

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

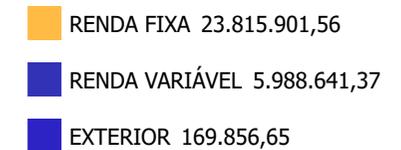
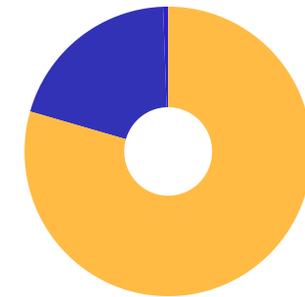
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.372.305,80	4,58%	389	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	663.443,83	2,21%	1.050	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	1.622.618,43	5,41%	222	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.180.456,46	3,94%	575	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.149.982,13	3,84%	461	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	1.010.577,72	3,37%	97	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	463 dias	2.507.744,08	8,37%	280	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	2027-05-16	972.049,96	3,24%	58	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.658.201,19	5,53%	808	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.412.853,55	4,71%	1.035	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.484.728,69	8,29%	975	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.138.796,41	3,80%	253	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.346.081,51	4,49%	773	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	107.031,76	0,36%	1.173	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.201.483,45	4,01%	202	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.621.742,01	5,41%	868	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	732.265,14	2,44%	163	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.592.369,85	5,31%	250	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	41.169,59	0,14%	98	0,13%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	885.572,95	2,95%	702	0,22%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	487.442,83	1,63%	1.898	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	303.033,08	1,01%	3.616	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	393.229,04	1,31%	25.273	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	296.263,72	0,99%	37.274	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	315.923,08	1,05%	1.419	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	572.414,90	1,91%	90	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	141.602,87	0,47%	7.714	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	202.150,49	0,67%	3.338	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	612.542,33	2,04%	7.558	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	169.856,65	0,57%	518	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	412.771,66	1,38%	183	0,14%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.295.764,42	4,32%	8.305	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	69.930,00	0,23%		0,06%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			29.974.399,58				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2022)

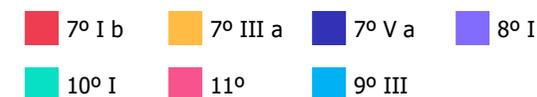
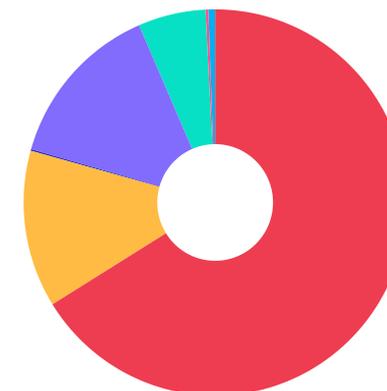
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,00%	80,00%	23.979.519,66
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	19.828.354,97	66,15%	10,00%	39,50%	80,00%	4.151.164,69
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	3.946.377,00	13,17%	2,00%	10,00%	50,00%	11.040.822,79
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	4.496.159,94
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	41.169,59	0,14%	0,00%	0,30%	1,00%	258.574,41
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.498.719,98
Total Renda Fixa	100,00%	23.815.901,56	79,45%	12,00%	70,80%	231,00%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	4.210.175,29	14,05%	0,00%	20,00%	30,00%	4.782.144,58
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.708.536,08	5,70%	0,00%	6,00%	10,00%	1.288.903,88
Artigo 11º	5,00%	69.930,00	0,23%	0,00%	0,70%	5,00%	1.428.789,98
Total Renda Variável	30,00%	5.988.641,37	19,98%	0,00%	26,70%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	599.487,99
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	169.856,65	0,57%	0,00%	2,50%	8,00%	2.228.095,32
Total Exterior	10,00%	169.856,65	0,57%	0,00%	2,50%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	17.801.525,19	59,39	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.399.439,66	38,03	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	732.265,14	2,44	0,00
PETRA CAPITAL	41.169,59	0,14	0,00

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	80,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	19.828.354,97	66,15	10,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	3.946.377,00	13,17	2,00	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	41.169,59	0,14	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	4.210.175,29	14,05	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 9º, Inciso III	169.856,65	0,57	0,00	8,00
Artigo 10º, Inciso I	1.708.536,08	5,70	0,00	10,00
Artigo 11º	69.930,00	0,23	0,00	5,00

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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,62%	6,94%	0,09%	2,94%	8,91%	15,68%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	6,74%	0,26%	2,81%	8,72%	15,30%	1,42%	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%
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,58%	6,25%	5,47%	5,41%	7,24%	3,87%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,54%	5,99%	5,34%	5,23%	6,90%	3,28%	2,43%	0,06%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,39%	5,10%	3,01%	3,14%	5,19%	8,56%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,36%	4,82%	2,92%	2,95%	4,83%	7,86%	3,63%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,37%	4,93%	2,93%	3,00%	4,78%	7,89%	3,62%	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%	15,75%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,43%	-	0,50%	-	-	-	2,06%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	7,04%	0,50%	3,16%	9,15%	15,36%	1,26%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	1,48%	6,12%	1,70%	3,16%	7,25%	12,30%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45%	5,92%	1,63%	3,07%	6,95%	11,76%	2,43%	0,06%

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
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50%	6,09%	1,76%	3,18%	7,15%	11,91%	2,47%	0,06%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,52%	6,08%	1,80%	3,22%	7,12%	11,92%	2,52%	0,06%
IRF-M (Benchmark)	1,40%	6,96%	4,66%	5,53%	8,01%	6,91%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,38%	6,84%	4,63%	5,48%	7,83%	6,48%	1,56%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,24%	6,69%	2,87%	4,60%	7,75%	9,64%	1,12%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,99%	8,08%	3,06%	5,77%	9,78%	11,85%	0,00%	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,46%	-59,72%	-1,52%	-59,64%	-60,12%	-62,24%	0,06%	0,58%
IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	-	0,44%	-	-	-	2,06%	-
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,29%	7,17%	2,97%	4,71%	8,80%	10,21%	1,39%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,24%	8,29%	3,54%	5,84%	9,44%	10,38%	0,79%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,08%	-	0,02%	-0,25%	-	-	0,75%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
IBX-50 (Benchmark)	0,48%	5,31%	11,70%	-8,80%	0,58%	19,15%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	0,32%	3,65%	11,39%	-10,01%	-2,13%	15,01%	10,35%	0,22%
Ibovespa (Benchmark)	0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-1,71%	5,56%	11,15%	-6,34%	-0,17%	14,77%	10,10%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,34%	-1,51%	7,67%	-9,41%	-4,02%	24,18%	10,89%	0,20%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-0,82%	4,29%	9,27%	-7,40%	-2,92%	20,36%	9,88%	0,20%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,36%	1,67%	9,61%	-8,81%	-1,48%	22,12%	11,01%	0,21%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-2,86%	-4,12%	10,23%	-7,79%	-13,85%	0,36%	9,19%	0,21%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,69%	2,56%	11,57%	-6,47%	-8,05%	3,01%	10,03%	0,22%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	11,99%	9,62%	29,48%	1,43%	4,96%	-12,00%	14,20%	0,30%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-3,86%	8,48%	9,99%	-3,81%	4,03%	20,49%	10,84%	0,22%
SMLL (Benchmark)	-1,84%	-8,06%	14,47%	-13,82%	-18,43%	-5,58%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-1,94%	-8,24%	13,94%	-14,26%	-18,90%	-7,59%	12,05%	0,29%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-



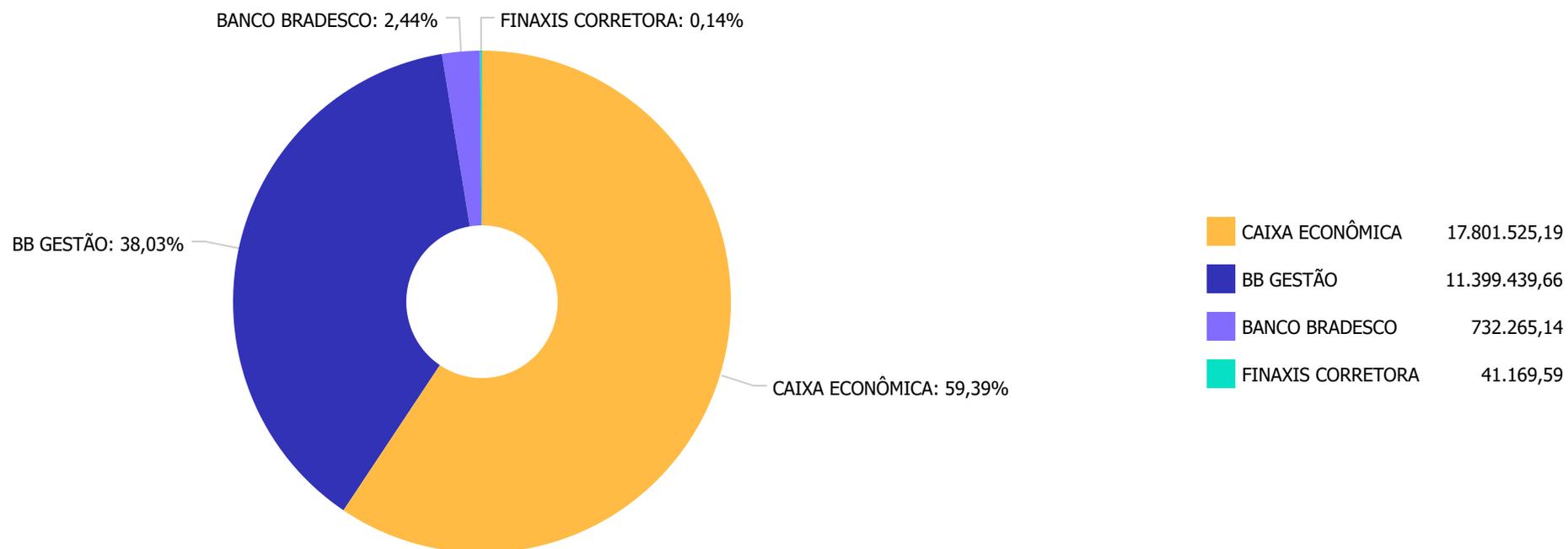
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,24%	8,76%	3,65%	5,75%	10,85%	14,76%	0,40%	0,01%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,41%	9,11%	4,90%	4,84%	10,04%	15,37%	1,55%	0,03%
IFIX (Benchmark)	0,49%	6,63%	6,98%	7,58%	10,13%	7,01%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,48%	2,48%	10,51%	8,13%	-2,90%	-62,20%	5,02%	0,13%

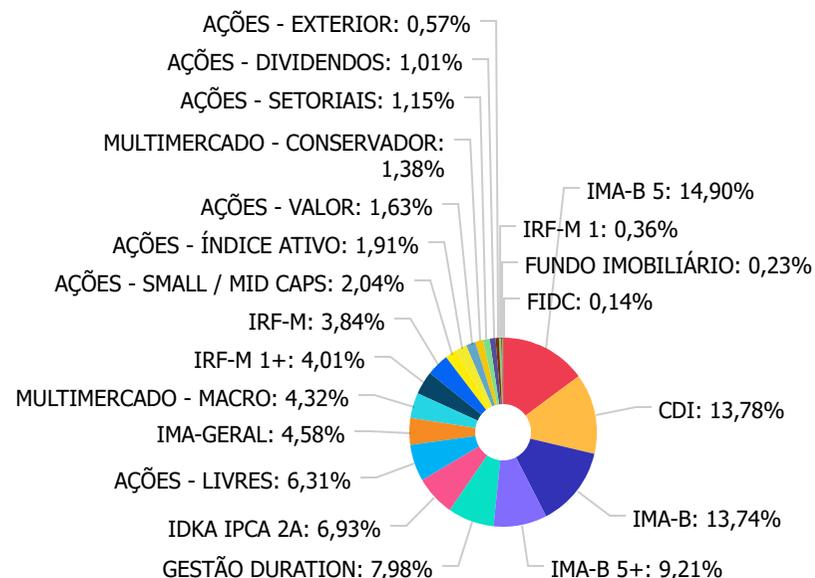
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%

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



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

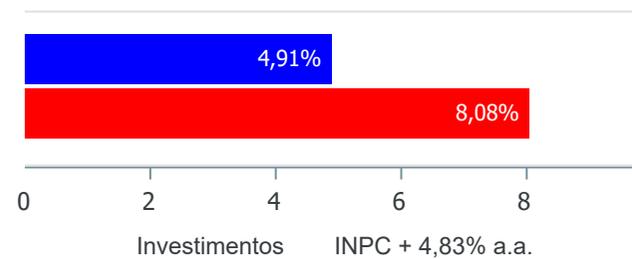


IMA-B 5	4.467.356,37	CDI	4.129.486,09	IMA-B	4.118.907,82
IMA-B 5+	2.761.414,84	GESTÃO DURATION	2.390.466,33	IDKA IPCA 2A	2.076.297,38
AÇÕES - LIVRES	1.890.988,79	IMA-GERAL	1.372.305,80	MULTIMERCADO - MACRO	1.295.764,42
IRF-M 1+	1.201.483,45	IRF-M	1.149.982,13	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	612.542,33
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	572.414,90	AÇÕES - VALOR	487.442,83	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	412.771,66
AÇÕES - SETORIAIS	343.753,36	AÇÕES - DIVIDENDOS	303.033,08	AÇÕES - EXTERIOR	169.856,65
IRF-M 1	107.031,76	FUNDO IMOBILIÁRIO	69.930,00	FIDC	41.169,59

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	29.067.844,45	391.267,24	461.203,65	29.151.122,82	153.214,78	153.214,78	0,53%	0,53%	1,07%	1,07%	49,26%	3,00%
Fevereiro	29.151.122,82	488.382,26	566.873,85	29.153.234,42	80.603,19	233.817,97	0,28%	0,81%	1,36%	2,44%	32,93%	2,28%
Março	29.153.234,42	773.020,12	770.355,18	29.950.375,80	794.476,44	1.028.294,41	2,72%	3,55%	2,13%	4,63%	76,78%	3,53%
Abril	29.950.375,80	508.686,69	697.873,19	29.541.527,93	-219.661,37	808.633,04	-0,73%	2,79%	1,40%	6,09%	45,85%	2,77%
Mai	29.541.527,93	568.436,91	594.475,99	29.745.884,83	230.395,98	1.039.029,02	0,78%	3,59%	0,86%	7,01%	51,29%	3,23%
Junho	29.745.884,83	3.054.540,60	3.130.939,04	29.104.049,78	-565.436,61	473.592,41	-1,90%	1,62%	1,02%	8,10%	20,07%	2,80%
Julho	29.104.049,78	2.131.557,90	2.132.884,86	29.267.642,37	164.919,55	638.511,96	0,57%	2,20%	-0,21%	7,87%	27,96%	2,70%
Agosto	29.267.642,37	597.481,92	632.942,18	29.782.363,70	550.181,59	1.188.693,55	1,88%	4,12%	0,12%	8,00%	51,53%	3,20%
Setembro	29.782.363,70	602.338,01	634.918,11	29.974.399,58	224.615,98	1.413.309,53	0,75%	4,91%	0,07%	8,08%	60,75%	3,01%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



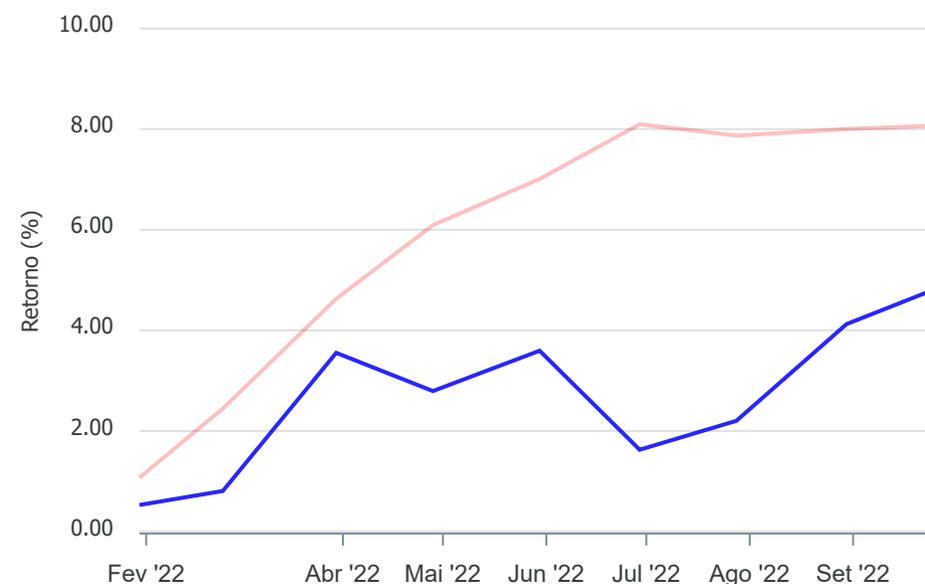
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.112.384,31	0,00	0,00	1.138.796,41	26.412,10	2,37%	2,37%	3,62%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.585.251,46	0,00	0,00	1.622.618,43	37.366,97	2,36%	2,36%	3,63%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.183.293,24	0,00	0,00	1.201.483,45	18.190,21	1,54%	1,54%	2,43%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.568.505,24	0,00	0,00	1.592.369,85	23.864,61	1,52%	1,52%	2,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.326.235,17	0,00	0,00	1.346.081,51	19.846,34	1,50%	1,50%	2,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.160.622,22	3.000,00	0,00	1.180.456,46	16.834,24	1,45%	1,45%	2,43%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.134.370,42	0,00	0,00	1.149.982,13	15.611,71	1,38%	1,38%	1,56%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	722.949,50	0,00	0,00	732.265,14	9.315,64	1,29%	1,29%	1,39%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.637.867,05	0,00	0,00	1.658.201,19	20.334,14	1,24%	1,24%	0,79%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.355.526,47	0,00	0,00	1.372.305,80	16.779,33	1,24%	1,24%	1,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	95.969,05	9.925,29	0,00	107.031,76	1.137,42	1,07%	1,09%	0,13%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.253.800,68	353.796,35	0,00	1.621.742,01	14.144,98	0,88%	0,99%	0,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.405.683,88	0,00	0,00	1.412.853,55	7.169,67	0,51%	0,51%	1,50%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.202.895,80	0,00	545.233,18	663.443,83	5.781,21	0,48%	0,53%	1,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	1.006.230,33	0,00	0,00	1.010.577,72	4.347,39	0,43%	0,43%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.563.023,18	0,00	89.134,93	2.484.728,69	10.840,44	0,42%	0,43%	1,26%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	732.883,90	235.616,37	0,00	972.049,96	3.549,69	0,37%	0,43%	2,06%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.505.665,83	0,00	0,00	2.507.744,08	2.078,25	0,08%	0,08%	0,75%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	41.358,64	0,00	0,00	41.169,59	-189,05	-0,46%	-0,46%	0,06%
Total Renda Fixa	23.594.516,37	602.338,01	634.368,11	23.815.901,56	253.415,29	1,07%		1,72%

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 CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	126.440,06	0,00	0,00	141.602,87	15.162,81	11,99%	11,99%	14,20%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	68.100,00	0,00	550,00	69.930,00	2.380,00	3,49%	1,48%	5,02%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.277.691,69	0,00	0,00	1.295.764,42	18.072,73	1,41%	1,41%	1,55%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	407.733,95	0,00	0,00	412.771,66	5.037,71	1,24%	1,24%	0,40%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	570.573,97	0,00	0,00	572.414,90	1.840,93	0,32%	0,32%	10,35%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	394.631,02	0,00	0,00	393.229,04	-1.401,98	-0,36%	-0,36%	11,01%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	318.129,00	0,00	0,00	315.923,08	-2.205,92	-0,69%	-0,69%	10,03%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	305.537,40	0,00	0,00	303.033,08	-2.504,32	-0,82%	-0,82%	9,88%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	494.053,18	0,00	0,00	487.442,83	-6.610,35	-1,34%	-1,34%	10,89%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	901.005,65	0,00	0,00	885.572,95	-15.432,70	-1,71%	-1,71%	10,10%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	624.636,17	0,00	0,00	612.542,33	-12.093,84	-1,94%	-1,94%	12,05%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	304.987,00	0,00	0,00	296.263,72	-8.723,28	-2,86%	-2,86%	9,19%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	210.262,01	0,00	0,00	202.150,49	-8.111,52	-3,86%	-3,86%	10,84%
Total Renda Variável	6.003.781,10	0,00	550,00	5.988.641,37	-14.589,73	-0,24%		7,93%



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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	184.066,23	0,00	0,00	169.856,65	-14.209,58	-7,72%	-7,72%	9,55%
Total Exterior	184.066,23	0,00	0,00	169.856,65	-14.209,58	-7,72%		9,55%

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 IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.227.784,94	0,00	87.884,52	1.201.483,45	61.583,03	5,02%	5,34%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.601.508,10	0,00	0,00	1.658.201,19	56.693,09	3,54%	3,54%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.638.959,32	0,00	544.360,34	1.149.982,13	55.383,15	3,38%	4,63%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.333.979,44	0,00	0,00	1.372.305,80	38.326,36	2,87%	2,87%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.357.459,09	229.610,95	1.000.000,00	1.622.618,43	35.548,39	1,37%	2,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.100.348,99	6.005,42	0,00	1.138.796,41	32.442,00	2,93%	2,93%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	511.400,66	1.078.007,35	0,00	1.621.742,01	32.334,00	2,03%	3,06%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	2.066.418,41	0,00	500.000,00	1.592.369,85	25.951,44	1,26%	1,80%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.322.791,89	0,00	0,00	1.346.081,51	23.289,62	1,76%	1,76%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	711.136,60	0,00	0,00	732.265,14	21.128,54	2,97%	2,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.687.417,18	16.800,00	543.257,26	1.180.456,46	19.496,54	1,14%	1,63%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.650.460,74	0,00	178.269,85	2.484.728,69	12.537,80	0,47%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.010.577,72	10.577,72	1,06%	0,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	74.182,81	29.721,37	0,00	107.031,76	3.127,58	3,01%	3,37%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.206.096,24	0,00	545.233,18	663.443,83	2.580,77	0,21%	0,26%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	498.373,92	471.232,74	0,00	972.049,96	2.443,30	0,25%	0,50%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.006.117,92	500.000,00	0,00	2.507.744,08	1.626,16	0,06%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.411.341,83	0,00	0,00	1.412.853,55	1.511,72	0,11%	0,11%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	41.803,87	0,00	0,00	41.169,59	-634,28	-1,52%	-1,52%
Total Renda Fixa	23.447.581,95	3.331.377,83	3.399.005,15	23.815.901,56	435.946,93	1,63%	

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 (%)	(%) Instit
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	796.772,17	0,00	0,00	885.572,95	88.800,78	11,15%	11,15%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	537.618,28	0,00	0,00	612.542,33	74.924,05	13,94%	13,94%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.235.236,20	0,00	0,00	1.295.764,42	60.528,22	4,90%	4,90%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	513.878,33	0,00	0,00	572.414,90	58.536,57	11,39%	11,39%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	452.714,20	0,00	0,00	487.442,83	34.728,63	7,67%	7,67%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	358.741,38	0,00	0,00	393.229,04	34.487,66	9,61%	9,61%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	283.163,42	0,00	0,00	315.923,08	32.759,66	11,57%	11,57%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	109.359,76	0,00	0,00	141.602,87	32.243,11	29,48%	29,48%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	268.768,37	0,00	0,00	296.263,72	27.495,35	10,23%	10,23%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	277.316,96	0,00	0,00	303.033,08	25.716,12	9,27%	9,27%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	183.797,52	0,00	0,00	202.150,49	18.352,97	9,99%	9,99%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	398.242,89	0,00	0,00	412.771,66	14.528,77	3,65%	3,65%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	63.280,00	0,00	1.740,00	69.930,00	8.390,00	13,26%	10,51%
Total Renda Variável	5.478.889,48	0,00	1.740,00	5.988.641,37	511.491,89	9,34%	



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	177.578,35	0,00	0,00	169.856,65	-7.721,70	-4,35%	-4,35%
Total Exterior	177.578,35	0,00	0,00	169.856,65	-7.721,70	-4,35%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.