



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

SETEMBRO/2022

Este relatório tem como objetivo demonstrar a análise do relatório de investimentos, de acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento a Política de Investimentos do mês em referência, e a aprovação pelo Conselho Fiscal.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

PARECER COMITE DE INVESTIMENTOS SETEMBRO/2022

O comitê de investimentos do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPECERICA DA SERRA-ITAPREV, fazendo uso de sua competência que lhe confere o Decreto Municipal Nº 2352/2015, em sua reunião ordinária do dia 18 de outubro de 2022, analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês de setembro/2022 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

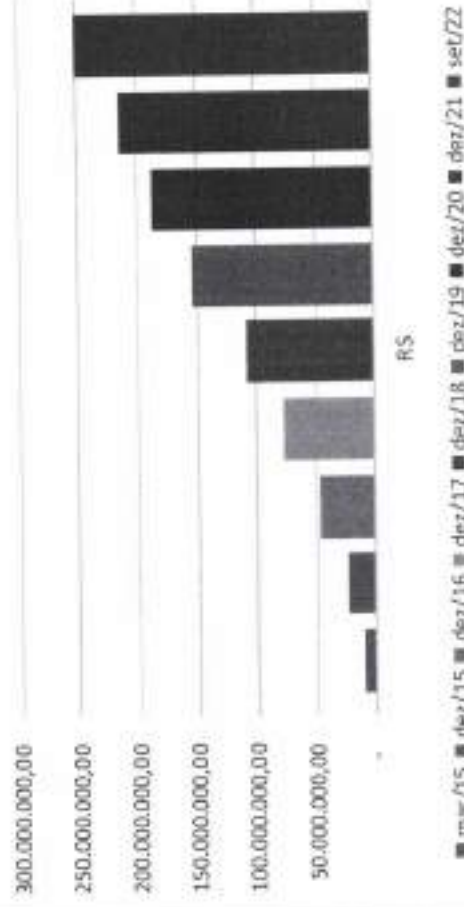
1) CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A carteira de investimentos do Instituto de Previdência do município de Itapeçerica da Serra-ITAPREV, no mês de setembro de 2022 apresentou desvalorização de 0,40% encerrando o mês com recursos aplicados no valor total de R\$ 251.353.252,11 (Duzentos e cinquenta e um milhões, trezentos e cinquenta e três mil, duzentos e cinquenta e dois reais e onze centavos)

Ano	R\$
mar/15	9.333.541,95
dez/15	22.750.600,24
dez/16	47.169.736,15
dez/17	76.356.500,87
dez/18	107.384.837,09
dez/19	152.862.799,62
dez/20	186.459.080,35
dez/21	214.632.111,69
set/22	251.353.252,11

Início Itaprev

Comparativo Evolução Patrimônio





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

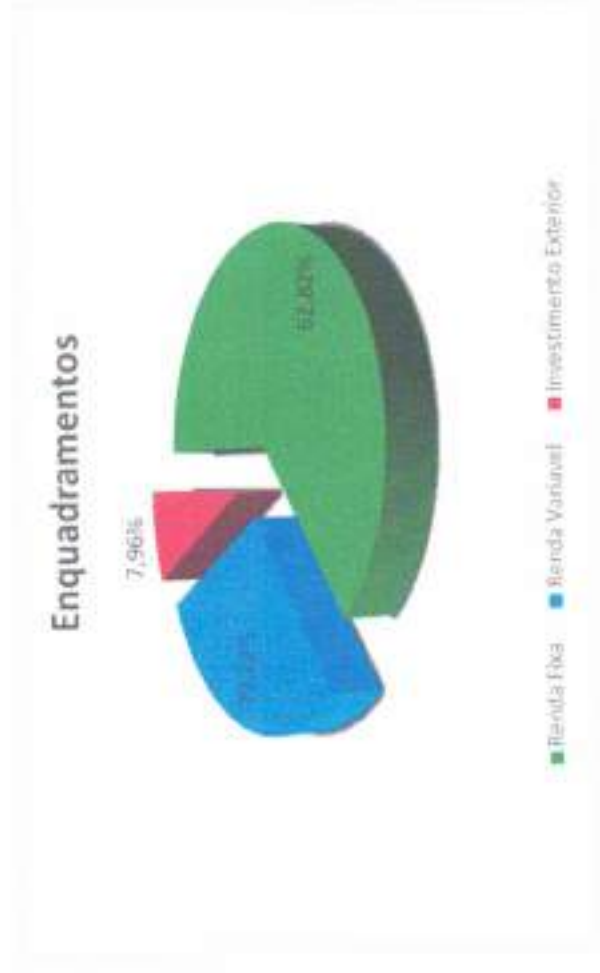
2) COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A carteira de investimentos do Instituto de Previdência do município de Itapeverica da Serra-ITAPREV, atende aos requisitos de limites e enquadramento da resolução Nº 3922/2010 e suas alterações e, aos limites e enquadramentos aprovados na política de investimentos vigente sendo composta por:

62,82% em investimentos denominados Renda fixa;

29,22% em investimentos denominados Renda Variável; e

7,96% em investimentos denominados exterior.





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.649.172,34	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	20.213,76	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.806.967,32	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	11.154.241,07	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.024.408,04	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.659.273,33	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	10.321.535,25	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	15.177.359,43	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	15.123.457,23	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	19.384.915,65	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	6.669.547,05	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.532.230,73	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.871.505,22	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.052.717,52	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.190.353,41	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.605.555,59	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	9.684.886,21	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	Renda Fixa
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.743.629,41	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	Renda Fixa
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	11.378.729,02	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	Renda Fixa
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	7.284.208,98	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	Renda Fixa
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	2.248.511,98	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	18/04/2018	5.039.319,36	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	Renda Fixa
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 du	Não há	3.020.352,81	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	Renda Fixa
TOTAL RENDA FIXA			159.643.090,71		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.760.498,84	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	2.428.170,47	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	6.957.385,79	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+7 du	Não há	2.473.375,75	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.211.264,06	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	6.610.724,52	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.383.046,53	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
QUELUZ VALOR FIC AÇÕES	D+13	Não há	1.549.978,83	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.317.748,64	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
SOMMA BRASIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.198.516,15	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.045.694,64	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.130.083,87	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	9.671.086,22	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	4.936.244,19	Artigo 8º, Inciso I	Renda Variável
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	1.951.184,97	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	D+15	Não há	1.429.964,96	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	4.095.310,13	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+3 du	25 meses	2.988.623,51	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	4.181.751,94	Artigo 10º, Inciso I	Renda Variável
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	931.030,59	Artigo 11º	Renda Variável
TOTAL RENDA VARIÁVEL			74.251.684,60		

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	D+5 du	Não há	1.292.544,83	Artigo 9º, Inciso II	Invest. Exterior
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	D+4 du	Não há	1.241.234,38	Artigo 9º, Inciso II	Invest. Exterior
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	8.740.075,22	Artigo 9º, Inciso III	Invest. Exterior
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	8.948.465,54	Artigo 9º, Inciso III	Invest. Exterior
TOTAL INVEST. EXTERIOR			20.222.319,97		

TOTAL RENDA FIXA	159.643.090,71
TOTAL RENDA VARIÁVEL	74.251.684,60
TOTAL INVEST. EXTERIOR	20.222.319,97
TOTAL DE RECURSOS	254.117.095,28



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

3) META ATUARIAL

O retorno da carteira de investimentos do Instituto de Previdência do Município de ITAPEERICA DA SERRA – ITAPREV, no acumulado do ano é positivo em 2,87% (dois virgula oitenta e sete por cento), abaixo da meta atuarial acumulada de IPCA+4,88% que em julho ficou acumulada 7,88% (Sete virgula setenta e seis por cento)

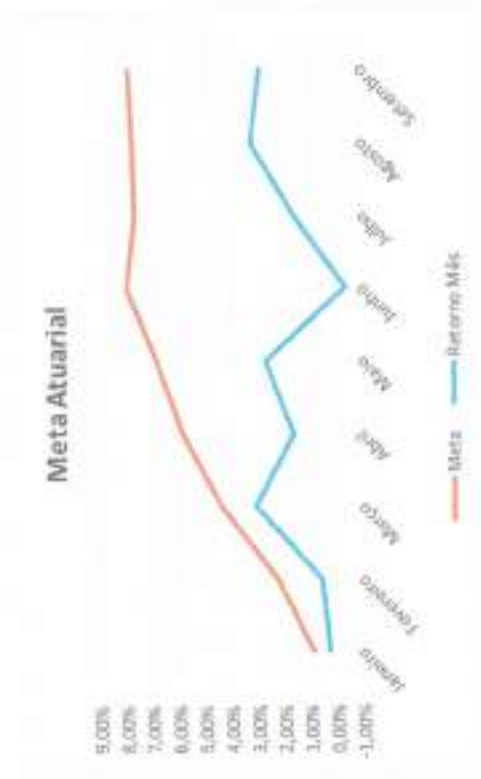
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno no Mês	Retorno Mês	Meta	Retorno acumulado	Retorno acum.	Meta acum.	Gap (%)
Janeiro	214.632.111,69	12.280.631,66	6.113.007,65	221.301.245,11	765.333,74	0,35%	0,94%	765.333,74	0,35%	0,94%	36,92%
Fevereiro	221.301.245,11	21.425.532,35	20.712.943,48	222.686.288,48	672.454,50	0,30%	1,37%	1.437.788,24	0,65%	2,33%	27,98%
Março	222.686.288,48	14.098.344,28	10.872.124,90	231.476.765,46	5.564.257,60	2,46%	2,04%	7.002.045,84	3,13%	4,42%	70,85%
Abril	231.476.765,46	25.238.249,27	21.942.687,27	231.503.797,81	-3.268.529,70	-1,39%	1,42%	3.733.516,14	1,69%	5,90%	28,70%
Maior	231.503.797,81	29.841.260,89	26.493.926,60	237.356.791,31	2.505.659,21	1,07%	0,89%	6.239.175,35	2,78%	6,85%	40,60%
Junho	237.356.791,31	58.116.281,58	54.639.551,02	233.630.162,85	-7.203.359,02	-2,99%	1,07%	964.183,67	-0,29%	7,99%	-3,69%
Julho	233.630.162,85	32.333.753,86	28.905.593,45	241.703.488,38	4.645.165,12	1,96%	-0,28%	3.680.981,45	1,66%	7,68%	21,59%
Agosto	241.703.488,38	17.566.409,07	14.218.752,01	248.975.865,11	3.924.719,67	1,60%	0,07%	7.605.701,12	3,29%	7,76%	42,35%
Setembro	248.975.865,11	35.665.557,87	32.278.765,32	251.353.252,11	-1.009.405,55	-0,40%	0,11%	6.596.295,57	2,87%	7,88%	36,49%
					-1.009.405,55	-0,40%	0,11%	6.596.295,57	2,87%	7,88%	36,49%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP, DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

Retorno obtido no mês	-0,40%
Meta atuarial do mês	0,11%
Retorno da carteira em 2022	2,87%
Meta atuarial em 2022	7,88%



RECURSOS PREVIDENCIARIOS	251.353.252,11
RECURSOS TAXA ADMINISTRATIVA	2.763.843,17
TOTAL DE RECURSOS ITAPREV	254.117.095,28



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPETININGA, DO ESTADO DE SÃO PAULO

ESTADO DE SÃO PAULO

Retorno acumulado 2015 a 2022



5) ENQUADRAMENTO

Em atendimento a Resolução Nº 4963/2021 em substituição a resolução Nº 3922/2010 e suas alterações, e em atendimento aos limites previsto na política de investimentos vigente, a carteira de investimentos do Instituto de Previdência do Município de Itapetininga, atende aos limites pré-estabelecidos.

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira		Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
		\$	%	Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'a'	100,00%	0	0,00%	0,00%	10,00%	50,00%	127.058.547,64
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	100,00%	127.928.339,15	50,34%	20,00%	34,00%	90,00%	100.777.046,60
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'c'	100,00%	0	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	7.623.512,86
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	60,00%	23.655.079,39	9,31%	10,00%	14,50%	60,00%	128.815.177,78
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0	0,00%	0,00%	6,00%	20,00%	50.823.419,06
Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'b'	5,00%	8.059.672,17	3,17%	0,00%	5,00%	5,00%	4.646.182,59
Total Renda Fixa	100,00%	159.643.090,71	62,82%	30,00%	69,50%	228,00%	



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira		Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP	
		\$	%	Inferior	Alvo	Superior	Superior	Superior
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	58.673.818,50	23,09%	10,00%	19,00%	30,00%	17.561.310,08	
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.705.854,76	
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	14.646.835,51	5,76%	2,00%	5,00%	10,00%	10.764.874,02	
Artigo 11º	5,00%	931.030,59	0,37%	0,00%	0,50%	1,00%	1.610.140,36	
Total Renda Variável	30,00%	74.251.684,60	29,22%	12,00%	24,50%	46,00%		

Artigos Exterior	Resolução %	Carteira		Estratégia de Alocação - Limite -			GAP	
		\$	%	Inferior	Alvo	Superior	Superior	Superior
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	2.533.779,21	1,00%	0,50%	3,00%	10,00%	22.877.930,32	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	17.688.540,76	6,96%	2,00%	6,00%	10,00%	7.723.168,77	
Total Exterior	10,00%	20.222.319,97	7,96%	2,50%	9,00%	20,00%		

6) DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS

Os recursos financeiros do Instituto de Previdência do Município de Itapetereira da Serra, apresenta a seguinte distribuição quanto a gestores, administradores e Subsegmento de aplicações:



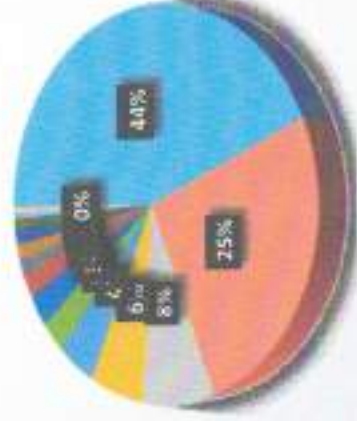
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP, DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

Gestores

Gestão	Valor	% s/ Carteira
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	110.854.792,37	43,62%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	63.676.230,61	25,06%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	19.315.963,54	7,60%
TRIGONO CAPITAL	14.607.330,41	5,75%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	10.723.306,37	4,22%
TARPON INVESTIMENTOS	7.175.778,51	2,82%
RIOBRAVO INVESTIMENTOS	7.170.375,45	2,82%
GUEPARDO INVESTIMENTOS	5.383.046,53	2,12%
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL	3.558.983,02	1,40%
CONSTANCIA INVESTIMENTOS	3.211.264,06	1,26%
SOMMA INVESTIMENTOS	3.198.516,15	1,26%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	2.760.498,84	1,09%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.549.978,83	0,61%
ZION INVEST	931.030,59	0,37%

GESTÃO



- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO DE RECURSOS DTVM
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- BEM DTVM
- BANCO DAYCOVAL
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT
- TARPON INVESTIMENTOS
- RIOBRAVO INVESTIMENTOS
- GUEPARDO INVESTIMENTOS
- SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL
- CONSTANCIA INVESTIMENTOS
- SOMMA INVESTIMENTOS
- AZ QUEST INVESTIMENTOS
- QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS
- ZION INVEST

Administradores

Administrador	Valor	% s/ Carteira
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	110.854.792,37	43,62%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	63.676.230,61	25,06%
BEM DTVM	36.056.946,76	14,19%
BANCO DAYCOVAL	31.874.786,58	12,54%
BNP PARIBAS	10.723.306,37	4,22%
PLANNER TRUSTEE DTVM LTDA.	931.030,59	0,37%

ADMINISTRAÇÃO



- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- BEM DTVM
- BANCO DAYCOVAL
- BNP PARIBAS
- PLANNER TRUSTEE DTVM LTDA.



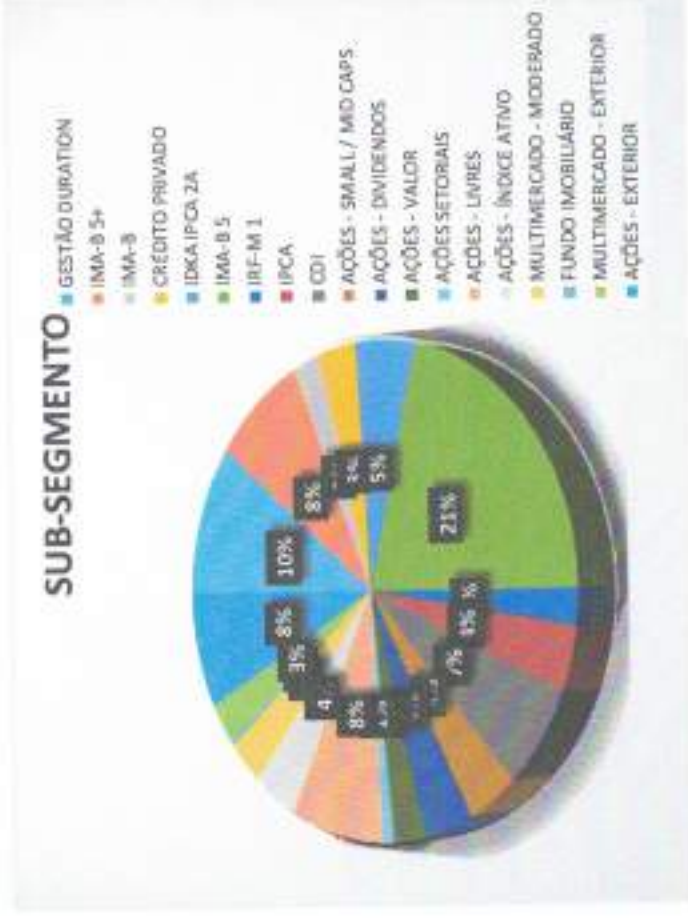
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

Subsegmento das

Aplicações

Sub-Segmento	Valor	% s/Carteira	GESTÃO DURATION
GESTÃO DURATION	26.245.018,30	10,30%	LONGUÍSSIMO PRAZO
IMA-B 5+	20.409.323,69	8,03%	LONGO PRAZO
IMA-B	6.098.138,72	2,40%	
CRÉDITO PRIVADO	8.059.672,17	3,17%	
IDKA IPCA 2A	12.678.472,17	4,99%	MEDIO PRAZO
IMA-B 5	53.507.775,25	21,06%	
IRF-M 1	5.605.555,59	2,21%	CURTO PRAZO
IPCA	10.321.535,25	4,06%	
CDI	16.717.599,20	6,58%	
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	10.170.118,78	4,00%	
AÇÕES - DIVIDENDOS	9.671.086,22	3,81%	
AÇÕES - VALOR	6.933.025,36	2,73%	
AÇÕES SETORIAIS	2.428.170,47	0,96%	
AÇÕES - LIVRES	19.662.177,00	7,74%	
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	9.809.240,67	3,86%	
AÇÕES - MODERADO	7.562.901,87	2,98%	MULTIMERCADO
MULTIMERCADO - MODERADO	931.030,59	0,37%	0,37
FUNDO IMOBILIÁRIO	7.083.933,64	2,79%	EXTERIOR
MULTIMERCADO - EXTERIOR	20.222.319,97	7,96%	
AÇÕES - EXTERIOR			



7) RISCO

Value at Risk (VaR) é um método para avaliar o risco em operações financeiras. O VaR resume, em um número, o risco de um produto financeiro ou o risco de uma carteira de investimentos, de um montante financeiro. Esse número representa a pior perda esperada em um dado horizonte de tempo e é associado a um intervalo de confiança. Existem várias técnicas de avaliação do risco de operações financeiras, tais como Back Test, Stress Test, Expected Shortfall, além do Value at Risk. Essas técnicas visam quantificar o risco de mercado, ou seja, do risco de perdas monetárias decorrentes da variação de preços, de taxas de juros ou de taxas de câmbio.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

Normalmente o VaR é calculado com 95%, 97,5% ou 99% de confiança. Este nível de confiança nos indica que é esperada perda maior que a calculada pelo VaR. Assim, ao utilizar 99% de confiança, espera-se que a cada 100 observações do VaR, em pelo menos 1 vez a perda do investimento financeiro seja superior à perda estimada no cálculo do VaR. Assim, com o auxílio da amostra e distribuição dos retornos do ativo que está em análise e o seu desvio padrão, o VaR calcula qual a probabilidade de perda máxima que se pode ter investindo naquele ativo com um intervalo de confiança. Por exemplo, o VaR calculado de um investimento é de 5% com um intervalo de confiança de 99%. Isso nos diz que a perda máxima que esse investimento pode sofrer é de 5%. Vale destacar que em casos como crise financeira, pandemias e eventos “fora da curva”, as perdas não podem ser mensuradas pelo VaR.

Retorno dos investimentos e benchmark SETEMBRO/2022

Renda Fixa

CDI	Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,93%	7,61%	2,89%	5,46%	9,21%	11,44%	0,80%	0,00%	0,68%
	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1,18%	9,95%	3,60%	6,91%	12,40%	18,49%	0,35%	0,03%	0,66%
	BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRI...	0,99%	8,08%	3,06%	5,77%	9,78%	11,85%	1,00%	0,00%	0,73%
	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	9,12%	3,34%	6,40%	11,18%	14,86%	0,20%	0,03%	0,72%
	BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,85%	6,90%	2,61%	4,89%	8,25%	-	1,75%	0,00%	0,67%
	CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-	-

IDKA IPCA 2 Anos	Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI...	0,51%	6,53%	0,11%	2,61%	8,47%	14,89%	0,20%	1,50%	3,87%
	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREV...	0,53%	6,74%	0,26%	2,81%	8,72%	15,30%	0,20%	1,42%	3,83%
	IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,62%	6,94%	0,09%	2,94%	8,91%	15,68%	-	-	-

IMA-B	Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
	CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1,18%	-0,92%	-3,33%	-1,48%	1,21%	-0,72%	0,20%	2,84%	7,81%
	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	1,50%	6,09%	1,76%	3,18%	7,15%	11,91%	0,20%	2,47%	5,79%
	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO...	1,52%	6,08%	1,80%	3,22%	7,12%	11,92%	0,20%	2,52%	5,76%
	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	1,45%	5,92%	1,63%	3,07%	6,95%	11,76%	0,20%	2,43%	5,75%
	IMA-B (Benchmark)	1,48%	6,12%	1,70%	3,16%	7,25%	12,30%	-	-	-



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

IMA-B 5										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses	
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDE...	0,49%	-	-0,02%	2,35%	-	-	0,20%	1,46%	-	
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,46%	6,65%	0,55%	3,07%	8,60%	13,91%	0,50%	1,19%	3,65%	
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,40%	6,90%	0,40%	3,05%	8,97%	15,18%	0,20%	1,27%	3,76%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,43%	7,04%	0,50%	3,16%	9,15%	15,36%	0,20%	1,26%	3,73%	
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	0,43%	-	0,50%	-	-	-	0,20%	2,06%	-	
IMA-B 5 (Benchmark)	0,42%	7,07%	0,43%	3,14%	9,25%	15,75%	-	-	-	

IMA-B 5+										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PR...	2,36%	4,82%	2,92%	2,95%	4,83%	7,86%	0,20%	3,63%	8,46%	
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,39%	5,10%	3,01%	3,14%	5,19%	8,56%	-	-	-	

IPCA										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses	
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,28%	8,63%	3,51%	5,91%	10,29%	11,11%	0,40%	1,00%	1,54%	
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIX...	1,26%	7,50%	3,07%	5,15%	9,00%	12,03%	0,30%	1,12%	2,24%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIX...	1,24%	8,29%	3,54%	5,84%	9,44%	10,38%	0,20%	0,79%	1,87%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVID...	0,08%	7,15%	0,02%	3,11%	8,79%	15,18%	0,15%	0,75%	3,76%	
IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-	-	

IPCA + 6,00% ao ano										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses	
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO P...	0,56%	7,80%	0,93%	3,74%	9,33%	13,52%	0,20%	1,11%	3,57%	
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,20%	8,74%	0,17%	3,87%	13,60%	32,72%	-	-	-	

IRF-M 1										
Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1,09%	8,39%	3,37%	6,04%	9,57%	12,03%	0,20%	0,13%	1,53%	
IRF-M 1 (Benchmark)	1,11%	8,59%	3,43%	6,17%	9,81%	12,55%	-	-	-	



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPÁ DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

Renda Variável

Não definido		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIME...		-	-	-	-	-	-	1,20%	-	-
Não definido (Benchmark)		-	-	-	-	-	-	-	-	-

CDI		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO		1,04%	8,05%	2,81%	4,58%	10,11%	11,71%	0,85%	0,68	1,67%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCAD...		2,23%	11,46%	6,57%	6,55%	12,47%	18,77%	1,50%	1,41	4,61%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...		1,18%	9,95%	3,60%	6,91%	12,40%	18,49%	0,35%	0,03	0,66%
CDI (Benchmark)		1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-	-

Global BDRX		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I		-7,72%	-30,97%	-4,35%	-14,12%	-22,81%	-8,72%	0,70%	9,55	22,00%
Global BDRX (Benchmark)		-8,38%	-30,78%	-4,37%	-14,20%	-22,27%	-5,91%	-	-	-

Ibovespa		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO		0,82%	-	2,27%	-	-	-	1,20%	1,54	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES		-1,08%	7,96%	10,66%	-2,51%	3,16%	20,85%	2,00%	8,9	19,22%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES		2,32%	16,51%	14,29%	-3,47%	8,76%	20,38%	1,50%	11,02	23,22%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES		4,62%	10,59%	24,42%	-3,83%	10,72%	35,10%	2,00%	8,85	28,12%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES		0,37%	1,73%	11,80%	-8,19%	-6,04%	9,94%	2,00%	10,96	22,67%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES		1,40%	10,29%	21,02%	2,79%	10,29%	-	1,90%	10,7	29,91%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...		-3,16%	8,47%	12,02%	7,95%	5,50%	-	2,50%	8,47	26,84%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES		0,87%	6,60%	13,19%	-7,96%	-2,72%	6,85%	2,50%	10,67	23,63%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC...		-3,26%	2,67%	11,45%	2,83%	-3,52%	79,45%	2,00%	8,68	26,39%
BB AGRO FIC AÇÕES		-3,39%	-1,42%	6,72%	-8,27%	-1,84%	-	1,00%	7,54	21,32%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES		-0,37%	8,09%	11,15%	-6,96%	0,09%	11,31%	2,00%	10,7	22,58%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES		3,71%	20,84%	25,28%	5,18%	19,66%	73,30%	2,00%	8,75	24,47%
Ibovespa (Benchmark)		0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-	-



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

IBX		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
QUELUZ VALOR FI AÇÕES		-0,20%	5,20%	8,31%	-7,91%	-3,62%	-6,12%	2,00%	11,38	20,81%
IBX (Benchmark)		-0,05%	4,43%	10,77%	-9,10%	-1,33%	16,26%	-	-	-

IFIX		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES F...		-2,21%	44,04%	-4,09%	2,84%	24,69%	411,54%	1,60%	9,65	97,99%
IFIX (Benchmark)		0,49%	6,63%	6,98%	7,58%	10,13%	7,01%	-	-	-

MSCI ACWI		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO ...		-8,62%	-19,76%	-2,65%	-17,23%	-9,27%	18,60%	1,20%	11,7	22,46%
MSCI ACWI (Benchmark)		-5,78%	-28,97%	-4,29%	-11,25%	-22,48%	-6,15%	-	-	-

MSCI USA Extended ESG Focus		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I		-6,40%	-29,77%	-3,31%	-12,80%	-21,19%	-6,54%	1,00%	9,65	21,42%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)		-5,60%	-28,67%	-2,27%	-10,43%	-19,81%	-0,31%	-	-	-

SMLL		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos										
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES		-2,18%	-5,30%	7,57%	-10,89%	-13,12%	0,05%	2,00%	9,77	18,16%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		-0,93%	-5,64%	11,31%	-13,98%	-16,94%	-1,99%	2,00%	10,87	27,21%
SMLL (Benchmark)		-1,84%	-8,06%	14,47%	-13,82%	-18,43%	-5,58%	-	-	-



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

Investimento no Exterior

Global BDRX										
Ativos										
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses	
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-7,72%	-30,97%	-4,35%	-14,12%	-22,81%	-8,72%	0,70%	9,55	22,00%	
Global BDRX (Benchmark)	-8,38%	-30,78%	-4,37%	-14,20%	-22,27%	-5,91%	-	-	-	

MSCI ACWI										
Ativos										
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses	
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVES...	-6,57%	-29,50%	-3,00%	-11,56%	-24,72%	-2,41%	0,85%	9,68	19,52%	
MSCI ACWI (Benchmark)	-5,78%	-28,97%	-4,29%	-11,25%	-22,48%	-6,15%	-	-	-	

MSCI USA Extended ESG Focus										
Ativos										
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses	
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,40%	-29,77%	-3,31%	-12,80%	-21,19%	-6,54%	1,00%	9,65	21,42%	
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-5,60%	-28,67%	-2,27%	-10,43%	-19,81%	-0,31%	-	-	-	

MSCI WORLD										
Ativos										
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	VaR Mês	Volatilidade - 12 meses	
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMEN...	-5,93%	-25,33%	-3,29%	-8,74%	-17,98%	-4,94%	0,70%	7,24	18,70%	
MSCI WORLD (Benchmark)	-5,49%	-28,69%	-3,57%	-11,09%	-21,36%	-3,69%	-	-	-	

8) DELIBERAÇÕES

Deliberações do comitê de investimentos:

RESGATE

CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LP- Resgate de R\$ 2.000.000,00 para diversificação da carteira em ativos de maior rentabilidade. Os recursos do resgate ficará disponível no fundo CAIXA BR DISPONIBILIDADES.

RESGATE

BB IDKA 2 TP RF LP PREVIDENCIARIO – Resgate de R\$ 2.000.000,00 para diversificação da carteira os recursos do resgate foram aplicados no fundo BB TP XXI FI RF PREVIDENCIARIO.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

APLICAÇÃO

DAYCOVAL CLASSIC FI RF CREDITO PRIVADO - Aplicação de R\$ 3.000.000,00 em ativos de credito privado atrelados aos CDI para diversificação da carteira, os recursos da aplicação foram resgatados do fundo CX BR DISPONIBILIDADES.

APLICAÇÃO

BB IMA-B5 FIC RF PREVIDENCIARIO LP – Aplicação de R\$ 3.000.000,00 em ativos renda fixa de médio prazo, os recursos para aplicação foram resgatados do fundo BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIARIO.

RESGATE

CAIXA BR IPCA XVI FI RF CREDITO PRIVADO – Resgate de R\$ 1.500.000,00 para diversificação da carteira, os recursos do resgate ficarão disponíveis no fundo CX BR DISPONIBILIDADES para futura aplicação.

RESGATE

CAIXA BRASIL GESTAO ESTRATEGICA – Resgate de R\$ 1.000.000,00 para aplicação em ativos de maior rentabilidade, os recursos do resgate ficarão aplicados no fundo CX BR DISPONIBILIDADES.

RESGATE

CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP – Resgate de R\$ 2.000.000,00 para aplicação em ativos de maior rentabilidade, os recursos do resgate ficarão aplicados no fundo CX BR DISPONIBILIDADES.

APLICAÇÃO

BB TP XXI FI RF PREVIDENCIARIO – Aplicação de R\$ 2.000.000,00 em fundo vértice de curto prazo, com os títulos públicos pagamento cupons acima de IPCA+ 5% ao ano, estes ativos tomam-se ótimas opções para diversificação da carteira. Os recursos da aplicação foram resgatados do fundo BB IDKA 2 TP RF LP PREVIDENCIARIO.

RESGATE

META VALOR FI AÇÕES – Resgate total do fundo no valor de R\$ 6.534.445,62, o fundo META VALOR, não vem apresentando boa rentabilidade após o período de maior impacto da pandemia em comparativo aos seus pares.

APLICAÇÃO

DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES – aplicação de R\$ 6.534.445,62 referente ao resgate do fundo META VALOR FI AÇÕES, o fundo Ibovespa ativo possui em sua premissa superar a rentabilidade do índice IBOVESPA



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

RESGATE

CAIXA INDEXADO BOLSA AMERICANA – Resgate de R\$ 2.000.000,00, os ativos de investimento no exterior estão sofrendo grandes impactos negativos devido a inflação americana, resgate para diminuição da volatilidade da carteira.

RESGATE

CAIXA BR ESTRATEGIA LIVRE MULTIMERCADO - Resgate de R\$ 1.500.000,00 para diversificação da carteira, os recursos do resgate ficarão aplicados no fundo CX BR DISPONIBILIDADES para futura diversificação.

RESGATE

BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIARIO – Resgate de R\$ 3.000.000,00 para diversificação da carteira, os recursos do resgate serão aplicados no fundo BB IMA-B5 TP RF LP PREVIDENCIARIO.

APLICAÇÃO

TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES – aplicação de R\$ 3.000.000,00 para diversificação em ativos de renda variável, os fundos da gestora TRIGONO apresentam excelentes retorno no ano mesmo em meio a forte volatilidade do mercado. Os recursos da aplicação foram resgatados do fundo CX BR DISPONIBILIDADE.

APLICAÇÃO

TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES – Aplicação de R\$ 3.000.000,00 em fundo de renda variável estratégia dividendos, os fundos da gestora TRIGONO apresentam excelentes retorno no ano mesmo em meio a forte volatilidade do mercado. Os recursos da aplicação foram resgatados do fundo CX BR DISPONIBILIDADE.

APLICAÇÃO

RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO – R\$ Aplicação de R\$ 3.000.000,00 em ativo multimercado capital protegido, este tipo de fundo possui uma estratégia de proteção do capital investido em cenário adverso. Os recursos da aplicação serão resgatados do fundo CX BR DISPONIBILIDADE.

Repasso das contribuições dos entes - Estima-se o recebimento de aproximadamente R\$ 3.100.000,00 (três milhões e cem mil reais) que serão utilizados aproximadamente R\$ 900.000,00 (Novecentos mil reais) para pagamento de benefícios e custeio do RPPS. O Saldo restante ficará aplicado no fundo CX BR DISPONIBILIDADE para futura diversificação da carteira.

9) Análises Técnicas

- A carteira do RPPS atende as especificações e enquadramentos e limites da resol. 3922/2010.

- A carteira do RPPS possui 76,02 % de liquidez, permitindo a manutenção do portfólio em casos de mudanças no cenário econômico.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP, DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

- Não há desequilíbrio ou ativos em liquidação na carteira do RPPS.

- No fechamento de agosto, a carteira de investimentos encontra-se com rentabilidade abaixo da meta atuarial acumulada projetada, devido a disseminação da pandemia de COVID-19 e incertezas políticas e fiscais.

10) Credenciamento

Distribuidores

Distribuidores com credenciamento válidos.

Gestores

FINACAP INVESTIMENTOS LTDA

BB GESTÃO DE RECURSOS DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS PÚBLICOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A

AZQUEST INVESTIMENTOS

META ASSET MANAGEMENT

Administradores

CAIXA ECONOMICA FEDERAL

11) Assuntos Gerais:

No mês de setembro a carteira foi fortemente impactada pelos dados negativos no cenário exterior, diversos países estão se deparando com índices inflacionários a muito tempo não vistos, no Brasil o combate inflacionário começou antes já em 2021 com a elevação das taxas de juros. O COPOM sinalizou o encerramento da subida da taxa de juros brasileira, ao contrário de EUA e EUROPA que começam agora uma tímida elevação, o COPOM não descarta ainda uma elevação adicional da taxa a depender do nível que os países desenvolvidos elevarem suas taxas. Somado a inflação ainda a os desdobramentos da invasão da Rússia a Ucrânia, com a aproximação do inverno europeu a preocupação com o abastecimento energético principalmente com o fornecimento do gás russo que pode ser cortado a qualquer momento para a Europa.

Deliberado pela aplicação no fundo RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO, após explanação dos representantes da distribuidora do fundo PRIVATIZA, o comitê de investimentos deliberou pelo aporte após análise favorável da consultoria CREDITO E MERCADO, o fundo possui em sua política de investimentos buscar retorno aos seus cotistas através de investimentos em



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

diversas classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, renda variável, cambial e derivativos, negociados nos mercados interno, sem o compromisso de concentração em nenhuma classe específica, o fundo possui ainda, o objetivo de acompanhar a variação do índice S&P 500, com proteção do capital investido durante a vigência da operação estruturada. Devido à alta concentração do RPPS em renda variável, optou-se pelo aporte no valor de R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais).

Deliberado pelo comitê aplicação no fundo FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES, em visita ao distribuidor R3 investimentos o fundo em questão foi apresentado ao comitê de investimentos, o fundo segue a estratégia “valor” de investimentos desenvolvida por Benjamin Graham, que consiste em encontrar ações que estão sendo negociadas a um preço abaixo do seu valor intrínseco que estão subvalorizadas e adquiri-las neste momento, a fim de aguardar a convergências de fatores que levarão estes determinados papéis aos seus preços considerados justos. A consultoria de investimentos recomendou o aporte no fundo recomendando que os recursos da aplicação sejam resgatados de fundo do mesmo segmento, para aplicação neste fundo foram resgatados recursos do fundo META VALOR FI AÇÕES, que não estava performando satisfatoriamente em comparação a ativos da mesma classe. Devido à alta exposição em segmentos de renda variável o comitê de investimentos optou pelo aporte de R\$ 4.000.000,00 (Quatro milhões de reais) o que não traz nenhum tipo de desenquadramento a carteira do RPPS.

No processo de acompanhamento e avaliação regular dos ativos que compõem a carteira, o comitê deliberou pelo resgate total dos ativos que não apresentam retorno satisfatório a carteira do RPPS em comparação a outros ativos da mesma categoria, os resgates mencionados não trazem prejuízo ao capital investido, todos os resgates acontecem com ganho a carteira do RPPS:

BB IMA-B5+ TP RF PREVIDENCIARIO
BB AGRO FIC AÇÕES
SOMMA BRASIL FI AÇÕES
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIARIO
CAIXA ESTRATEGIA LIVRE MULTIMERCADO
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES

Em análise para resgate total:
QUELUZ VALOR FI AÇÕES



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

Este fundo possui a estratégia “valor” de investimentos, e desde a aplicação do RPPS em junho/2021 não apresenta retornos satisfatório e em linhas em comparação aos seus pares de mercado, no fechamento de SET/22 o fundo apresenta prejuízo em valor de R\$ 450.021,17 do capital investido de R\$ 2.000.000,00, o comitê de investimentos acompanha a rentabilidade do fundo para efetuar o resgate de no mínimo o capital investido para aplicação em ativos que traga retorno a carteira do RPPS.

Resgate parcial dos ativos:

CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I

BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NIVEL I

CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP

Estes ativos estão expostos a economias globais e americana, e estes ativos estão sofrendo com a subida da taxa de juros global, o que traz uma volatilidade que afeta a rentabilidade da carteira do RPPS, o resgate parcial se deve a busca para diminuição desta volatilidade até que o stress das economias desenvolvidas diminua e, será analisado a possibilidade de novos aportes. Os resgates não trazem prejuízo ao capital investido.

Conforme nota técnica SEI N457/2022 referente as aplicações em fundos para investidor qualificado, o comitê de investimentos acompanha os fundos:

ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTAVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES
SCHORDER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVEST. NO EXTERIOR FIC AÇÕES

Conforme a resolução Nº4963/21, os RPPS que não possuem o pró gestão a partir de 02 de maio de 2021 perderam o status de investidor qualificado, o RPPS de Itapeçerica da Serra fez adesão, mas, até momento, não se certificou em nenhum nível. Até a publicação da nota técnica Nº457/22 o RPPS poderia manter os ativos na carteira, mas não pode realizar novos aportes. Com a publicação da nota Nº 457/22 o RPPS deverá certificar-se ao pró gestão ou resgatar os recursos aportados desde que não ocorram prejuízos ao capital investido, com a volatilidade do cenário externo estas duas aplicações de nossa carteira estão com rentabilidade negativa no capital investido, o que impossibilita o resgate neste momento. O comitê de investimento acompanhará o que ocorrer primeiro, a certificação do RPPS ao Pró gestão para manter os ativos na carteira, ou a recuperação do capital investido para análise de possível resgate se o RPPS não estiver próximo da obtenção da certificação pró gestão.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

No processo de atualização e aprimoramento, os membros do comitê de investimentos, participaram do Congresso Previdenciário da APEPREV em Curitiba/PR e do encontro sobre Perspectivas Política, econômica e de Mercado realizado pelo gestor de fundos BNP Paribas. .


No processo de debates com gestores e distribuidores de fundos de investimentos o comitê de investimentos reuniu-se com os representantes das empresas:

DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT
TRIGONO CAPITAL
R3 INVESTIMENTOS
DOLLAR BILLS

Com a SELIC alta até o final de 2022, os fundos vértices continuam atrativos para valorização dos recursos previdenciários, o comitê de investimentos avaliará novos aportes nesses fundos, com aportes pontuais em fundos de renda variável e investimentos no exterior para composição da carteira.


José Roberto dos Santos
Membro Comitê de investimento
CPA-10/ICGRPPS


Alex Domingues de Castro Santos
Membro Comitê de investimento
CPA-10/ICGRPPS


Rafael de Jesus Freitas
Membro Comitê de investimento
CPA-10



REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO FISCAL

Aos dias 20 de outubro de dois mil e vinte dois às 14h, 92ª (nonagésima segunda reunião), do Conselho Fiscal do ITAPREV, reunião ordinária com os senhores membros do Conselho Fiscal, realizada na Sala de Reuniões do Bloco B do Complexo Administrativo da Prefeitura, com Ana Maria Bondezan, Conceição Aparecida Borges Kusuki Conselho, Eyandro Ferreira Domingues Conforme análise do Balançete de Receitas e Despesas do mês de setembro de dois mil e vinte dois, saldo de fechamento R\$ 254.117.442,20 (duzentos e cinquenta e quatro mil e dezessete mil quatrocentos e quarenta e dois reais e vinte centavos). Observando quanto pendência de Repasse de Contribuição Patronal da Prefeitura Municipal de Itapeçerica da Serra e Autarquia Municipal de Saúde a partir do mês setembro de 2022, está sendo efetuado o pagamento da 21ª (vigésima primeira) parcela do total de 24 (vinte e quatro) parcelas, atualizadas no valor R\$ 236.590,92 (duzentos e trinta e seis mil quinhentos e noventa reais e dois centavos) referente ao pagamento da Prefeitura Municipal de Itapeçerica da Serra, e o valor de R\$ 160.418,76 (cento e sessenta mil quatrocentos e dezoto reais e setenta e seis centavos) da Autarquia Municipal de Saúde de Itapeçerica da Serra, mês setembro de 2022. Analisado o Relatório do Comitê de Investimentos do mês de agosto e setembro de 2022, onde lido foi e APROVADO na sua íntegra. Encerrada esta reunião a qual lavro a ata e assinamos abaixo, ficando confirmada a próxima reunião ordinária para o dia 17 (dezessete) de novembro dois mil e vinte dois, às 14h, neste mesmo local.

Ana Maria Bondezan
Presidente do Conselho Fiscal

Conceição Aparecida Borges Kusuki
Secretária do Conselho Fiscal

Conselheiro Eyandro Ferreira Domingues
Conselho Fiscal



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL

O Conselho Fiscal, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, aprovou o relatório de investimentos referente ao mês de ABRIL 2022, conforme registro na ata de reunião em anexo



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA

ESTADO DE SÃO PAULO



**CRÉDITO
& MERCADO**

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º trimestre de 2022



CRÉDITO & MERCADO

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	3.649.172,34	1,44%	520	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	20.213,76	0,01%	1.553	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.808.967,32	1,89%	1.030	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 6 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	11.154.241,07	4,39%	796	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	1.024.406,04	0,40%	222	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.559.273,33	0,65%	575	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	10.321.535,25	4,06%	336	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-09-15	15.177.359,43	5,97%	269	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	2027-05-16	15.123.457,23	5,95%	58	6,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	19.364.915,65	7,63%	89	2,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	6.669.547,05	2,62%	322	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.532.230,73	0,60%	808	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	7.671.505,22	3,10%	1.035	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 6 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	12.052.717,52	4,74%	975	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.190.353,41	0,86%	773	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.605.555,59	2,21%	1.173	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	9.584.888,21	3,81%	3.243	5,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.743.528,41	1,08%	868	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	11.378.729,02	4,48%	120	1,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	7.284.208,98	2,87%	976	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '



Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	2.248.511,98	0,86%	250	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	16/04/2016	5.030.319,36	1,98%	112	2,31%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 ou	Não há	3.020.352,81	1,19%	46.671	0,19%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.760.498,84	1,09%	4.177	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 ou	Não há	2.428.170,47	0,96%	6.432	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	6.957.385,79	2,74%	622	3,29%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+7 ou	Não há	2.473.375,75	0,97%	9.733	0,77%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.211.264,06	1,26%	3.960	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	6.610.724,52	2,60%	580	4,44%	Artigo 8º, Inciso I
GUERPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.363.046,53	2,12%	34	0,49%	Artigo 8º, Inciso I
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	1.549.878,83	0,61%	68	1,73%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	2.317.748,84	0,91%	18	3,13%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.196.516,10	1,26%	2.840	0,92%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.045.694,64	1,99%	47	0,39%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.130.063,87	0,84%	193	1,19%	Artigo 8º, Inciso I
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	9.671.086,22	3,81%	18	2,26%	Artigo 8º, Inciso I
TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	4.936.244,19	1,94%	31	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO ...	D+5 ou	Não há	1.292.544,83	0,51%	66	2,09%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 ou	Não há	1.241.234,38	0,49%	316	0,47%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	6.740.075,22	3,44%	15.427	1,25%	Artigo 9º, Inciso III



Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	8.948.465,54	3,52%	518	0,43%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 ou	Não há	1.951.184,97	0,77%	98	1,64%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.429.984,98	0,56%	128	0,18%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	4.055.310,13	1,61%	10.270	0,24%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERC...	D+3 ou	25 meses	2.888.623,51	1,18%	21	1,46%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 ou	Não há	4.181.751,94	1,65%	20	2,55%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI ...	Não se ...	Não se aplica	601.030,69	0,37%		0,65%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			254.117.095,28				



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%	10,00%	50,00%	127.058.547,64
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	127.928.339,15	50,34%	20,00%	34,00%	90,00%	100.777.046,60
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	7.623.512,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	23.655.079,39	9,31%	10,00%	14,50%	60,00%	126.815.177,78
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	6,00%	20,00%	50.823.419,06
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	8.059.672,17	3,17%	0,00%	5,00%	5,00%	4.646.182,59
Total Renda Fixa	100,00%	159.543.090,71	62,62%	30,00%	69,50%	228,00%	



RENDA FIXA 159.543.090,71
 RENDA VARIÁVEL 74.251.684,60
 EXTERIOR 20.222.319,97



Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 6º, Inciso I	30,00%	58.673.818,50	23,09%	10,00%	19,00%	30,00%	17.561.310,06
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.705.854,75
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	14.646.835,51	5,76%	2,00%	5,00%	10,00%	10.764.674,02
Artigo 11*	5,00%	931.030,59	0,37%	0,00%	0,50%	1,00%	1.610.140,36
Total Renda Variável	30,00%	74.251.684,60	29,22%	12,00%	24,50%	46,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	2.533.779,21	1,00%	0,50%	3,00%	10,00%	22.677.930,32
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	17.686.540,76	6,96%	2,00%	6,00%	10,00%	7.723.168,77
Total Exterior	10,00%	20.222.319,97	7,96%	2,50%	9,00%	20,00%	



Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão	Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite	
					Carteira \$	Carteira %	Inferior (%)	Superior (%)
CAIXA DTVM	110.654.752,37	43,62	-	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	50,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	63.676.230,61	25,06	-	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	127.928.339,15	50,34	20,00	90,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	19.315.963,54	7,60	0,17	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	3,00
TRÍGONO CAPITAL	14.607.330,41	5,75	0,33	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	23.656.079,39	9,31	10,00	60,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	10.723.306,37	4,22	0,02	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	8.059.672,17	3,17	0,00	5,00
TARPON INVESTIMENTOS	7.175.778,51	2,82	0,10	Artigo 8º, Inciso I	58.673.818,50	23,09	10,00	30,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	7.170.375,45	2,82	0,55	Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
GUEPARDO INVESTIMENTOS	5.383.046,53	2,12	0,16	Artigo 9º, Inciso II	2.533.779,21	1,00	0,50	10,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	3.658.983,02	1,40	0,04	Artigo 9º, Inciso III	17.688.540,76	6,96	2,00	10,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.211.264,06	1,26	0,19	Artigo 10º, Inciso I	14.646.835,51	5,76	2,00	10,00
SOMMA INVESTIMENTOS	3.188.516,15	1,26	-	Artigo 11º	931.030,59	0,37	0,00	1,00
AZQUEST INVESTIMENTOS	2.760.488,84	1,09	0,01	Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.549.978,83	0,61	-					
ZION INVEST	931.030,59	0,37	-					

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)



	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,62%	6,94%	0,08%	2,94%	8,91%	15,88%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	6,74%	0,26%	2,81%	8,72%	15,30%	1,42%	0,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,51%	6,53%	0,11%	2,61%	8,47%	14,89%	1,50%	0,04%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,20%	6,74%	0,17%	3,87%	13,60%	32,72%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,56%	7,80%	0,93%	3,74%	9,33%	13,42%	1,11%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,39%	0,10%	3,01%	3,14%	5,19%	8,66%	-	-
BS IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,36%	4,82%	2,92%	2,95%	4,83%	7,88%	3,63%	0,08%
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%	0,02%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,42%	7,07%	0,43%	3,14%	9,25%	15,76%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	7,04%	0,50%	3,16%	9,16%	15,36%	1,26%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,40%	6,90%	0,40%	3,05%	8,97%	15,18%	1,27%	0,04%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,46%	6,65%	0,55%	3,07%	8,60%	13,91%	1,19%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	-	-0,02%	2,35%	-	-	1,46%	-
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,43%	-	0,50%	-	-	-	2,06%	-

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var. Mês	Volatilidade 12M
IMA-B (Benchmark)								
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48%	6,12%	1,70%	3,16%	7,25%	12,30%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,45%	5,92%	1,63%	3,07%	6,95%	11,76%	2,43%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,52%	5,08%	1,80%	3,22%	7,12%	11,92%	2,52%	0,06%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,18%	-0,92%	-3,33%	-1,49%	1,21%	-0,72%	2,84%	0,08%
CDI (Benchmark)								
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	8,80%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,11%	9,12%	3,34%	6,40%	11,18%	14,86%	0,03%	0,01%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,99%	8,08%	3,06%	5,77%	9,78%	11,85%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1,18%	9,90%	3,60%	6,91%	12,40%	18,48%	0,03%	0,01%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,93%	7,61%	2,89%	5,46%	9,21%	11,44%	0,00%	0,01%
	0,85%	6,90%	2,61%	4,89%	8,25%	-	0,00%	0,01%
IPCA (Benchmark)								
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	16,15%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,06%	7,15%	0,02%	3,11%	6,79%	15,16%	0,75%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,24%	6,29%	3,54%	5,84%	9,44%	10,38%	0,78%	0,02%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,26%	7,50%	3,07%	5,16%	9,00%	12,03%	1,12%	0,02%
	1,28%	6,63%	3,51%	5,91%	10,29%	11,11%	1,00%	0,02%



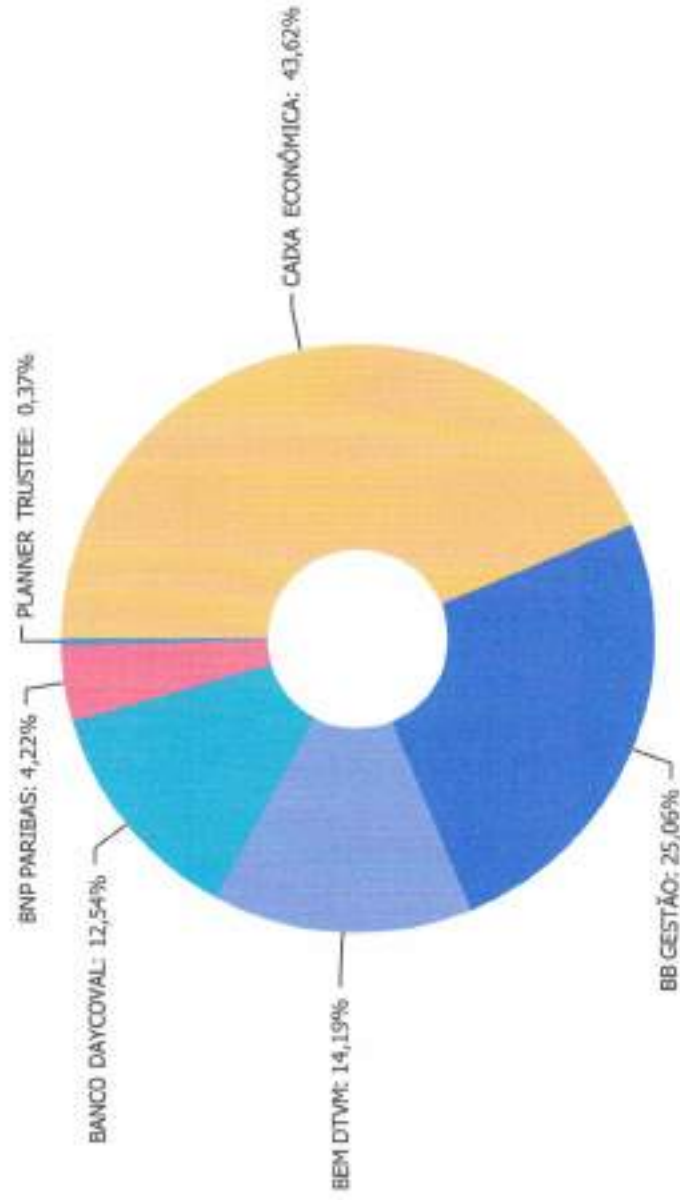
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-5,00%	-28,67%	-2,27%	-10,43%	-19,61%	-0,31%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,40%	-59,77%	-3,31%	-12,80%	-21,19%	-6,54%	9,65%	0,21%
Global BDRX (Benchmark)	-6,36%	-30,78%	-4,37%	-14,20%	-22,27%	-5,91%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,72%	-30,97%	-4,35%	-14,12%	-22,61%	-8,72%	9,65%	0,22%
IBX (Benchmark)	-0,05%	4,43%	10,77%	-9,10%	-1,33%	16,28%	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-0,20%	5,20%	8,32%	-7,91%	-3,62%	-0,12%	11,36%	0,21%
Ibovespa (Benchmark)	0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	0,87%	6,68%	13,19%	-7,96%	-2,72%	6,65%	10,67%	0,24%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	0,37%	1,73%	11,80%	-8,16%	-6,04%	9,94%	10,96%	0,23%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,08%	7,96%	10,65%	-2,51%	3,16%	20,85%	6,90%	0,19%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-0,37%	8,06%	11,15%	-6,96%	0,10%	11,32%	10,70%	0,23%
TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,26%	2,66%	11,46%	2,83%	-3,53%	79,45%	6,68%	0,26%
QUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,40%	10,29%	21,02%	2,79%	10,28%	-	10,70%	0,30%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	2,33%	16,51%	14,29%	-3,47%	8,76%	20,38%	11,02%	0,23%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	3,71%	20,84%	25,28%	5,18%	19,66%	73,30%	6,75%	0,24%
BB AGRO FIC AÇÕES	-3,39%	-1,42%	6,72%	-6,27%	-1,94%	-	7,54%	0,21%
TRIGOND DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,16%	8,47%	12,02%	7,96%	5,50%	-	8,47%	0,27%



	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	4,62%	10,59%	24,42%	-3,83%	10,72%	35,10%	8,85%	0,26%
SMLL (Benchmark)	-1,84%	-8,05%	14,47%	-13,82%	-18,43%	-5,56%	-	-
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-0,83%	-5,64%	11,31%	-13,98%	-16,94%	-1,89%	10,87%	0,27%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-2,16%	-5,30%	7,57%	-10,89%	-13,12%	0,05%	9,77%	0,18%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,80%	14,21%	-	-
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,18%	9,89%	3,60%	6,91%	12,40%	15,48%	0,03%	0,01%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,23%	11,46%	6,57%	6,55%	12,47%	18,77%	1,41%	0,05%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,04%	8,05%	2,81%	4,38%	10,11%	11,71%	0,88%	0,02%
MSCI ACWI (Benchmark)	-5,78%	-29,97%	-4,20%	-11,25%	-22,48%	-8,15%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-8,63%	-19,70%	-2,69%	-17,23%	-9,27%	15,60%	11,70%	0,22%
FIX (Benchmark)	0,49%	6,63%	6,86%	7,58%	10,13%	7,01%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI - CARE11	-2,21%	44,04%	-4,09%	2,84%	24,69%	411,54%	9,65%	0,96%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-5,00%	-28,07%	-2,27%	-10,43%	-19,81%	-0,31%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,40%	-29,77%	-3,31%	-12,80%	-21,19%	-6,54%	9,55%	0,21%
Global BDRX (Benchmark)	-8,38%	-30,78%	-4,37%	-14,20%	-22,27%	-5,91%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,72%	-30,97%	-4,35%	-14,12%	-22,81%	-8,72%	9,55%	0,22%
MSCI WORLD (Benchmark)	-6,49%	-26,69%	-3,57%	-11,09%	-21,36%	-3,89%	-	-
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	-5,93%	-25,33%	-3,29%	-8,74%	-17,98%	-4,94%	7,24%	0,19%
MSCI ACWI (Benchmark)	-5,78%	-26,97%	-4,29%	-11,25%	-22,46%	-6,15%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	-8,57%	-29,50%	-3,00%	-11,58%	-24,72%	-2,41%	9,69%	0,20%

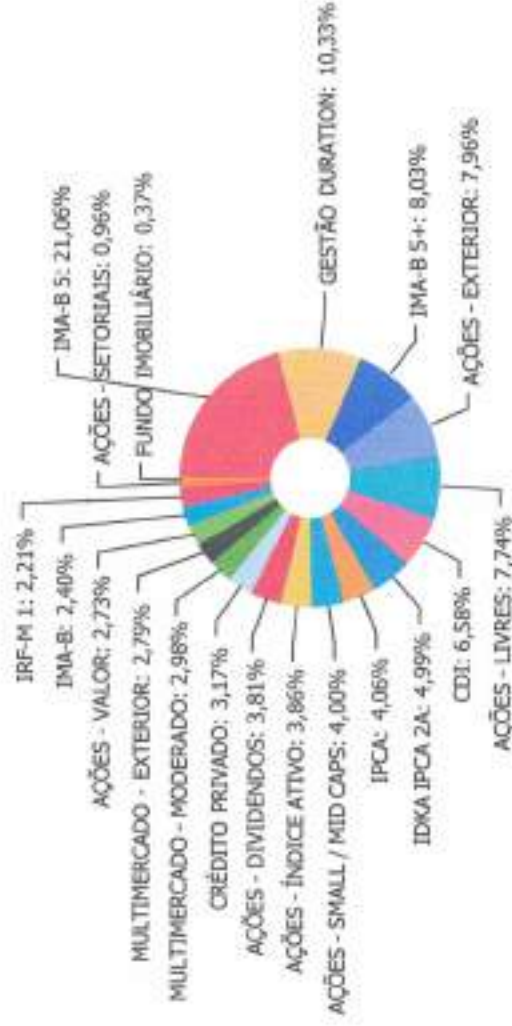


Administrador	Valor
CAIXA ECONÔMICA	110.854.792,37
BB GESTÃO	63.676.230,61
BEM DTVM	36.056.946,76
BANCO DAYCOVAL	31.874.788,58
BNP PARIBAS	10.723.306,37
PLANNER TRUSTEE	931.030,59



CRÉDITO & MERCADO

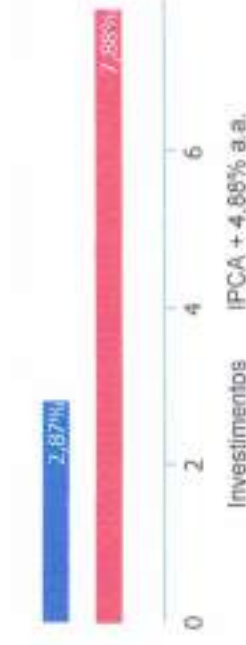
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2022)



■ IMA-B 5	53.507.775,25	■ GESTÃO DURATION	26.245.018,30	■ IMA-B 5+	20.409.323,69	■ AÇÕES - EXTERIOR	20.222.319,97
■ AÇÕES - LIVRES	19.662.177,00	■ CDI	16.717.599,20	■ IDKA IPCA 2A	12.678.472,54	■ IPCA	10.321.535,25
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	10.170.118,78	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	9.809.240,67	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	9.671.086,22	■ CRÉDITO PRIVADO	8.059.672,17
■ MULTIMERCADO - MODERADO	7.562.901,87	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	7.083.933,64	■ AÇÕES - VALOR	6.933.025,36	■ IMA-B	6.098.138,72
■ IRF-M 1	5.605.555,59	■ AÇÕES - SETORIAIS	2.428.170,47	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	931.030,59		

**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum.	Retorno Mês	Reformo Acum.	Meta Mês	Meta Acum.	Gap Acum.	VaR
Janeiro	214.632.111,69	11.944.031,15	6.040.231,47	221.301.245,11	765.333,74	765.333,74	0,35%	0,35%	0,94%	0,94%	36,52%	3,50%
Fevereiro	221.301.245,11	21.425.532,35	20.712.943,48	222.686.288,48	672.454,50	1.437.788,24	0,30%	0,65%	1,37%	2,33%	27,98%	3,44%
Março	222.686.288,48	14.098.344,28	10.872.124,90	231.476.765,48	5.584.257,60	7.002.045,84	2,46%	3,11%	2,04%	4,42%	70,85%	4,45%
Abril	231.476.765,48	25.238.248,27	21.942.687,22	231.503.797,81	-3.258.539,70	3.733.516,14	-1,39%	1,66%	1,42%	5,90%	28,70%	3,86%
Mai	231.503.797,81	29.841.260,89	26.493.926,60	237.356.791,31	2.505.659,21	6.239.175,35	1,07%	2,73%	0,89%	6,85%	40,60%	4,57%
Junho	237.356.791,31	58.116.281,58	54.639.551,02	233.630.162,85	-7.203.359,02	-664.183,67	-2,99%	-0,23%	1,07%	7,99%	-3,69%	4,86%
Julho	233.630.162,85	32.333.753,66	28.905.583,45	241.703.488,38	4.645.165,12	3.680.981,45	1,98%	1,66%	-0,28%	7,68%	21,56%	4,11%
Agosto	241.703.488,38	17.566.409,07	14.218.752,01	248.975.865,11	3.924.719,67	7.605.701,12	1,60%	3,20%	0,07%	7,76%	42,35%	4,76%
Setembro	248.975.865,11	35.665.557,87	32.278.765,32	251.353.252,11	-1.009.405,55	6.596.295,57	-0,40%	2,87%	0,11%	7,88%	36,49%	4,16%

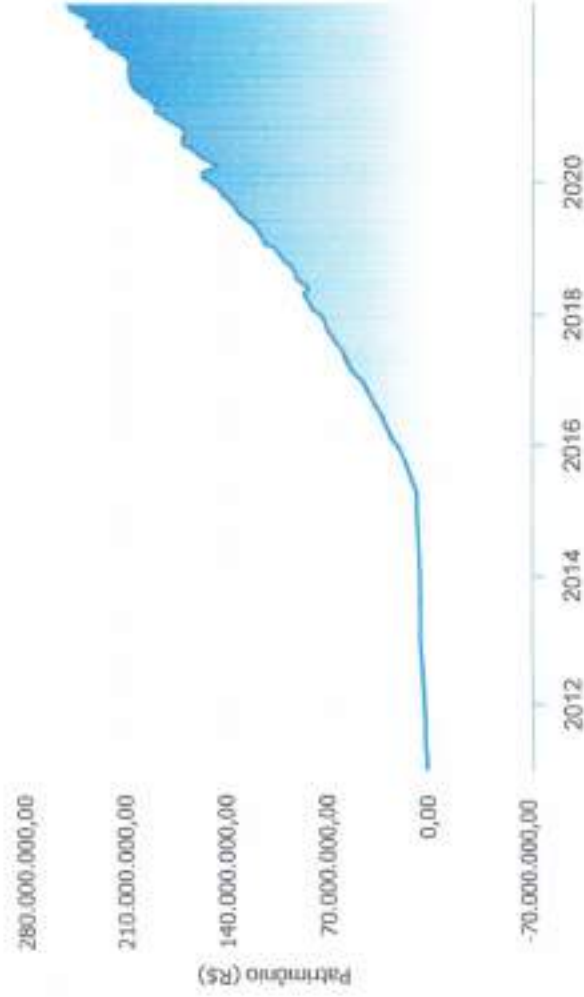
Investimentos x Meta de Rentabilidade



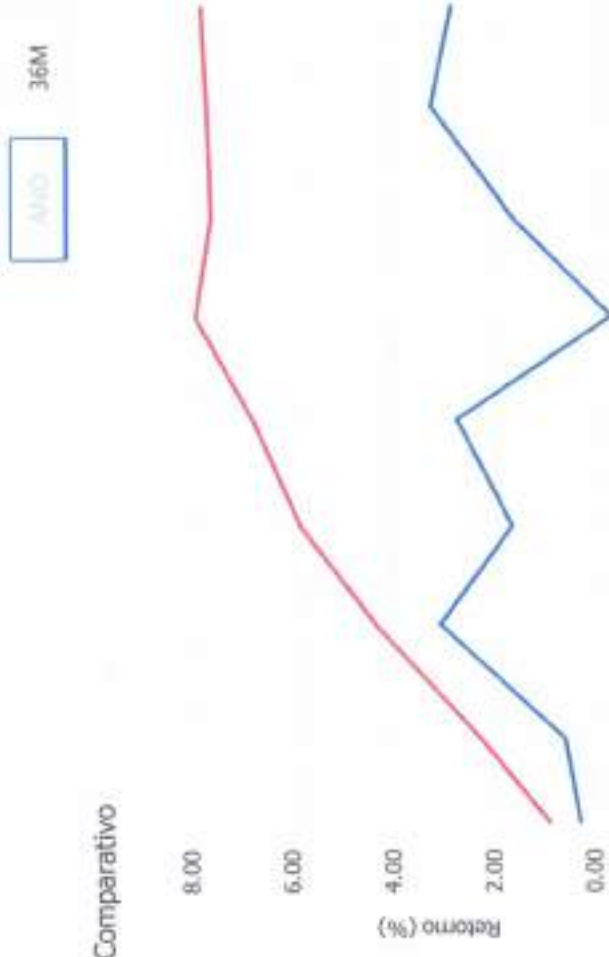
CRÉDITO & MERCADO

Gráficos Ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



AVD 36M

Investimentos

IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1

IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

Meta de Rentabilidade

CDI IMA-B

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2022****FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Insút	Var - Mês
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.000.817,14	0,00	0,00	1.024.408,04	23.590,90	2,36%	2,36%	3,63%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	2.214.813,89	0,00	0,00	2.246.511,96	33.698,09	1,52%	1,52%	2,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.158.058,31	0,00	0,00	2.190.353,41	32.294,10	1,50%	1,50%	2,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.635.550,50	0,00	0,00	1.659.273,33	23.722,83	1,45%	1,45%	2,43%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.603.951,43	0,00	0,00	3.649.172,34	45.220,91	1,25%	1,25%	1,12%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	19.168.943,63	0,00	0,00	19.384.915,65	225.972,02	1,18%	1,18%	2,84%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	13.225.590,79	0,00	2.000.000,00	11.378.729,02	153.138,23	1,16%	1,28%	1,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.204.587,63	0,00	0,00	7.284.208,98	79.621,35	1,11%	1,11%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.545.231,70	0,00	0,00	5.605.555,59	60.323,89	1,09%	1,09%	0,13%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.874.080,38	0,00	158.475,97	2.743.629,41	28.025,00	0,86%	0,99%	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.510.211,26	0,00	1.000.000,00	1.532.230,73	22.019,47	0,88%	1,24%	0,79%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	11.283,80	9.747,00	974,72	20.213,76	157,68	0,75%	0,85%	0,00%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	3.000.000,00	0,00	3.020.352,81	20.352,81	0,68%	1,18%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.831.560,49	0,00	0,00	7.671.505,22	39.844,73	0,51%	0,51%	1,50%
BS TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIAR...	13.106.785,03	2.000.000,00	0,00	15.177.350,43	70.564,40	0,47%	0,49%	1,46%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CREDITO PRIVAD...	6.508.975,30	0,00	1.500.000,00	5.039.319,36	30.344,06	0,47%	0,56%	1,11%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	9.640.667,60	0,00	0,00	9.684.886,21	44.228,71	0,46%	0,46%	1,19%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.058.329,70	0,00	0,00	15.123.457,23	65.127,53	0,43%	0,43%	2,06%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.778.746,43	0,00	2.000.000,00	4.806.987,32	28.220,89	0,42%	0,53%	1,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	14.001.366,30	0,00	2.000.000,00	12.052.717,52	51.331,22	0,37%	0,43%	1,28%

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2022****FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.113.513,35	3.000.000,00	0,00	11.154.241,07	40.727,72	0,37%	0,40%	1,27%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	6.231.445,95	12.031.112,25	10.644.319,70	6.669.547,05	51.308,55	0,30%	0,93%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	10.312.909,66	0,00	0,00	10.321.535,25	8.625,59	0,08%	0,08%	0,75%
Total Renda Fixa	157.727.441,17	20.040.859,25	19.303.770,39	159.643.090,71	1.178.560,68	0,74%		1,36%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

	Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instlt	Var - Mês
TARPOH WAHOO FIC AÇÕES		2.035.972,89	0,00	0,00	2.130.083,87	94.110,98	4,62%	4,62%	8,85%
TARPOH GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES		4.855.425,25	0,00	0,00	5.045.694,64	180.269,39	3,71%	3,71%	8,75%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES		2.265.095,68	0,00	0,00	2.317.748,64	52.652,96	2,32%	2,32%	11,02%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP		2.869.413,43	0,00	1.500.000,00	1.429.964,95	60.551,53	2,11%	2,23%	1,41%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES		5.308.512,95	0,00	0,00	5.363.046,53	74.533,58	1,40%	1,40%	10,70%
META VALOR FI AÇÕES		6.568.578,84	0,00	6.634.445,62	0,00	65.866,78	1,00%	1,82%	11,57%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO		4.147.863,98	0,00	0,00	4.181.751,94	33.867,96	0,82%	0,82%	1,54%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO		4.914.091,74	0,00	3.000.000,00	1.951.184,97	37.093,23	0,75%	1,04%	0,68%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES		3.186.720,90	0,00	0,00	3.198.516,15	11.795,25	0,37%	0,37%	10,96%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES		1.553.144,27	0,00	0,00	1.549.978,83	-3.165,44	-0,20%	-0,20%	11,38%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES		0,00	8.634.445,62	0,00	6.610.724,52	-23.721,10	-0,36%	0,87%	10,67%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES		6.863.047,35	0,00	0,00	6.957.385,79	-25.981,56	-0,37%	-0,37%	10,70%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		0,00	3.000.000,00	0,00	2.988.623,51	-11.376,49	-0,38%	-	-
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		2.496.603,85	0,00	0,00	2.473.375,75	-23.228,11	-0,93%	-0,93%	10,87%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES		3.246.408,18	0,00	0,00	3.211.264,06	-35.144,12	-1,08%	-1,08%	8,90%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES		2.622.147,45	0,00	0,00	2.760.498,64	-61.648,81	-2,18%	-2,18%	9,77%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI - ...		952.031,28	0,00	0,00	931.030,56	-21.000,69	-2,21%	-2,21%	9,68%
B6 AGRO FIC AÇÕES		2.513.394,13	0,00	0,00	2.428.170,47	-85.223,66	-3,39%	-3,39%	7,54%
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES		7.023.612,13	3.000.000,00	0,00	9.671.085,22	-352.525,91	-3,52%	-3,16%	8,47%
TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...		2.152.827,92	3.000.000,00	0,00	4.936.244,19	-216.953,73	-4,20%	-3,28%	6,68%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6.491.176,55	0,00	2.000.000,00	4.095.310,13	-365.866,42	-6,10%	-8,62%	11,70%
Total Renda Variável	72.396.088,78	15.634.445,62	13.134.445,62	74.251.684,80	-844.404,18	-0,86%		8,93%



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO...	1.374.069,81	0,00	0,00	1.292.544,83	-81.524,98	-5,93%	-5,93%	7,24%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	9.337.968,20	0,00	0,00	8.740.075,22	-597.922,98	-6,40%	-6,40%	9,65%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	1.328.570,09	0,00	0,00	1.241.234,38	-87.335,71	-6,57%	-6,57%	9,68%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.697.061,24	0,00	0,00	8.948.485,54	-748.595,70	-7,72%	-7,72%	9,55%
Total Exterior	21.737.699,34	0,00	0,00	20.222.319,97	-1.515.379,37	-6,97%		9,46%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

	Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
	CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	11.997.196,48	4.000.000,00	5.000.000,00	11.378.729,02	381.532,54	2,38%	3,51%
	CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	20.063.327,95	0,00	863.409,99	19.384.915,65	214.997,46	1,07%	-3,33%
	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.079.884,01	3.000.000,00	2.000.000,00	7.284.208,98	204.324,97	2,25%	3,34%
	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	2.169.781,95	33.849.059,91	29.532.901,65	6.608.547,05	193.807,24	0,51%	2,89%
	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	2.463.177,95	3.000.000,00	0,00	5.605.555,59	142.377,53	2,01%	3,37%
	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.540.712,57	0,00	3.000.000,00	3.649.172,34	108.459,77	1,66%	3,07%
	CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.018.289,77	5.000.000,00	0,00	15.123.457,23	105.167,46	0,70%	0,50%
	BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.090.132,17	0,00	424.774,22	2.743.829,41	89.271,46	2,87%	3,06%
	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.453.355,59	0,00	4.000.000,00	1.532.230,73	78.875,14	1,45%	3,54%
	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	13.991.829,79	0,00	2.000.000,00	12.052.717,52	60.887,76	0,44%	0,50%
	CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	6.485.252,85	0,00	1.500.000,00	5.039.319,38	54.066,51	0,83%	0,83%
	DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	9.531.650,08	0,00	0,00	9.584.886,21	53.236,13	0,55%	0,55%
	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	8.113.261,61	3.000.000,00	0,00	11.154.241,07	40.979,46	0,37%	0,40%
	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	2.208.846,73	0,00	0,00	2.248.511,98	39.665,25	1,80%	1,80%
	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.152.456,38	0,00	0,00	2.190.353,41	37.897,03	1,76%	1,76%
	BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	10.145.315,25	5.370.747,79	370.747,79	15.177.359,43	32.044,18	0,21%	-0,02%
	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	995.380,61	0,00	0,00	1.024.408,04	29.027,43	2,92%	2,92%
	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.632.595,83	0,00	0,00	1.659.273,33	26.677,50	1,63%	1,63%
	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	3.000.000,00	0,00	3.020.352,81	20.352,81	0,68%	3,60%
	CAIXA BRASIL IDXA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.658.895,29	2.000.000,00	0,00	7.671.505,22	12.609,93	0,16%	0,11%

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2022****FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instít
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.796.782,02	0,00	2.000.000,00	4.806.867,32	10.185,30	0,15%	0,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	10.319.464,22	0,00	0,00	10.321.535,25	2.071,03	0,02%	0,02%
BB AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	12.110,75	6.747,00	2.006,32	20.213,76	362,33	1,66%	2,61%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.285.616,07	0,00	4.270.139,48	0,00	-15.376,69	-0,36%	2,97%
Total Renda Fixa	150.485.215,40	62.229.554,70	64.983.979,12	159.643.090,71	1.912.299,73	1,21%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Insbit
TARPPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	4.027.643,66	0,00	0,00	5.045.694,64	1.018.050,98	25,26%	25,28%
GUERARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.447.980,86	0,00	0,00	5.383.046,53	935.065,67	21,02%	21,02%
META VALOR FIAÇÕES	5.818.872,25	0,00	6.634.445,62	0,00	816.573,37	14,02%	14,94%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	6.258.572,91	0,00	0,00	6.957.385,79	697.812,88	11,15%	11,15%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.071.836,83	8.904.644,92	5.904.844,02	8.671.066,22	599.248,49	4,00%	12,02%
TARPPON WAHDO FIC AÇÕES	1.712.040,50	0,00	0,00	2.130.063,67	418.043,37	24,42%	24,42%
SOMMA BRASIL FIC AÇÕES	2.860.919,06	0,00	0,00	3.188.516,15	337.597,09	11,80%	11,80%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	2.901.834,76	0,00	0,00	3.211.264,06	309.329,30	10,66%	10,66%
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	2.027.879,41	0,00	0,00	2.917.748,64	289.869,23	14,29%	14,29%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.222.063,88	0,00	0,00	2.473.375,75	251.321,87	11,31%	11,31%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.566.162,10	0,00	0,00	2.760.498,94	194.346,74	7,57%	7,57%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.762.587,06	0,00	1.500.000,00	1.429.964,96	177.367,91	6,44%	6,57%
BB AGRO FIC AÇÕES	2.275.306,30	0,00	0,00	2.428.170,47	152.864,17	6,72%	6,72%
BB ALOCAÇÃO FIC MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	4.829.848,85	0,00	3.000.000,00	1.961.184,97	121.336,12	2,51%	2,81%
QUELUZ VALOR FIC AÇÕES	1.430.966,12	0,00	0,00	1.549.978,83	118.982,71	8,31%	8,31%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIC MULTIMERCADO	4.089.061,80	0,00	0,00	4.181.751,94	92.690,34	2,27%	2,27%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	1.868.616,47	4.806.622,56	1.806.622,56	4.936.244,19	67.627,72	1,01%	11,46%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO LP	6.092.762,58	0,00	2.000.000,00	4.096.310,13	2.547,55	0,04%	-2,65%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIC MULTIMERCADO	0,00	3.000.000,00	0,00	2.998.623,51	-11.376,49	-0,38%	-
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,00	6.634.445,62	0,00	6.610.724,52	-23.721,10	-0,36%	13,19%

Total Renda Variável

64.256.076,98% no 22/09/2022

20.845.912,20

73.320.654,01

0,00% no 30/09/2022
Rua Ba...
o de Parana... 233 - 15º Andar CJ 1
01 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410