

OK

RELATORIO DE INVESTIMENTOS
SETEMBRO 2022
3 TRIMESTRE



SUMÁRIO

1. Apresentação	3
2. Parecer do Comitê de Investimentos	3
3. Aprovação do Conselho de Administração	3

Handwritten signatures in blue ink, including a large signature on the left and several smaller ones on the right.

1. APRESENTAÇÃO

Este documento apresenta a posição da carteira de investimentos do São Roque Prev por segmentos e ativos, por tipo de risco, por instituição financeira e por limites da Política de Investimentos, e o acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos.

Tem por objetivo demonstrar os resultados das ações do deliberadas pelo Comitê de Investimentos.

Após cada reunião é elaborado uma ata que fica a disposição dos Conselhos de Administração e Fiscal para acompanhamento e homologação.

2. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos do São Roque Prev analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês set/2022 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do São Roque Prev e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

3. APROVAÇÃO DO CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO

O Conselho de Administração, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, HOMOLOGA o relatório de investimentos referente ao mês de setembro de 2022, em reunião realizada em 25 de outubro de 2022.

Rosana Teixeira de Carvalho



Lisete de Fátima Oliveira



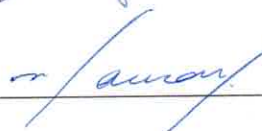
Silvia Cristina de Almas de Alcântara



Solange Siqueira Duarte Silva



Mauracy Moraes de Oliveira



Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2022

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

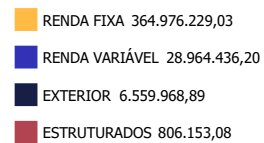
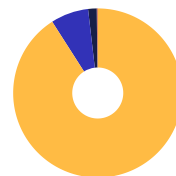
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			78.211.889,77	19,53%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.088.890,30	0,77%	796	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.670.727,48	0,67%	575	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	512.818,80	0,13%	1.087	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	19.537.465,05	4,88%	336	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	26.888.720,38	6,71%	808	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.974.279,01	0,74%	1.035	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	10.800.537,82	2,70%	975	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.438.358,19	0,36%	773	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	14.340.407,34	3,58%	868	0,41%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.110.980,30	0,78%	91	0,51%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	19.490.009,56	4,87%	295	0,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.318.145,73	2,58%	126	1,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	41.960.811,30	10,48%	289	0,77%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.278.134,96	0,32%	250	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	37.342.764,43	9,32%	241	1,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	10.741.049,38	2,68%	296	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info		80.270.239,23	20,04%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	21.719.917,20	5,42%	702	5,49%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU FOF RPI IBOVSPAATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.438.365,92	1,61%	44	1,06%	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 ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.419.499,65	0,60%	15.427	0,35%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.344.667,08	0,59%	518	0,11%	Artigo 9º, Inciso III
ITAU FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.795.802,16	0,45%	2.992	1,34%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	528.696,87	0,13%	3.485	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	277.456,21	0,07%	8.044	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		2.314.308,07	0,58%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			400.500.634,12				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.314.308,07				Artigo 6º
PL Total			402.814.942,19				

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

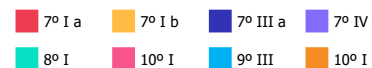
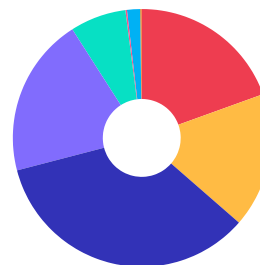
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	78.211.889,77	19,53%	0,00%	25,00%	50,00%	122.038.427,29
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	67.911.797,03	16,96%	12,00%	17,00%	50,00%	132.338.520,03
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	138.582.303,00	34,60%	10,00%	25,00%	60,00%	101.718.077,47
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	80.270.239,23	20,04%	0,00%	20,00%	20,00%	-170.112,41
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.025.031,71
Total Renda Fixa	100,00%	364.976.229,03	91,13%	22,00%	87,00%	185,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	28.158.283,12	7,03%	4,00%	10,00%	15,00%	31.916.812,00
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	806.153,08	0,20%	0,00%	1,00%	5,00%	19.218.878,63
Total Renda Variável / Estruturado	30,00%	28.964.436,20	7,23%	4,00%	11,00%	20,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.559.968,89	1,64%	0,00%	2,00%	5,00%	13.465.062,82
Total Exterior	10,00%	6.559.968,89	1,64%	0,00%	2,00%	5,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	98.809.807,55	24,67	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	78.211.889,77	19,53	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	64.289.725,82	16,05	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	37.342.764,43	9,32	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	22.600.989,86	5,64	0,00
ITAÚ UNIBANCO	12.536.851,54	3,13	0,00
ITAÚ DTVM	6.438.365,92	1,61	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 '	78.211.889,77	19,53	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	67.911.797,03	16,96	12,00	50,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	138.582.303,00	34,60	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	28.158.283,12	7,03	4,00	15,00
Artigo 9º, Inciso III	6.559.968,89	1,64	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	806.153,08	0,20	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	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%	-	-
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)	1,11%	8,59%	3,43%	6,17%	9,81%	12,55%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	8,39%	3,37%	6,02%	9,57%	11,94%	0,13%	0,02%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,42%	7,07%	0,43%	3,14%	9,25%	15,75%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	7,04%	0,50%	3,16%	9,15%	15,36%	1,26%	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%
IMA-B (Benchmark)	1,48%	6,12%	1,70%	3,16%	7,25%	12,30%	-	-
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%
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%
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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,46%	5,92%	1,64%	3,02%	6,80%	10,85%	2,45%	0,06%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,12%	9,26%	3,38%	6,42%	11,30%	14,99%	0,02%	0,01%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	9,35%	3,44%	6,62%	11,58%	15,22%	0,01%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	9,49%	3,40%	6,56%	11,70%	15,57%	0,01%	0,01%

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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,99%	8,08%	3,06%	5,77%	9,78%	11,85%	0,00%	0,01%

IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,24%	8,29%	3,54%	5,84%	9,44%	10,38%	0,79%	0,02%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,28%	8,63%	3,51%	5,91%	10,29%	11,11%	1,00%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	7,15%	0,02%	3,11%	8,79%	15,18%	0,75%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,53%	8,40%	2,97%	5,62%	10,74%	13,75%	2,07%	0,02%

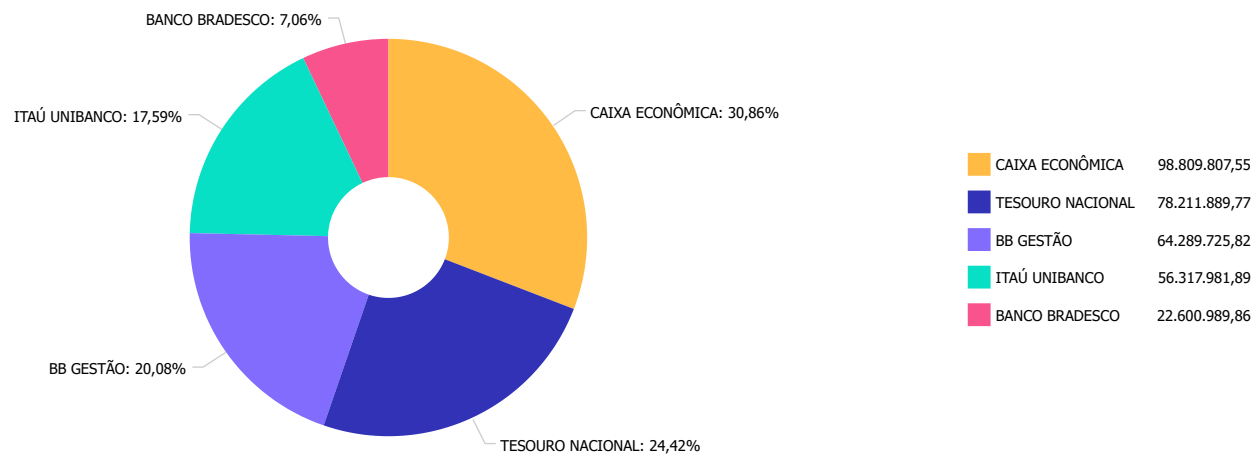
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-5,60%	-28,67%	-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%	9,65%	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%
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%
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,80%	6,29%	12,66%	-5,60%	-3,26%	7,77%	10,55%	0,21%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,48%	10,32%	6,73%	3,66%	10,21%	16,28%	3,15%	0,07%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1,20%	10,25%	3,54%	6,80%	12,27%	15,31%	0,14%	0,01%

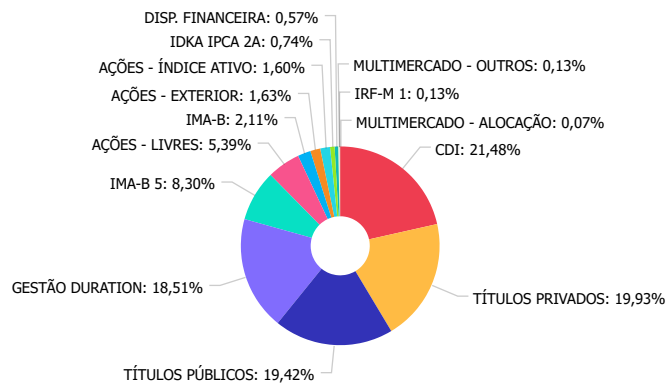
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-5,60%	-28,67%	-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%	9,65%	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%
ITAU FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,63%	-21,27%	-4,53%	-8,92%	-13,80%	8,07%	8,21%	0,17%

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



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



■ CDI	86.532.277,58	■ TÍTULOS PRIVADOS	80.270.239,23	■ TÍTULOS PÚBLICOS	78.211.889,77	■ GESTÃO DURATION	74.549.630,54
■ IMA-B 5	33.426.893,17	■ AÇÕES - LIVRES	21.719.917,20	■ IMA-B	8.498.200,93	■ AÇÕES - EXTERIOR	6.559.968,89
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.438.365,92	■ IDKA IPCA 2A	2.974.279,01	■ DISP. FINANCEIRA	2.314.308,07	■ MULTIMERCADO - OUTROS	528.696,87
■ IRF-M 1	512.818,80	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	277.456,21				

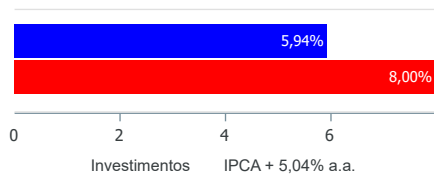
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2022)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	30/06/2022	19.713	4058,06717400	3.967,528523	79.996.678,20	78.211.889,77	Curva

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	376.717.647,44	10.356.964,81	11.768.751,83	379.574.284,25	4.268.423,83	4.268.423,83	1,13%	1,13%	0,95%	0,95%	118,92%	2,69%
Fevereiro	379.574.284,25	2.182.941,52	2.015.508,23	382.172.076,40	2.430.358,86	6.698.782,69	0,64%	1,78%	1,39%	2,35%	75,72%	2,11%
Março	382.172.076,40	3.579.604,77	1.763.527,83	393.494.117,69	9.505.964,35	16.204.747,04	2,48%	4,30%	2,06%	4,46%	96,48%	3,06%
Abril	393.494.117,69	4.280.705,01	964.179,46	392.627.311,29	-4.183.331,95	12.021.415,09	-1,05%	3,20%	1,44%	5,96%	53,73%	2,44%
Mai	392.627.311,29	86.263.391,03	110.415.112,13	372.968.820,27	4.493.230,08	16.514.645,17	1,14%	4,38%	0,90%	6,91%	63,39%	2,39%
Junho	372.968.820,27	245.721.598,23	223.724.601,75	392.257.467,83	-2.708.348,92	13.806.296,25	-0,69%	3,67%	1,08%	8,07%	45,42%	1,94%
Julho	392.257.467,83	154.816.827,65	154.252.730,57	396.136.558,98	3.314.994,07	17.121.290,32	0,84%	4,54%	-0,27%	7,78%	58,39%	1,69%
Agosto	396.136.558,98	3.210.880,35	4.889.629,95	397.972.795,26	3.514.985,88	20.636.276,20	0,89%	5,47%	0,09%	7,87%	69,47%	2,01%
Setembro	397.972.795,26	2.926.081,02	2.178.606,48	400.500.634,12	1.780.364,32	22.416.640,52	0,45%	5,94%	0,12%	8,00%	74,24%	2,13%

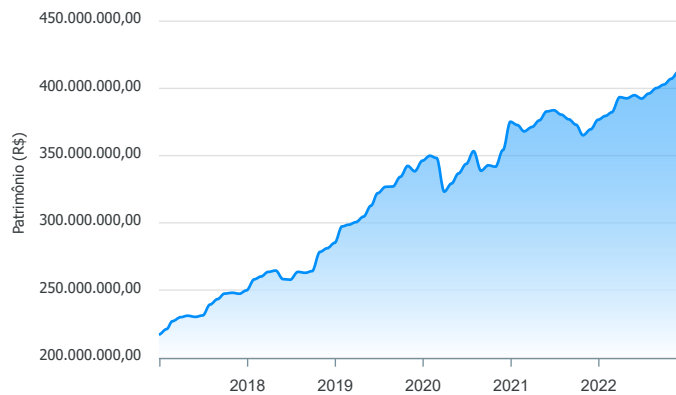
Investimentos x Meta de Rentabilidade



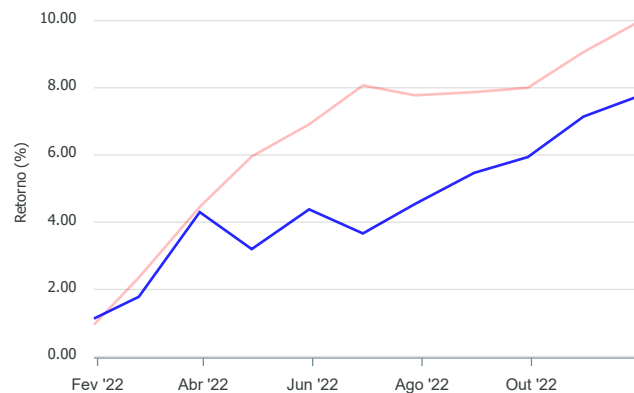
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	36.779.213,91	0,00	0,00	37.342.764,43	563.550,52	1,53%	1,53%	2,07%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.258.979,75	0,00	0,00	1.278.134,96	19.155,21	1,52%	1,52%	2,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.417.151,34	0,00	0,00	1.438.358,19	21.206,85	1,50%	1,50%	2,47%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.066.080,23	0,00	0,00	3.110.980,30	44.900,07	1,46%	1,46%	2,45%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.632.543,77	0,00	0,00	2.670.727,48	38.183,71	1,45%	1,45%	2,43%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	10.187.539,03	0,00	0,00	10.318.145,73	130.606,70	1,28%	1,28%	1,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	26.558.990,04	0,00	0,00	26.888.720,38	329.730,34	1,24%	1,24%	0,79%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.622.243,86	0,00	0,00	10.741.049,38	118.805,52	1,12%	1,12%	0,01%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19.275.084,12	0,00	0,00	19.490.009,56	214.925,44	1,12%	1,12%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	41.498.214,50	0,00	0,00	41.960.811,30	462.596,80	1,11%	1,11%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	507.310,32	0,00	0,00	512.818,80	5.508,48	1,09%	1,09%	0,13%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	13.442.746,52	2.926.081,02	2.178.606,48	14.340.407,34	150.186,28	0,92%	0,99%	0,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.959.185,73	0,00	0,00	2.974.279,01	15.093,28	0,51%	0,51%	1,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.754.600,87	0,00	0,00	10.800.537,82	45.936,95	0,43%	0,43%	1,26%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.076.562,40	0,00	0,00	3.088.890,30	12.327,90	0,40%	0,40%	1,27%
LETRA FINANCEIRA BTG	80.013.639,33	0,00	0,00	80.270.239,23	256.599,90	0,32%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	78.091.008,42	0,00	0,00	78.211.889,77	120.881,35	0,15%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	19.521.137,79	0,00	0,00	19.537.465,05	16.327,26	0,08%	0,08%	0,75%
Total Renda Fixa	361.662.231,93	2.926.081,02	2.178.606,48	364.976.229,03	2.566.522,56	0,71%		0,81%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável/Estruturados/Imobiliário	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	273.418,97	0,00	0,00	277.456,21	4.037,24	1,48%	1,48%	3,15%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	522.442,86	0,00	0,00	528.696,87	6.254,01	1,20%	1,20%	0,14%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	6.387.509,89	0,00	0,00	6.438.365,92	50.856,03	0,80%	0,80%	10,55%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	22.098.425,93	0,00	0,00	21.719.917,20	-378.508,73	-1,71%	-1,71%	10,10%
Total Renda Variável	29.281.797,65	0,00	0,00	28.964.436,20	-317.361,45	-1,08%		9,95%

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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.902.930,76	0,00	0,00	1.795.802,16	-107.128,60	-5,63%	-5,63%	8,21%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.585.021,62	0,00	0,00	2.419.499,65	-165.521,97	-6,40%	-6,40%	9,65%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.540.813,30	0,00	0,00	2.344.667,08	-196.146,22	-7,72%	-7,72%	9,55%
Total Exterior	7.028.765,68	0,00	0,00	6.559.968,89	-468.796,79	-6,67%		9,22%

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 MATRIZ FI RENDA FIXA	13.051.386,83	27.617.241,10	0,00	41.960.811,30	1.292.183,37	3,18%	3,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	36.265.339,47	0,00	0,00	37.342.764,43	1.077.424,96	2,97%	2,97%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	35.969.414,56	0,00	10.000.000,00	26.888.720,38	919.305,82	2,56%	3,54%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.894.804,71	7.000.000,00	0,00	19.490.009,56	595.204,85	3,15%	3,44%
TÍTULOS PÚBLICOS	79.996.678,20	0,00	2.314.308,07	78.211.889,77	529.519,64	0,66%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	8.526.895,96	36.336.547,92	31.039.627,52	14.340.407,34	516.590,98	1,15%	3,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.388.098,50	0,00	0,00	10.741.049,38	352.950,88	3,40%	3,40%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	19.617.241,10	0,00	9.617.241,10	10.318.145,73	318.145,73	1,62%	3,51%
LETRA FINANCEIRA BTG	0,00	80.000.000,00	0,00	80.270.239,23	270.239,23	0,34%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	675.293,10	10.000.000,00	0,00	10.800.537,82	125.244,72	1,17%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	20.279.633,77	0,00	20.349.790,31	0,00	70.156,54	0,35%	3,35%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.627.788,00	0,00	0,00	2.670.727,48	42.939,48	1,63%	1,63%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.413.472,02	0,00	0,00	1.438.358,19	24.886,17	1,76%	1,76%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.255.587,80	0,00	0,00	1.278.134,96	22.547,16	1,80%	1,80%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	496.103,57	0,00	0,00	512.818,80	16.715,23	3,37%	3,37%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	39.077.551,07	0,00	36.000.000,00	3.088.890,30	11.339,23	0,03%	0,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	19.533.544,82	0,00	0,00	19.537.465,05	3.920,23	0,02%	0,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	10.184.207,27	0,00	7.000.000,00	3.110.980,30	-73.226,97	-0,72%	1,64%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	30.142.737,40	0,00	27.000.000,00	2.974.279,01	-168.458,39	-0,56%	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 (%)	(%) Instit
Total Renda Fixa	341.395.778,15	160.953.789,02	143.320.967,00	364.976.229,03	5.947.628,86	1,66%	

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	19.541.953,80	0,00	0,00	21.719.917,20	2.177.963,40	11,15%	11,15%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	5.714.700,24	0,00	0,00	6.438.365,92	723.665,68	12,66%	12,66%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	510.612,02	0,00	0,00	528.696,87	18.084,85	3,54%	3,54%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	18.259.961,81	0,00	18.000.000,00	277.456,21	17.494,40	0,10%	6,73%
Total Renda Variável	44.027.227,87	0,00	18.000.000,00	28.964.436,20	2.937.208,33	6,67%	

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
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.502.255,81	0,00	0,00	2.419.499,65	-82.756,16	-3,31%	-3,31%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.880.950,16	0,00	0,00	1.795.802,16	-85.148,00	-4,53%	-4,53%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.451.255,84	0,00	0,00	2.344.667,08	-106.588,76	-4,35%	-4,35%
Total Exterior	6.834.461,81	0,00	0,00	6.559.968,89	-274.492,92	-4,02%	

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.

