INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DE RIBEIRÃO PIRES

IMPRERP

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro 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 (Outubro / 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	1.083.500,15	0,77%	388	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	7.844.686,13	5,61%	518	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	12.757.345,10	9,12%	1.030	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	7.326.646,43	5,24%	789	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	59.492,37	0,04%	572	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	518.728,11	0,37%	95	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.190.257,46	0,85%	1.094	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.265.863,20	2,34%	473	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	4.973.699,48	3,56%	274	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	463 dias	42.805.386,21	30,61%	285	1,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	1.985.504,76	1,42%	252	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.119.819,56	0,80%	809	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.288.584,35	0,92%	1.014	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	52.151,50	0,04%	960	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	873,46	0,00%	253	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	9.720,19	0,01%	772	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	24.765,66	0,02%	219	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	4.554.177,43	3,26%	1.033	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	319.804,49	0,23%	980	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	153.414,06	0,11%	638	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2022)

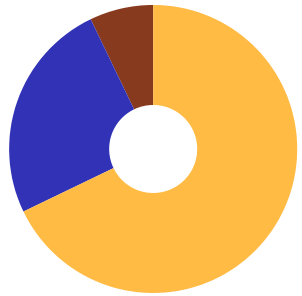
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	10.824,88	0,01%	250	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	Não pos...	Não há	3.545.893,43	2,54%	8	18,17%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	4.628.594,93	3,31%	28.072	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.264.552,88	2,33%	1.850	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	7.373.593,65	5,27%	6.147	1,57%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	252.019,69	0,18%	3.492	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.842.850,56	1,32%	25.266	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	204.413,34	0,15%	12.579	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	3.057.709,96	2,19%	1.379	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	484.150,30	0,35%	191	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	2.580.153,32	1,84%	28.486	0,60%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	7.410.674,07	5,30%	14.900	1,07%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	10.134,80	0,01%	99	0,01%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.131.144,77	2,95%	8.049	0,19%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	404.770,53	0,29%	9.814	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	2.852.193,04	2,04%	109	0,42%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	900.093,97	0,64%	4.215	0,44%	Artigo 10º, Inciso I
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	3.075.757,01	2,20%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	880.257,82	0,63%		0,65%	Artigo 11º
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	1.610.750,83	1,15%		2,59%	Artigo 11º

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			**139.854.953,88**				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			**93.757,06**				Artigo 6º
PL Total			**139.948.710,94**				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 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%	5,00%	35,00%	48.949.233,86
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	86.282.258,46	61,69%	20,00%	35,00%	80,00%	25.601.704,64
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	5.062.986,52	3,62%	5,00%	18,00%	60,00%	78.849.985,81
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	20.978.243,08
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	3.545.893,43	2,54%	0,00%	2,32%	5,00%	3.446.854,26
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,78%	5,00%	6.992.747,69
Total Renda Fixa	100,00%	94.891.138,41	67,85%	25,00%	64,10%	200,00%	



RENDA FIXA 94.891.138,41

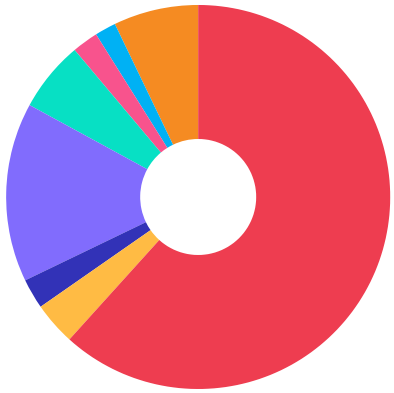
RENDA VARIÁVEL 34.972.988,08

EXTERIOR 9.990.827,39

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	21.107.885,31	15,09%	10,00%	18,00%	30,00%	20.848.600,85
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	8.298.337,11	5,93%	2,00%	6,00%	10,00%	5.687.158,28
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	3.075.757,01	2,20%	0,00%	2,50%	5,00%	3.916.990,68
Artigo 11º	5,00%	2.491.008,65	1,78%	0,00%	2,40%	5,00%	4.501.739,04
Total Renda Variável	30,00%	34.972.988,08	25,01%	12,00%	28,90%	50,00%	

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%	5,00%	6.992.747,69
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	9.990.827,39	7,14%	3,00%	7,00%	10,00%	3.994.668,00
Total Exterior	10,00%	9.990.827,39	7,14%	3,00%	7,00%	15,00%	



7º I b | 7º III a | 7º V a | 8º I | 10º I | 10º II | 11º | 9º III

Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	71.166.148,76	50,89	-
CAIXA DTVM	55.823.859,02	39,92	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.545.893,43	2,54	1,01
KPTL	3.075.757,01	2,20	1,33
BANCO J. SAFRA S/A	2.852.193,04	2,04	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.610.750,83	1,15	-
SICREDI	900.093,97	0,64	0,00
ZION INVEST	880.257,82	0,63	-

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	35,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	86.282.258,46	61,69	20,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	5.062.986,52	3,62	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	3.545.893,43	2,54	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	21.107.885,31	15,09	10,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	9.990.827,39	7,14	3,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	8.298.337,11	5,93	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	3.075.757,01	2,20	0,00	5,00
Artigo 11º	2.491.008,65	1,78	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 Outubro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,21%	11,60%	1,91%	4,39%	14,99%	37,36%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	-0,12%	3,02%	-0,60%	-0,88%	13,85%	-48,56%	-	0,09%
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%	0,03%
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%	0,03%
IMA Geral (Benchmark)	1,01%	8,88%	3,72%	5,61%	11,80%	12,98%	-	-
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	8,63%	3,82%	5,66%	11,60%	11,95%	0,67%	0,02%
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%	3,62%	9,83%	8,35%	2,41%	0,07%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,00%	9,68%	3,38%	6,44%	11,52%	13,50%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	9,45%	3,31%	6,32%	11,23%	12,92%	0,04%	0,01%
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%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,89%	8,92%	2,30%	3,42%	12,47%	17,14%	0,75%	0,03%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,89%	2,34%	-0,81%	-0,03%	6,01%	4,24%	0,85%	0,06%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,89%	-	2,21%	3,00%	-	-	0,85%	-
IMA-B (Benchmark)	1,23%	7,43%	3,86%	3,57%	11,40%	13,44%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,18%	7,12%	3,73%	3,27%	11,06%	12,77%	1,56%	0,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	7,18%	3,77%	3,47%	11,10%	12,87%	1,55%	0,05%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,10%	7,24%	3,84%	3,57%	11,14%	12,92%	1,62%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	7,34%	3,92%	3,56%	11,26%	13,01%	1,58%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	0,93%	7,95%	4,44%	6,64%	11,95%	8,26%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	7,79%	4,38%	6,53%	11,79%	7,77%	0,96%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,02%	10,00%	3,30%	6,51%	11,49%	15,20%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,01%	10,13%	3,32%	6,57%	11,65%	15,31%	0,02%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03%	10,25%	3,36%	6,65%	11,77%	15,91%	0,02%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,04%	10,21%	3,35%	6,62%	11,79%	15,78%	0,01%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01%	7,78%	3,50%	5,11%	10,65%	10,83%	0,69%	0,02%
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%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01%	8,59%	3,46%	5,57%	11,11%	13,25%	0,73%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,24%	-	2,18%	-0,23%	-	-	0,53%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	4,92%	-25,16%	-5,28%	-0,38%	-24,21%	4,96%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,33%	-26,73%	-6,37%	-2,90%	-25,64%	-0,64%	14,96%	0,18%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,39%	13,74%	2,50%	5,62%	17,65%	43,76%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
S&P 500 (Benchmark)	7,99%	-18,76%	-6,25%	-6,29%	-15,92%	18,41%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	7,70%	-14,01%	-4,26%	-2,48%	-9,96%	27,17%	12,69%	0,22%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8,77%	-12,58%	-3,74%	-1,33%	-8,19%	32,53%	13,20%	0,23%
Ibovespa (Benchmark)	5,45%	10,70%	12,48%	7,57%	12,11%	23,51%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	5,76%	10,30%	11,42%	3,32%	11,51%	25,51%	13,50%	0,19%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4,36%	6,11%	9,95%	3,47%	8,25%	28,30%	14,66%	0,20%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3,61%	2,04%	7,10%	2,39%	5,28%	25,87%	14,36%	0,19%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	7,88%	10,63%	14,51%	9,41%	10,38%	13,28%	13,53%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,78%	9,32%	8,90%	4,61%	15,03%	37,52%	12,63%	0,18%
BB AGRO FIC AÇÕES	8,23%	6,70%	11,83%	3,14%	12,04%	-	8,74%	0,22%
SMLL (Benchmark)	7,30%	-1,35%	16,81%	0,91%	0,06%	3,68%	-	-
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	6,75%	-1,45%	16,96%	-0,46%	-0,57%	-0,99%	15,08%	0,28%

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

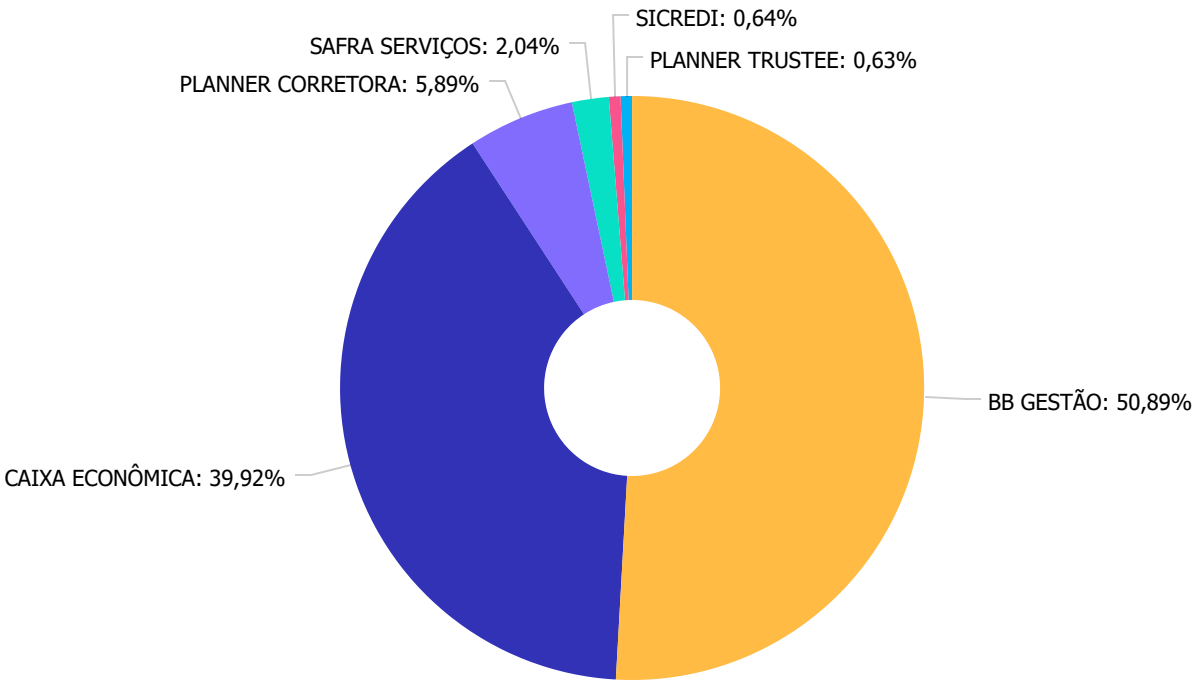
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,02%	10,00%	3,30%	6,51%	11,49%	15,20%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,88%	11,16%	5,61%	6,99%	13,11%	17,94%	2,04%	0,03%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	8,61%	-12,66%	-3,85%	-1,43%	-8,39%	31,52%	13,08%	0,23%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,25%	9,40%	3,42%	5,24%	11,56%	13,53%	0,77%	0,01%
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%	0,23%
IFIX (Benchmark)	0,02%	6,66%	6,30%	6,34%	11,80%	8,12%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-29,52%	-1,24%	-31,63%	37,92%	19,11%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-5,01%	36,82%	-17,43%	-0,79%	48,63%	379,75%	16,51%	0,95%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	4,92%	-25,16%	-5,28%	-0,38%	-24,21%	4,96%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,33%	-26,73%	-6,37%	-2,90%	-25,64%	-0,64%	14,96%	0,18%

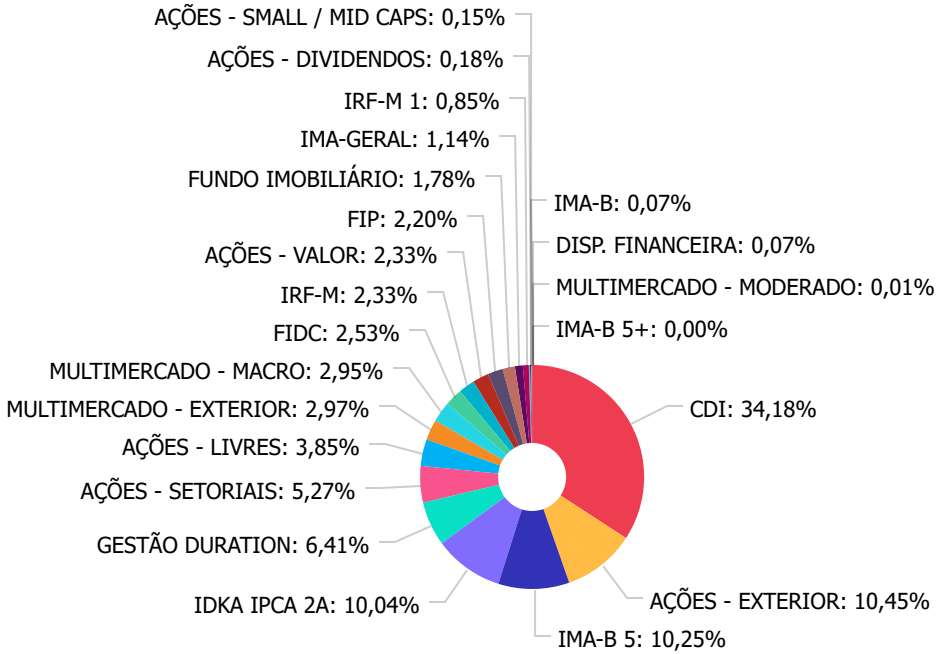
Global BDRX (Benchmark)	1,33%	-29,86%	-9,99%	-6,55%	-29,14%	-2,97%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,24%	-15,47%	-5,51%	-5,97%	-13,63%	-	11,75%	0,18%

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



BB GESTÃO	71.166.148,76
CAIXA ECONÔMICA	55.823.859,02
PLANNER CORRETORA	8.232.401,27
SAFRA SERVIÇOS	2.852.193,04
SICREDI	900.093,97
PLANNER TRUSTEE	880.257,82

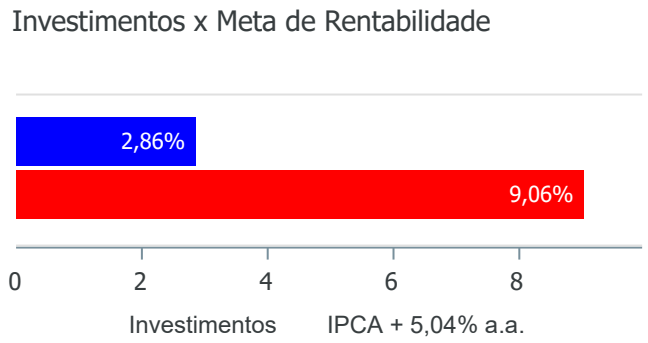
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2022)



CDI	47.832.782,19	AÇÕES - EXTERIOR	14.619.422,32	IMA-B 5	14.338.002,17	IDKA IPCA 2A	14.045.929,45
GESTÃO DURATION	8.964.505,69	AÇÕES - SETORIAIS	7.373.593,65	AÇÕES - LIVRES	5.384.710,82	MULTIMERCADO - EXTERIOR	4.157.057,54
MULTIMERCADO - MACRO	4.131.144,77	FIDC	3.545.893,43	IRF-M	3.265.863,20	AÇÕES - VALOR	3.264.552,88
FIP	3.075.757,01	FUNDO IMOBILIÁRIO	2.491.008,65	IMA-GERAL	1.602.228,26	IRF-M 1	1.190.257,46
AÇÕES - DIVIDENDOS	252.019,69	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	204.413,34	IMA-B	104.803,10	DISP. FINANCEIRA	93.757,06
MULTIMERCADO - MODERADO	10.134,80	IMA-B 5+	873,46				

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

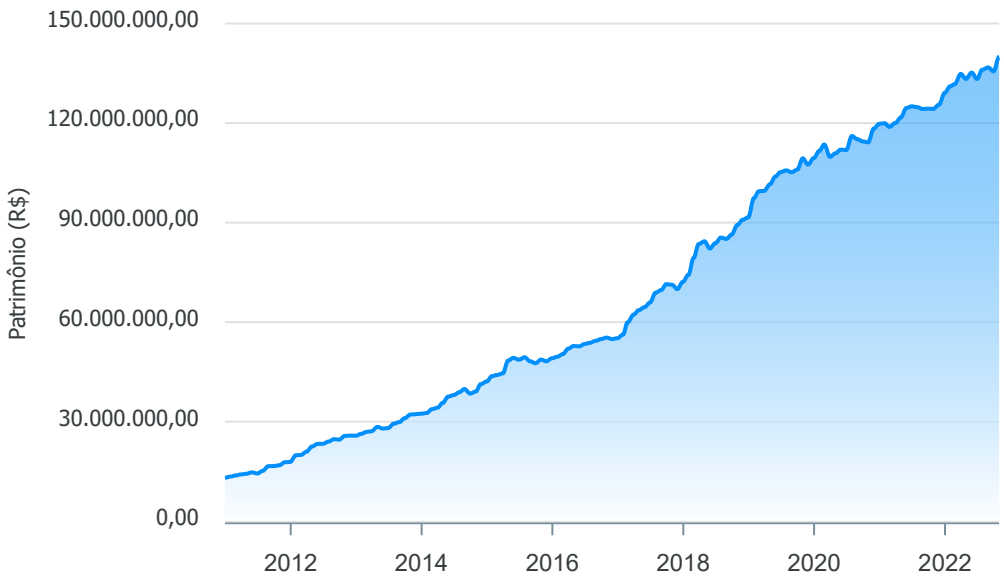
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	129.088.821,93	7.300.622,35	4.355.546,47	131.097.558,00	-936.339,81	-936.339,81	-0,71%	-0,71%	0,95%	0,95%	-74,43%	3,28%
Fevereiro	131.097.558,00	6.994.395,60	6.553.785,05	131.677.856,99	139.688,44	-796.651,37	0,11%	-0,60%	1,39%	2,35%	-25,68%	3,17%
Março	131.677.856,99	11.195.662,38	10.773.041,52	134.804.770,73	2.704.292,88	1.907.641,51	2,05%	1,43%	2,06%	4,46%	32,11%	3,46%
Abril	134.804.770,73	9.522.587,43	9.466.231,48	133.320.564,91	-1.540.561,77	367.079,74	-1,14%	0,27%	1,44%	5,96%	4,57%	3,39%
Maio	133.320.564,91	44.920.830,83	44.425.004,92	135.199.970,30	1.383.579,48	1.750.659,22	1,03%	1,31%	0,90%	6,91%	18,94%	5,07%
Junho	135.199.970,30	3.651.034,15	7.109.367,03	128.967.407,43	-2.774.229,99	-1.023.570,77	-2,05%	-0,77%	1,08%	8,07%	-9,54%	3,84%
Julho	128.967.407,43	3.329.841,51	2.781.744,51	131.768.158,42	2.252.653,99	1.229.083,22	1,74%	0,96%	-0,27%	7,78%	12,30%	3,16%
Agosto	131.768.158,42	2.447.857,03	1.986.564,44	132.531.355,06	301.904,05	1.530.987,27	0,23%	1,19%	0,09%	7,87%	15,08%	3,27%
Setembro	132.531.355,06	7.589.719,28	6.894.384,61	131.671.525,44	-1.555.164,29	-24.177,02	-1,17%	0,01%	0,12%	8,00%	0,07%	3,39%
Outubro	131.671.525,44	2.428.853,76	1.850.052,26	136.027.326,34	3.776.999,40	3.752.822,38	2,86%	2,86%	0,98%	9,06%	31,58%	4,00%



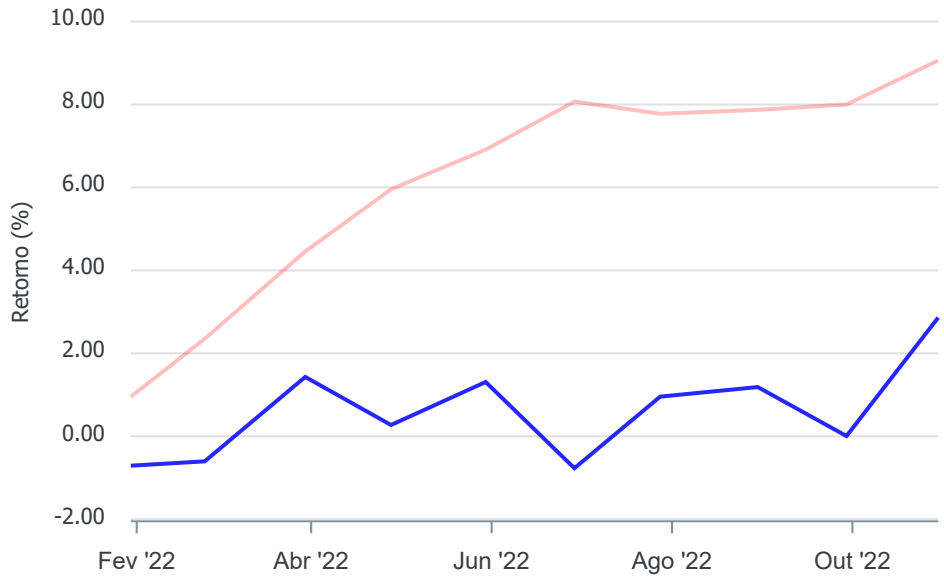
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Outubro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	41.868.866,30	0,00	0,00	42.805.386,21	936.519,91	2,24%	2,24%	0,53%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.948.592,67	0,00	0,00	1.985.504,76	36.912,09	1,89%	1,89%	0,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	4.881.297,15	0,00	0,00	4.973.699,48	92.402,33	1,89%	1,89%	0,85%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	7.190.746,78	0,00	0,00	7.326.646,43	135.899,65	1,89%	1,89%	0,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	51.191,46	0,00	0,00	52.151,50	960,04	1,88%	1,88%	0,75%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.017.918,98	0,00	500.000,00	12.757.345,10	239.426,12	1,84%	1,85%	0,82%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.265.426,42	0,00	0,00	1.288.584,35	23.157,93	1,83%	1,83%	0,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	58.790,76	0,00	0,00	59.492,37	701,61	1,19%	1,19%	1,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.606,93	0,00	0,00	9.720,19	113,26	1,18%	1,18%	1,58%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.477,38	0,00	0,00	24.765,66	288,28	1,18%	1,18%	1,56%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	10.707,39	0,00	0,00	10.824,88	117,49	1,10%	1,10%	1,62%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	513.289,80	0,00	0,00	518.728,11	5.438,31	1,06%	1,06%	0,67%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	316.537,29	0,00	0,00	319.804,49	3.267,20	1,03%	1,03%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	7.765.915,37	0,00	0,00	7.844.686,13	78.770,76	1,01%	1,01%	0,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.072.623,78	0,00	0,00	1.083.500,15	10.876,37	1,01%	1,01%	0,69%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	152.867,96	0,00	1.000,00	153.414,06	1.546,10	1,01%	1,01%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.108.886,80	0,00	0,00	1.119.819,56	10.932,76	0,99%	0,99%	0,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.178.661,66	0,00	0,00	1.190.257,46	11.595,80	0,98%	0,98%	0,04%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.181.992,85	55.124,09	0,00	3.265.863,20	28.746,26	0,89%	0,89%	0,96%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.628.606,46	2.873.729,67	1.997.310,16	4.554.177,43	49.151,46	0,76%	1,04%	0,01%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/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...	867,89	0,00	0,00	873,46	5,57	0,64%	0,64%	2,41%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	3.554.184,92	0,00	0,00	3.545.893,43	-8.291,49	-0,23%	-	-
Total Renda Fixa	**92.802.057,00**	**2.928.853,76**	**2.498.310,16**	**94.891.138,41**	**1.658.537,81**	**1,78%**		**0,62%**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/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	372.125,83	0,00	0,00	404.770,53	32.644,70	8,77%	8,77%	13,19%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	827.507,40	0,00	0,00	900.093,97	72.586,57	8,77%	8,77%	13,20%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	2.626.103,13	0,00	0,00	2.852.193,04	226.089,91	8,61%	8,61%	13,08%
BB AGRO FIC AÇÕES	6.812.877,89	0,00	0,00	7.373.593,65	560.715,76	8,23%	8,23%	8,74%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.834.410,79	0,00	0,00	3.057.709,96	223.299,17	7,88%	7,88%	13,53%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	4.297.679,46	0,00	0,00	4.628.594,93	330.915,47	7,70%	7,70%	12,69%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	191.495,25	0,00	0,00	204.413,34	12.918,09	6,75%	6,75%	15,08%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	457.719,04	0,00	0,00	484.150,30	26.431,26	5,77%	5,77%	12,63%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	238.285,63	0,00	0,00	252.019,69	13.734,06	5,76%	5,76%	13,50%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.765.843,54	0,00	0,00	1.842.850,56	77.007,02	4,36%	4,36%	14,66%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.150.855,63	0,00	0,00	3.264.552,88	113.697,25	3,61%	3,61%	14,36%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.054.923,70	0,00	0,00	4.131.144,77	76.221,07	1,88%	1,88%	2,04%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	10.010,05	0,00	0,00	10.134,80	124,75	1,25%	1,25%	0,77%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1.598.933,95	0,00	0,00	1.610.750,83	11.816,88	0,74%	0,00%	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	3.083.630,36	0,00	0,00	3.075.757,01	-7.873,35	-0,26%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	926.709,42	0,00	0,00	880.257,82	-46.451,60	-5,01%	-5,01%	16,51%
Total Renda Variável	**33.249.111,07**	**0,00**	**0,00**	**34.972.988,08**	**1.723.877,01**	**5,18%**		**10,85%**

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	2.428.571,00	0,00	0,00	2.580.153,32	151.582,32	6,24%	6,24%	11,75%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	7.103.242,65	0,00	0,00	7.410.674,07	307.431,42	4,33%	4,33%	14,96%
Total Exterior	**9.531.813,65**	**0,00**	**0,00**	**9.990.827,39**	**459.013,74**	**4,82%**		**14,13%**

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.