

2022

Relatório Mensal

Outubro

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, 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
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.979.502,63	3,17%	3.173.943.781,02	0,19%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.288.474,61	1,74%	7.996.820.457,76	0,04%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.997.902,76	1,59%	6.120.033.935,05	0,05%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.547.197,06	2,94%	3.736.730.846,68	0,15%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.932.846,86	2,61%	2.426.875.574,48	0,20%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	402.107,75	0,21%	5.839.461.409,01	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.272.808,86	5,97%	8.108.886.938,29	0,14%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.546.426,25	5,06%	8.449.071.998,91	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.914.753,22	6,31%	3.862.167.779,60	0,31%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.868.272,12	8,41%	5.646.338.902,14	0,28%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	593.984,03	0,31%	18.643.982.158,94	0,00%	7º I b
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	7.569.067,21	4,01%	213.017.354,12	3,55%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.907.254,02	2,60%	2.434.245.468,97	0,20%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	22.614.834,13	11,98%	1.288.130.355,76	1,76%	7º I b
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	15.584.865,19	8,26%	1.200.224.364,33	1,30%	7º I b
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	8.758.371,52	4,64%	1.020.507.303,91	0,86%	7º I b
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	11.715.973,80	6,21%	5.828.324.671,55	0,20%	7º III a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.599.525,30	0,85%	3.859.205.707,52	0,04%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	527.393,79	0,28%	14.020.474.735,38	0,00%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	254.832,73	0,14%	3.279.050.946,44	0,01%	7º III a
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.235.845,66	2,24%	1.073.500.070,60	0,39%	8º I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.215.517,55	1,17%	1.488.244.493,95	0,15%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.937.164,34	1,03%	727.308.936,83	0,27%	8º I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.959.351,97	3,16%	648.659.983,49	0,92%	8º I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	3.388.968,24	1,80%	685.388.293,76	0,49%	8º I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.862.127,86	2,58%	274.271.738,77	1,77%	8º I
SICREDI SULAMÉRICA VALOR FI AÇÕES	3.091.798,49	1,64%	24.903.139,46	12,42%	8º I

Investimentos

\$ 188.742.279,63

Disponibilidades Financeiras

\$ 120.564,25

Total Carteira

\$ 188.862.843,88

Governança (Pró Gestão)

⚖️ Não possui

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.876.750,68	1,52%	690.721.324,94	0,42%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I I	2.619.925,66	1,39%	218.254.665,02	1,20%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	953.220,32	0,51%	2.170.160.001,28	0,04%	10º I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.011.189,23	1,60%	789.136.322,70	0,38%	10º I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.147.636,78	1,67%	1.767.351.817,15	0,18%	10º I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.566.389,01	2,42%	206.430.458,86	2,21%	10º I

Investimentos

 188.742.279,63

Disponibilidades Financeiras

 120.564,25

Total Carteira


 188.862.843,88

Governança (Pró Gestão)

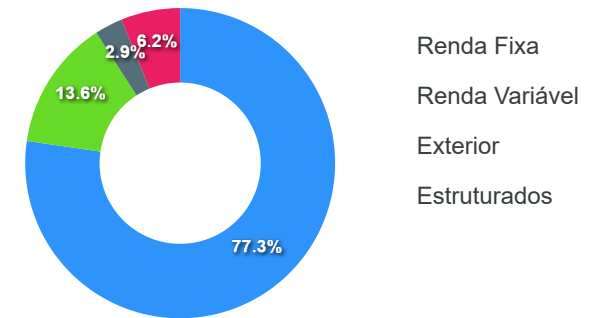
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Utilizado	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	69,78%	131.778.668,22	30,22%	57.070.410,14
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	7,47%	14.097.725,62	52,53%	99.211.721,40
8º I - Fundos de Ações	30,00%	13,60%	25.690.774,11	16,40%	30.963.949,40
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	2,91%	5.496.676,34	7,09%	13.388.231,50
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	6,18%	11.678.435,34	3,82%	7.206.472,50

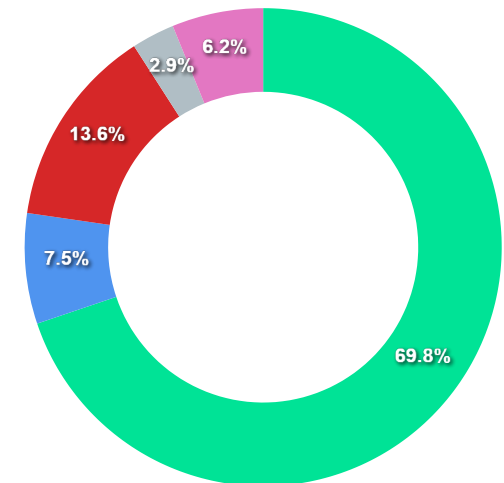
Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Segmentos



Artigos

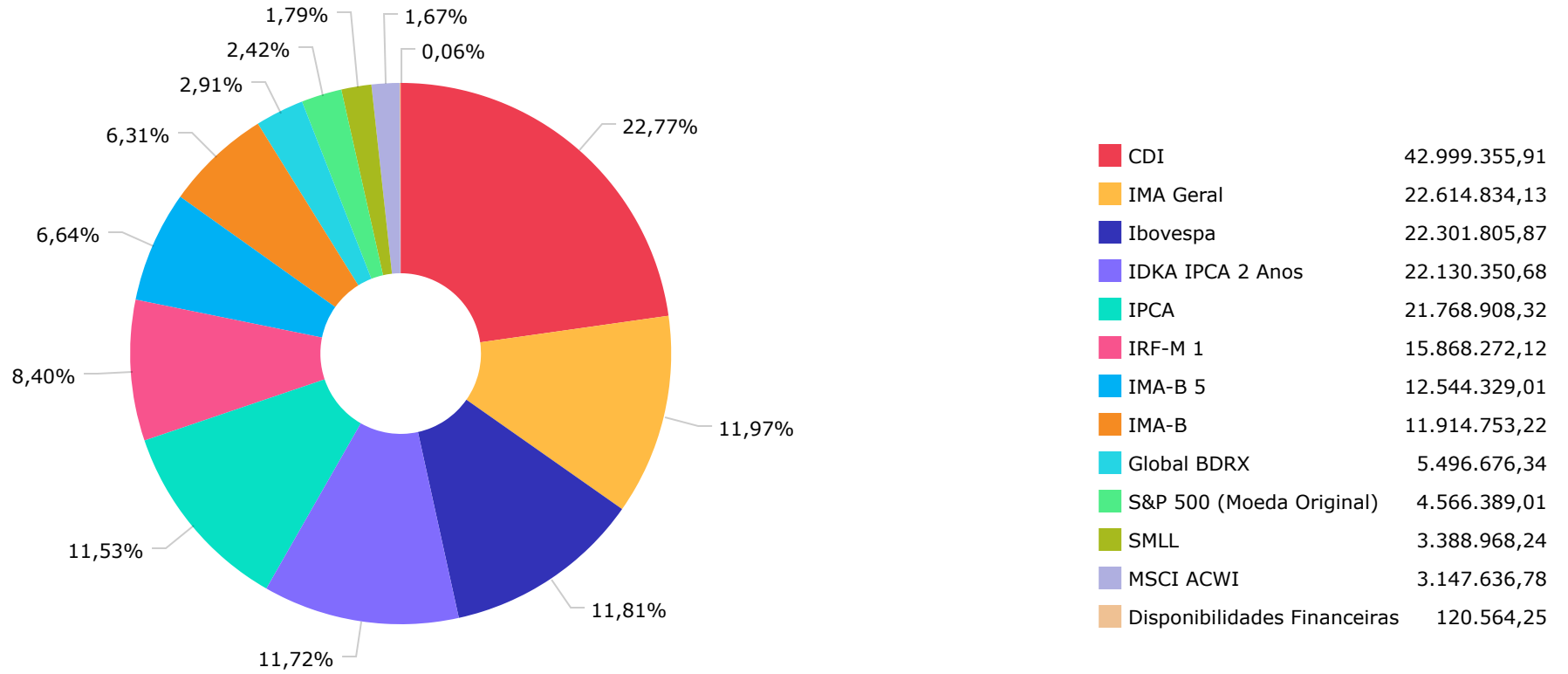


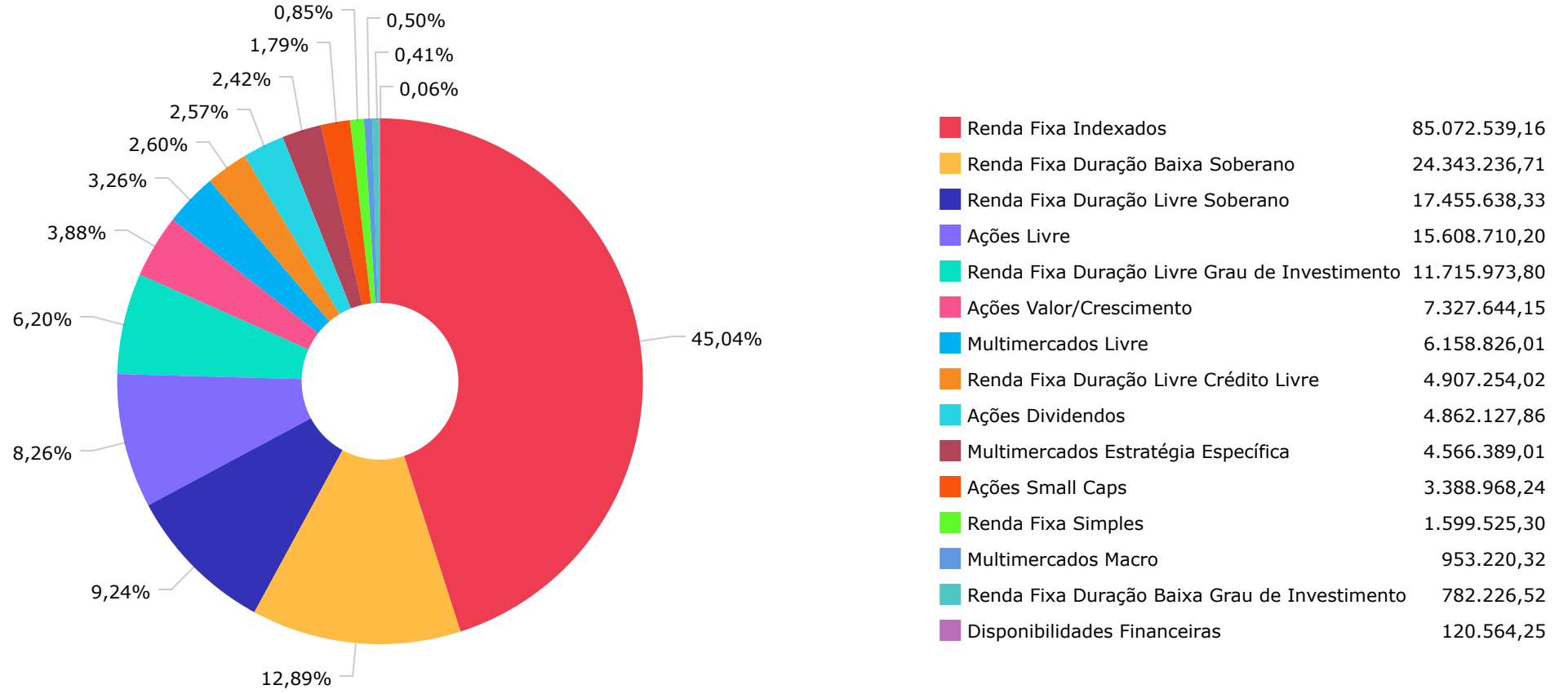
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	19,25%	59,24%	111.874.194,02	8° I - Fundos de Ações	13,60%	11,21%	12,70%	20,00%	12.079.041,56
7° I b - FI 100% Títulos TN	69,78%	14,81%	19,25%	70,00%	415.686,63	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	2,24%	20,00%	37.769.815,67
7° III a - FI Referenciados RF	7,47%	13,13%	17,50%	50,00%	80.326.813,56	9° III - Ações - BDR Nível I	2,91%	3,75%	5,00%	10,00%	13.388.231,50
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	17,50%	20,00%	37.769.815,67	10° I - Fundos Multimercados	6,18%	2,09%	2,78%	10,00%	7.206.472,50
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	2,78%	5,00%	9.442.453,92	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	9.442.453,92

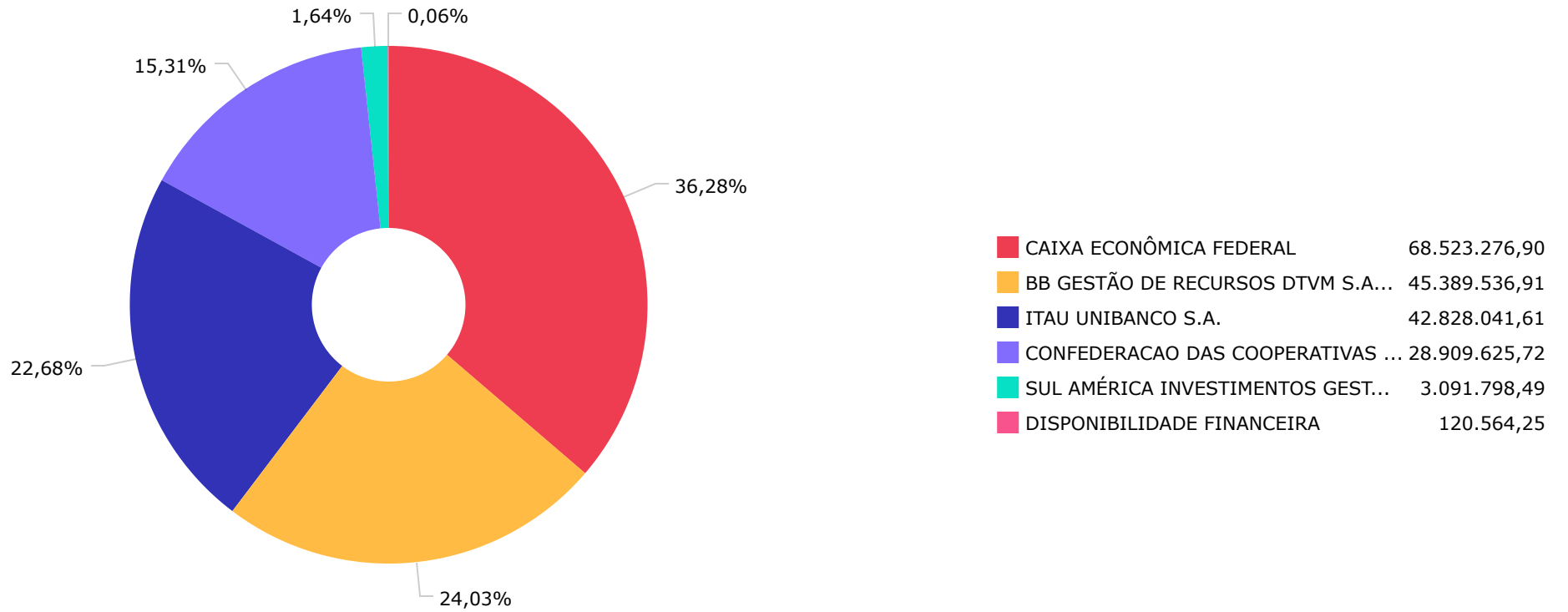
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20		
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,64	13,28	7,53	8,47	15,78	21,37	1,88	3,96
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,88	11,16	5,61	6,99	13,11	17,94	2,04	4,29
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09	10,68	3,44	6,88	12,27	16,66	0,02	0,05
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03	10,25	3,36	6,65	11,77	15,91	0,02	0,04
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,01	10,13	3,32	6,57	11,65	15,31	0,02	0,03
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,03	10,00	3,31	6,55	11,48	15,19	0,00	0,01
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	1,02	9,95	3,30	6,52	11,41	15,05	0,00	0,01
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,95	9,10	3,06	6,00	10,39	12,85	0,00	0,01
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,01		3,18	6,47			0,30	0,63
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	1,33	-29,86	-9,99	-6,55	-29,14	-2,97		
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I I	6,53	-15,44	-3,19	3,27	-15,46	20,02	15,39	32,42
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,33	-26,73	-6,37	-2,90	-25,64	-0,63	14,96	31,51
IBOVESPA - BENCHMARK	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51		
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,77	9,32	8,90	4,61	15,03	37,52	12,63	26,60
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,69	11,11	9,86	3,20	14,91	28,79	13,32	28,05
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	7,88	10,63	14,51	9,41	10,38	13,28	13,53	28,50
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4,36	6,11	9,95	3,47	8,25	28,30	14,66	30,86
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3,61	2,04	7,09	2,39	5,28	25,87	14,36	30,25
SICREDI SULAMÉRICA VALOR FI AÇÕES	6,86	4,24	13,88	9,17	1,51	7,48	14,42	30,38
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,85	8,72	2,35	3,19	12,14	17,05	0,82	1,73
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,83	8,48	2,24	3,04	11,90	16,82	0,85	1,79
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	1,83	8,46	2,27	3,05	11,84	16,74	0,85	1,79

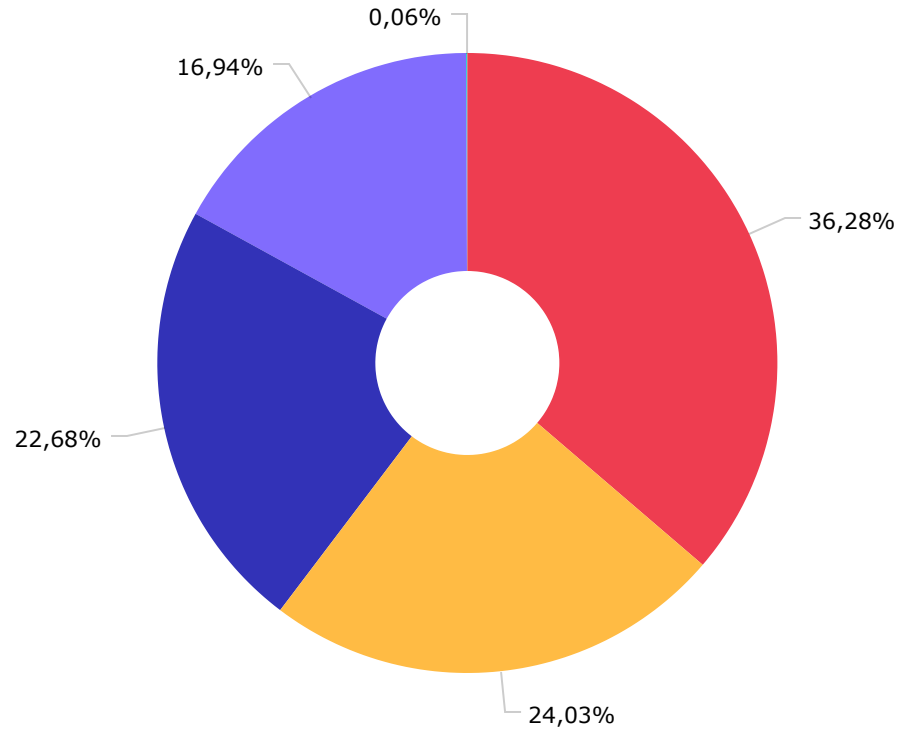
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA GERAL - BENCHMARK	1,01	8,88	3,72	5,61	11,80	12,98		
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	1,90	8,97	2,31	3,42	12,54	17,26	0,75	1,58
IMA-B - BENCHMARK	1,23	7,43	3,86	3,57	11,40	13,44		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18	7,34	3,92	3,56	11,26	13,01	1,58	3,33
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,91	9,12	2,35	3,50	12,73	17,73		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,88	9,05	2,36	3,51	12,60	17,31	0,75	1,57
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,89	8,92	2,30	3,42	12,47	17,14	0,75	1,58
IPCA - BENCHMARK	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,24	9,55	2,18	3,12	12,46	18,19	0,53	1,12
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,88	9,36	3,05	5,73	12,11	14,66	1,08	2,28
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,99	9,36	3,75	5,92	11,26	11,59	0,47	0,98
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01	8,59	3,46	5,57	11,11	13,25	0,73	1,54
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,89		2,21	3,00			0,85	1,80
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,00	9,68	3,38	6,44	11,52	13,50		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,98	9,45	3,32	6,31	11,24	12,97	0,03	0,07
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	7,99	-18,76	-6,25	-6,29	-15,92	18,41		
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8,77	-12,58	-3,74	-1,33	-8,19	32,53	13,20	27,81
SMLL - BENCHMARK	7,30	-1,35	16,81	0,91	0,06	3,68		
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	7,11	-1,72	16,25	0,20	-0,87	1,42	14,92	31,43

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
MSCI ACWI - BENCHMARK	3,03	-26,82	-6,84	-4,13	-26,70	-3,07		
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8,77	-12,72	-3,83	-1,40	-8,31	32,33	13,19	27,78









CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	68.523.276,90
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	45.389.536,91
ITAU UNIBANCO S.A.	42.828.041,61
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	32.001.424,21
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	120.564,25

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	139.439.646,44	60.032.607,42	56.687.776,17	143.465.830,23	681.352,54	681.352,54	0,48% ▲	0,48%	0,95%	0,95%	50,53%	2,95%
Fevereiro	143.465.830,23	11.725.421,36	12.769.220,80	142.562.506,48	140.475,69	821.828,23	0,10% ▲	0,58%	1,39%	2,35%	24,68%	2,58%
Março	142.562.506,48	18.816.154,99	16.229.229,37	148.535.751,46	3.386.319,36	4.208.147,59	2,33% ▲	2,92%	2,06%	4,46%	65,47%	3,23%
Abril	148.535.751,46	10.770.689,67	9.892.242,54	147.707.650,95	-1.706.547,64	2.501.599,95	-1,14% ▼	1,75%	1,44%	5,96%	29,36%	2,08%
Mai	147.707.650,95	28.080.909,22	8.217.214,86	169.337.697,66	1.766.352,35	4.267.952,30	1,05% ▲	2,82%	0,90%	6,91%	40,81%	2,84%
Junho	169.337.697,66	25.145.716,32	22.695.696,16	168.983.687,55	-2.804.030,27	1.463.922,03	-1,63% ▼	1,14%	1,08%	8,07%	14,13%	2,77%
Julho	168.983.687,55	24.723.407,45	22.382.200,00	173.850.773,67	2.525.878,67	3.989.800,70	1,47% ▲	2,63%	-0,27%	7,78%	33,80%	2,45%
Agosto	173.850.773,67	11.841.870,45	8.973.567,91	178.700.392,83	1.981.316,62	5.971.117,32	1,12% ▲	3,78%	0,09%	7,87%	48,03%	2,73%
Setembro	178.700.392,83	5.030.794,88	2.051.729,31	181.612.592,39	-66.866,01	5.904.251,31	-0,04% ▼	3,74%	0,12%	8,00%	46,75%	2,84%
Outubro	181.612.592,39	4.425.154,79	1.638.322,71	188.742.279,63	4.342.855,16	10.247.106,47	2,36% ▲	6,19%	0,98%	9,06%	68,32%	3,35%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	4.208.147,59	2,92%	4,46%
2º Trim	-2.744.225,56	-1,73%	3,46%
1º Sem	1.463.922,03	1,14%	8,07%
3º Trim	4.440.329,28	2,57%	-0,07%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

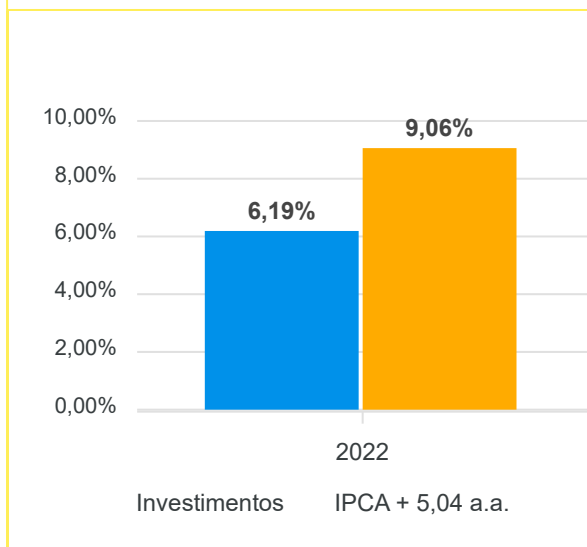


Gráfico Risco x Retorno

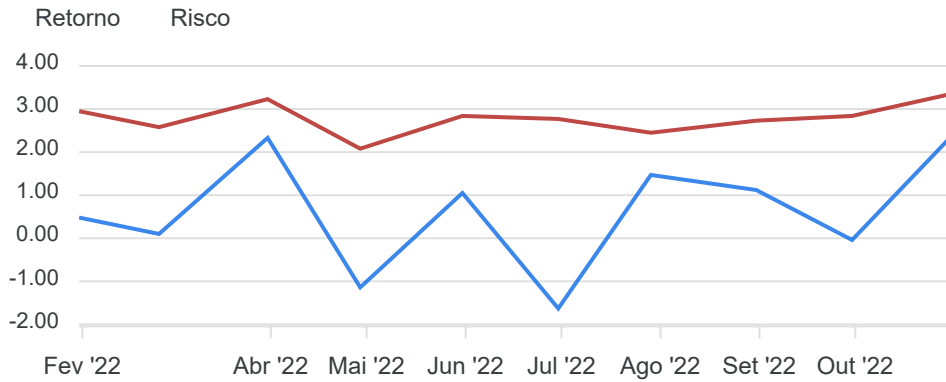
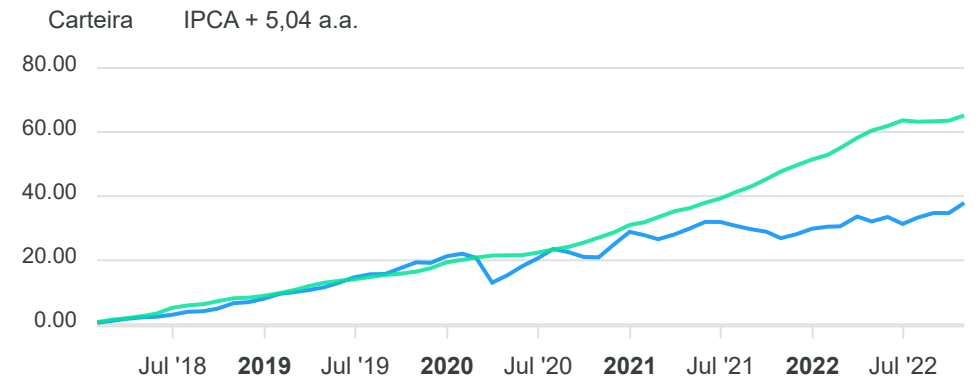
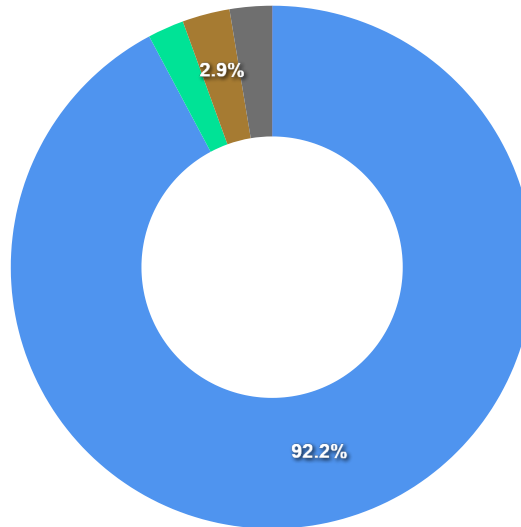


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/10/2022

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	174.146.954,30	92,27
Até D+180	4.235.845,66	2,24
Até D+360	5.547.197,06	2,94
Até D+720	4.932.846,86	2,61
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.919.460,70	0,00	0,00	5.979.502,63	60.041,93	1,01% ▲	0,73%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	11.599.061,93	0,00	0,00	11.715.973,80	116.911,87	1,01% ▲	0,30%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	964.444,73	622.870,90	0,00	1.599.525,30	12.209,67	0,77% ▲	0,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.228.608,67	0,00	0,00	3.288.474,61	59.865,94	1,85% ▲	0,82%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.942.295,61	0,00	0,00	2.997.902,76	55.607,15	1,89% ▲	0,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.425.526,89	0,00	0,00	5.547.197,06	121.670,17	2,24% ▲	0,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.841.203,49	0,00	0,00	4.932.846,86	91.643,37	1,89% ▲	0,85%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	522.005,80	0,00	0,00	527.393,79	5.387,99	1,03% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	398.181,99	0,00	0,00	402.107,75	3.925,76	0,99% ▲	0,47%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.066.471,99	0,00	1.000.000,00	11.272.808,86	206.336,87	1,71% ▲	0,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.370.686,14	2,00	0,00	9.546.426,25	175.738,11	1,88% ▲	0,75%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.775.916,76	0,00	0,00	11.914.753,22	138.836,46	1,18% ▲	1,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.556.655,94	2.802.281,89	638.322,71	15.868.272,12	147.657,00	0,90% ▲	0,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	588.027,13	0,00	0,00	593.984,03	5.956,90	1,01% ▲	0,02%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	7.433.329,51	0,00	0,00	7.569.067,21	135.737,70	1,83% ▲	0,85%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.864.474,70	0,00	0,00	4.907.254,02	42.779,32	0,88% ▲	1,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	252.090,92	0,00	0,00	254.832,73	2.741,81	1,09% ▲	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	22.193.574,68	0,00	0,00	22.614.834,13	421.259,45	1,90% ▲	0,75%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	15.426.543,92	0,00	0,00	15.584.865,19	158.321,27	1,03% ▲	0,00%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	8.669.742,82	0,00	0,00	8.758.371,52	88.628,70	1,02% ▲	0,00%
	142.038.304,32	3.425.154,79	1.638.322,71	145.876.393,84	2.051.257,44	1,43%	0,58%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.088.320,40	0,00	0,00	4.235.845,66	147.525,26	3,61% ▲	14,36%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.122.937,93	0,00	0,00	2.215.517,55	92.579,62	4,36% ▲	14,66%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.795.696,64	0,00	0,00	1.937.164,34	141.467,70	7,88% ▲	13,53%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.634.012,48	0,00	0,00	5.959.351,97	325.339,49	5,77% ▲	12,63%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	3.163.973,09	0,00	0,00	3.388.968,24	224.995,15	7,11% ▲	14,92%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.644.528,44	0,00	0,00	4.862.127,86	217.599,42	4,69% ▲	13,32%
SICREDI SULAMÉRICA VALOR FI AÇÕES	2.893.427,09	0,00	0,00	3.091.798,49	198.371,40	6,86% ▲	14,42%
-	24.342.896,07	0,00	0,00	25.690.774,11	1.347.878,04	5,54%	13,81%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	935.633,06	0,00	0,00	953.220,32	17.587,26	1,88% ▲	2,04%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.962.650,36	0,00	0,00	3.011.189,23	48.538,87	1,64% ▲	1,88%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.918.288,06	1.000.000,00	0,00	3.147.636,78	229.348,72	7,86% ▲	13,19%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.198.140,22	0,00	0,00	4.566.389,01	368.248,79	8,77% ▲	13,20%
-	10.014.711,70	1.000.000,00	0,00	11.678.435,34	663.723,64	6,03%	9,37%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.757.408,83	0,00	0,00	2.876.750,68	119.341,85	4,33% ▲	14,96%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I I	2.459.271,47	0,00	0,00	2.619.925,66	160.654,19	6,53% ▲	15,39%
	5.216.680,30	0,00	0,00	5.496.676,34	279.996,04	5,37%	7,83%

Cenário Econômico

Se o mês de setembro não foi fácil para a rentabilidade dos investimentos, o mesmo não podemos falar de outubro. No geral todas as estratégias experimentaram bons resultados, e para aqueles que possuíam carteiras bem diversificadas, apresentaram forte rentabilidade. Na renda fixa os fundos foram beneficiados pelo fechamento da curva de juros, na renda variável os fundos ligados a índices IBOVESPA subiram mais 5% e no acumulado do ano está muito próximo das metas atuárias. Por fim, os ativos ligados a índices no exterior, que vinham amargando resultados ruins nos últimos meses, tiveram bons resultados no mês.

A inflação segue como destaque, e começando pelo Brasil, o IPCA fechou pelo terceiro mês consecutivo no negativo, fato que não ocorria desde 1998. Os resultados ainda seguem impactados pela redução dos preços dos combustíveis, energia e telecomunicações. Por outro lado, alguns pontos chamam a atenção, já que suprindo esses itens, os dados ainda apresentam boa alta, como é o caso dos alimentos, que apresentam a maior inflação acumulada nos nove primeiros meses do ano desde o início do plano real. Com a estabilização dos preços dos combustíveis, para o mês de outubro os dados do IPCA-15 divulgado, apontam para o fim da série de deflação.

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, apesar da atenção dos investidores locais ter ficado voltada para a disputa eleitoral. Todos os segmentos apresentaram bons retornos, sendo que o investimento em fundos de ações foi o principal destaque de outubro. Além do mercado de ações, a renda fixa também se destacou em outubro - efeito da taxa Selic a 13,75% ao ano.

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, 7 de novembro de 2022.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

