

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
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	717.869,85	4,13%	4.086.335.709,28	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	695.594,50	4,00%	3.200.270.776,09	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	184.290,90	1,06%	5.839.461.409,01	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.959.608,03	11,28%	8.108.886.938,29	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.425.843,57	8,20%	8.449.071.998,91	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	615.840,89	3,54%	1.174.260.901,84	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.114.368,26	6,41%	3.862.167.779,60	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	842.560,40	4,85%	5.646.338.902,14	0,01%	7º I b
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	53.415,45	0,31%	35.375.949.590,53	0,00%	7º I b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	3.537.118,84	20,35% ▲	1.078.455.317,88	0,33%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.141,61	0,01%	14.020.474.735,38	0,00%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1.165.314,91	6,71%	2.196.787.659,94	0,05%	7º III a
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	879.859,29	5,06%	520.825.145,72	0,17%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	834.489,99	4,80%	2.673.080.510,36	0,03%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	595.840,25	3,43%	596.240.734,23	0,10%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	173.879,83	1,00%	2.030.078.847,62	0,01%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	428.181,33	2,46%	134.239.582,59	0,32%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	607.365,74	3,50%	2.170.160.001,28	0,03%	10º I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	575.968,79	3,31%	789.136.322,70	0,07%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	579.568,30	3,34%	1.273.842.064,19	0,05%	10º I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	389.828,03	2,24%	135.567.993,01	0,29%	11º

Investimentos

\$ 17.377.948,76

Disponibilidades Financeiras

\$ 5.343,23

Total Carteira

\$ 17.383.291,99

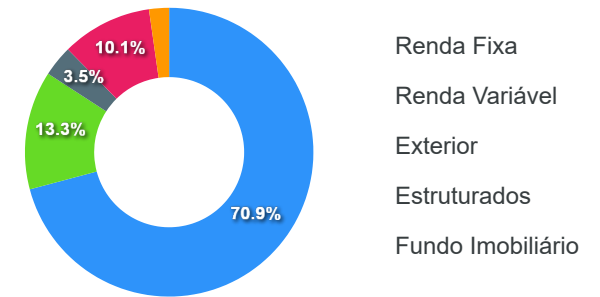
Governança (Pró Gestão)
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	43,77% 7.609.391,85	56,23% 9.773.900,14
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	27,06% 4.703.575,36	32,94% 5.726.399,83
8º I - Fundos de Ações	30,00%	13,29% 2.310.189,53	16,71% 2.904.798,07
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,46% 602.061,16	6,54% 1.136.268,04
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	10,14% 1.762.902,83	-0,14% -24.573,63
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	2,24% 389.828,03	2,76% 479.336,57

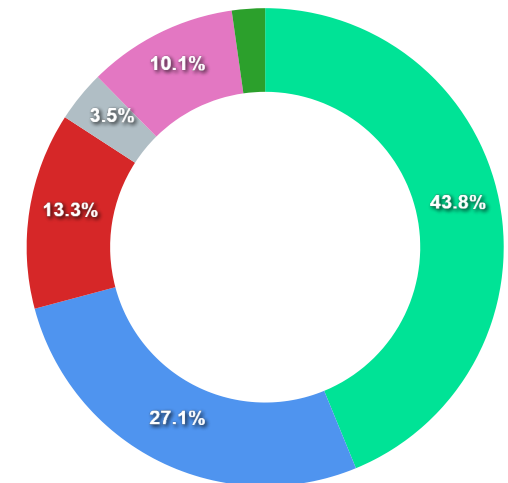
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



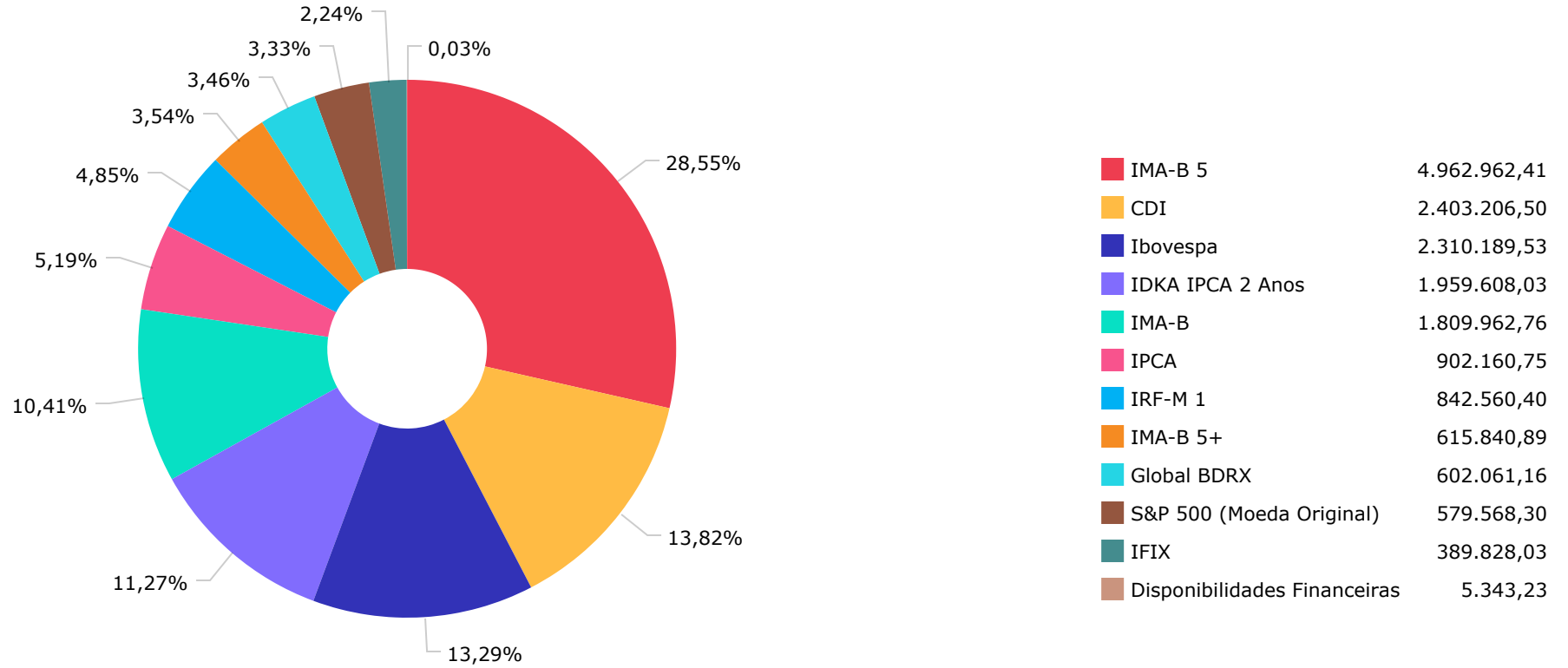
Artigos

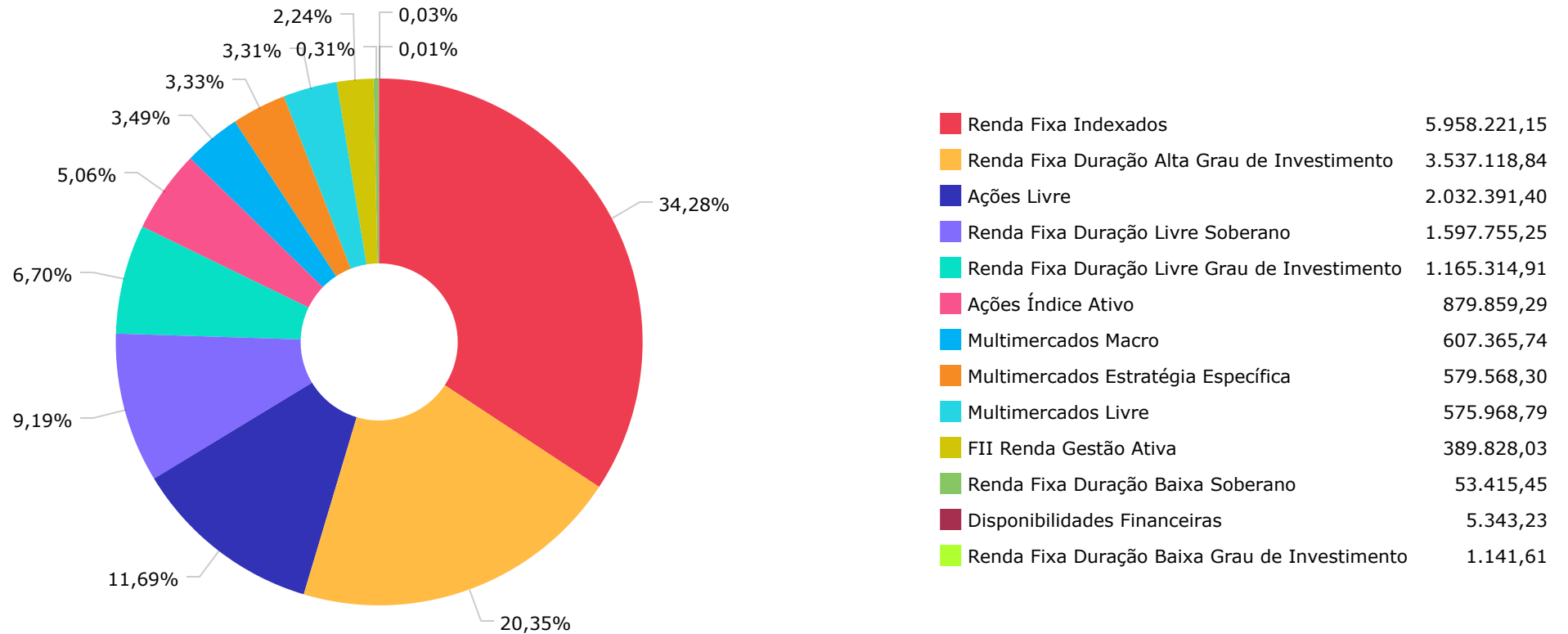


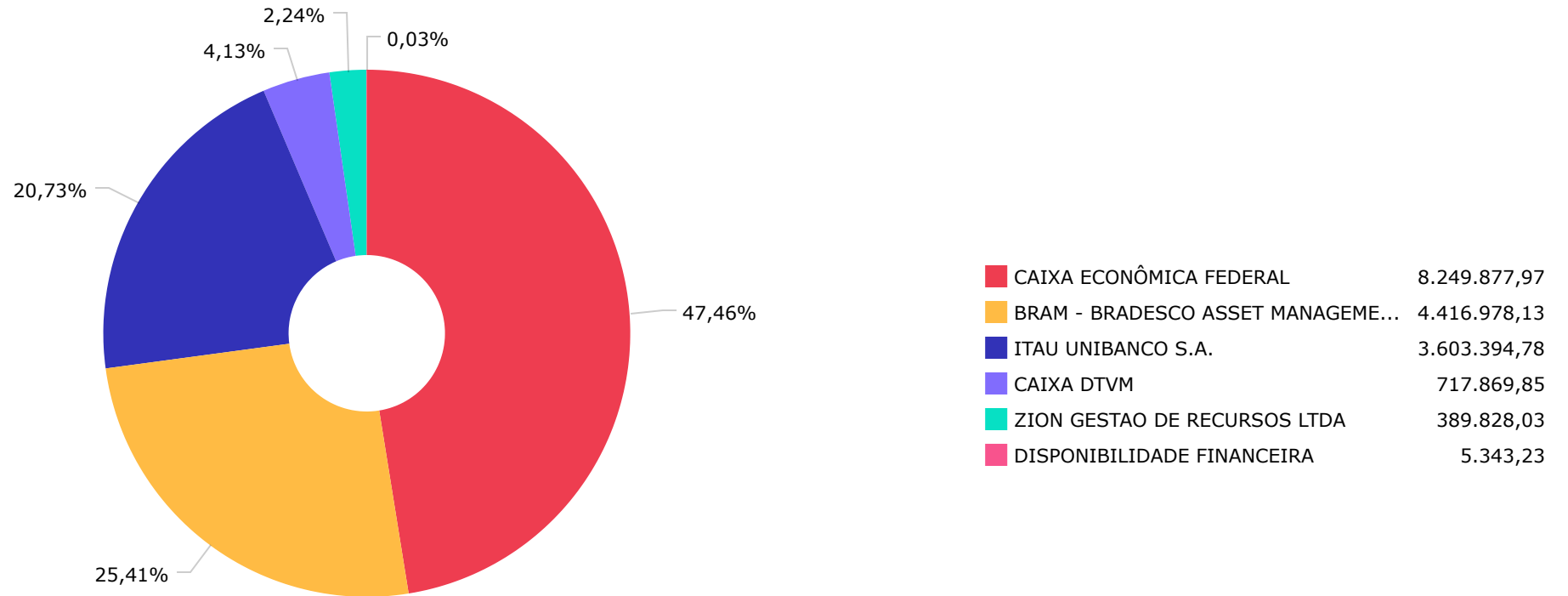
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	4,00%	100,00%	17.383.291,99	8° I - Fundos de Ações	13,29%	0,00%	20,00%	30,00%	2.904.798,07
7° I b - FI 100% Títulos TN	43,77%	0,00%	39,00%	100,00%	9.773.900,14	9° III - Ações - BDR Nível I	3,46%	0,00%	5,00%	10,00%	1.136.268,04
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	17.383.291,99	10° I - Fundos Multimercados	10,14%	0,00%	5,00%	10,00%	-24.573,63
7° III a - FI Referenciados RF	27,06%	0,00%	20,00%	60,00%	5.726.399,83	11° - Fundos Imobiliários	2,24%	0,00%	2,00%	5,00%	479.336,57
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	3.476.658,40						
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	869.164,60						
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	869.164,60						
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	869.164,60						

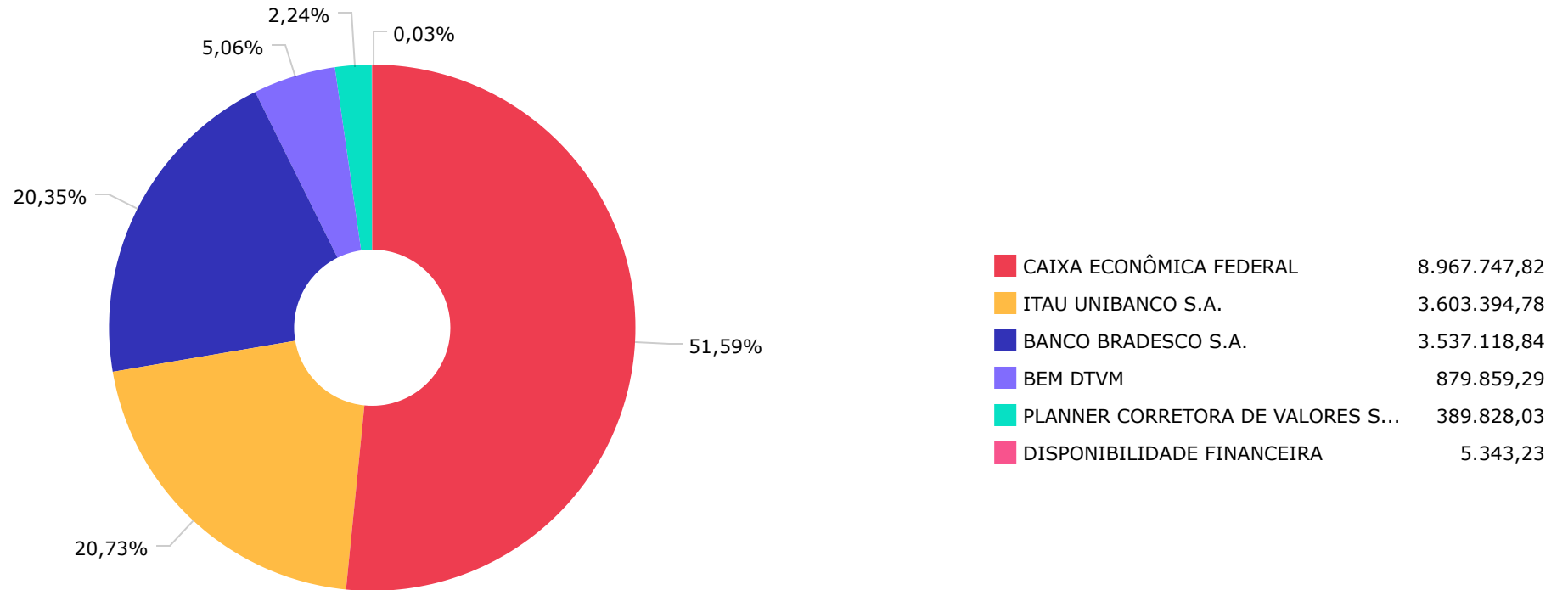
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20		
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,64	13,28	7,53	8,47	15,78	21,37	1,88	3,96
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,88	11,16	5,61	6,99	13,11	17,94	2,04	4,29
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03	10,25	3,36	6,65	11,77	15,91	0,02	0,04
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,00	10,02	3,01	6,01	11,49	17,21	0,24	0,50
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,82	7,78	2,64	5,16	8,81	10,38	0,00	0,00
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	1,33	-29,86	-9,99	-6,55	-29,14	-2,97		
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,44	-16,20	-3,47	2,69	-16,39	17,43	15,40	32,44
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,70	-29,79	-9,82	-6,27	-29,23	-5,49	16,62	34,99
IBOVESPA - BENCHMARK	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51		
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	5,78	14,43	13,32	10,57	14,43	10,06	14,75	31,07
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	10,60	12,92	16,65	14,07	12,37	23,30	12,57	26,47
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	6,95	7,34	13,29	7,65	4,78	9,46	14,54	30,62
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69		
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
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
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,89	2,34	-0,81	-0,03	6,01	4,24	0,85	1,80
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
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,84	8,68	2,24	3,28	12,23	16,16	0,75	1,57

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B 5+ - BENCHMARK	0,65	5,79	5,62	3,73	10,15	9,03		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,64	5,61	5,60	3,61	9,83	8,35	2,41	5,08
IPCA - BENCHMARK	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,99	9,36	3,75	5,92	11,26	11,59	0,47	0,98
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,24		2,18	-0,23			0,53	1,12
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		
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	8,72	-12,75	-3,84	-1,45	-8,38	32,25	13,17	27,73
IFIX - BENCHMARK	0,02	6,66	6,30	6,34	11,80	8,12		
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-5,01	36,82	-17,43	-0,79	48,63	-4,05	16,51	34,76







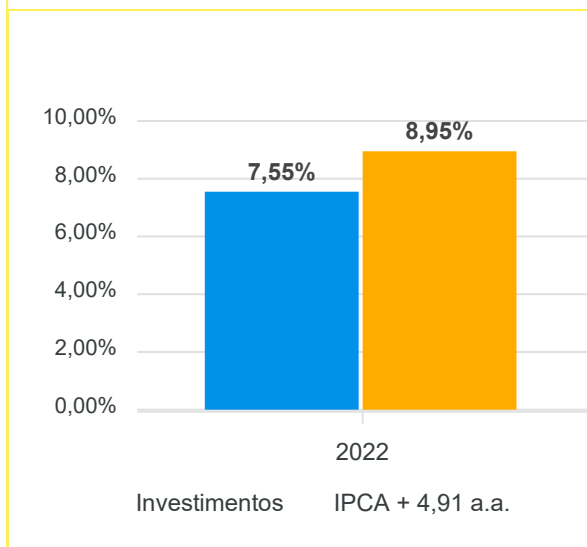


Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	18.540.137,29	0,00	780.527,08	17.749.947,75	-9.662,46	-9.662,46	-0,05% ▼	-0,05%	0,94%	0,94%	-5,32%	2,95%
Fevereiro	17.749.947,75	3.279.810,25	4.195.905,06	16.933.089,70	99.236,76	89.574,30	0,56% ▲	0,51%	1,38%	2,33%	21,89%	2,78%
Março	16.933.089,70	6.263.507,11	5.741.066,11	17.977.559,96	522.029,26	611.603,56	2,99% ▲	3,51%	2,05%	4,42%	79,41%	3,65%
Abril	17.977.559,96	2.898.094,69	2.249.130,10	18.508.770,67	-117.753,88	493.849,68	-0,63% ▼	2,86%	1,43%	5,91%	48,39%	2,09%
Mai	18.508.770,67	5.552.524,63	5.766.457,09	18.564.186,16	269.347,95	763.197,63	1,46% ▲	4,35%	0,89%	6,86%	63,41%	4,05%
Junho	18.564.186,16	1.905.305,92	2.068.495,33	18.128.087,81	-272.908,94	490.288,69	-1,47% ▼	2,82%	1,07%	8,00%	35,25%	2,96%
Julho	18.128.087,81	2.524.783,52	3.368.444,94	17.536.426,44	252.000,05	742.288,74	1,39% ▲	4,25%	-0,28%	7,70%	55,19%	3,17%
Agosto	17.536.426,44	2.685.539,86	2.835.052,16	17.494.060,14	107.146,00	849.434,74	0,61% ▲	4,89%	0,08%	7,78%	62,85%	3,23%
Setembro	17.494.060,14	2.530.603,10	2.691.834,77	17.331.596,22	-1.232,25	848.202,49	-0,01% ▼	4,88%	0,11%	7,90%	61,77%	3,24%
Outubro	17.331.596,22	1.069.535,13	1.463.779,16	17.377.948,76	440.596,57	1.288.799,06	2,54% ▲	7,55%	0,97%	8,95%	84,36%	3,91%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	611.603,56	3,51%	4,42%
2º Trim	-121.314,87	-0,67%	3,43%
1º Sem	490.288,69	2,82%	8,00%
3º Trim	357.913,80	2,00%	-0,10%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado



Gráficos

Gráfico Risco x Retorno

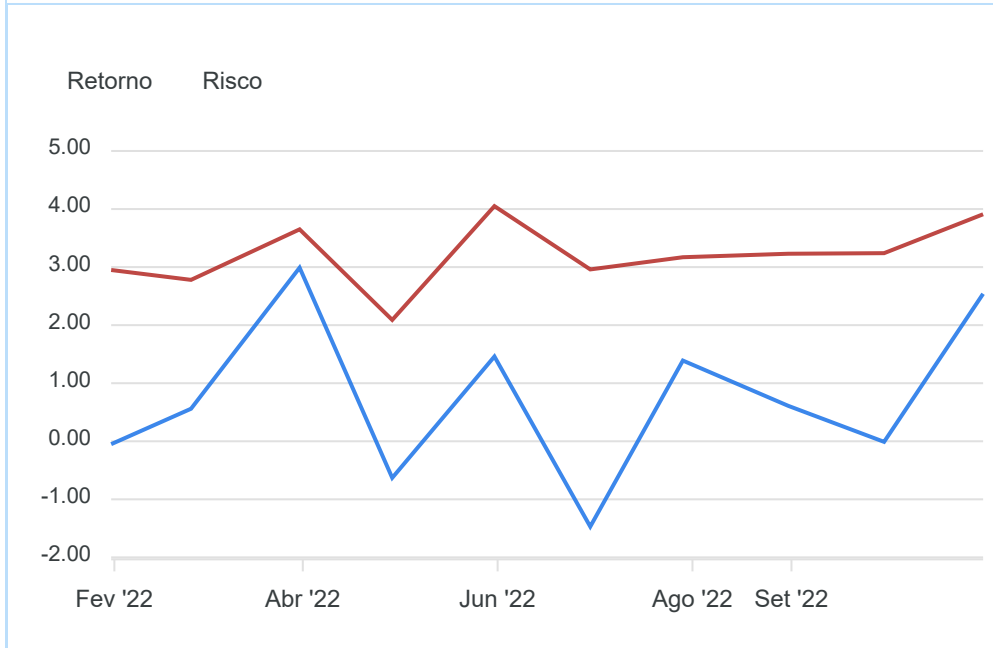
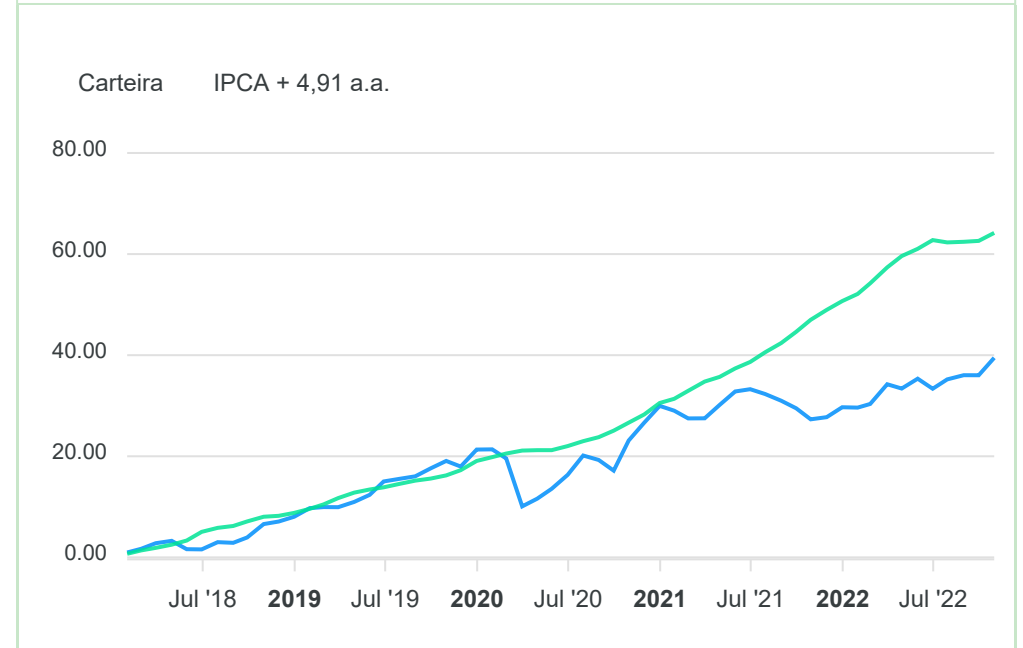


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	3.473.239,45	0,00	0,00	3.537.118,84	63.879,39	1,84% ▲	0,75%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	702.163,90	0,00	0,00	717.869,85	15.705,95	2,24% ▲	0,53%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	682.662,86	0,00	0,00	695.594,50	12.931,64	1,89% ▲	0,85%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	20.966,66	0,00	20.000,00	1.141,61	174,95	0,83% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	182.491,67	0,00	0,00	184.290,90	1.799,23	0,99% ▲	0,47%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.944.178,43	0,00	20.000,00	1.959.608,03	35.429,60	1,82% ▲	0,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.399.595,51	0,00	0,00	1.425.843,57	26.248,06	1,88% ▲	0,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	611.912,26	0,00	0,00	615.840,89	3.928,63	0,64% ▲	2,41%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.101.383,06	0,00	0,00	1.114.368,26	12.985,20	1,18% ▲	1,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	992.218,69	0,00	158.937,25	842.560,40	9.278,96	0,94% ▲	0,03%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	243.996,72	1.069.535,13	1.264.841,91	53.415,45	4.725,51	0,36% ▲	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1.153.795,01	0,00	0,00	1.165.314,91	11.519,90	1,00% ▲	0,24%
	12.508.604,22	1.069.535,13	1.463.779,16	12.312.967,21	198.607,02	1,59%	0,81%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	831.745,43	0,00	0,00	879.859,29	48.113,86	5,78% ▲	14,75%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	410.399,43	0,00	0,00	389.828,03	-20.571,40	-5,01% ▼	16,51%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	596.159,63	0,00	0,00	607.365,74	11.206,11	1,88% ▲	2,04%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	566.684,46	0,00	0,00	575.968,79	9.284,33	1,64% ▲	1,88%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	754.528,39	0,00	0,00	834.489,99	79.961,60	10,60% ▲	12,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	557.140,92	0,00	0,00	595.840,25	38.699,33	6,95% ▲	14,54%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	533.083,77	0,00	0,00	579.568,30	46.484,53	8,72% ▲	13,17%
-	4.249.742,03	0,00	0,00	4.462.920,39	213.178,36	5,02%	10,87%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	170.968,23	0,00	0,00	173.879,83	2.911,60	1,70% ▲	16,62%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	402.281,74	0,00	0,00	428.181,33	25.899,59	6,44% ▲	15,40%
	573.249,97	0,00	0,00	602.061,16	28.811,19	5,03%	4,80%