10/03/2021	Curva - Taxa: 4,1500%	19	5.167,286641	98.178,45
NTN-B - 15/08/2050	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7800%	69	4.713,821628	325.253,69
NTN-B - 15/08/2050	15/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	29	4.064,285949	117.864,29
NTN-B - 15/05/2055	01/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	359	4.842,382518	1.738.415,32
NTN-B - 15/05/2055	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,8000%	134	4.813,091413	644.954,25

Investimentos

\$ 72.935.129,50

Disponibilidades Financeiras

\$ 1.172.962,84

Total Carteira

\$ 74.108.092,34

Governança (Pró Gestão)

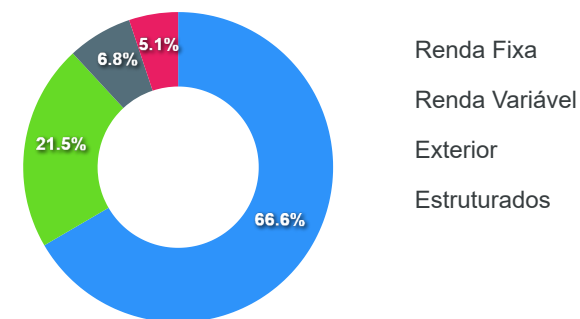
Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	13,75%	10.190.334,00 86,25%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	23,77%	17.617.465,66 76,23%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	28,02%	20.765.359,60 31,98%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	21,17%	15.686.085,48 8,83%
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,40%	2.516.366,53 6,60%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,27%	2.422.326,11 6,73%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	5,04%	3.737.192,12 4,96%

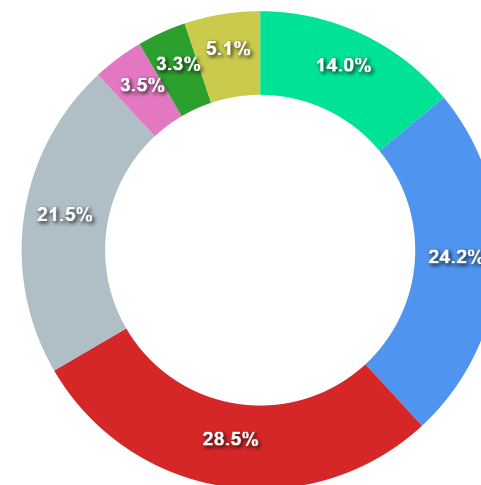
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos

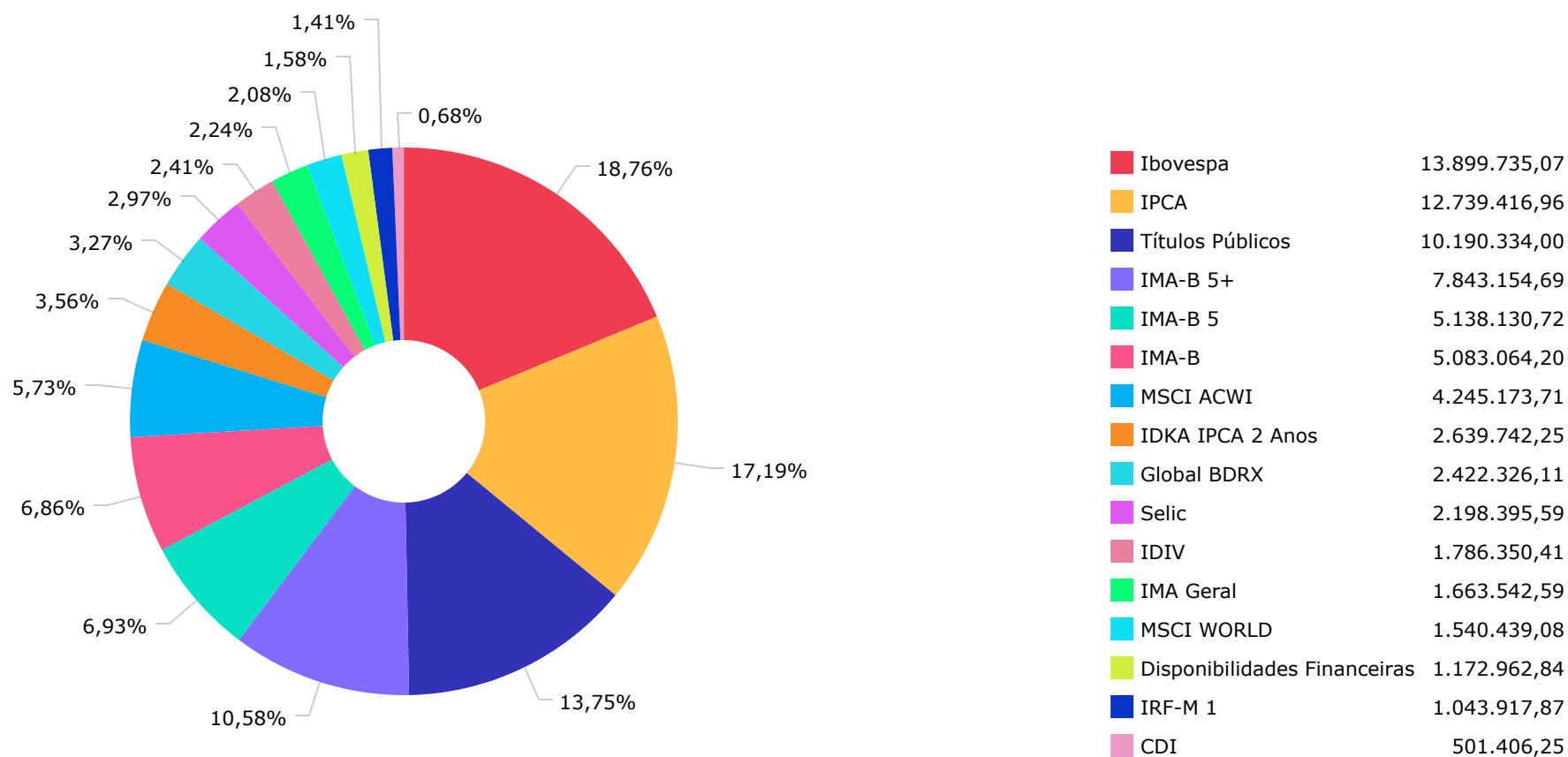


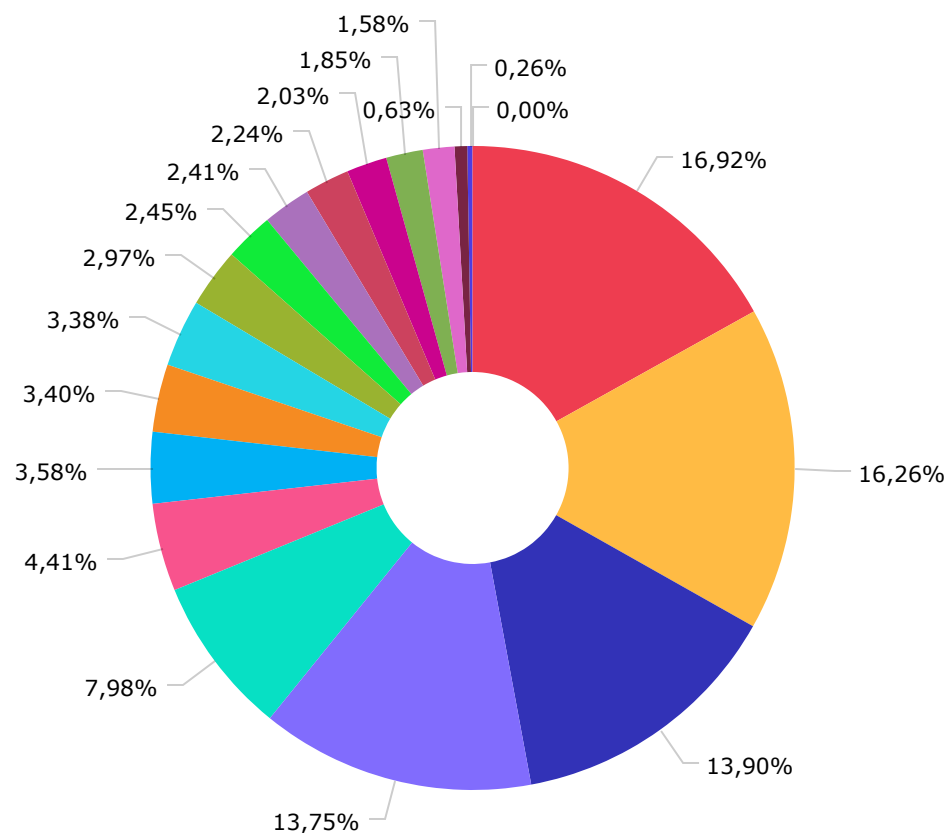
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	13,75%	0,00%	15,00%	100,00%	63.917.758,34	8º I - Fundos de Ações	21,17%	0,00%	7,00%	30,00%	6.546.342,22
7º I b - FI 100% Títulos TN	23,77%	0,00%	50,00%	100,00%	56.490.626,68	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	22.232.427,70
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.705.404,62	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	7.410.809,23
7º III a - FI Referenciados RF	28,02%	0,00%	11,00%	60,00%	23.699.495,80	9º II - Constituídos no Brasil	3,40%	0,00%	1,00%	10,00%	4.894.442,70
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	44.464.855,40	9º III - Ações - BDR Nível I	3,27%	0,00%	4,00%	10,00%	4.988.483,12
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	14.821.618,47	10º I - Fundos Multimercados	5,04%	0,00%	5,00%	10,00%	3.673.617,11
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.705.404,62	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.705.404,62
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.705.404,62	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.705.404,62
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.705.404,62	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.705.404,62
						12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.705.404,62

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21		
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12	9,30	3,41	6,53	11,54	15,48	0,02	0,03
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09	9,03	3,33	6,29	11,10	14,29	0,02	0,04
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,41	9,11	4,90	4,84	10,03	15,37	1,55	3,26
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	-8,38	-30,78	-4,37	-14,20	-22,27	-5,91		
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,63	-21,27	-4,53	-8,92	-13,80	8,07	8,21	17,28
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,72	-30,97	-4,35	-14,12	-22,81	-8,72	9,55	20,12
IBOVESPA - BENCHMARK	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31		
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,08	7,96	10,66	-2,51	3,16	20,85	8,90	18,74
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	0,45	4,88	11,63	-8,33	-0,94	15,81	11,17	23,52
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-1,35	8,17	13,87	-3,35	-1,15	7,51	11,50	24,22
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-0,13	3,58	11,14	-9,22	-3,03	14,00	11,04	23,25
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-1,00	2,10	11,81	-3,37	-6,05	12,04	10,07	21,21
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,69	2,56	11,57	-6,47	-8,05	3,01	10,03	21,13
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	-0,26	1,10	12,82	-8,74	-11,81	-4,69	10,16	21,40
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-1,48	0,36	12,40	-9,65	-13,57	-1,92	10,21	21,50
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	0,02	-2,31	11,23	-7,19	-14,49	-8,77	10,81	22,78
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,31	-0,74	14,37	-9,67	-20,04	-23,90	9,85	20,74
IDIV - BENCHMARK	-1,80	9,21	4,42	-5,43	7,21	28,20		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,87	8,29	4,08	-5,75	6,09	22,82	9,75	20,54
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	2,60	8,47	14,89	1,50	3,17

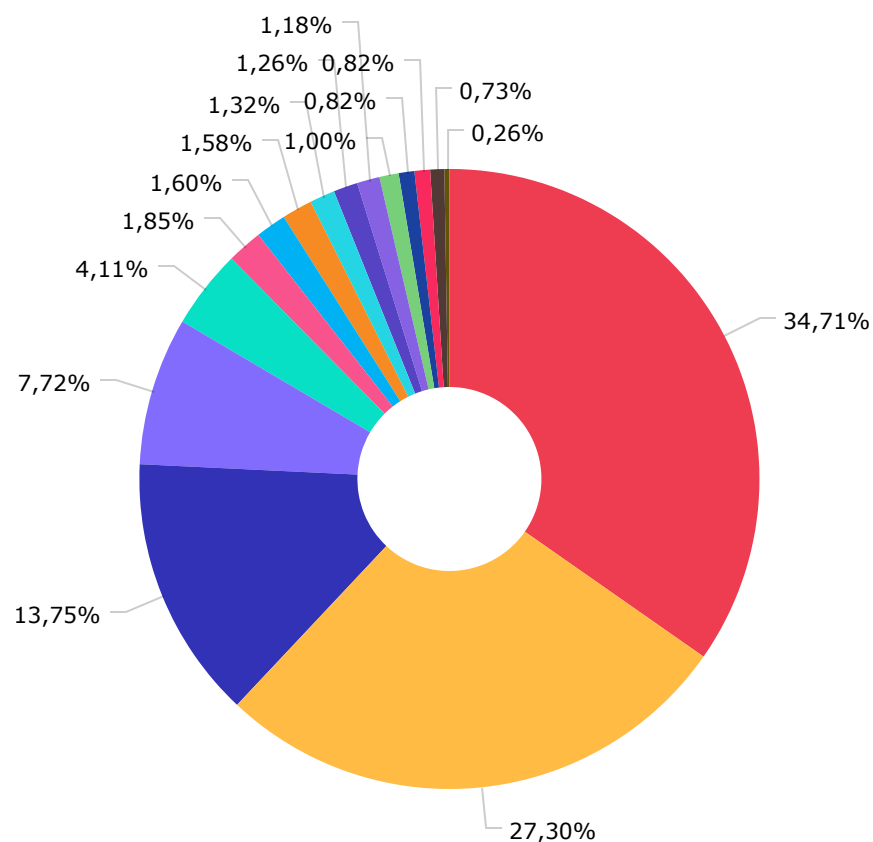
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA GERAL - BENCHMARK	1,26	7,80	3,17	5,13	9,24	11,95		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1,21	7,55	3,07	4,90	8,81	10,90	1,19	2,51
IMA-B - BENCHMARK	1,48	6,12	1,70	3,16	7,25	12,30		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50	6,09	1,76	3,18	7,15	11,91	2,47	5,20
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,52	6,08	1,80	3,22	7,12	11,91	2,52	5,31
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,31	6,03	1,59	3,04	7,07	11,49	2,22	4,68
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45	5,92	1,63	3,07	6,95	11,76	2,43	5,11
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	2,66
IMA-B 5+ - BENCHMARK	2,39	5,10	3,01	3,14	5,19	8,56		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2,37	4,88	2,95	2,96	4,54	7,59	3,67	7,72
IPCA - BENCHMARK	-0,29	4,09	-1,32	0,86	7,17	18,15		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,53	8,40	2,97	5,62	10,74	13,75	2,07	4,35
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,24	8,29	3,54	5,84	9,44	10,38	0,79	1,66
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25	7,50	3,07	5,15	9,00	12,03	1,12	2,36
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1,07	7,15	2,71	5,10	8,83	11,44	0,90	1,90
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,29	7,17	2,97	4,71	8,80	10,21	1,39	2,93
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,08		0,02	-0,25			0,75	1,57
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43		0,44				2,06	4,33
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,11	8,59	3,43	6,17	9,81	12,55		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,09	8,39	3,37	6,04	9,57	12,03	0,13	0,27

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
SELIC - BENCHMARK	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21		
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05	8,66	3,25	6,09	10,63	13,79	0,01	0,02
MSCI WORLD - BENCHMARK	-5,49	-28,69	-3,57	-11,09	-21,36	-3,69		
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	-5,93	-25,33	-3,29	-8,74	-17,98	-4,94	7,24	15,24
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-9,46	-46,23	1,59	-21,02	-45,36	-40,77	16,14	33,99
MSCI ACWI - BENCHMARK	-5,78	-28,97	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15		
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-8,62	-19,76	-2,65	-17,23	-9,27	18,60	11,70	24,65
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-6,57	-29,50	-3,00	-11,56	-24,72	-2,41	9,68	20,38

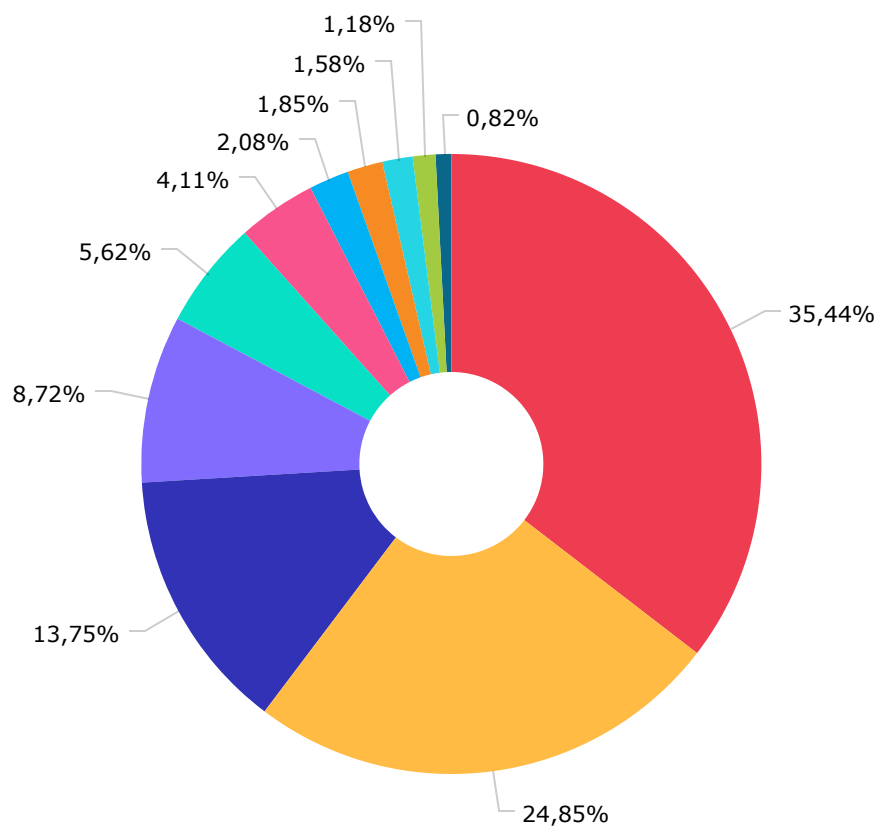




Renda Fixa Indexados	12.537.019,97
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	12.050.457,00
Ações Livre	10.304.667,87
Títulos Públicos	10.190.334,00
Renda Fixa Duração Livre Soberano	5.910.890,37
Multimercados Livre	3.269.246,26
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	2.652.680,50
Ações Investimento no Exterior	2.516.366,53
Ações Indexados	2.503.887,22
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	2.198.395,59
Ações Índice Ativo	1.814.458,35
Ações Dividendos	1.786.350,41
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	1.663.542,59
Ações Sustentabilidade/Governança	1.505.727,13
Renda Fixa Duração Alta Soberano	1.367.835,07
Disponibilidades Financeiras	1.172.962,84
Multimercados Macro	467.945,86
Ações Valor/Crescimento	193.320,61
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	2.004,17



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.722.637,36
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN...	20.230.740,75
TESOURO NACIONAL	10.190.334,00
ITAU UNIBANCO S.A.	5.718.873,30
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.043.656,21
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	1.367.835,07
CONSTANCIA INVESTIMENTOS LTDA.	1.183.229,38
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.172.962,84
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	975.927,45
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT B...	935.944,81
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	877.401,43
ITAÚ DTVM S.A.	743.967,96
SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...	604.764,56
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT...	604.494,27
CAIXA DTVM	542.002,34
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	193.320,61



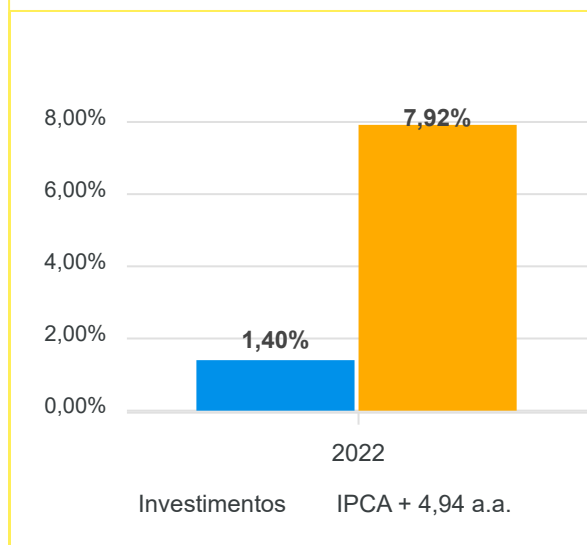
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	26.264.639,70
BANCO BRADESCO S.A.	18.416.282,40
TESOURO NACIONAL	10.190.334,00
ITAU UNIBANCO S.A.	6.462.841,26
BEM DTVM	4.166.935,79
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.043.656,21
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	1.540.439,08
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S...	1.367.835,07
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.172.962,84
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	877.401,43
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	604.764,56

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%

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

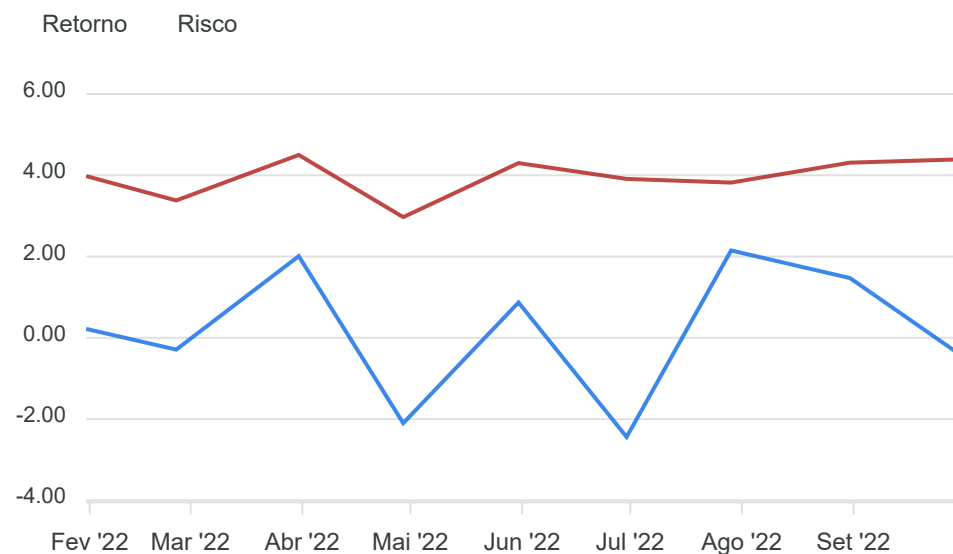
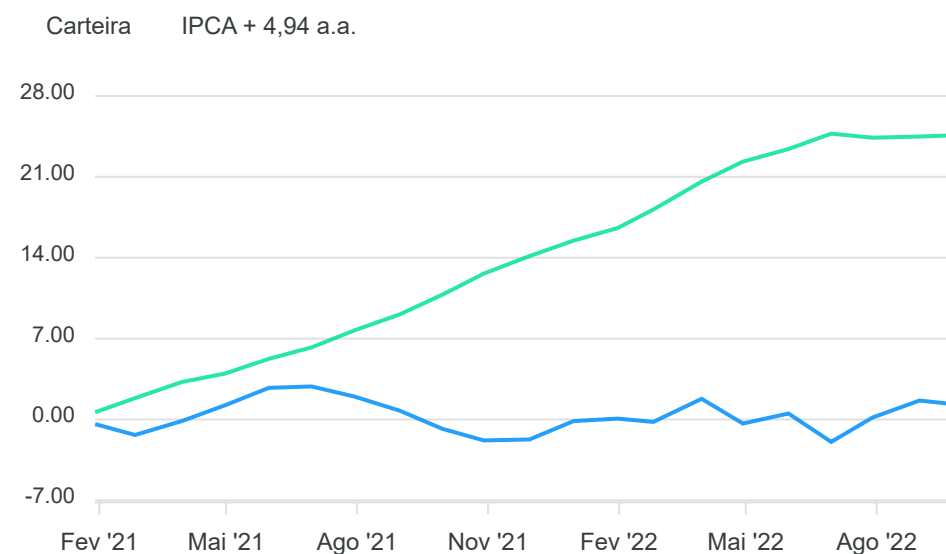


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



RENTA FIJA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	10.186.756,91	0,00	0,00	10.190.334,00	3.577,09	0,04% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	448.816,92	0,00	0,00	454.448,49	5.631,57	1,25% ▲	1,12%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	311.622,32	0,00	0,00	316.142,24	4.519,92	1,45% ▲	2,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	764.037,35	0,00	0,00	767.338,35	3.301,00	0,43% ▲	2,06%
BNB RPPS IMA-B FI RENTA FIJA	1.350.094,10	0,00	0,00	1.367.835,07	17.740,97	1,31% ▲	2,22%
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIJA	4.153.778,43	0,00	0,00	4.207.302,31	53.523,88	1,29% ▲	1,39%
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	1.806.207,20	420.371,67	50.000,00	2.198.395,59	21.816,72	0,98% ▲	0,01%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENTA FIJA	7.661.841,39	0,00	0,00	7.843.154,69	181.313,30	2,37% ▲	3,67%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENTA FIJA	1.643.595,38	0,00	0,00	1.663.542,59	19.947,21	1,21% ▲	1,19%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA	541.553,16	0,00	0,00	542.002,34	449,18	0,08% ▲	0,75%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIJA	3.469.806,87	0,00	0,00	3.512.884,58	43.077,71	1,24% ▲	0,79%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	2.626.346,61	0,00	0,00	2.639.742,25	13.395,64	0,51% ▲	1,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	5.116.277,17	0,00	0,00	5.138.130,72	21.853,55	0,43% ▲	1,26%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	2.224.724,32	0,00	0,00	2.258.016,02	33.291,70	1,50% ▲	2,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA	1.032.683,80	0,00	0,00	1.043.917,87	11.234,07	1,09% ▲	0,13%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	31.116,13	0,00	0,00	31.456,22	340,09	1,09% ▲	0,02%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO IMA-B LP	1.123.969,82	0,00	0,00	1.141.070,87	17.101,05	1,52% ▲	2,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIJA	2.612.648,12	0,00	0,00	2.652.680,50	40.032,38	1,53% ▲	2,07%
SANTANDER ATIVO FIC RENTA FIJA	596.367,62	0,00	0,00	602.760,39	6.392,77	1,07% ▲	0,90%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO DI	1.942,53	423.544,61	426.900,00	2.004,17	3.417,03	0,80% ▲	0,02%
	47.704.186,15	843.916,28	476.900,00	48.573.159,26	501.956,83	1,04%	1,46%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.507.708,73	0,00	0,00	1.505.727,13	-1.981,60	-0,13% ▼	11,04%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.076.959,13	420.371,67	0,00	2.503.887,22	6.556,42	0,26% ▲	11,17%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.839.371,46	0,00	0,00	1.814.458,35	-24.913,11	-1,35% ▼	11,50%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	880.166,27	0,00	0,00	877.401,43	-2.764,84	-0,31% ▼	9,85%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.178.257,52	0,00	0,00	3.156.219,44	-22.038,08	-0,69% ▼	10,03%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	461.419,16	0,00	0,00	467.945,86	6.526,70	1,41% ▲	1,55%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.820.379,15	0,00	0,00	1.786.350,41	-34.028,74	-1,87% ▼	9,75%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.577.822,72	0,00	0,00	3.269.246,26	-308.576,46	-8,62% ▼	11,70%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.196.178,66	0,00	0,00	1.183.229,38	-12.949,28	-1,08% ▼	8,90%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.543.483,32	0,00	0,00	1.528.036,89	-15.446,43	-1,00% ▼	10,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	745.927,15	0,00	0,00	743.967,96	-1.959,19	-0,26% ▼	10,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	399.410,66	0,00	0,00	393.486,66	-5.924,00	-1,48% ▼	10,21%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	193.289,03	0,00	0,00	193.320,61	31,58	0,02% ▲	10,81%
-	19.420.372,96	420.371,67	0,00	19.423.277,60	-417.467,03	-2,10%	10,39%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	994.977,88	0,00	0,00	935.944,81	-59.033,07	-5,93% ▼	7,24%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.384.540,93	0,00	0,00	1.277.656,86	-106.884,07	-7,72% ▼	9,55%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.212.954,51	0,00	0,00	1.144.669,25	-68.285,26	-5,63% ▼	8,21%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	667.657,41	0,00	0,00	604.494,27	-63.163,14	-9,46% ▼	16,14%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.044.595,63	0,00	0,00	975.927,45	-68.668,18	-6,57% ▼	9,68%
	5.304.726,36	0,00	0,00	4.938.692,64	-366.033,72	-6,90%	7,72%

RENTA FIJA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	440.907,38	0,00	0,00	454.448,49	13.541,11	3,07% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	311.059,36	0,00	0,00	316.142,24	5.082,88	1,63% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	0,00	750.000,00	0,00	767.338,35	17.338,35	2,31% ▲
BNB RPPS IMA-B FI RENTA FIJA	1.346.487,71	0,00	0,00	1.367.835,07	21.347,36	1,59% ▲
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIJA	6.093.623,08	0,00	2.000.000,00	4.207.302,31	113.679,23	1,87% ▲
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	1.796.883,13	420.371,67	79.272,67	2.198.395,59	60.413,46	2,72% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENTA FIJA	2.625.078,22	4.916.600,00	0,00	7.843.154,69	301.476,47	4,00% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENTA FIJA	3.620.724,05	0,00	2.000.000,00	1.663.542,59	42.818,54	1,18% ▲
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA	541.919,39	0,00	0,00	542.002,34	82,95	0,02% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIJA	5.393.795,14	0,00	2.000.000,00	3.512.884,58	119.089,44	2,21% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	2.636.917,79	0,00	0,00	2.639.742,25	2.824,46	0,11% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	3.097.934,55	2.000.000,00	0,00	5.138.130,72	40.196,17	0,79% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	2.218.948,30	0,00	0,00	2.258.016,02	39.067,72	1,76% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA	1.009.911,80	0,00	0,00	1.043.917,87	34.006,07	3,37% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	30.443,84	0,00	0,00	31.456,22	1.012,38	3,33% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO IMA-B LP	1.120.941,62	0,00	0,00	1.141.070,87	20.129,25	1,80% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIJA	2.576.144,53	0,00	0,00	2.652.680,50	76.535,97	2,97% ▲
SANTANDER ATIVO FIC RENTA FIJA	586.857,14	0,00	0,00	602.760,39	15.903,25	2,71% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO DI	10.348,90	1.565.539,77	1.584.900,00	2.004,17	11.015,50	0,70% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	10.162.885,82	117.651,39	120.217,66	10.190.334,00	30.014,45	0,29% ▲
	45.621.811,75	9.770.162,83	7.784.390,33	48.573.159,26	965.575,01	2,03%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.354.828,49	0,00	0,00	1.505.727,13	150.898,64	11,14% ▲
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	1.868.965,68	420.371,67	0,00	2.503.887,22	214.549,87	9,37% ▲
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.593.433,08	0,00	0,00	1.814.458,35	221.025,27	13,87% ▲
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	767.129,84	0,00	0,00	877.401,43	110.271,59	14,37% ▲
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.828.935,16	0,00	0,00	3.156.219,44	327.284,28	11,57% ▲
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	446.087,00	0,00	0,00	467.945,86	21.858,86	4,90% ▲
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.716.358,21	0,00	0,00	1.786.350,41	69.992,20	4,08% ▲
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.358.223,92	0,00	0,00	3.269.246,26	-88.977,66	-2,65% ▼
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.069.253,24	0,00	0,00	1.183.229,38	113.976,14	10,66% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.366.690,98	0,00	0,00	1.528.036,89	161.345,91	11,81% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	659.412,80	0,00	0,00	743.967,96	84.555,16	12,82% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	350.071,10	0,00	0,00	393.486,66	43.415,56	12,40% ▲
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	173.809,53	0,00	0,00	193.320,61	19.511,08	11,23% ▲
	17.553.199,03	420.371,67	0,00	19.423.277,60	1.449.706,90	8,07%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	967.754,26	0,00	0,00	935.944,81	-31.809,45	-3,29% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.335.739,25	0,00	0,00	1.277.656,86	-58.082,39	-4,35% ▼
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.198.943,77	0,00	0,00	1.144.669,25	-54.274,52	-4,53% ▼
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	595.009,20	0,00	0,00	604.494,27	9.485,07	1,59% ▲
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.006.139,77	0,00	0,00	975.927,45	-30.212,32	-3,00% ▼
	5.103.586,25	0,00	0,00	4.938.692,64	-164.893,61	-3,23%

Cenário Econômico

O cenário macroeconômico do 3º trimestre de 2022 manteve o tom do ano em curso, ou seja, com volatilidades provocadas pela inflação persistente, e em elevação, notadamente, nos países do bloco europeu e nos Estados Unidos. Valores não verificados nos últimos 40 anos e ao redor dos 2 dígitos. Como estes países também adotam a política monetária de meta de inflação, as suas respectivas taxas de juros são o principal instrumento de contenção dos preços via sua elevação, que os Bancos Centrais lançam mão visando trazer a inflação para suas respectivas metas.

O Banco Central do Brasil iniciou este movimento antes dos demais países citados. Assim, ao final do 3º trimestre o nosso BC já estabelecia a parada deste movimento enquanto banco central americano (FED) e o banco central europeu (BOE) se debatem em que patamar farão suas próximas elevações, ainda em 2022.

No caso brasileiro, o poder executivo, alinhado com os secretários de fazenda dos estados, executou ação de política fiscal visando também conter a inflação. A escolha negociada foi a redução de parcela dos impostos incidentes sobre a gasolina, diesel, energia elétrica e gás de cozinha. Como estes itens tem elevada participação no cálculo do índice oficial da inflação brasileira, o IPCA, este apresentou deflação em julho e agosto.

Em resumo, o trimestre foi de muitas incertezas e volatilidades quanto a definição do preço mais importante de todas as economias, sua taxa básica de juros, e "temperando" este aspecto, no cenário internacional tivemos a manutenção da guerra na Ucrânia e, a nível nacional, nossas eleições para presidente, para a Câmara Federal, e para as Câmaras Estaduais assim como a renovação de 1/3 do Senado Federal.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2022. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2022 ainda não foram integralmente atingidos.

Rentabilidade e Risco (por ativo)

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados.

Distribuição por Benchmarks

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Distribuição por Classificação ANBIMA

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

Distribuição por Gestoras e Administradoras

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

A rentabilidade consolidada da carteira no período continua demonstrando recuperação face o aumento das taxas de juros visando à contenção do processo inflacionário, combinado com o crescimento do fluxo de capital estrangeiro para a Bolsa, que vem impactando de forma favorável o desempenho das Bolsas.

Retorno dos Fundos de Investimentos

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2022, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 06 de outubro de 2022.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

