
**REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE
SÃO JOSÉ DOS QUATRO MARCOS - MT / PREVIQUAM**

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

**SETEMBRO
2022**

14 de outubro de 2022

ÍNDICE

1 – INTRODUÇÃO	2
2 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA e POLÍTICA DE INVESTIMENTOS	4
2.1 - Movimentação Financeira da Carteira	4
2.2 - PAI - Limite de Segmento	5
2.3 - PAI - Limite de Benchmark	6
3 – ENQUADRAMENTO: RESOLUÇÃO CMN 4.963/2021	7
3.1 - Enquadramento sobre Segmentos e Fundos de Investimento	7
3.1.1 - Disponibilidade Financeira e Total por Segmento	10
3.2 - Enquadramento sobre Patrimônio Líquido dos Fundos de Investimento	11
3.3 - Enquadramento dos Fundos de Investimento que recebem cotas	13
3.4 - Movimentação das Cotas Aplicadas nos Fundos de Investimento	14
3.5 - Enquadramento sobre os recursos de terceiros dos Gestores	15
4 – SEPARAÇÃO DOS RECURSOS - PROVISÃO DE CAIXA	16
4.1 - Planejamento Financeiro	17
5 – DISTRIBUIÇÃO ESTATÍSTICA DA CARTEIRA	18
5.1 - Distribuição por Segmento (Renda Fixa e Renda Variável)	18
5.2 - Distribuição por índice (Benchmark)	19
5.3 - Distribuição por Instituição Financeira	20
5.4 - Distribuição dos Recursos Disponíveis e Imobilizado	21
5.4.1 - Distribuição da Disponibilidade dos Recursos nos próximos 25 anos	22
6 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO	24
7 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	28
8 – RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO	38
8.1 - Rentabilidade Mensal da Carteira de Investimentos	38
8.2 - Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos	39
8.3 - Rentabilidade da Carteira de Investimentos	41
8.4 - Meta Atuarial	41
9 – ANÁLISE DO MERCADO	42
10 – ANÁLISE MACROECONÔMICA	46
11 – PROJEÇÃO DA META ATUARIAL E RENTABILIDADE DA CARTEIRA	49

1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o parecer econômico referente ao mês de SETEMBRO, sobre o desempenho mensal das rentabilidades das atuais aplicações financeiras do PREVIQUAM.

Este Relatório contém uma análise do enquadramento de suas aplicações frente à Resolução CMN 4.963/2021, um resumo do Regulamento dos fundos de investimento, uma análise sobre o comportamento mensal das rentabilidades ao longo do ano, uma análise do retorno da carteira de investimento quanto a Meta Atuarial e uma projeção sobre o cumprimento da Meta.

Este relatório vem atender o **Inciso II, do Art. 3º da Portaria MPS 519/2011**, que exige a elaboração de **Relatórios Mensais**, para acompanhamento do desempenho das aplicações financeiras.

Art. 3. II – Exigir da entidade credenciada, mediante contrato, no mínimo mensalmente, relatório detalhado contendo informações sobre a rentabilidade e risco das aplicações.

2.1-MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2022 - PREVIQUAM

Nº	MESES	SALDO INICIAL	APORTES (Aplicação)	RESGATES	VARIÇÃO PU - TÍTULOS PÚBLICOS	RENTABILIDADE			SALDO FINAL
						Positiva (a)	Negativa (b)	Consolidado c = (a) - (b)	
1	JANEIRO	42.067.535,64	26.562,76	(438.056,40)	-	208.814,46	(172.454,24)	36.360,22	41.692.402,22
2	FEVEREIRO	41.692.402,22	960.594,66	(445.107,58)	-	349.110,88	(60.430,98)	288.679,90	42.496.569,20
3	MARÇO	42.496.569,20	591.667,30	(550.394,93)	-	997.207,84	(85.734,35)	911.473,49	43.449.315,05
4	ABRIL	43.449.315,05	504.776,84	(387.264,56)	-	463.135,56	(135.096,31)	328.039,25	43.894.866,58
5	MAIO	43.894.866,58	519.689,63	(398.869,19)	-	431.850,61	(21.243,83)	410.606,77	44.426.293,79
6	JUNHO	44.426.293,79	125.638,70	(489.928,52)	-	164.594,79	(212.581,64)	(47.986,84)	44.014.017,13
7	JULHO	44.014.017,13	1.020.382,81	(1.395.535,42)	-	281.032,53	(143.924,53)	137.108,00	43.775.972,52
8	AGOSTO	43.775.972,52	1.320.887,14	(496.672,95)	-	444.096,55	(34.496,71)	409.599,84	45.009.786,55
9	SETEMBRO	45.009.786,55	471.066,46	(518.357,75)	-	417.033,53	(120.522,06)	296.511,47	45.259.006,73
10	OUTUBRO	45.259.006,73	-	-	-	-	-	-	45.259.006,73
11	NOVEMBRO	45.259.006,73	-	-	-	-	-	-	45.259.006,73
12	DEZEMBRO	45.259.006,73	-	-	-	-	-	-	45.259.006,73
13	ANO	42.067.535,64	5.541.266,30	(5.120.187,30)	-	3.756.876,75	(986.484,66)	2.770.392,09	45.259.006,73

*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

2.2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2022 - LIMITE DE SEGMENTO - PREVIQUAM

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.963/2021	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.963/2021	Limites do PAI		Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENGUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
RENDA FIXA							
1	Títulos Públicos Federal	Art. 7, I, a (100%)	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
2	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, b (100%)	0,0%	100,0%	65,1%	29.459.776,53	-
3	F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, c (100%)	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7, II (5%)	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
5	F.I. de Renda Fixa	Art. 7, III, a (60%)	0,0%	60,0%	30,5%	13.790.666,22	-
6	F.I. de Índice de Renda Fixa	Art. 7, III, b (0%)	0,0%	60,0%	0,0%	-	-
7	Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F.	Art. 7, IV (20%)	0,0%	20,0%	0,0%	-	-
8	FIDC - Classe Sênior	Art. 7, V, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
9	F.I. Renda Fixa de "Crédito Privado"	Art. 7, V, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
10	F.I. em 85% de Debêntures	Art. 7, V, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
11	TOTAL - RENDA FIXA				95,6%	43.250.442,75	
RENDA VARIÁVEL							
12	F.I. Ações	Art. 8, I (30%)	0,0%	30,0%	2,8%	1.268.613,20	-
13	F.I. Ações em Índices de Renda Variável	Art. 8, II (30%)	0,0%	30,0%	0,0%	-	-
14	TOTAL - RENDA VARIÁVEL	Art. 8, §1º (30%)			2,8%	1.268.613,20	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS							
15	F.I. e F.I.C FI Multimercados	Art. 10, I (10%)	0,0%	10,0%	0,8%	371.929,56	-
16	F.I. em Participações	Art. 10, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
17	F.I. Ações - Mercado de Acesso	Art. 10, III (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
18	TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	Art. 10 (15%)			0,8%	371.929,56	
FUNDOS IMOBILIÁRIOS							
19	F.I. Imobiliário	Art. 11 (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
20	TOTAL - FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Art. 11 (5%)			0,0%	-	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR							
21	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9º, I (10%)	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
22	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	Art. 9º, II (10%)	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
23	Fundos de Ações - BDR Nível I	Art. 9º, III (10%)	0,0%	10,0%	0,8%	368.021,22	-
24	TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Art. 9 (10%)			0,8%	368.021,22	
EMPRESTIMO CONSIGNADO							
25	Empréstimo Consignado	Art. 12 (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
26	TOTAL - EMPRESTIMO CONSIGNADO	Art. 12 (5%)			0,0%	-	
27	DESENGUADRADO	-	-	100,0%	0,0%	-	-
28	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-	-	-	0,0%	1.102,76	-
29	PATRIMÔNIO TOTAL				100,0%	45.260.109,49	

2.3-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2022 - LIMITE DE BENCHMARK - PREVIQUAM

Nº	ÍNDICES DE BENCHMARK	Limites do PAI		Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
		Mínimo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
RENDA FIXA						
1	DI	0,0%	80,0%	8,9%	4.034.263,36	-
2	IRF - M 1	0,0%	50,0%	15,5%	7.026.172,55	-
3	IRF - M	0,0%	40,0%	0,0%	-	-
4	IRF - M 1+	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
5	IMA - B 5	0,0%	60,0%	23,8%	10.753.361,67	-
6	IMA - B	0,0%	43,2%	31,8%	14.372.101,59	-
7	IMA - B 5+	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
8	IMA - GERAL e IMA - GERAL ex-C	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
9	IDKA 2, IDKA 3	0,0%	50,0%	15,6%	7.064.543,59	-
10	IPCA	0,0%	30,0%	0,0%	-	-
11	IPCA + TAXA DE JUROS	0,0%	30,0%	0,0%	-	-
RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS NO EXTERIOR						
13	ÍNDICES DE RENDA VARIÁVEL	0,0%	30,0%	2,8%	1.268.613,20	-
14	ÍNDICES DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,0%	10,0%	1,6%	739.950,78	-
15	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	0,0%	0,0%	0,0%	1.102,76	-

Os demais índices (Benchmark) não listados acima, e que por ventura o RPPS venha aplicar, não possuem limitação de aplicação conforme PAI em vigor.

3.1-ENQUADRAMENTO SOBRE SEGMENTOS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS

RENDA FIXA								
Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMIN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
1	11.060.913/0001-10	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	3.776.400,05	8,34%	SIM			
2	10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	1.094.149,83	2,42%	SIM			
3	05.164.356/0001-84	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.632.921,95	3,61%	SIM	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações	65,1%	SIM
4	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	4.090.426,50	9,04%	SIM	Art. 7, I, b (100%)		
5	03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	6.976.961,62	15,42%	SIM			
6	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	7.064.543,59	15,61%	SIM			
7	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	4.824.372,99	10,66%	SIM			
8	11.087.118/0001-15	SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP	4.389.233,03	9,70%	SIM			
9	19.196.599/0001-09	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1	1.107.649,73	2,45%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	30,5%	SIM
10	07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	5.892.442,05	13,02%	SIM			
11	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	2.401.341,41	5,31%	SIM			
(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA			43.250.442,75	95,56%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: SETEMBRO

RENDA VARIÁVEL

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do FUNDO sobre o RPPS	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
12	15.154.220/0001-47	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	534.692,34	1,18%	SIM			
13	08.973.948/0001-35	BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO FIC FI	347.766,54	0,77%	SIM	F.I. Ações, Art. 8, I (30%)	2,8%	SIM
14	30.518.554/0001-46	BB AÇÕES PETROBRAS I FI	386.154,32	0,85%	SIM			
15	30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	371.929,56	0,82%	SIM	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	0,8%	SIM
(2) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL			1.640.542,76	3,62%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: SETEMBRO

INVESTIMENTO NO EXTERIOR								
Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
16	17.502.937/0001-68	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	368.021,22	0,81%	SIM	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	0,8%	0,0%
(3) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			368.021,22	0,81%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: SETEMBRO

3.1.1-DISPONIBILIDADE FINANCEIRA E TOTAL POR SEGMENTO

Nº DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		
17	Caixa Econômica Federal	0,002%
	1.102,76	
(4) TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		0,002%
	1.102,76	

TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS			
(1)	TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	43.250.442,75	95,56%
(2)	TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	1.640.542,76	3,62%
(3)	TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	368.021,22	0,81%
(4)	TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)	1.102,76	0,00%
PATRIMÔNIO LÍQUIDO TOTAL (1 + 2 + 3 + 4)		45.260.109,49	100,00%

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: SETEMBRO

3.2-ENQUADRAMENTO SOBRE O PATRIMÔNIO LÍQUIDO DOS FUNDOS

Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	Patrimônio Líquido do Fundo de Investimento	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do FUNDO	Enquadrado?
Art. 19 - As aplicações deverão representar até 15% do patrimônio líquido do fundo.	1	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	2.401.341,41	3.459.949.589,95	0,069%	SIM
	2	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	4.824.372,99	6.071.749.354,31	0,079%	SIM
	3	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	7.064.543,59	8.749.817.040,89	0,081%	SIM
	4	03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	6.976.961,62	6.260.416.458,58	0,111%	SIM
	5	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	4.090.426,50	5.858.339.074,80	0,070%	SIM
	6	07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	5.892.442,05	730.227.548,87	0,807%	SIM
	7	30.518.554/0001-46	BB AÇÕES PETROBRAS I FI	386.154,32	526.216.538,42	0,073%	SIM
	8	08.973.948/0001-35	BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO FIC FI	347.766,54	199.922.021,13	0,174%	SIM
	9	05.164.356/0001-84	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.632.921,95	17.792.135.878,61	0,009%	SIM
	10	10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	1.094.149,83	5.416.816.231,94	0,020%	SIM
	11	11.060.913/0001-10	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	3.776.400,05	8.885.835.879,64	0,042%	SIM
	12	30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	371.929,56	1.721.873.439,88	0,022%	SIM
	13	15.154.220/0001-47	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	534.692,34	643.251.684,47	0,083%	SIM
	14	17.502.937/0001-68	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	368.021,22	2.057.509.929,37	0,018%	SIM
	15	19.196.599/0001-09	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1	1.107.649,73	374.429.452,36	0,296%	SIM
	16	11.087.118/0001-15	SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP	4.389.233,03	433.955.467,21	1,011%	SIM
TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO				45.259.006,73			
TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)				1.102,76			
PATRIMÔNIO LÍQUIDO				45.260.109,49			

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: SETEMBRO

3.3-ENQUADRAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS QUE RECEBEM COTAS DE FI

FIC - Fundo de Investimento em Cotas	Distribuição das cotas do FIC	Valor Aplicado no Fundo (R\$)	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Patrimônio Líquido do FI	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do FUNDO	ENQUADRADO?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO
FI - Fundo de Investimento								
BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	100,00%	6.976.961,62	15,42%	6.260.416.458,58	0,111%	SIM		
<i>BB TOP RF IMA-B 5 LP FI</i>	<i>100,00%</i>	<i>6.977.108,17</i>	<i>15,42%</i>	<i>7.798.910.564,54</i>	<i>0,089463%</i>	<i>SIM</i>	<i>F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações</i>	<i>SIM</i>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	100,00%	4.824.372,99	10,66%	6.071.749.354,31	0,079%	SIM		
<i>BB IRF-M 1 FI DE RF</i>	<i>100,00%</i>	<i>4.824.475,30</i>	<i>10,66%</i>	<i>6.071.804.584,81</i>	<i>0,079457%</i>	<i>SIM</i>		
SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP	100,00%	4.389.233,03	9,70%	433.955.467,21	1,011%	SIM		
<i>FI RF REFERENCIADO IMA-B ALOCAÇÃO LP</i>	<i>100,00%</i>	<i>4.389.189,14</i>	<i>9,70%</i>	<i>551.143.632,30</i>	<i>0,796378%</i>	<i>SIM</i>		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	100,00%	2.401.341,41	5,31%	3.459.949.589,95	0,069%	SIM		
<i>BB TOP RF SIMPLES FI</i>	<i>100,01%</i>	<i>2.401.501,34</i>	<i>5,31%</i>	<i>91.360.309.222,82</i>	<i>0,002629%</i>	<i>SIM</i>		
							<i>F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)</i>	SIM

FIC - Fundo de Investimento em Cotas	Distribuição das cotas do FIC	Valor Aplicado no Fundo (R\$)	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Patrimônio Líquido do FI	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do FUNDO	ENQUADRADO?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO
FI - Fundo de Investimento								
FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	0,48%	534.692,34	1,18%	643.251.684,47	0,083%	SIM		
FI CAIXA MASTER CONSERVADOR RF REFERENCIADO DI LP	0,48%	2.577,22	0,01%	17.814.383.703,56	0,000014%	SIM	F.I. Ações, Art. 8, I (30%)	SIM
BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO FIC FI	100,00%	347.766,54	0,77%	199.922.021,13	0,174%	SIM		
BB TOP AÇÕES SETOR FINANCEIRO FI	100,02%	347.827,52	0,77%	258.346.279,66	0,134636%	SIM		
FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,98%	368.021,22	0,81%	2.057.509.929,37	0,018%	SIM	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	SIM
FI CAIXA MASTER CONSERVADOR RF REFERENCIADO DI LP	0,98%	3.613,97	0,01%	17.814.383.703,56	0,000020%	SIM		

3.4-MOVIMENTAÇÃO DAS COTAS APLICADAS NOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

Nº Agência	Conta	Fundo de Investimento	CNPJ	Valor da Cota		Quantidade de Cotas				
				Inicial *	Final **	Inicial *	Final **	Aplicação	Resgate	Final **
1	3823	006.000000011-8	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	R\$ 3,589840	R\$ 3,605174	707589,645226	0,0000000	0,0000000	707589,645226
2	3823	006.000000005-3	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	R\$ 2,877358	R\$ 2,908660	376169,743276	0,0000000	0,0000000	376169,743276
3	3823	006.000000011-8	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	05.164.356/0001-84	R\$ 4,557376	R\$ 4,607186	354429,326818	0,0000000	0,0000000	354429,326818
4	3823	006.000000005-3	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	R\$ 3,589840	R\$ 3,605174	339904,948264	0,0000000	0,0000000	339904,948264
5	2505-4	10337-3	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	R\$ 2,336380	R\$ 2,359609	66549,752137	2620,9572460	4491,4475920	64679,261791
6	2505-4	6868-3	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	03.543.447/0001-03	R\$ 22,920661	R\$ 23,012505	303181,319994	0,0000000	0,0000000	303181,319994
7	2505-4	6868-3	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	07.861.554/0001-22	R\$ 5,965347	R\$ 6,051932	973646,426865	0,0000000	0,0000000	973646,426865
8	2505-4	6868-3	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	07.442.078/0001-05	R\$ 6,726016	R\$ 6,823573	599455,217731	0,0000000	0,0000000	599455,217731
9	2505-4	6868-3	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	11.328.882/0001-35	R\$ 2,999088	R\$ 3,031652	169649,223048	25946,5170840	0,0000000	195595,740132
10	2505-4	6868-3	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDXA 2 TP FI	13.322.205/0001-35	R\$ 3,212408	R\$ 3,229419	2187558,784121	0,0000000	0,0000000	2187558,784121
11	2505-4	9960-0	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	11.328.882/0001-35	R\$ 2,999088	R\$ 6,063305	113906,251551	0,0000000	0,0000000	109724,414618
12	2505-4	9960-0	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	R\$ 2,336380	R\$ 2,359609	129,820707	13,2838730	82,4078520	60,696728
13	2505-4	6866-7	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	11.328.882/0001-35	R\$ 2,999088	R\$ 3,031652	1286014,289353	0,0000000	0,0000000	1286014,289353
14	2505-4	6866-7	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	R\$ 4,672760	R\$ 4,719219	965319,404131	164572,6563650	176946,0686090	952945,991887
15	0805	26000-2	SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP	11.087.118/0001-15	R\$ 4,005972	R\$ 4,065910	1079520,485307	0,0000000	0,0000000	1079520,485307
16	0805	26000-2	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1	19.196.599/0001-09	R\$ 2,042394	R\$ 2,065290	536316,904887	0,0000000	0,0000000	536316,904887
17	2505-4	6868-3	BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO FIC FI	08.973.948/0001-35	R\$ 2,941377	R\$ 3,029622	114788,739277	0,0000000	0,0000000	114788,739277
18	2505-4	6868-3	BB AÇÕES PETROBRAS I FI	30.518.554/0001-46	R\$ 2,943411	R\$ 2,640478	172665,904971	0,0000000	26421,8065270	146244,098444
19	3823	006.000000011-8	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	15.154.220/0001-47	R\$ 1,508031	R\$ 1,478834	361563,511157	0,0000000	0,0000000	361563,511157
20	3823	006.000000011-8	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	30.036.235/0001-02	R\$ 1,553997	R\$ 1,419969	261927,888094	0,0000000	0,0000000	261927,888094
21	3823	006.000000011-8	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	R\$ 5,124561	R\$ 4,728954	77822,957998	0,0000000	0,0000000	77822,957998

* Informação baseada no último dia útil do mês anterior (31/08/2022).

** Informação baseada no último dia útil do mês (30/09/2022).

3.5-ENQUADRAMENTO SOBRE OS RECURSOS DE TERCEIROS DOS GESTORES

Nº	Gestor de Recursos	Recursos do RPPS aplicado no Gestor	Total de Recursos de Terceiros geridos pelo GESTOR	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do GESTOR	Enquadrado?
1	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	31.984.009,03	1.438.582.167.376,27	0,0022%	SIM
2	CAIXA ASSET DTVM	7.778.114,95	501.569.248.239,81	0,0016%	SIM
3	Confederação Interestadual das Cooperativas Ligadas ao Sicredi	5.496.882,76	70.481.198.906,93	0,0078%	SIM
TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO		45.259.006,73			
TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		1.102,76			
PATRIMÔNIO LÍQUIDO		45.260.109,49			

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: SETEMBRO

4-SEPARAÇÃO DOS RECURSOS - PROVISÃO DE CAIXA

PROVISÃO DE CAIXA DEFINIDA NO PAI/2022?

SEPARAÇÃO DOS RECURSOS	VALOR (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido *
PROVISÃO DE CAIXA CONTIDA NO PAI/2022?	4.579.300,00	11,3%

*POSIÇÃO DA CARTEIRA (R\$) EM 31/10/2021.

ATUALIZAÇÃO DOS VALORES EM PROVISÃO DE CAIXA

SEPARAÇÃO DOS RECURSOS	VALOR APLICADO (em R\$)	% dos Recursos em Fundos para Provisão de Caixa
Valor Atualizado em Fundos para Provisão de Caixa (Curto Prazo)	4.992.898,22	11,0%

Referência: SETEMBRO

NECESSIDADE ATUAL DE PROVISÃO DE CAIXA

NECESSIDADE ATUAL DA PROVISÃO DE CAIXA	VALOR (em R\$)	% dos Recursos em Fundos para Provisão de Caixa
Valor Atual da Provisão da Caixa	1.409.015,38	3,1%

Referência: SETEMBRO

A Política de Investimento determina que parte dos recursos acumulados sejam separados por **PROVISÃO DE CAIXA**. Essa separação tem o intuito de amenizar os efeitos da volatilidade do mercado, sobre os recursos utilizados no curto prazo, em casos de interrupção no Fluxo de caixa (repasse e outras receitas).

4.1-PLANEJAMENTO FINANCEIRO

Provisão de Caixa	Banco	Agência	Conta	Valor (R\$)	Fundo de Investimento
Reservas de Obrigações Previdenciárias no exercício e Reservas para pagto da Despesa Adm no exercício	CAIXA	3823	006.000000005-3	1.094.149,83	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF
	BB	2505-4	6866-7	3.898.748,39	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI
Total				4.992.898,22	
Total				4.992.898,22	

*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

Referência: SETEMBRO

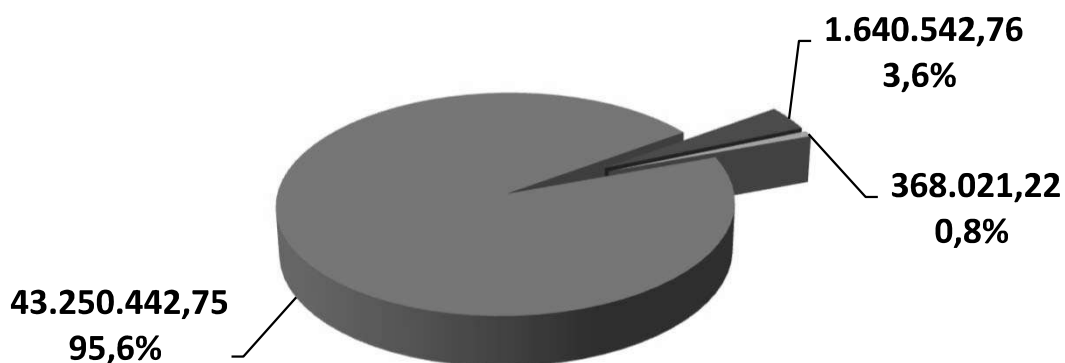
5. - DISTRIBUIÇÃO ESTATÍSTICA DA CARTEIRA

5.1-DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO (RENDA FIXA e RENDA VARIÁVEL)

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
RENDA FIXA	43.250.442,75	95,6%
RENDA VARIÁVEL	1.640.542,76	3,6%
INVESTIMENTO NO EXTERIOR	368.021,22	0,8%
TOTAL	45.259.006,73	100,0%

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / SEGMENTO

■ RENDA FIXA ■ RENDA VARIÁVEL ■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR

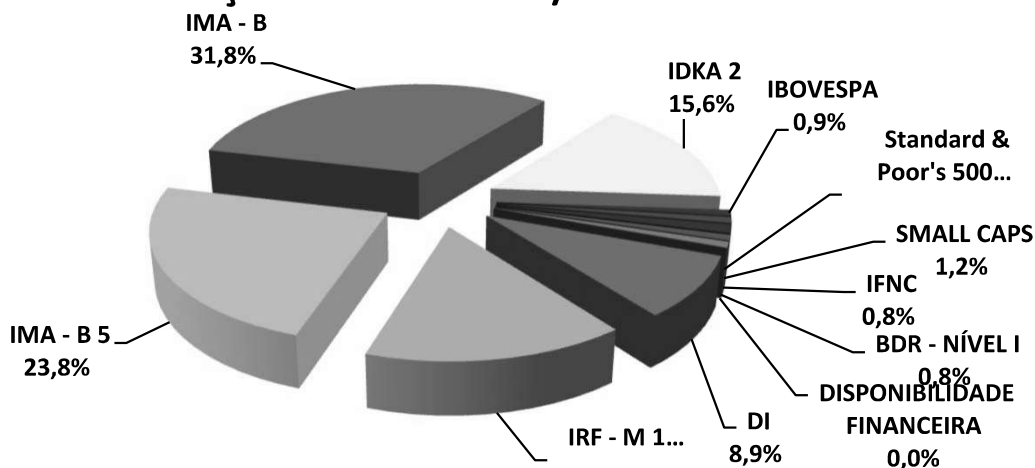


**OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).*

5.2-DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICE (Benchmark)

ÍNDICE (BENCHMARK)	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
DI	4.034.263,36	8,9%
IRF - M 1	7.026.172,55	15,5%
IRF - M	-	0,0%
IRF - M 1+	-	0,0%
IMA - B 5	10.753.361,67	23,8%
IMA - B	14.372.101,59	31,8%
IMA - B 5+	-	0,0%
IMA - GERAL	-	0,0%
IMA - GERAL EX - C	-	0,0%
IDKA 2	7.064.543,59	15,6%
IDKA 3	-	0,0%
IPCA	-	0,0%
IPCA + 6,00% a.a.	-	0,0%
IPCA + 7,50% a.a.	-	0,0%
Multimercado	-	0,0%
IBOVESPA	386.154,32	0,9%
IBR - X	-	0,0%
Imobiliário - IMOB	-	0,0%
Dividendos	-	0,0%
Imobiliário - IFIX	-	0,0%
ISE	-	0,0%
ICON	-	0,0%
Standard & Poor's 500	371.929,56	0,8%
IGC	-	0,0%
Petrobrás	-	0,0%
SMALL CAPS	534.692,34	1,2%
IFNC	347.766,54	0,8%
Standard & Poor's 500 (BRASIL)	-	0,0%
BDR - NÍVEL I	368.021,22	0,8%
MSCI ACWI	-	0,0%
MSCI WORLD	-	0,0%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.102,76	0,0%
TOTAL	45.260.109,49	100,0%

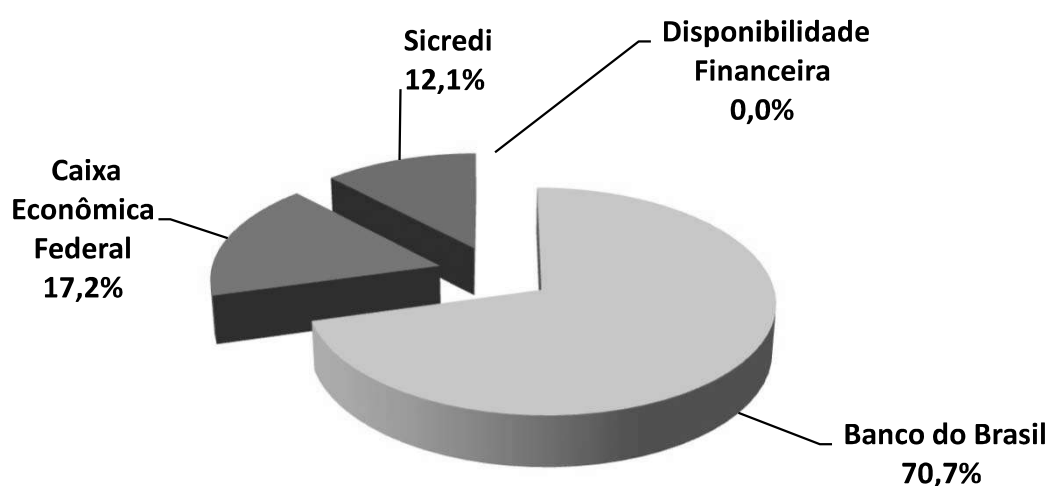
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / POR ÍNDICE



5.3-DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
Banco do Brasil	31.984.009,03	70,7%
Caixa Econômica Federal	7.778.114,95	17,2%
Sicredi	5.496.882,76	12,1%
Disponibilidade Financeira	1.102,76	0,0%
TOTAL	45.260.109,49	100%

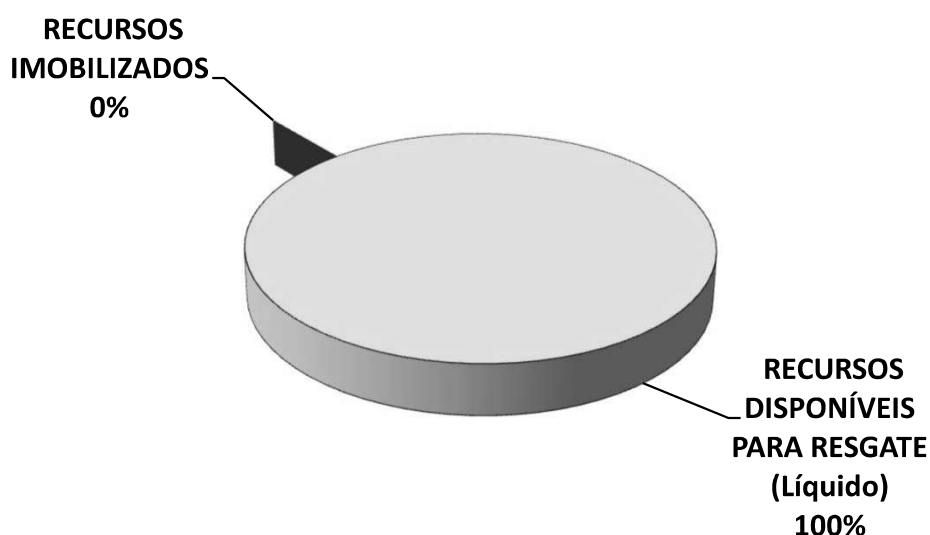
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



5.4-DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DISPONÍVEIS E IMOBILIZADO

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
RECURSOS DISPONÍVEIS PARA RESGATE (Líquido)	45.260.109,49	100,0%
RECURSOS IMOBILIZADOS	-	0,0%
TOTAL	45.260.109,49	100,0%

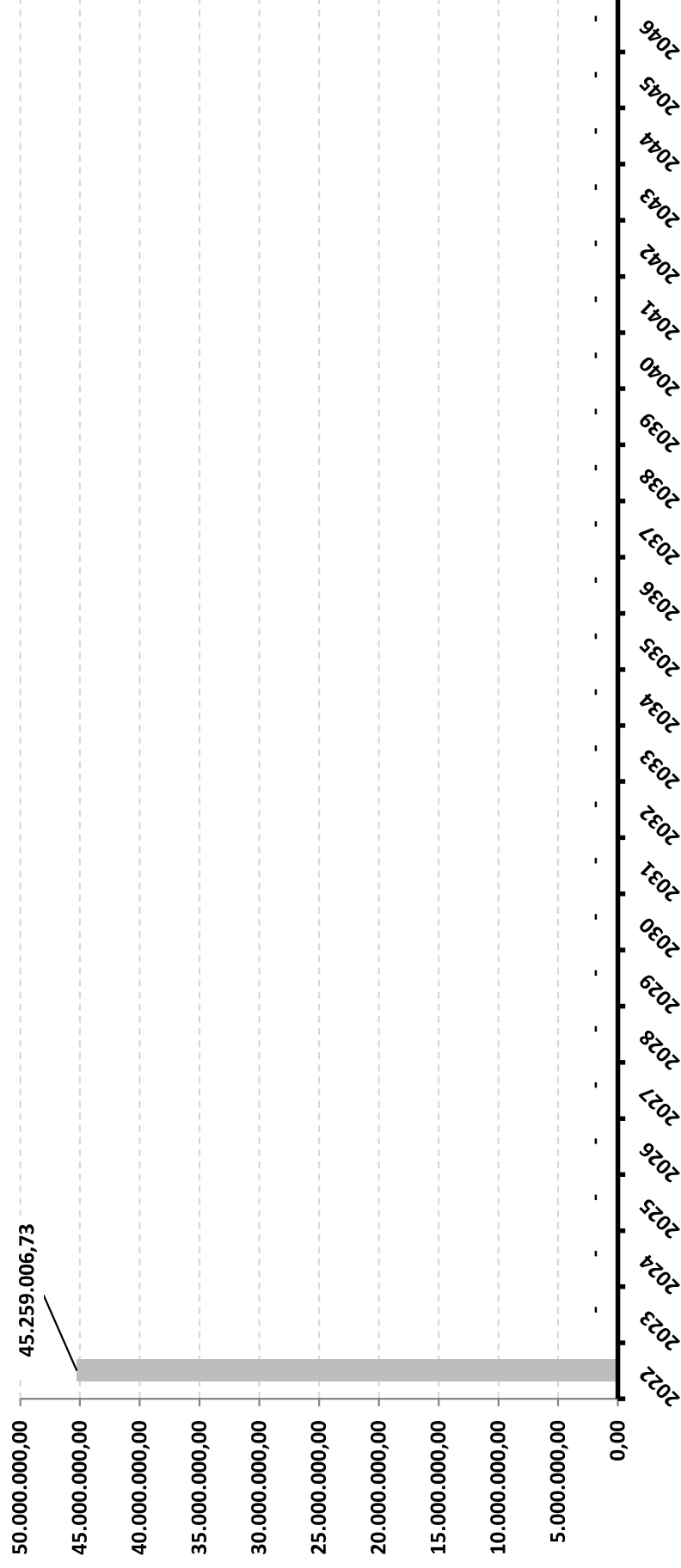
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA /POR LIQUIDEZ



5.4-DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DISPONÍVEIS E IMOBILIZADO

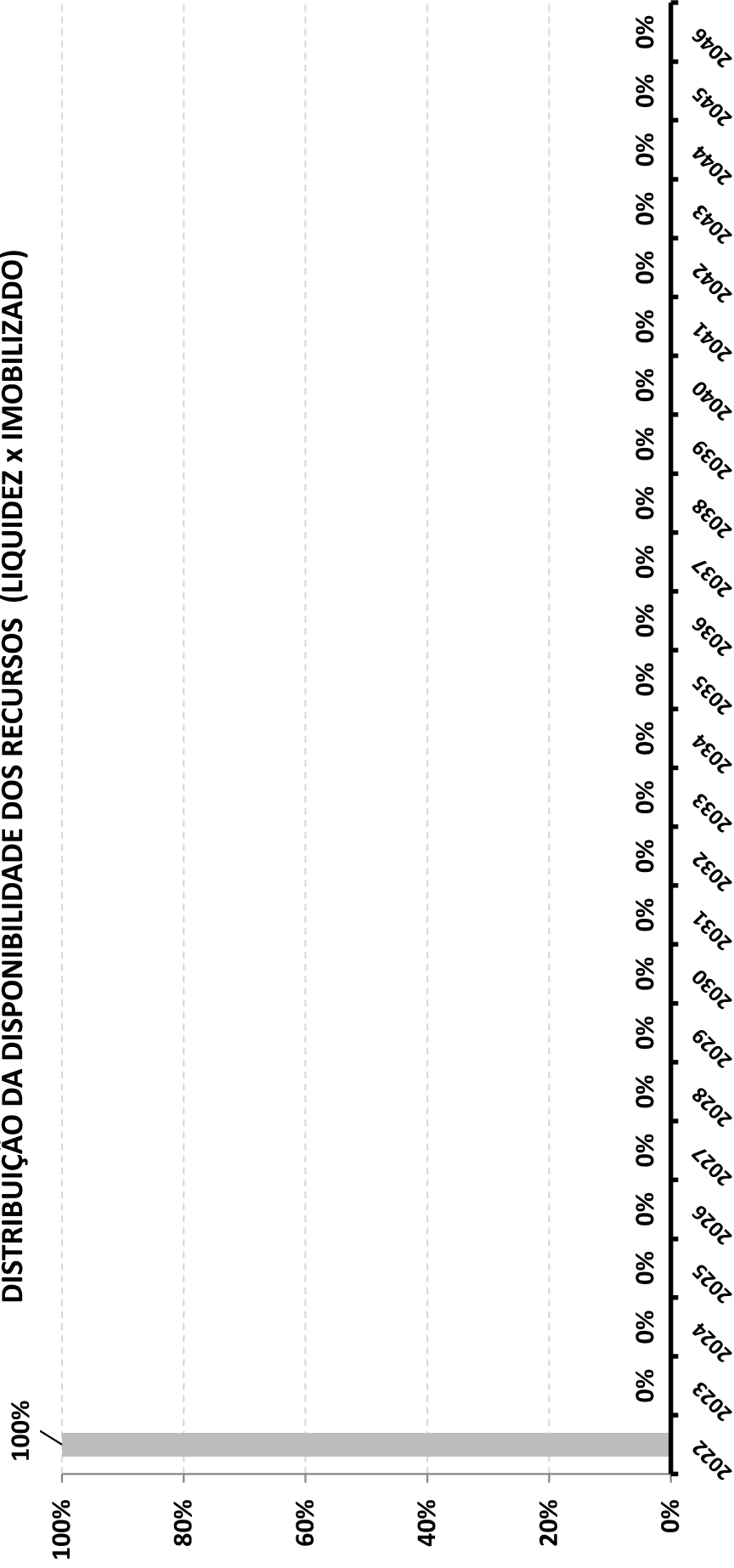
5.4.1-DISTRIBUIÇÃO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS NOS PRÓXIMOS 25 ANOS

DISTRIBUIÇÃO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS (LIQUIDEZ x IMOBILIZADO)



*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

DISTRIBUIÇÃO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS (LIQUIDEZ x IMOBILIZADO)



*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

6-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

1

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI
CNPJ	13.077.415/0001-05	11.328.882/0001-35	13.322.205/0001-35	03.543.447/0001-03
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Previdência Renda Fixa	Renda Fixa índices	Previdência Renda Fixa	Renda Fixa Índices
ÍNDICE	CDI	IRF – M 1	IDKA 2	IMA - B 5
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
DATA DE INÍCIO	28/04/2011	08/12/2009	28/04/2011	17/12/1999
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,00% a.a.	0,10% a.a.	0,20% a.a.	0,20%a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	1.000,00	10.000,00	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor	0,01
RESGATE MÍNIMO	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor	0,01
SALDO MÍNIMO	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor	0,01
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	2 - Baixo	2 - Baixo	1 - Muito baixo	4 - Alto
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	3.459.949.589,95	6.071.749.354,31	8.749.817.040,89	6.260.416.458,58
NÚMERO DE COTISTAS **	868	1087	1050	796
VALOR DA COTA **	2,359609473	3,031652467	3,229418857	23,01250491
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	11/10/2017	05/02/2020	05/02/2020	05/02/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

2

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	BB AÇÕES PETROBRAS I FI	BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO FIC FI
CNPJ	07.442.078/0001-05	07.861.554/0001-22	30.518.554/0001-46	08.973.948/0001-35
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Variável	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices	Fundos de Mono Ação	Ações Setoriais
ÍNDICE	IMA – B	IMA – B	PETR3	IFNC
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Público em geral	Público em geral
DATA DE INÍCIO	24/07/2005	09/03/2006	21/08/2018	02/10/2007
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,30% a.a.	2,00% a.a.	2,00% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	10.000,00	10.000,00	0,01	0,01
APLICAÇÕES ADICIONAIS	Qualquer valor	Qualquer valor	0,01	0,01
RESGATE MÍNIMO	Qualquer valor	Qualquer valor	0,01	0,01
SALDO MÍNIMO	Qualquer valor	Qualquer valor	0,01	0,01
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	5 - Muito Alto	5 - Muito Alto	5 - Muito Alto	5 - Muito Alto
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	5.858.339.074,80	730.227.548,87	526.216.538,42	199.922.021,13
NÚMERO DE COTISTAS **	575	222	31104	5624
VALOR DA COTA **	6,823573111	6,051932089	2,640478	3,029622427
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	11/10/2017	23/05/2016	04/06/2019	04/05/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

3

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP
CNPJ	05.164.356/0001-84	10.740.670/0001-06	11.060.913/0001-10	30.036.235/0001-02
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Investimentos Estruturados
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices	Multimercados Dinâmico
ÍNDICE	CDI	IRF – M 1	IMA - B 5	S&P500
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprio de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
DATA DE INÍCIO	10/02/2006	28/05/2010	09/07/2010	16/10/2018
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,80% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	1.000,00	1.000,00	10.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0	0,00	0,00	1.000,00
RESGATE MÍNIMO	0	0,00	0,00	1.000,00
SALDO MÍNIMO	0	0,00	0,00	5.000,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	1 - Muito baixo	2 - Baixo	2 - Baixo	4 - Alto
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	17.792.135.878,61	5.416.816.231,94	8.885.835.879,64	1.721.873.439,88
NÚMERO DE COTISTAS **	623	1173	975	10270
VALOR DA COTA **	4,60718633	2,90865985	3,60517378	1,41996931
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	30/09/2019	25/09/2018	17/10/2019	04/01/2021
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

4

INFORMAÇÕES	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1	SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP
CNPJ	15.154.220/0001-47	17.502.937/0001-68	19.196.599/0001-09	11.087.118/0001-15
SEGMENTO	Renda Variável	Investimento no Exterior	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	AÇÕES SMALL CAPS	Ações Livre	Renda Fixa Índices	Renda Fixa Índices
ÍNDICE	SMLL	BDR	IRF – M 1	IMA – B
PÚBLICO ALVO	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de Previdência Social	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de Previdência Social	Regimes Próprio de Previdência Social	Regimes Próprio de Previdência Social
DATA DE INÍCIO	01/11/2012	24/06/2013	07/02/2014	18/12/2009
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,50% a.a.	0,70% a.a.	0,20% a.a.	0,20%a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	1.000,00	50.000,00	50.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	100,00	100,00	5.000,00	5.000,00
RESGATE MÍNIMO	100,00	100,00	5.000,00	5.000,00
SALDO MÍNIMO	500,00	500,00	50.000,00	50.000,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	5 - Muito Alto	4 - Alto	2 - Baixo	3 - Médio
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	643.251.684,47	2.057.509.929,37	374.429.452,36	433.955.467,21
NÚMERO DE COTISTAS **	7558	518	269	279
VALOR DA COTA **	1,47883381	4,72895435	2,0652896	4,0659099
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	17/12/2020	03/11/2020	14/08/2020	22/12/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

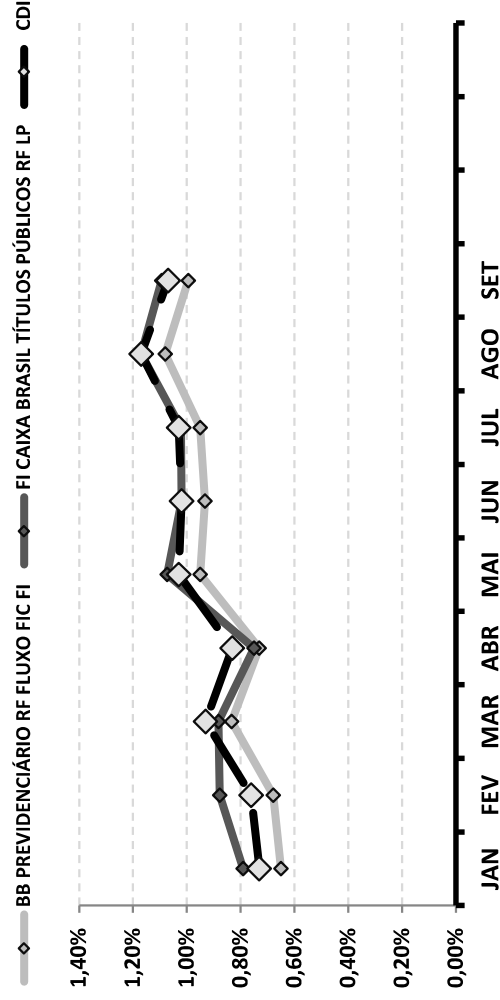
** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

7-RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

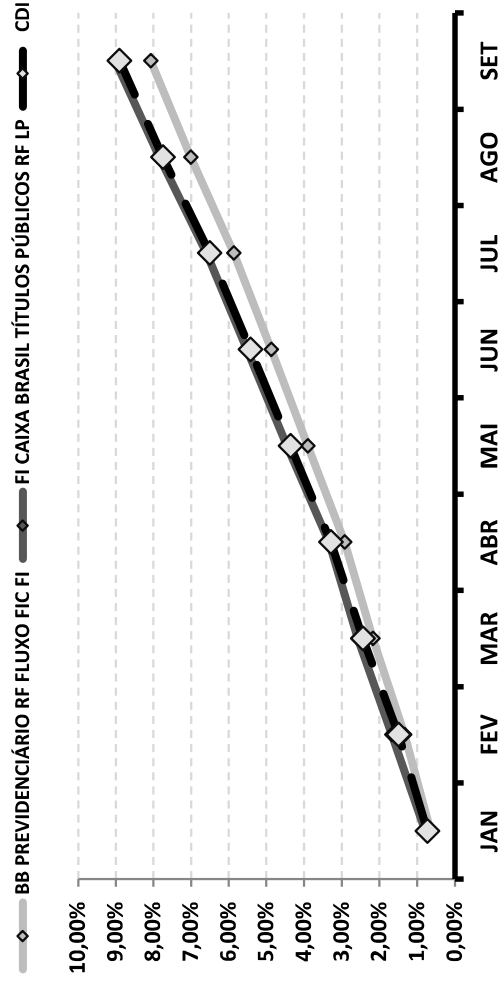
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2022 - Fundos atrelados ao CDI

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	ACUMULADO
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	0,65%	0,68%	0,83%	0,73%	0,95%	0,93%	0,95%	1,08%	0,99%	8,07%
05.164.356/0001-84	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,79%	0,88%	0,88%	0,75%	1,07%	1,02%	1,02%	1,17%	1,09%	9,02%
	CDI	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%	1,17%	1,07%	8,90%

Rentabilidade Mensal



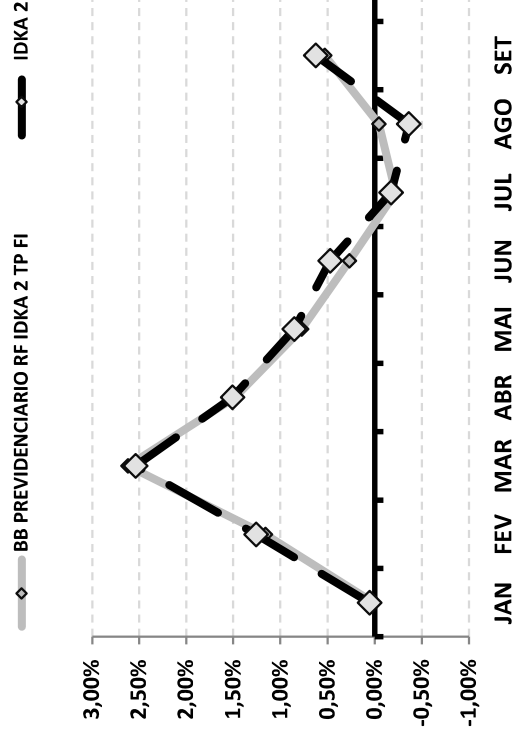
Rentabilidade Acumulada



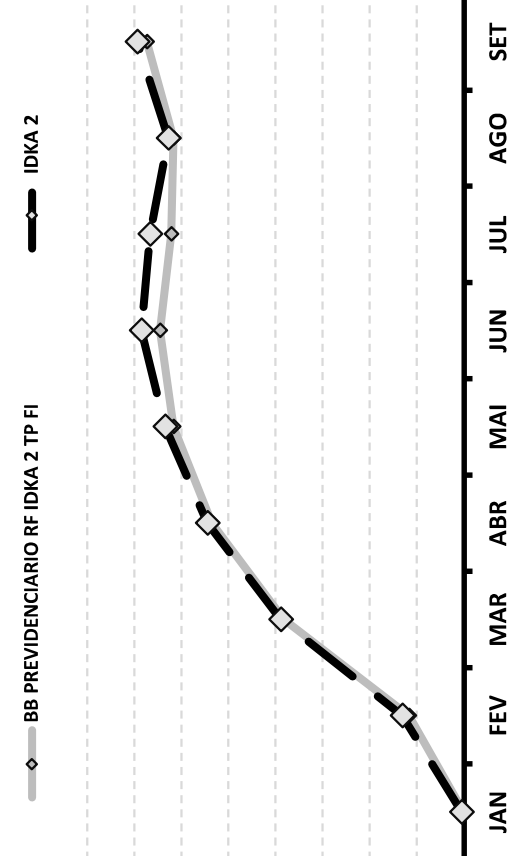
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2022 - Fundos atrelados ao IDKA 2

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	ACUMULADO
13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	0,01%	1,16%	2,62%	1,48%	0,77%	0,27%	-0,22%	-0,04%	0,53%	6,73%
	IDKA 2	0,05%	1,26%	2,54%	1,51%	0,85%	0,47%	-0,17%	-0,36%	0,62%	6,94%

Rentabilidade Mensal



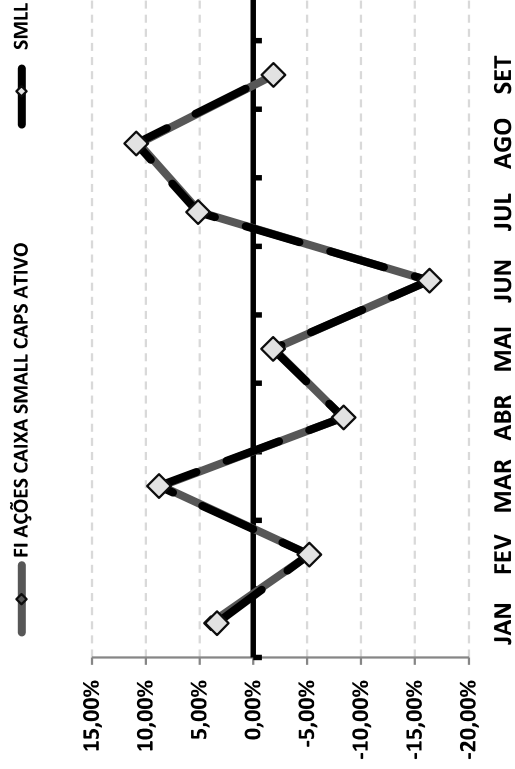
Rentabilidade Acumulada



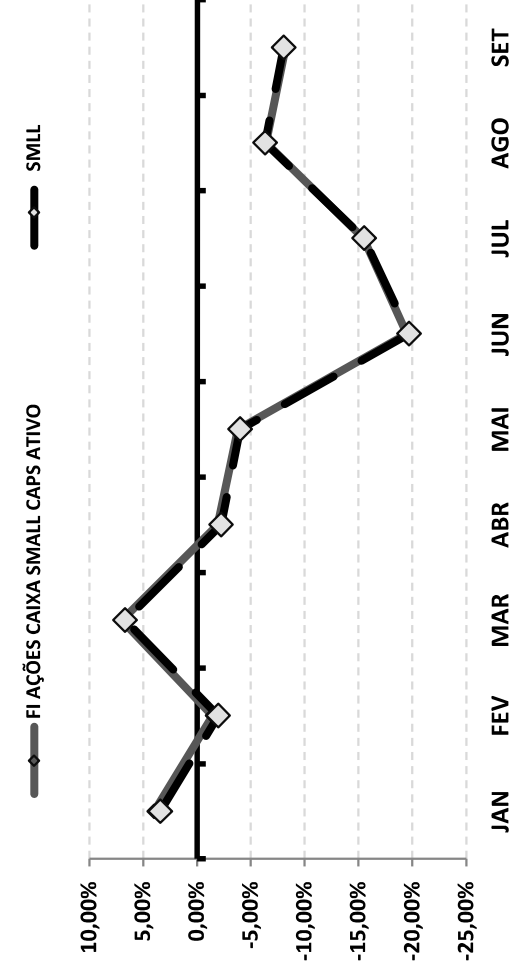
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2022 - Fundos atrelados ao SMLL

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	ACUMULADO
15.154.220/0001-47	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3,98%	-5,20%	8,57%	-8,34%	-1,92%	-16,29%	4,98%	10,67%	-1,94%	-8,24%
	SMLL	3,42%	-5,19%	8,81%	-8,36%	-1,82%	-16,33%	5,16%	10,90%	-1,84%	-8,06%

Rentabilidade Mensal



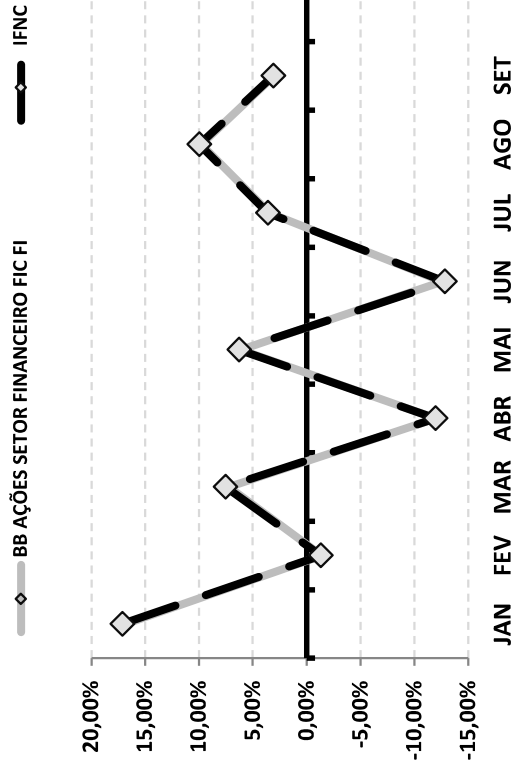
Rentabilidade Acumulada



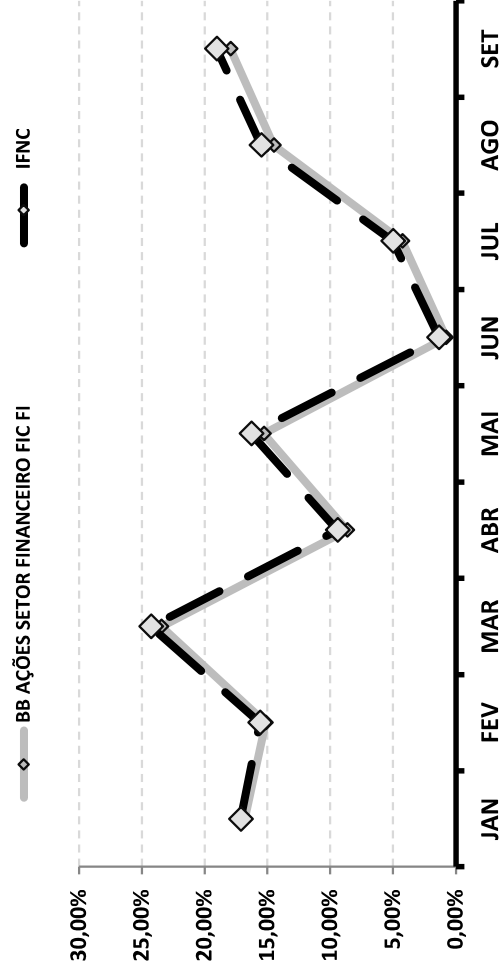
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2022 - Fundos atrelados ao IFNC

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	ACUMULADO
08.973.948/0001-35	BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO FIC FI	16,79%	-1,43%	7,24%	-11,99%	6,10%	-12,57%	3,45%	9,80%	3,00%	17,92%
	IFNC	17,12%	-1,31%	7,53%	-11,96%	6,25%	-12,83%	3,60%	9,99%	3,09%	19,05%

Rentabilidade Mensal

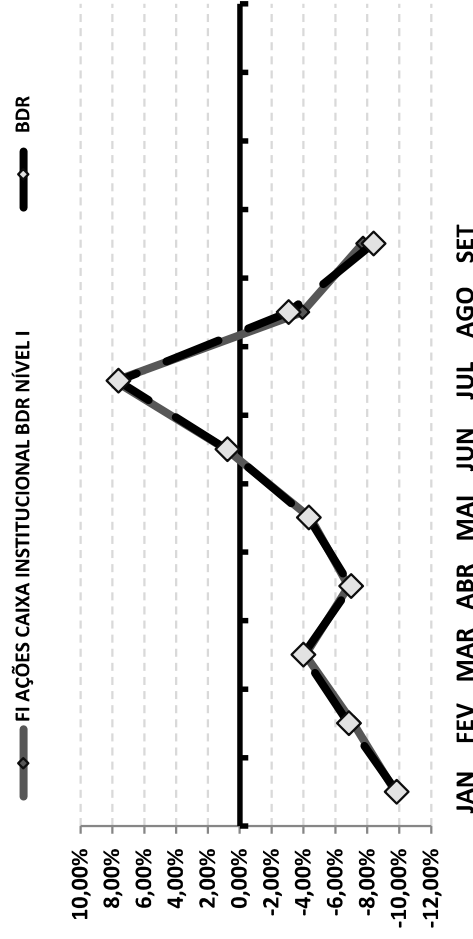
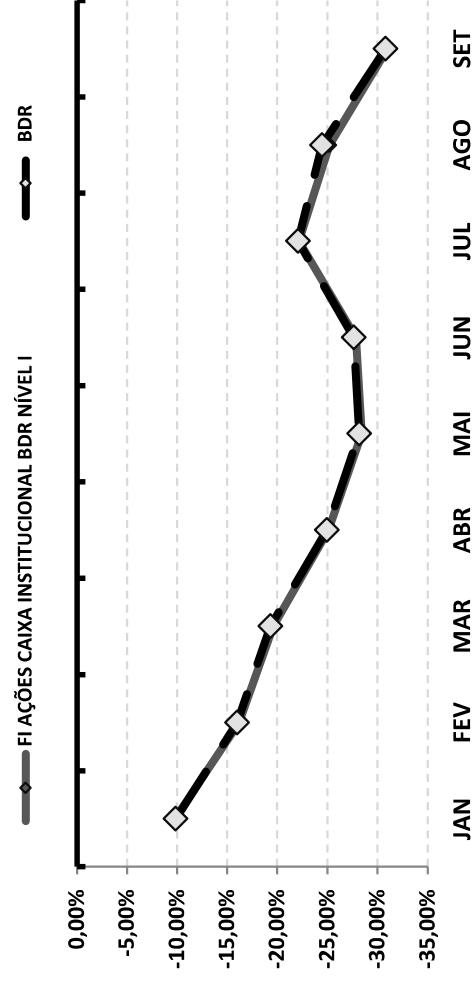


Rentabilidade Acumulada



RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2022 - Fundos atrelados ao BDR

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	ACUMULADO
17.502.937/0001-68	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-9,75%	-7,12%	-4,11%	-6,82%	-4,44%	0,83%	7,88%	-3,92%	-7,72%	-30,97%
	BDR	-9,83%	-6,82%	-3,98%	-6,96%	-4,32%	0,79%	7,65%	-3,05%	-8,38%	-30,78%

Rentabilidade Mensal

Rentabilidade Acumulada


8-RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

8.1-RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2022 - PREVIQUAM

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET
RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA	0,09%	0,69%	2,14%	0,75%	0,94%	-0,11%	0,31%	0,94%	0,66%
CDI	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%	1,17%	1,07%
IBOVESPA	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%	6,16%	0,47%
META ATUARIAL	0,94%	1,41%	2,02%	1,46%	0,87%	1,07%	-0,28%	0,04%	0,11%

A RENTABILIDADE DA CARTEIRA DO PREVIQUAM NO MÊS DE SETEMBRO FOI DE:

R\$ 296.511,47

A META ATUARIAL NO MÊS DE SETEMBRO FOI DE:

R\$ 47.822,53

8.2-RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2022 - PREVIQUAM

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET
RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA	0,09%	0,78%	2,94%	3,72%	4,69%	4,58%	4,90%	5,88%	6,58%
CDI	0,73%	1,50%	2,44%	3,29%	4,35%	5,42%	6,50%	7,75%	8,90%
IBOVESPA	6,98%	7,93%	14,47%	2,91%	6,22%	-5,99%	-1,58%	4,48%	4,97%
META ATUARIAL	0,94%	2,36%	4,42%	5,94%	6,86%	8,00%	7,69%	7,73%	7,84%

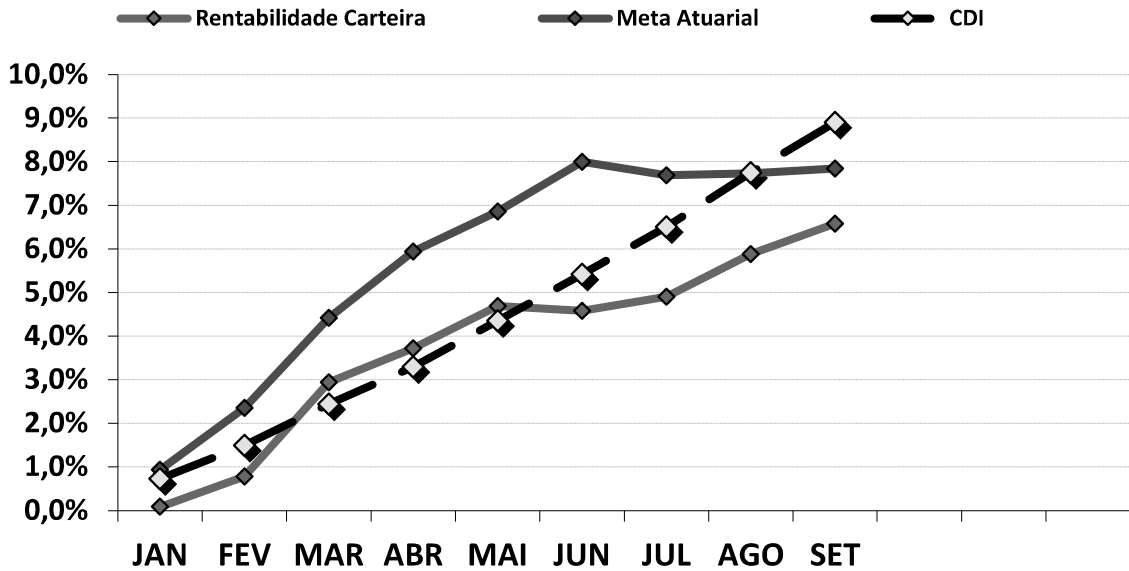
RENTABILIDADE ACUMULADA DO PREVIQUAM: R\$ 2.770.392,09

META ATUARIAL ACUMULADA: R\$ 3.262.457,77

DEFASAGEM PARA O CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL R\$ (492.065,67)

GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL

RENTABILIDADE DA CARTEIRA (Acumulada) 2022



RENTABILIDADE e ÍNDICES ACUMULADOS

	Rentabilidade Carteira	Meta Atuarial	CDI
JAN	0,09%	0,94%	0,73%
FEV	0,78%	2,36%	1,50%
MAR	2,94%	4,42%	2,44%
ABR	3,72%	5,94%	3,29%
MAI	4,69%	6,86%	4,35%
JUN	4,58%	8,00%	5,42%
JUL	4,90%	7,69%	6,50%
AGO	5,88%	7,73%	7,75%
SET	6,58%	7,84%	8,90%

8.3.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA

A Carteira de Investimentos do PREVIQUAM, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada de 6,58% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado de 8,90% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou até o momento, uma rentabilidade de 73,91% sobre o índice de referência do mercado.

8.4-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada do PREVIQUAM é de 6,58% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 7,84%, ou seja, até o momento, a carteira alcançou uma rentabilidade de 83,89% sobre a Meta Atuarial.

9-ANÁLISE DE MERCADO

9.1-TAXA SELIC

Na reunião nos dias 20 e 21 de setembro de 2022, o COPOM decidiu manter a Taxa SELIC em 13,75% a.a.. A decisão reflete a incerteza dentro do cenário econômico e o balanço de riscos apresentar variação ainda maior para as expectativas sobre a inflação, além de ser compatível com a estratégia de convergência da inflação sobre a meta nos anos de 2023 e 2024. O Comitê informa que será avaliado se a manutenção da taxa de juros por período prolongado será capaz de assegurar a convergência da inflação e dá enfoque em manter suas estratégias para consolidar o processo de desinflação e a ancoragem das expectativas sobre suas metas, podendo voltar ao ciclo de ajustes, caso o processo de desinflação não ocorra como esperado.

No mercado interno, o PIB apresentou um maior desempenho do que o esperado para o 2º trimestre. Os indicadores de atividade econômica sinalizaram crescimento, mesmo que de forma moderada, e o mercado de trabalho apresentou expansão mesmo que não tenha ocorrido queda real dos salários como nos últimos trimestres. Quanto ao consumidor, a inflação segue elevada apesar da queda recente em itens voláteis e medidas tributárias.

Em relação ao cenário internacional, a economia se mantém volátil e indicando perspectivas negativas quanto ao crescimento das principais economias. A alta da inflação segue causando impacto. Há uma normalização quanto as cadeias de suprimento e acomodação das principais commodities no atual período, o que pode levar a uma moderação global nas pressões inflacionárias ligadas a bens, no entanto, o baixo nível de ociosidade no mercado de trabalho faz sugestão de que pressões inflacionárias no setor de serviços possam demorar a se dissipar. O processo de normalização da política monetária nos países desenvolvidos caminha para taxas restritivas, o que impacta nas expectativas de crescimento econômico e aumentando o risco sobre brusca reprecificação nos mercados.

A principal mensagem que traz a nota do COPOM é que manterá a Taxa Selic em 13,75% a.a. após avaliar projeções, expectativas sobre a inflação, balanço de riscos e defasagem dos impactos da política monetária em uma situação contracionista. O Comitê enfatiza a contínua análise sobre a manutenção da taxa básica de juros para poder assegurar a convergência da inflação. Até o final do ano o COPOM projeta o IPCA em 6,00% e terminando o ano de 2023 em 5,00%.

A previsão do Boletim Focus, emitido pelo Banco Central no final de dezembro/2021, projetava a taxa de juros finalizando 2022 em 11.50% a.a..

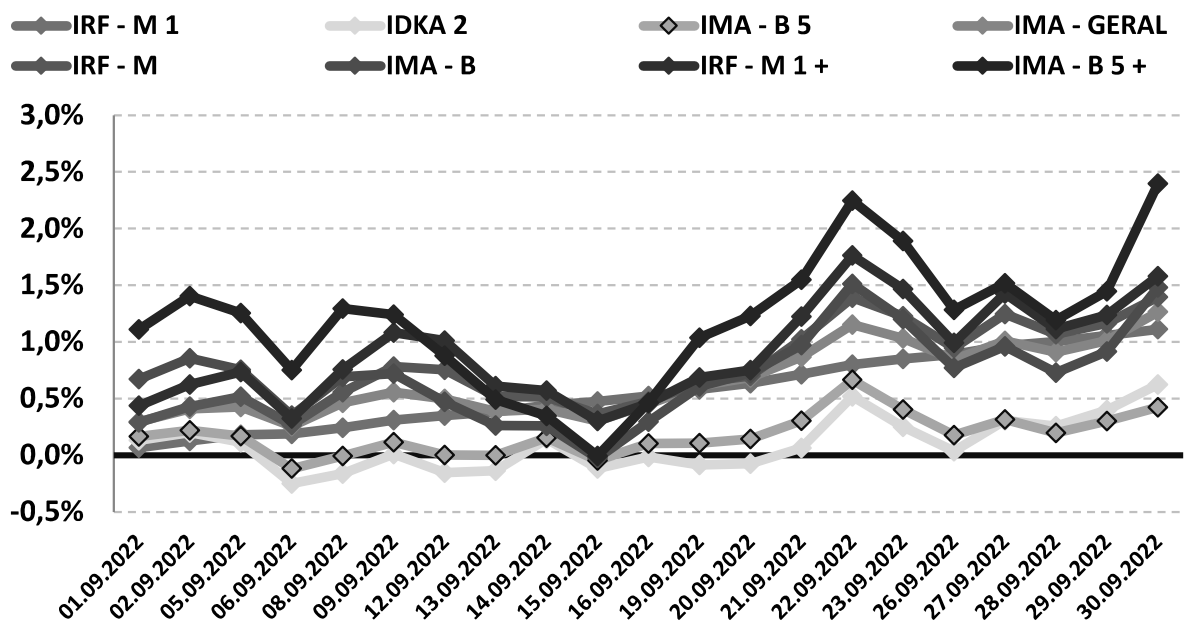
9.2-RENDA FIXA

Os Subíndices IMA iniciaram o mês de setembro com valorização, apresentando uma pequena desvalorização ainda na primeira semana do mês, se recuperando durante a semana e apresentando uma maior desvalorização na segunda semana de setembro. Os subíndices apresentaram forte recuperação na terceira semana e continuou “andando de lado” até o final do mês.

O destaque fica por conta dos Ativos de Longo Prazo (IRF – M; IMA – B; IMA – B 5+; IRF – M 1+) que fecharam o mês com retorno positivo. Somente o índice IMA - B 5+ chegou a rentabilizar - 0,01%, apresentando maior recuperação na 3ª semana do mês, finalizando o mês com retorno positivo de +2,39%.

PERFIL	Conservad.	Moderado			(do menos) Arrojado (para o mais)			
ÍNDICE	IRF – M 1	IDKA 2	IMA – B 5	IMA – GERAL	IRF – M	IMA – B	IRF – M 1+	IMA – B 5+
SETEMBRO	1,11%	0,62%	0,42%	1,26%	1,40%	1,48%	1,58%	2,39%
Acumulado/2022	8,59%	6,94%	7,07%	7,80%	6,96%	6,12%	6,25%	5,10%

Rentabilidade Acumulada (Mês)



9.3-RENDA VARIÁVEL - AÇÕES BRASILEIRAS

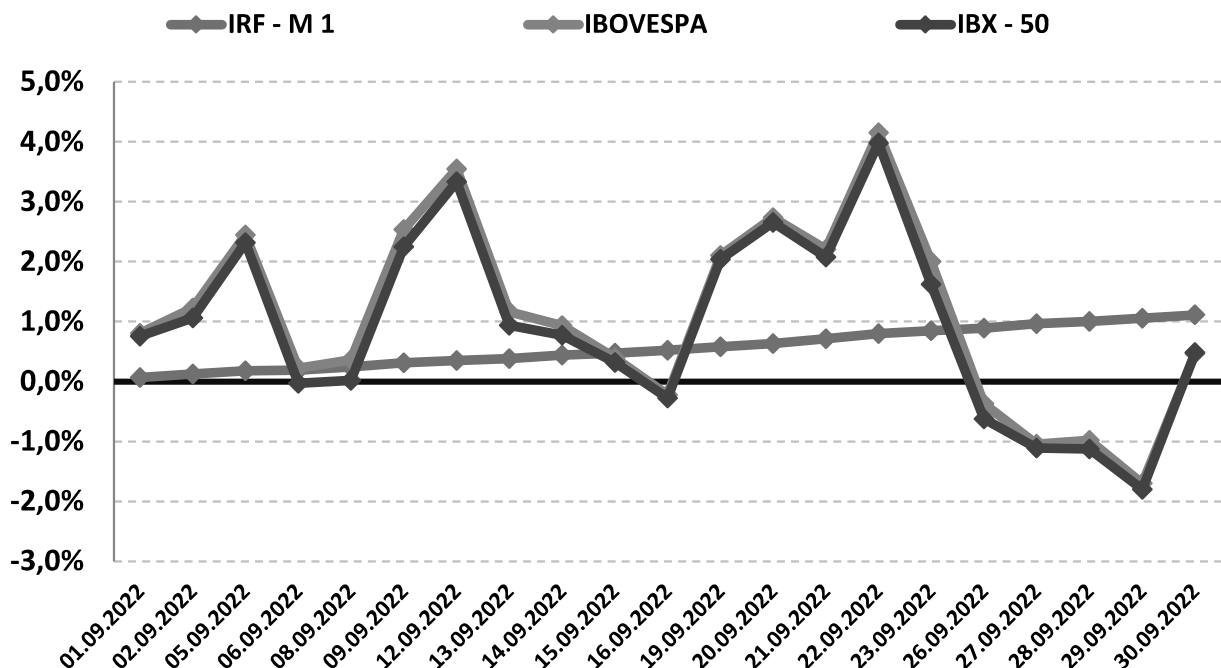
O segmento de Renda Variável iniciou o mês de setembro com pequena valorização, porém, apresentando oscilação e quedas no decorrer do mês, apresentando sua maior queda na última semana de setembro, mas conseguindo se recuperar e conseguindo finalizar o mês positivo. A Construção Civil teve inflação de +0,44% em setembro, apresentando a menor taxa observada desde julho/2020. A estagnação da Taxa Selic fez com que o índice obtivesse um rendimento positivo no final do mês.

O índice IBOVESPA, principal indicador de ações negociadas na Bolsa brasileira fechou o mês com variação positiva de +0,47% aos 110.036,79 pontos. O índice acumula uma variação positiva de +4,97% no ano. O índice IBRX-50 que representa as 50 maiores empresas negociadas na Bolsa, finalizou o mês com uma variação negativa de +0,49% aos 18.434,04 pontos. O índice acumula uma variação positiva de +5,33% no ano.

Analisando por setor, os principais responsáveis pela valorização do IBOVESPA foram as ações de empresas ligadas ao setor de Construção Civil e Minério (Vale) negociadas na B3, com valorização de +12,12% e +11,48%, respectivamente.

PERFIL	Conservad.	(do menos) Arrojado (para o mais)		
ÍNDICE	IRF - M 1	IBOVESPA	MAIORES DESEMPENHOS	
			CONSTRUÇÃO CIVIL	VALE
SETEMBRO	1,11%	0,47%	12,12%	11,48%
Acumulado/2022	8,59%	4,97%	10,25%	-0,38%

Rentabilidade Acumulada (Mês)



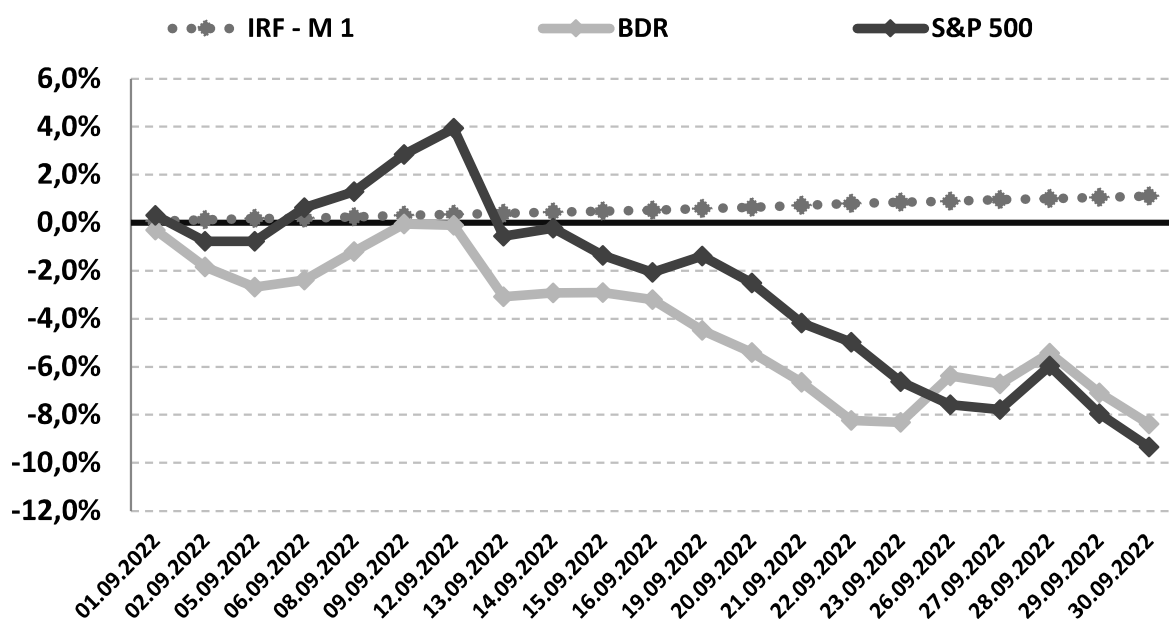
9.4-INVESTIMENTO NO EXTERIOR

O segmento de Investimento no Exterior apresentou forte oscilação no mês, iniciando com desvalorização, tendo pequena recuperação na 1ª semana, mas voltando a apresentar desvalorização e fechando o mês com rentabilidade negativa no acumulado.

O índice BDR, principal indicador de ações negociadas no Brasil de empresas do exterior fechou o mês com variação negativa de -8,38% com cotação de R\$ 10.646,89. O índice acumula uma variação negativa de -30,78% no ano. O índice S&P 500 que representa as 500 maiores empresas negociadas na Bolsa mundialmente, finalizou o mês com uma variação negativa de -9,34% com cotação de R\$ 3.585,62. O índice acumula uma variação negativa de -24,77% no ano.

PERFIL	Conservad.	(do menos) Arrojado (para o mais)	
ÍNDICE	IRF – M 1	BDR	S&P 500
SETEMBRO	1,11%	-8,38%	-9,34%
Acumulado/2022	8,59%	-30,78%	-24,77%

Rentabilidade Acumulada (Mês)



10-ANÁLISE MACROECONÔMICA

10.1-IPCA

O IPCA de setembro/2022 (-0,29%), continuou apresentando deflação pelo terceiro mês consecutivo, foi a menor variação para um mês de setembro desde o início da série histórica, maior se comparado ao mês anterior (agosto/2022 = -0,36%).

No ano, o IPCA registra alta de +4,09%. Nos últimos doze meses, o IPCA registra acumulação de +7,17%, abaixo dos últimos 12 meses anterior, que registrou acumulação de +8,73%.

Em setembro de 2021, o IPCA havia ficado em +1,16%.

10.1.1-MAIOR ALTA DE PREÇOS

O grupo que apresentou o maior impacto de alta no IPCA, foi o grupo de DESPESAS PESSOAIS cujo índice apresentou inflação de +0,10%, influenciado pela alta dos serviços bancários e ligados a turismo.

10.1.2-MENOR ALTA DE PREÇOS

O grupo que apresentou impacto negativo no IPCA foi o grupo TRANSPORTES, cujo índice apresentou deflação de -0,41% do IPCA, influenciado pela queda dos preços dos combustíveis.

10.1.3-ALIMENTAÇÃO E BEBIDAS ¹

No mês de setembro, o grupo ALIMENTAÇÃO E BEBIDAS apresentou deflação de -0,11%, um recuo em relação ao mês anterior (agosto/2022 = 0,05%). Os três produtos do grupo, com a maior alta de preços foram a Cebola (11,22% a.m. e 63,68% a.a.), as Frutas (3,09% a.m. e 18,22% a.a.) e a Batata-inglesa (2,76% a.m. e 20,03% a.a.). Os três produtos do grupo, com a maior queda de preços foram o Leite longa vida (-13,71% a.m. e 50,73% a.a.), o Óleo de soja (-6,27% a.m. e 5,13% a.a.) e o Feijão-Carioca (rajado) (-4,78% a.m. e 24,85% a.a.).

10.1.4-INFLAÇÃO POR REGIÃO

No mês, Vitória - ES foi a capital que apresentou a maior inflação (+0,17%), enquanto Fortaleza - CE apresentou a menor deflação de (-0,65%). No mesmo período, o IPCA registra deflação de -0,29%.

Em 2022, Rio de Janeiro - RJ é a capital que apresenta a maior inflação (5,50%), enquanto Porto Alegre - RS apresenta inflação de 1,83%. No mesmo período, o IPCA registra alta de 4,09%.

1 O grupo Alimentação e Bebidas, que representa 25,84% do IPCA, é o maior peso entre os 9 grupos pesquisados pelo IBGE. 1% de alta dos preços deste grupo, tem uma representatividade maior do que o grupo Comunicação, por exemplo, que representa 3,74% do IPCA. Por isso, este grupo merece uma análise especial sobre o aumento de preços.

10.2-CENÁRIO ECONÔMICO EXTERNO E INTERNO

INTERNACIONAL

O mês de setembro foi marcado pelo aperto monetário entre as economias mais desenvolvidas, os conflitos no Leste Europeu e a perspectiva de recessão gerada pelas incertezas e volatilidades dos ativos. As variações das moedas, bolsas e juros tem sido vistas em várias regiões do mundo entre os países emergentes gerando temores sobre a alta de juros. As tensões causadas pela guerra e desaceleração do crescimento, podem ser vistas também sobre os mercados. A desaceleração da atividade econômica gera uma menor demanda por commodities desacelerando o crescimento econômico. A inflação sobre os serviços segue causando impacto sobre o consumidor e sem acomodação a curto prazo. Com isso, é esperado a continuidade de medidas restritivas sobre a política monetária. Nos EUA, a última reunião do Federal Reserve (FED) reforça o interesse sobre a busca da estabilidade de preços, deixando claro de que os juros atingirão níveis elevados (do que já era esperado anteriormente) e que provavelmente não haverá recuos até 2024. Na Europa, segue o clima de riscos econômicos conforme a guerra entre Rússia e Ucrânia se desenrola. As tensões do conflito geram apreensão quanto ao suprimento energético, impactando diretamente sobre o custo de famílias e empresas diante do aumento dos preços. O Banco Central Europeu informou a normalização da política monetária afim de frear a inflação. Na China, o crescimento econômico apresenta desaceleração diante da falha em conseguir efeitos sobre os indicadores de créditos, que seguem moderados, mesmo diante dos estímulos monetários em curso. A atividade econômica ainda sofre com as medidas de contenção da COVID-19. Na América Latina, os países indicam para uma finalização da alta de juros, apresentando um aperto monetário em nível avançado. As decisões tomadas pelo FED têm causado influência sobre os países latino-americanos que estenderam os ciclos de alta de juros e postergação de cortes.

BRASIL

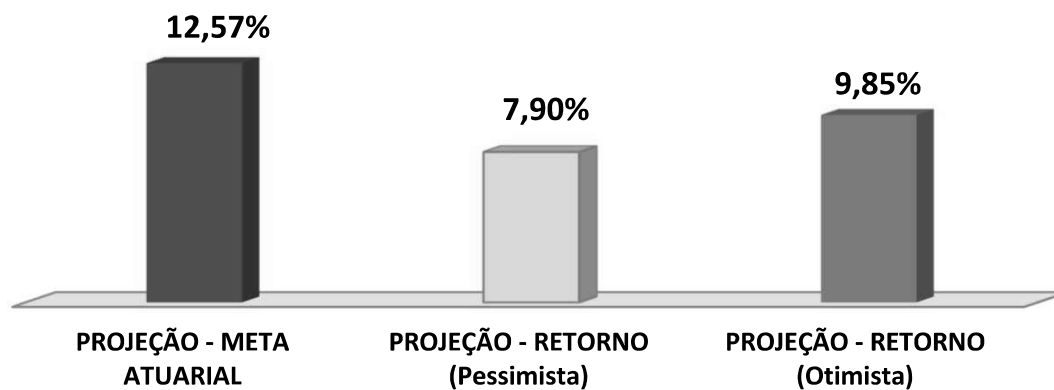
No Brasil, o Banco Central sinalizou o encerramento das elevações sobre os juros ao manter a Taxa Selic em 13,75% a.a. e indicar seu compromisso diante das metas de inflação. Ainda há apreensão sobre a política monetária diante das atividades econômicas mais persistentes, a desaceleração do mercado de trabalho e as incertezas fiscais para o ano de 2023. No 3º trimestre do ano é indicado um enfraquecimento do crescimento, em especial o setor varejista. É esperado uma expansão sobre o consumo das famílias em 2023 diante da redução da taxa desemprego, podendo seguir para um caminho contrário diante da política monetária restritiva global. O quadro Fiscal continua tendo resultados positivos causada pelo desempenho do mercado de trabalho e empresas.

11-PROJEÇÃO DA META ATUARIAL E RENTABILIDADE DA CARTEIRA

Conforme o último Boletim FOCUS, emitido pelo Banco Central em 07/10/2022, a inflação projetada para o final do ano deverá ficar em 7,11% e a Meta Atuarial aproximadamente em

Se não tivermos grandes oscilações no mercado e a distribuição permanecer nos mesmos índices, conforme demonstra a página 19, a carteira deverá rentabilizar entre 7,90% a 9,85% no final do ano, podendo encontrar dificuldades para alcançar a Meta Atuarial.

Projeção da Carteira



As recomendações e as análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 4.963/2021**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

É o Parecer.



Igor França Garcia

Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA

Consultor de Investimentos credenciado pela CVM