

Relatório Analítico dos Investimentos

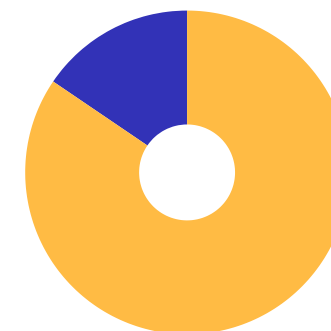
em outubro de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	11.646.161,92	15,69%	789	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.306.624,21	8,50%	572	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.545.591,89	3,43%	1.094	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	76.834,82	0,10%	234	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	11.342.944,05	15,28%	809	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	10.161.519,89	13,69%	1.014	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.906.048,73	3,92%	960	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	438.908,14	0,59%	1.177	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	6.954.824,12	9,37%	1.033	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.508.765,66	6,08%	161	0,61%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.815.978,59	7,84%	980	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.251.716,51	1,69%	1.850	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.211.286,27	1,63%	36.310	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.915.360,04	3,93%	154	0,56%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	1.780.738,53	2,40%	81	0,66%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.350.355,13	5,86%	7.832	0,52%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			74.213.658,50				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 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%	4,95%	59,84%	44.409.453,25
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	45.424.633,65	61,21%	14,96%	37,95%	79,84%	13.827.551,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	17.279.568,37	23,28%	16,00%	35,00%	40,00%	12.405.895,03
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,85%	5,00%	3.710.682,93
Total Renda Fixa	100,00%	62.704.202,02	84,49%	30,96%	80,75%	184,68%	



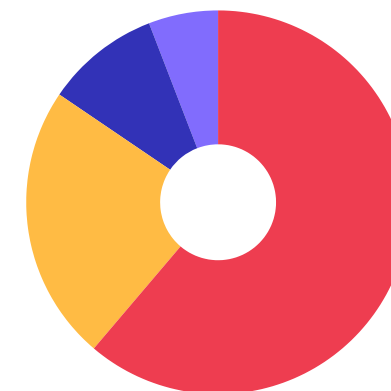
RENDA FIXA 62.704.202,02

RENDA VARIÁVEL 11.509.456,48

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	7.159.101,35	9,65%	8,20%	14,38%	20,00%	7.683.630,35
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.350.355,13	5,86%	2,15%	2,87%	10,00%	3.071.010,72
Total Renda Variável	30,00%	11.509.456,48	15,51%	10,35%	17,25%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	7.421.365,85
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	



■ 7º I b
 ■ 7º III a
 ■ 8º I
 ■ 10º I

Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2022)

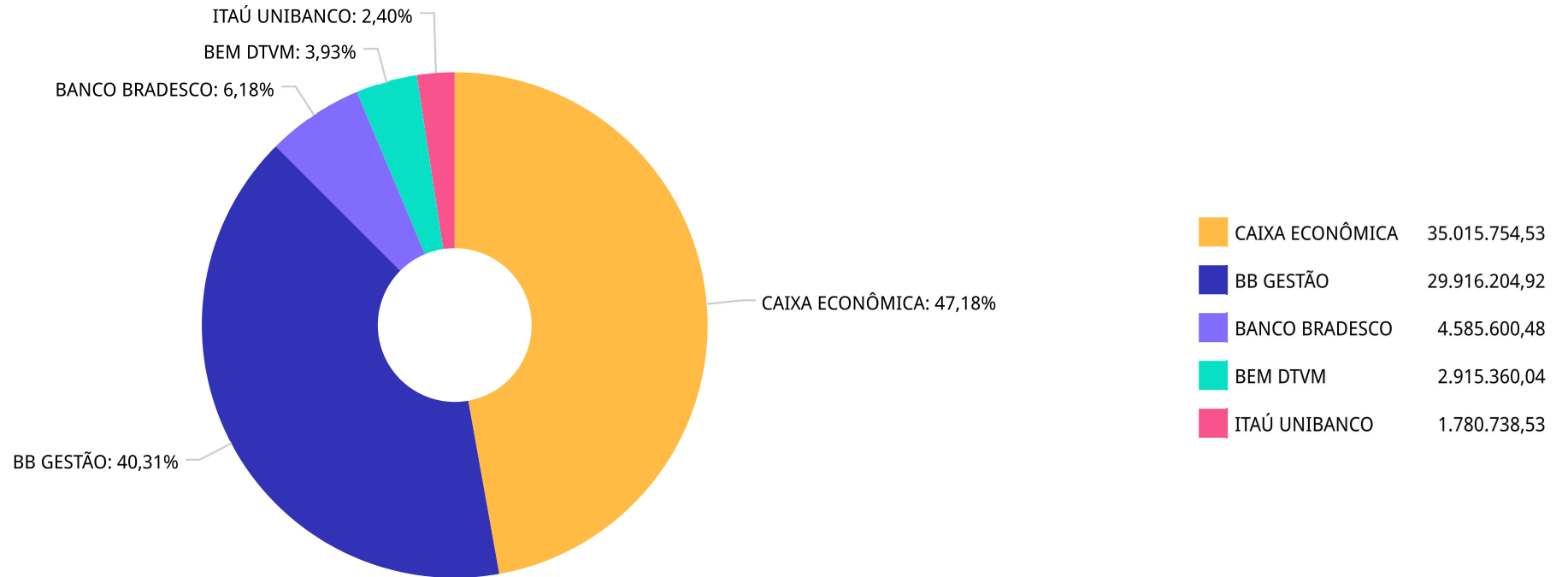
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	35.015.754,53	47,18	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	29.916.204,92	40,31	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	7.500.960,52	10,11	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.780.738,53	2,40	0,00

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

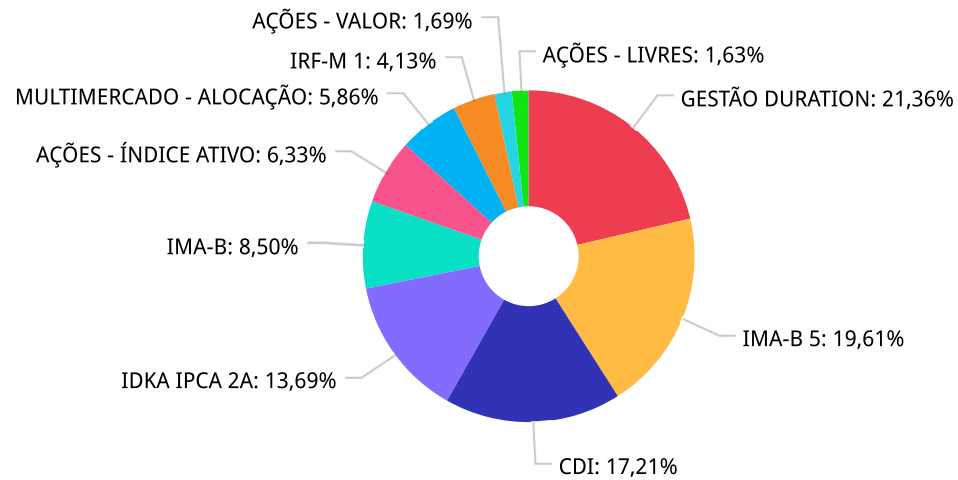
Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	59,84
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	45.424.633,65	61,21	14,96	59,84
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	17.279.568,37	23,28	26,25	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	7.159.101,35	9,65	10,78	20,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso I	4.350.355,13	5,86	2,15	10,00

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





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

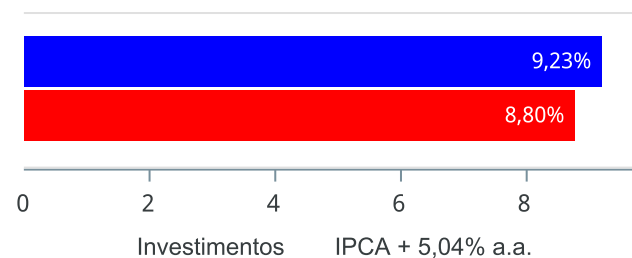


■ GESTÃO DURATION	15.851.709,71	■ IMA-B 5	14.552.210,65	■ CDI	12.770.802,71	■ IDKA IPCA 2A	10.161.519,89
■ IMA-B	6.306.624,21	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	4.696.098,57	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	4.350.355,13	■ IRF-M 1	3.061.334,85
■ AÇÕES - VALOR	1.251.716,51	■ AÇÕES - LIVRES	1.211.286,27				

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	63.744.225,71	436.991,85	402.857,17	64.281.547,15	503.186,76	503.186,76	0,79%	0,79%	0,95%	0,95%	82,80%	1,68%
Fevereiro	64.281.547,15	437.791,52	12.492,97	65.182.676,33	475.830,63	979.017,39	0,74%	1,53%	1,39%	2,35%	65,08%	1,31%
Março	65.182.676,33	438.357,42	12.492,97	67.096.295,98	1.487.755,20	2.466.772,59	2,27%	3,83%	2,06%	4,46%	85,99%	1,99%
Abril	67.096.295,98	501.033,90	12.492,97	67.640.170,29	55.333,38	2.522.105,97	0,08%	3,92%	1,44%	5,96%	65,77%	1,53%
Mai	67.640.170,29	505.483,81	12.492,97	68.881.589,62	748.428,49	3.270.534,46	1,10%	5,06%	0,90%	6,91%	73,19%	1,90%
Junho	68.881.589,62	509.114,38	12.492,97	68.748.004,91	-630.206,12	2.640.328,34	-0,91%	4,10%	1,08%	8,07%	50,86%	1,89%
Julho	68.748.004,91	514.361,90	18.739,45	69.803.382,58	559.755,22	3.200.083,56	0,81%	4,95%	-0,27%	7,78%	63,61%	1,78%
Agosto	69.803.382,58	515.141,88	12.492,97	71.369.878,71	1.063.847,22	4.263.930,78	1,51%	6,53%	0,09%	7,87%	83,02%	1,95%
Setembro	71.369.878,71	513.323,04	12.492,97	72.372.547,97	501.839,19	4.765.769,97	0,70%	7,28%	0,12%	8,00%	90,98%	2,07%
Outubro	72.372.547,97	524.116,93	12.492,97	74.213.658,50	1.329.486,57	6.095.256,54	1,82%	9,23%	0,74%	8,80%	104,99%	2,23%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

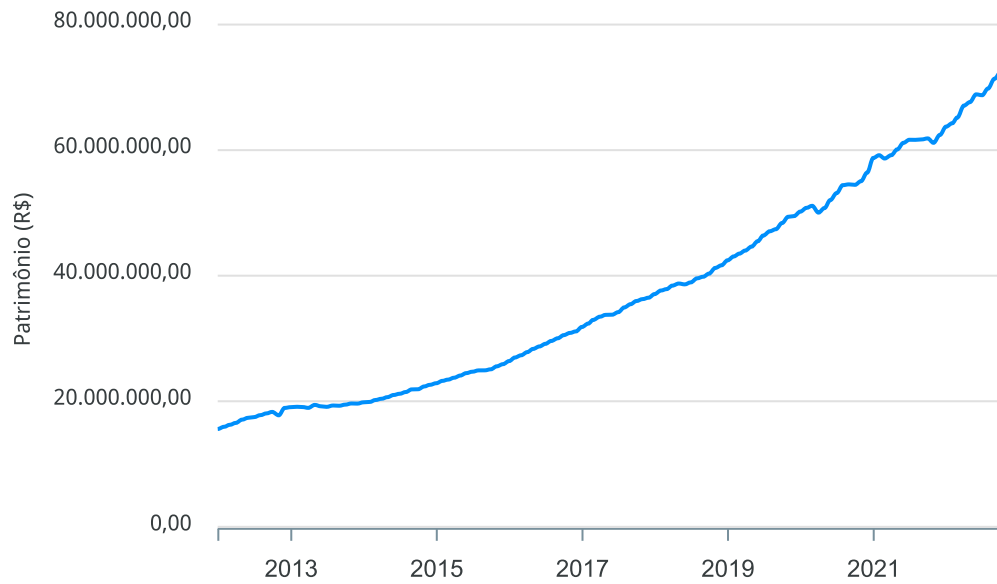




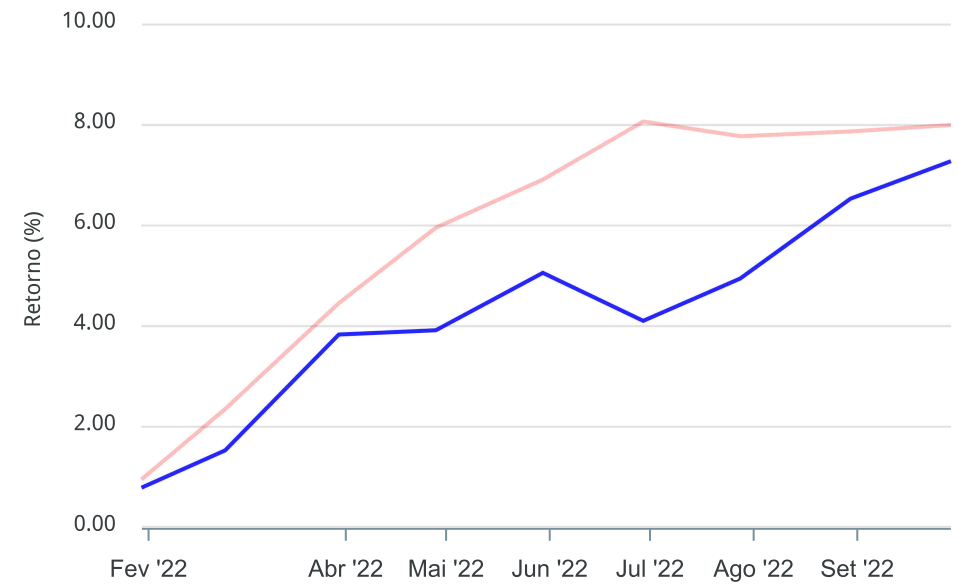
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMLL
- IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/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	11.427.489,85	2.660,34	0,00	11.646.161,92	216.011,73	1,89%	1,89%	0,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.852.551,90	0,00	0,00	2.906.048,73	53.496,83	1,88%	1,88%	0,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	9.978.901,00	0,00	0,00	10.161.519,89	182.618,89	1,83%	1,83%	0,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.244.709,81	0,00	12.492,97	6.306.624,21	74.407,37	1,19%	1,19%	1,55%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.460.311,90	0,00	0,00	4.508.765,66	48.453,76	1,09%	1,09%	0,89%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	6.883.299,62	0,00	0,00	6.954.824,12	71.524,50	1,04%	1,04%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.236.642,55	521.456,59	0,00	5.815.978,59	57.879,45	1,01%	1,03%	0,02%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	76.075,36	0,00	0,00	76.834,82	759,46	1,00%	1,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	11.232.203,22	0,00	0,00	11.342.944,05	110.740,83	0,99%	0,99%	0,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	434.627,05	0,00	0,00	438.908,14	4.281,09	0,99%	0,98%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.520.792,07	0,00	0,00	2.545.591,89	24.799,82	0,98%	0,98%	0,04%
Total Renda Fixa	61.347.604,33	524.116,93	12.492,97	62.704.202,02	844.973,73	1,37%		0,62%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	1.667.150,58	0,00	0,00	1.780.738,53	113.587,95	6,81%	6,81%	14,50%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.140.903,76	0,00	0,00	1.211.286,27	70.382,51	6,17%	6,17%	15,53%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.755.937,70	0,00	0,00	2.915.360,04	159.422,34	5,78%	5,78%	14,75%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.208.121,96	0,00	0,00	1.251.716,51	43.594,55	3,61%	3,61%	14,36%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.252.829,64	0,00	0,00	4.350.355,13	97.525,49	2,29%	2,29%	4,78%
Total Renda Variável	11.024.943,64	0,00	0,00	11.509.456,48	484.512,84	4,39%		10,98%

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.