

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, Ítem 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	101.746.027,22	39,51%	0,00		7º I a
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.178.316,43	6,67%	8.749.817.040,89	0,20%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	19.303.394,08	7,50%	6.260.416.458,58	0,31%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.855.335,14	1,50%	6.071.749.354,31	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.344.697,82	0,91%	5.850.800.339,33	0,04%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.731.602,68	4,56%	8.482.726.221,67	0,14%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.364.649,93	3,64%	8.885.835.879,64	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	851.107,29	0,33%	5.416.816.231,94	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.339.080,38	2,85%	17.792.135.878,61	0,04%	7º I b
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	635,42	0,00%	28.919.876.622,20	0,00%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	5.048.084,62	1,96%	889.444.204,65	0,57%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.534.605,95	0,60%	11.894.605.297,71	0,01%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	7.267.543,33	2,82%	2.088.496.299,29	0,35%	7º III a
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	12.715.441,70	4,94%	597.548.350,83	2,13%	7º III a
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.322.666,89	3,62%	5.877.853.184,58	0,16%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1.955.912,87	0,76%	374.429.452,36	0,52%	7º III a
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 1	0,01	0,00%	0,01	100,00% ▲	7º V a
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.819.572,12	2,26%	1.044.236.872,39	0,56%	8º I
BB AGRO FIC AÇÕES	2.708.671,71	1,05%	450.542.064,64	0,60%	8º I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.433.591,80	0,56%	1.433.036.477,39	0,10%	8º I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.531.415,09	1,37%	710.401.540,64	0,50%	8º I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.979.264,96	1,16%	1.095.965.089,71	0,27%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.968.290,38	2,32%	2.441.913.855,38	0,24%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.060.045,40	0,80%	561.410.693,77	0,37%	8º I
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	5.350.940,86	2,08%	1.293.545.032,18	0,41%	8º I
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.063.461,77	0,41%	1.006.692.313,90	0,11%	9º II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.185.232,78	0,85%	419.299.667,94	0,52%	9º III

Investimentos

\$ 257.524.377,45

Disponibilidades Financeiras

\$ 64.331,58

Total Carteira

\$ 257.588.709,03

Governança (Pró Gestão)
 NIVEL 2 01/06/2024

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	373.778,79	0,15%	2.057.509.929,37	0,02%	9º III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.842.459,57	0,72%	18.582.258.987,48	0,01%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.376.604,24	0,92%	1.207.167.139,22	0,20%	10º I
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.576.561,17	0,61%	706.287.111,00	0,22%	10º I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.054.869,32	1,96%	195.691.042,15	2,58%	10º I
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	0,01	0,00%	0,00		10º II
HAZ FII - ATCR11	807.717,34	0,31%	0,00		11º
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	832.798,38	0,32%	9.973.148,29	8,35%	NE

Investimentos

\$ 257.524.377,45

Disponibilidades Financeiras

\$ 64.331,58

Total Carteira

\$ 257.588.709,03

Governança (Pró Gestão)
 NIVEL 2 01/06/2024

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/05/2035	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8500%	302	4.097,527304	1.237.453,25
NTN-B - 15/05/2035	16/03/2022	Curva - Taxa: 5,8950%	478	4.082,117378	1.951.252,11
NTN-B - 15/05/2035	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,3810%	909	4.262,916376	3.874.990,99
NTN-B - 15/05/2035	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,7110%	224	4.145,621599	928.619,24
NTN-B - 15/05/2035	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,0286%	232	4.036,835661	936.545,87
NTN-B - 15/08/2040	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8480%	619	4.052,399647	2.508.435,38
NTN-B - 15/08/2040	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,4110%	1.182	4.246,313475	5.019.142,53
NTN-B - 15/08/2040	30/03/2022	Curva - Taxa: 5,4660%	586	4.221,201735	2.473.624,22
NTN-B - 15/08/2040	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,7210%	295	4.107,450332	1.211.697,85
NTN-B - 15/08/2040	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,0481%	297	3.967,749737	1.178.421,67
NTN-B - 15/05/2045	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8500%	1.053	4.120,814029	4.339.217,17
NTN-B - 15/05/2045	16/03/2022	Curva - Taxa: 5,9410%	1.059	4.076,748988	4.317.277,18
NTN-B - 15/05/2045	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,5010%	2.031	4.296,576458	8.726.346,79
NTN-B - 15/05/2045	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,8200%	508	4.135,497108	2.100.832,53
NTN-B - 15/05/2045	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,1386%	529	3.983,479633	2.107.260,73
NTN-B - 15/08/2050	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8500%	1.320	4.069,658289	5.371.948,94
NTN-B - 15/08/2050	16/03/2022	Curva - Taxa: 5,9410%	1.328	4.021,184770	5.340.133,37
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,5210%	2.535	4.252,665477	10.780.506,98
NTN-B - 15/08/2050	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,8200%	637	4.085,838514	2.602.679,13
NTN-B - 15/08/2050	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,1622%	650	3.907,034392	2.539.572,35
NTN-B - 15/05/2055	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8400%	1.573	4.140,075448	6.512.338,68
NTN-B - 15/05/2055	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,5200%	3.010	4.330,220738	13.033.964,42
NTN-B - 15/05/2055	30/03/2022	Curva - Taxa: 5,5810%	1.486	4.292,894825	6.379.241,71
NTN-B - 15/05/2055	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,8200%	754	4.151,558825	3.130.275,35
NTN-B - 15/05/2055	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,1660%	794	3.960,011197	3.144.248,89

Investimentos

\$ 257.524.377,45

Disponibilidades Financeiras

\$ 64.331,58

Total Carteira

\$ 257.588.709,03

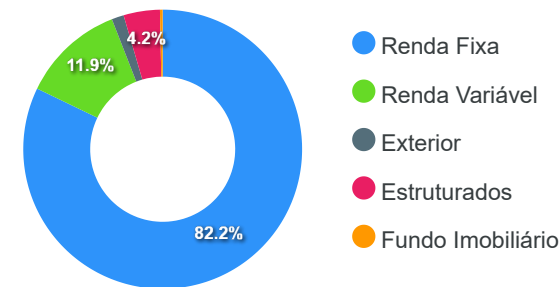
Governança (Pró Gestão)
 NIVEL 2 01/06/2024

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Utilizado	Utilizado	Livre
7° I a - Títulos TN SELIC	100,00%	39,50%	101.746.027,22	60,50%	155.842.681,81
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	29,90%	77.016.903,79	70,10%	180.571.805,24
7° III a - FI Referenciados RF	70,00%	12,73%	32.796.170,74	57,27%	147.515.925,58
7° V a - FIDC Cota Sênior	10,00%	0,00%	0,01	10,00%	25.758.870,89
8° I - Fundos de Ações	40,00%	11,59%	29.851.792,32	28,41%	73.183.691,29
9° II - Constituídos no Brasil	10,00%	0,41%	1.063.461,77	9,59%	24.695.409,13
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,99%	2.559.011,57	9,01%	23.199.859,33
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	4,21%	10.850.494,30	5,79%	14.908.376,60
10° II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	0,00%	0,01	5,00%	12.879.435,44
11° - Fundos Imobiliários	10,00%	0,31%	807.717,34	9,69%	24.951.153,56
Não Enquadrado	0,00%	0,32%	832.798,38	-0,32%	-832.798,38

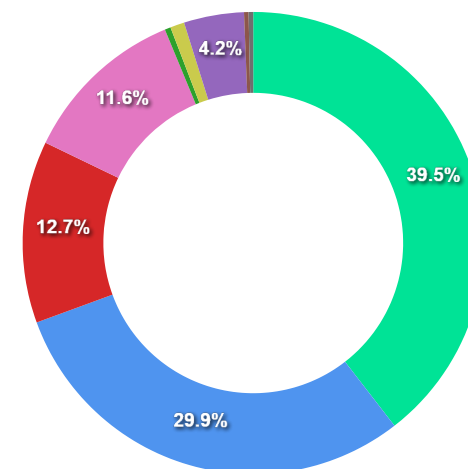
Governança (Pró Gestão)

NIVEL 2 01/06/2024

Segmentos



Artigos



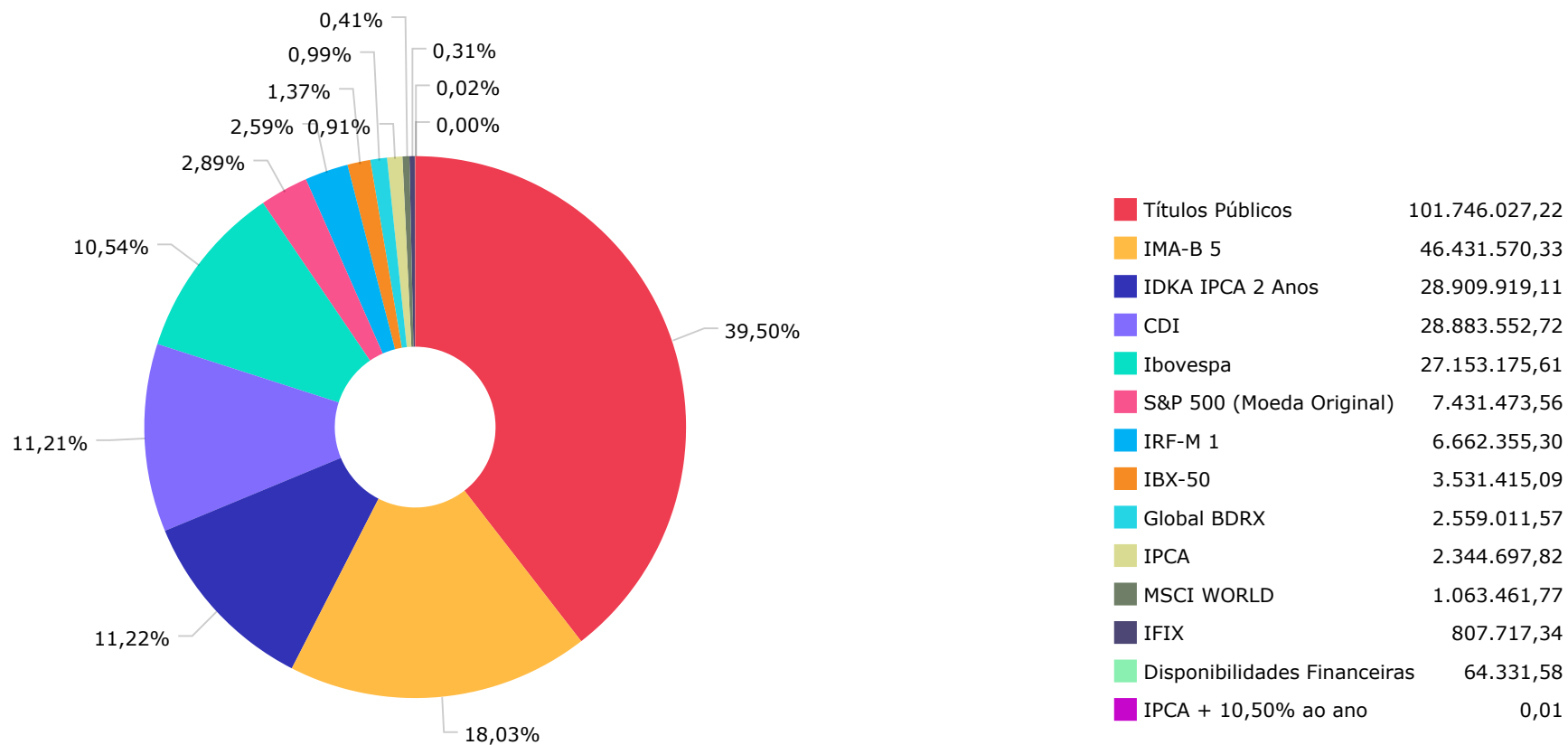
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	39,50%	0,00%	69,22%	80,00%	104.324.940,00
7° I b - FI 100% Títulos TN	29,90%	0,00%	0,00%	50,00%	51.777.450,73
7° III a - FI Referenciados RF	12,73%	0,00%	3,49%	50,00%	95.998.183,78
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	51.517.741,81
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	0,50%	1.287.943,54
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.879.435,45

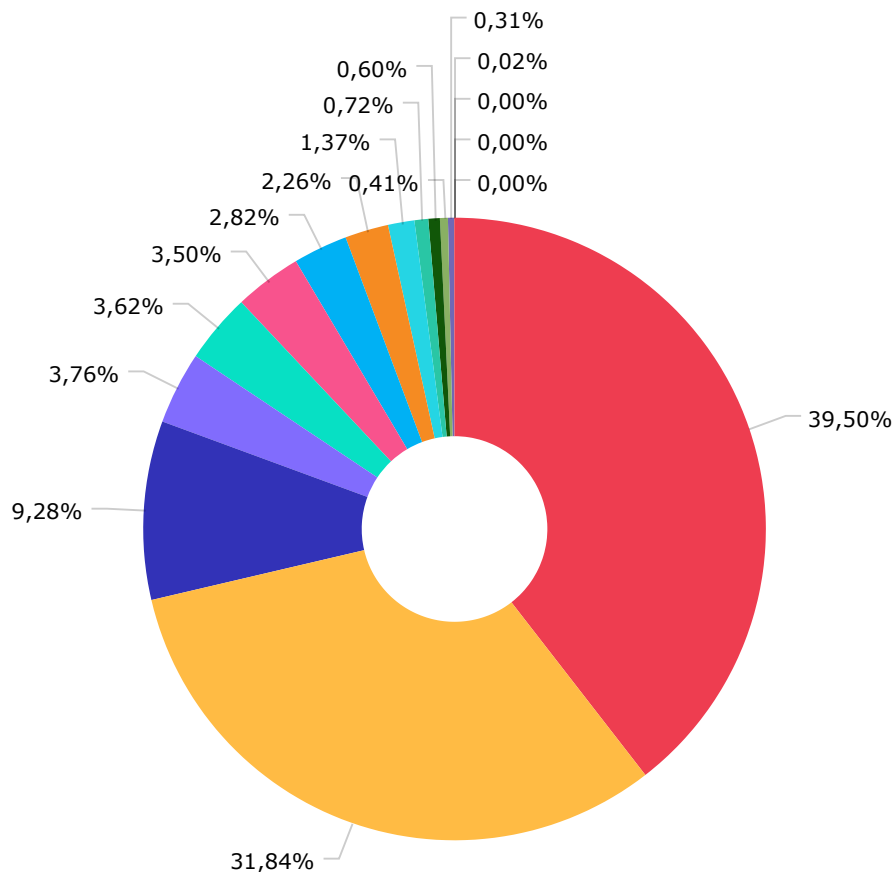
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8° I - Fundos de Ações	11,59%	0,00%	7,29%	20,00%	21.665.949,49
8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	51.517.741,81
9° II - Constituídos no Brasil	0,41%	0,00%	5,00%	10,00%	24.695.409,13
9° III - Ações - BDR Nível I	0,99%	0,00%	5,00%	10,00%	23.199.859,33
10° I - Fundos Multimercados	4,21%	0,00%	10,00%	10,00%	14.908.376,60
10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	0,07%	180.312,09
11° - Fundos Imobiliários	0,31%	0,00%	0,00%	0,37%	145.360,88
Não Enquadrado	0,32%	0,00%	0,00%	0,00%	-832.798,38

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21		
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1		0,00	0,00	0,00	900,00			
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,08	8,93	2,85	5,92	11,31	16,36	0,52	1,10
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,09	9,08	3,35	6,35	11,18	14,77	0,02	0,04
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09	9,03	3,33	6,29	11,10	14,29	0,02	0,04
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,07	8,90	3,29	6,25	10,92	14,13	0,00	0,01
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08	8,86	3,31	6,24	10,87	14,05	0,00	0,01
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,07	8,28	2,86	5,75	10,24	14,02	0,34	0,72
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-8,56	-19,58	-2,60	-17,10	-9,29	18,31	11,60	24,43
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	-8,38	-30,78	-4,37	-14,20	-22,27	-5,91		
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,95	-20,44	-5,71	-17,75	-13,90		10,57	22,26
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		
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	3,71	20,84	25,28	5,18	19,66	73,30	8,75	18,42
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,40	10,29	21,02	2,79	10,29		10,70	22,53
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	2,19	5,54	9,18	-0,98	3,34	4,46	7,49	15,78
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,36	1,67	9,61	-8,81	-1,48	22,12	11,01	23,19
BB AGRO FIC AÇÕES	-3,39	-1,42	6,72	-8,27	-1,84		7,54	15,89
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,34	-1,51	7,67	-9,41	-4,02	24,18	10,89	22,94
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-1,00	2,10	11,81	-3,37	-6,05	12,04	10,07	21,21
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-1,48	0,36	12,40	-9,65	-13,57	-1,92	10,21	21,50
IBX-50 - BENCHMARK	0,48	5,31	11,70	-8,80	0,58	19,15		
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	0,32	3,65	11,39	-10,01	-2,13	15,01	10,35	21,80

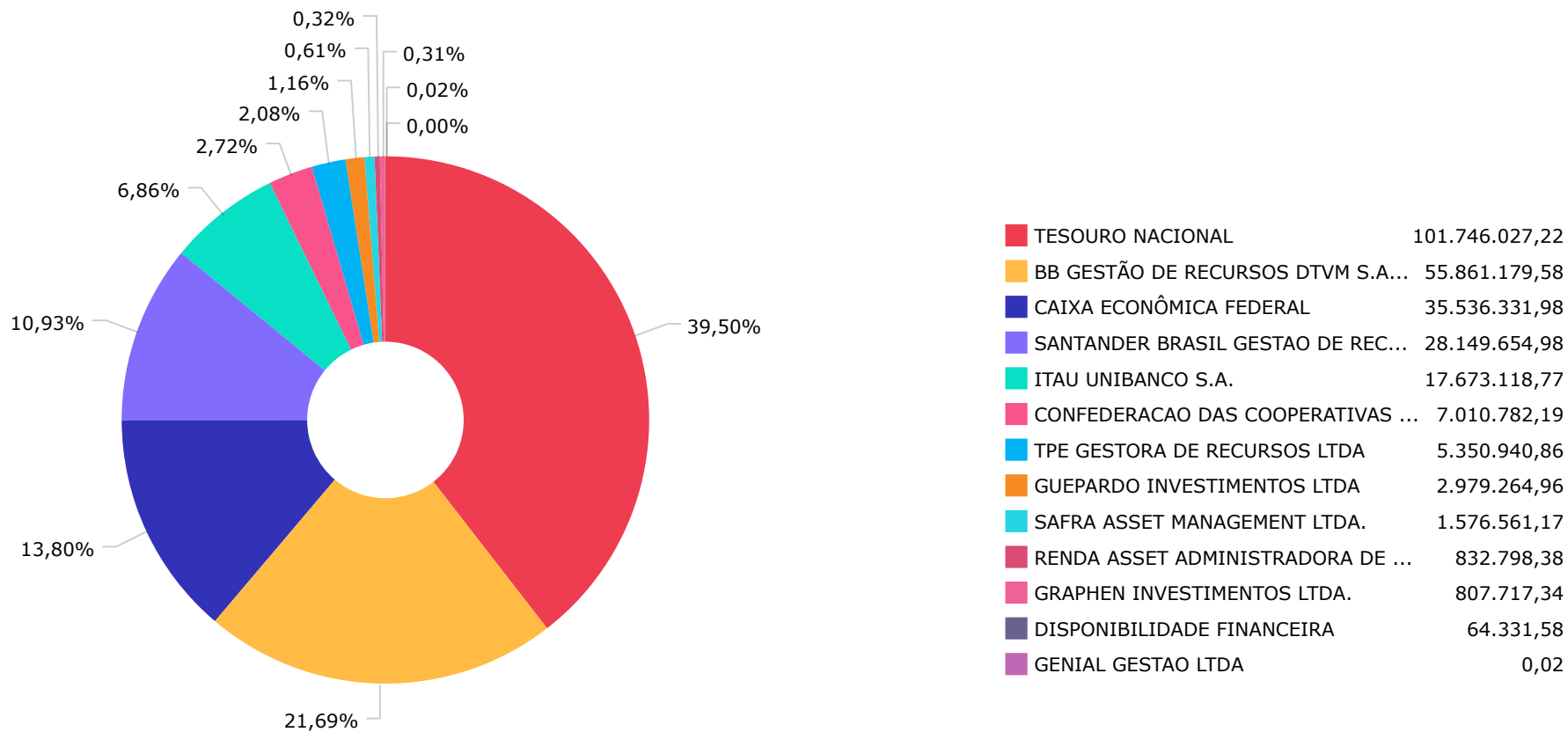
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,62	6,94	0,09	2,94	8,91	15,68		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53	6,74	0,26	2,81	8,72	15,30	1,42	2,99
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,51	6,53	0,11	2,60	8,47	14,89	1,50	3,17
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
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,40	6,91	0,39	3,03	9,03	15,26	1,27	2,67
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,40	6,90	0,40	3,05	8,97	15,18	1,27	2,67
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	0,40	6,90	0,38	3,01	8,76	14,32	1,26	2,66
IPCA - BENCHMARK	-0,29	4,09	-1,32	0,86	7,17	18,15		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,24	8,29	3,54	5,84	9,44	10,38	0,79	1,66
IPCA + 10,50% AO ANO - BENCHMARK	0,54	12,18	1,17	6,02	18,42	44,26		
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP								
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,11	8,59	3,43	6,17	9,81	12,55		
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1,12	8,76	3,47	6,15	10,15	12,92	0,12	0,26
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09	8,39	3,37	6,02	9,57	11,94	0,13	0,27
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
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	-9,34	-24,77	-5,28	-20,85	-16,76	6,62		
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-8,58	-19,63	-2,53	-17,14	-9,12	18,96	11,70	24,63
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-8,62	-19,75	-2,62	-17,18	-9,30	18,63	11,67	24,57
MSCI WORLD - BENCHMARK	-5,49	-28,69	-3,57	-11,09	-21,36	-3,69		
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	-5,52	-31,46	-2,27	-11,11	-26,92	-11,68	7,50	15,79

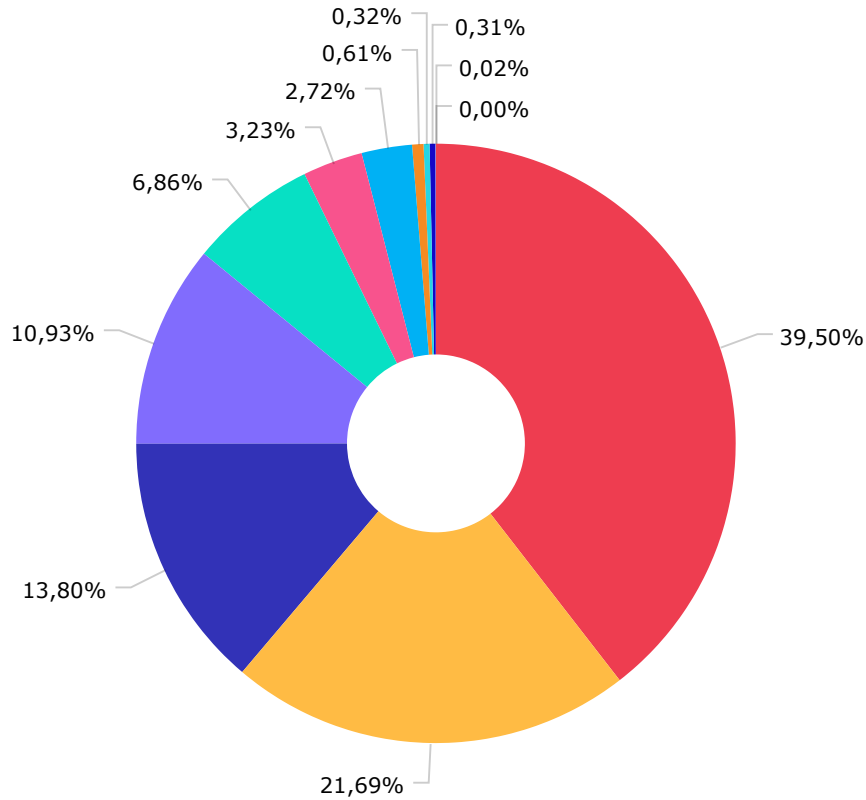
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IFIX - BENCHMARK	0,49	6,63	6,98	7,58	10,13	7,01		
HAZ FII - ATCR11								





Títulos Públicos	101.746.027,22
Renda Fixa Indexados	82.003.844,74
Ações Livre	23.892.615,06
Renda Fixa Duração Livre Soberano	9.683.778,20
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	9.322.666,89
Multimercados Estratégia Específica	9.008.034,73
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	7.267.543,33
Ações Valor/Crescimento	5.819.572,12
Ações Índice Ativo	3.531.415,09
Multimercados Juros e Moedas	1.842.459,57
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	1.534.605,95
Multimercados Investimento no Exterior	1.063.461,77
FII Desenvolvimento para Venda Gestão Ativa	807.717,34
Disponibilidades Financeiras	64.331,58
Renda Fixa Simples	635,42
Fundos de Participações	0,01
FIDC Fomento Mercantil	0,01





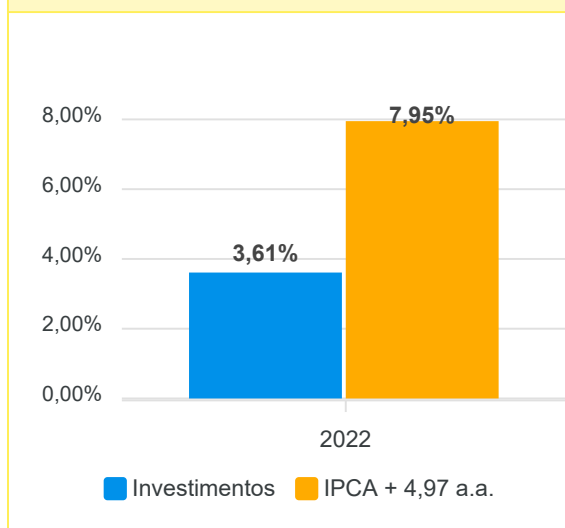
TESOURO NACIONAL	101.746.027,22
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	55.861.179,58
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	35.536.331,98
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	28.149.654,98
ITAU UNIBANCO S.A.	17.673.118,77
BANCO DAYCOVAL S.A.	8.330.205,82
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	7.010.782,19
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	1.576.561,17
BFL ADMINISTRACAO DE RECURSOS ...	832.798,38
RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL...	807.717,35
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	64.331,58
BANCO GENIAL S.A.	0,01

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	226.020.799,42	13.933.156,95	12.179.365,62	228.406.126,18	631.535,43	631.535,43	0,28% ▲	0,28%	0,95%	0,95%	29,47%	2,16%
Fevereiro	228.406.126,18	19.931.658,05	17.449.905,42	232.030.797,92	1.142.919,11	1.774.454,54	0,50% ▲	0,77%	1,38%	2,34%	32,91%	2,05%
Março	232.030.797,92	121.352.014,95	120.574.125,37	237.935.024,57	5.126.337,07	6.900.791,61	2,20% ▲	2,99%	2,05%	4,44%	67,34%	2,42%
Abril	237.935.024,57	17.974.453,39	13.795.554,26	241.339.098,59	-774.825,11	6.125.966,50	-0,32% ▼	2,66%	1,43%	5,93%	44,86%	0,95%
Mai	241.339.098,59	39.110.066,64	33.640.665,43	248.426.615,96	1.618.116,16	7.744.082,66	0,66% ▲	3,34%	0,90%	6,88%	48,55%	2,14%
Junho	248.426.615,96	13.403.054,81	11.273.915,49	247.705.833,50	-2.849.921,78	4.894.160,88	-1,14% ▼	2,16%	1,08%	8,03%	26,90%	1,99%
Julho	247.705.833,50	25.350.603,51	23.265.479,12	253.069.138,44	3.278.180,55	8.172.341,43	1,31% ▲	3,50%	-0,28%	7,73%	45,28%	1,74%
Agosto	253.069.138,44	11.677.106,99	10.884.146,29	254.464.332,57	602.233,43	8.774.574,86	0,24% ▲	3,75%	0,08%	7,82%	47,95%	1,88%
Setembro	254.464.332,57	17.579.343,69	14.189.294,12	257.524.377,45	-330.004,69	8.444.570,17	-0,13% ▼	3,61%	0,11%	7,95%	45,41%	2,14%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	6.900.791,61	2,99%	4,44%
2º Trim	-2.006.630,73	-0,81%	3,44%
1º Sem	4.894.160,88	2,16%	8,03%
3º Trim	3.550.409,29	1,42%	-0,08%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado



Gráficos

Gráfico Risco x Retorno

● Retorno ● Risco

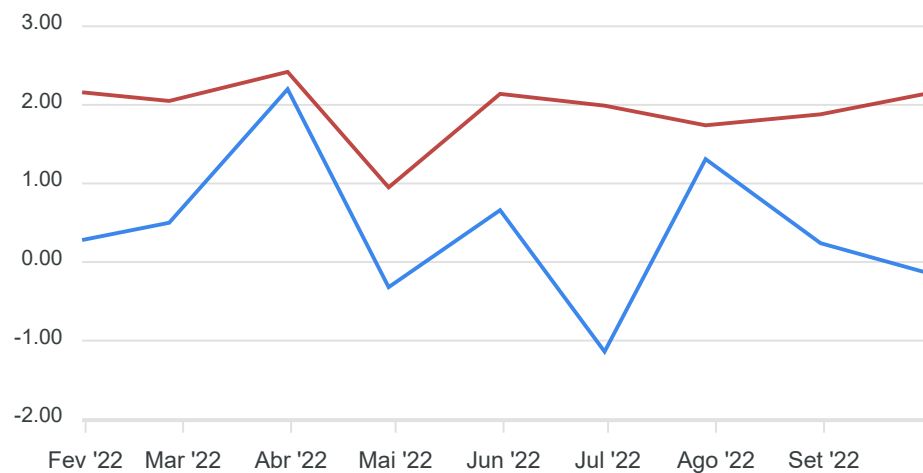
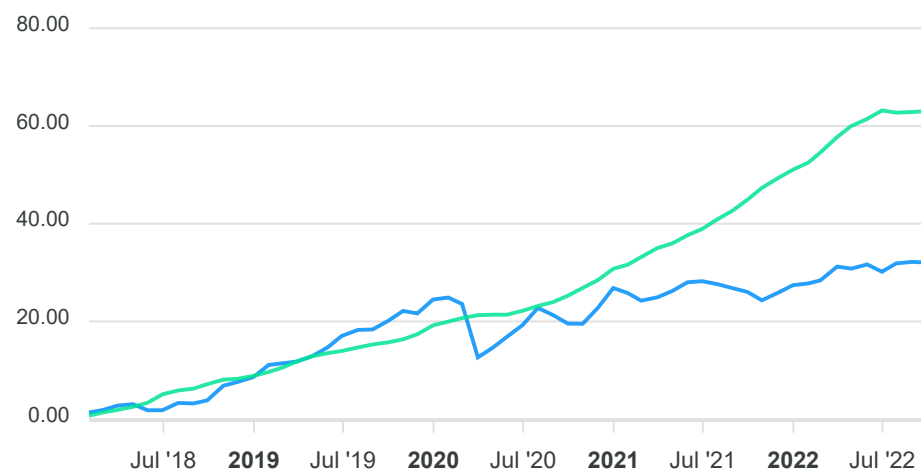


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade

● Carteira ● IPCA + 4,97 a.a.



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	101.629.689,63	0,00	0,00	101.746.027,22	116.337,59	0,11% ▲	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.087.830,83	0,00	0,00	17.178.316,43	90.485,60	0,53% ▲	1,42%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	19.226.353,33	0,00	0,00	19.303.394,08	77.040,75	0,40% ▲	1,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.813.922,81	0,00	0,00	3.855.335,14	41.412,33	1,09% ▲	0,13%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.115.453,98	2.851.922,71	4.464.662,69	1.534.605,95	31.891,95	0,53% ▲	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	147.460,82	0,00	148.122,71	0,00	661,89	0,45% ▲	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.315.945,33	0,00	0,00	2.344.697,82	28.752,49	1,24% ▲	0,79%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.672.069,48	0,00	0,00	11.731.602,68	59.533,20	0,51% ▲	1,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.324.820,13	0,00	0,00	9.364.649,93	39.829,80	0,43% ▲	1,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	841.948,14	0,00	0,00	851.107,29	9.159,15	1,09% ▲	0,13%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.380.279,01	1.950.720,75	1.065.050,00	7.339.080,38	73.130,62	0,88% ▲	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	7.189.986,51	0,00	0,00	7.267.543,33	77.556,82	1,08% ▲	0,52%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	628,67	0,00	0,00	635,42	6,75	1,07% ▲	0,00%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	5.027.908,87	0,00	0,00	5.048.084,62	20.175,75	0,40% ▲	1,27%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	12.664.941,62	0,00	0,00	12.715.441,70	50.500,08	0,40% ▲	1,26%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.049.908,62	10.714.816,14	8.511.458,72	9.322.666,89	69.400,85	0,39% ▲	0,00%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1.934.229,43	0,00	0,00	1.955.912,87	21.683,44	1,12% ▲	0,12%
TRENBANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
	209.423.377,22	15.517.459,60	14.189.294,12	211.559.101,76	807.559,06	0,38%	0,51%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.898.492,99	0,00	0,00	5.819.572,12	-78.920,87	-1,34% ▼	10,89%
BB AGRO FIC AÇÕES	2.803.740,38	0,00	0,00	2.708.671,71	-95.068,67	-3,39% ▼	7,54%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.822.952,38	0,00	0,00	1.842.459,57	19.507,19	1,07% ▲	0,34%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.438.702,99	0,00	0,00	1.433.591,80	-5.111,19	-0,36% ▼	11,01%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.520.057,76	0,00	0,00	3.531.415,09	11.357,33	0,32% ▲	10,35%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.938.014,11	0,00	0,00	2.979.264,96	41.250,85	1,40% ▲	10,70%
HAZ FII - ATCR11	806.973,06	0,00	0,00	807.717,34	744,28	0,09% ▲	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6.028.621,87	0,00	0,00	5.968.290,38	-60.331,49	-1,00% ▼	10,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.091.059,67	0,00	0,00	2.060.045,40	-31.014,27	-1,48% ▼	10,21%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.600.759,47	0,00	0,00	2.376.604,24	-224.155,23	-8,62% ▼	11,67%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	814.967,93	0,00	0,00	832.798,38	17.830,45	2,19% ▲	7,49%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.724.122,84	0,00	0,00	1.576.561,17	-147.561,67	-8,56% ▼	11,60%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.529.571,77	0,00	0,00	5.054.869,32	-474.702,45	-8,58% ▼	11,70%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	3.118.306,53	2.061.884,09	0,00	5.350.940,86	170.750,24	3,30% ▲	8,75%
-	41.136.343,76	2.061.884,09	0,00	42.342.802,35	-855.425,50	-1,98%	9,64%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.374.027,45	0,00	0,00	2.185.232,78	-188.794,67	-7,95% ▼	10,57%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	405.047,75	0,00	0,00	373.778,79	-31.268,96	-7,72% ▼	9,55%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	1.125.536,39	0,00	0,00	1.063.461,77	-62.074,62	-5,52% ▼	7,50%
	3.904.611,59	0,00	0,00	3.622.473,34	-282.138,25	-7,23%	7,36%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.133.294,86	0,00	0,00	17.178.316,43	45.021,57	0,26% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	19.225.756,77	0,00	0,00	19.303.394,08	77.637,31	0,40% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.228.398,51	0,00	500.000,00	3.855.335,14	126.936,63	3,00% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	10.113.784,35	9.644.293,20	18.376.397,23	1.534.605,95	152.925,63	0,77% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	144.534,16	0,00	148.122,71	0,00	3.588,55	2,48% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.252.716,57	0,00	987.874,26	2.344.697,82	79.855,51	2,46% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.719.050,16	0,00	0,00	11.731.602,68	12.552,52	0,11% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.318.455,54	0,00	0,00	9.364.649,93	46.194,39	0,50% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	823.382,11	0,00	0,00	851.107,29	27.725,18	3,37% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.065.529,77	5.843.223,25	4.765.060,45	7.339.080,38	195.387,81	1,64% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	7.066.271,57	0,00	0,00	7.267.543,33	201.271,76	2,85% ▲
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	615,17	0,00	0,00	635,42	20,25	3,29% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	5.028.596,66	0,00	0,00	5.048.084,62	19.487,96	0,39% ▲
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	12.667.353,52	0,00	0,00	12.715.441,70	48.088,18	0,38% ▲
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.533.435,63	25.157.144,84	23.561.464,88	9.322.666,89	193.551,30	0,59% ▲
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,00	1.912.634,54	0,00	1.955.912,87	43.278,33	2,26% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	92.348.023,88	9.987.874,27	0,00	101.746.027,22	-589.870,93	-0,58% ▼
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%
	206.669.199,24	52.545.170,10	48.338.919,53	211.559.101,76	683.651,95	0,32%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.404.947,60	0,00	0,00	5.819.572,12	414.624,52	7,67% ▲
BB AGRO FIC AÇÕES	2.538.148,74	0,00	0,00	2.708.671,71	170.522,97	6,72% ▲
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.791.211,56	0,00	0,00	1.842.459,57	51.248,01	2,86% ▲
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.307.860,46	0,00	0,00	1.433.591,80	125.731,34	9,61% ▲
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.170.283,75	0,00	0,00	3.531.415,09	361.131,34	11,39% ▲
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.461.749,77	0,00	0,00	2.979.264,96	517.515,19	21,02% ▲
HAZ FII - ATCR11	805.472,41	0,00	0,00	807.717,34	2.244,93	0,28% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.338.096,62	0,00	0,00	5.968.290,38	630.193,76	11,81% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.832.748,16	0,00	0,00	2.060.045,40	227.297,24	12,40% ▲
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.440.654,39	0,00	0,00	2.376.604,24	-64.050,15	-2,62% ▼
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	762.790,58	0,00	0,00	832.798,38	70.007,80	9,18% ▲
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.618.571,36	0,00	0,00	1.576.561,17	-42.010,19	-2,60% ▼
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.186.129,43	0,00	0,00	5.054.869,32	-131.260,11	-2,53% ▼
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	2.581.362,76	2.061.884,09	0,00	5.350.940,86	707.694,01	15,24% ▲
	37.240.027,60	2.061.884,09	0,00	42.342.802,35	3.040.890,66	7,74%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.317.666,84	0,00	0,00	2.185.232,78	-132.434,06	-5,71% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	390.770,81	0,00	0,00	373.778,79	-16.992,02	-4,35% ▼
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	1.088.169,01	0,00	0,00	1.063.461,77	-24.707,24	-2,27% ▼
	3.796.606,66	0,00	0,00	3.622.473,34	-174.133,32	-4,59%

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