
REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE
SORRISO - MT / PREVISÃO

RELATÓRIO MENSAL
DE
INVESTIMENTOS

AGOSTO
2022

12 de setembro 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	12
3.4 - Movimentação das Cotas Aplicadas nos Fundos de Investimento	13
3.5 - Enquadramento sobre os recursos de terceiros dos Gestores	14
4 – SEPARAÇÃO DOS RECURSOS - PROVISÃO DE CAIXA	15
4.1 - Planejamento Financeiro	16
5 – DISTRIBUIÇÃO ESTATÍSTICA DA CARTEIRA	17
5.1 - Distribuição por Segmento (Renda Fixa e Renda Variável)	17
5.2 - Distribuição por índice (Benchmark)	18
5.3 - Distribuição por Instituição Financeira	19
5.4 - Distribuição dos Recursos Disponíveis e Imobilizado	20
5.4.1 - Distribuição da Disponibilidade dos Recursos nos próximos 25 anos	21
6 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO	23
7 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	27
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 AGOSTO, sobre o desempenho mensal das rentabilidades das atuais aplicações financeiras do PREVISÓ.

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 - PREVISO

Nº	MESES	SALDO INICIAL	APORTES (Aplicação)	RESGATES	VARIÇÃO PU - TÍTULOS PÚBLICOS	RENTABILIDADE			SALDO FINAL
						Positiva (a)	Negativa (b)	Consolidado c = (a) - (b)	
1	JANEIRO	241.970.790,62	-	-	-	838.134,42	(676.071,36)	162.063,06	242.132.853,69
2	FEVEREIRO	242.132.853,69	-	-	-	1.981.830,99	(249.183,47)	1.732.647,53	243.865.501,21
3	MARÇO	243.865.501,21	2.451.892,18	-	-	5.538.409,44	(45.273,55)	5.493.135,89	251.810.529,28
4	ABRIL	251.810.529,28	1.471.862,78	-	-	2.331.019,07	(1.056.340,98)	1.274.678,09	254.557.070,15
5	MAIO	254.557.070,15	915.099,68	-	-	2.238.680,52	(74.932,79)	2.163.747,73	257.635.917,56
6	JUNHO	257.635.917,56	1.679.327,64	-	-	876.708,85	(1.194.492,67)	(317.783,82)	258.997.461,38
7	JULHO	258.997.461,38	1.672.213,66	-	-	1.464.828,31	(622.632,58)	842.195,73	261.511.870,77
8	AGOSTO	261.511.870,77	452.562,05	-	-	2.497.215,91	(159.505,87)	2.337.710,04	264.302.142,86
9	SETEMBRO	264.302.142,86	-	-	-	-	-	-	264.302.142,86
10	OUTUBRO	264.302.142,86	-	-	-	-	-	-	264.302.142,86
11	NOVEMBRO	264.302.142,86	-	-	-	-	-	-	264.302.142,86
12	DEZEMBRO	264.302.142,86	-	-	-	-	-	-	264.302.142,86
13	ANO	241.970.790,62	8.642.957,99	-	-	17.766.827,51	(4.078.433,26)	13.688.394,25	264.302.142,86

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

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

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 DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
RENDA FIXA								
1	Títulos Públicos Federal	Art. 7, I, a (100%)	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
2	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, b (100%)	0,0%	84,8%	100,0%	83,5%	222.262.860,92	-
3	F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, c (100%)	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
5	F.I. de Renda Fixa	Art. 7, III, a (60%)	0,0%	0,0%	40,0%	12,2%	32.449.790,88	-
6	F.I. de Índice de Renda Fixa	Art. 7, III, b (0%)	0,0%	10,9%	40,0%	0,0%	-	-
7	Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F.	Art. 7, IV (20%)	0,0%	0,0%	20,0%	0,0%	-	-
8	FIDC - Classe Sênior	Art. 7, V, a (5%)	0,0%	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%	0,0%	-	-
10	F.I. em 85% de Debêntures	Art. 7, V, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
11	TOTAL - RENDA FIXA					95,7%	254.712.651,80	
RENDA VARIÁVEL								
12	F.I. Ações	Art. 8, I (30%)	0,0%	2,7%	30,0%	2,4%	6.345.400,31	-
13	F.I. Ações em Índices de Renda Variável	Art. 8, II (30%)	0,0%	0,0%	30,0%	0,0%	-	-
14	TOTAL - RENDA VARIÁVEL	Art. 8, §1º (30%)				2,4%	6.345.400,31	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS								
15	F.I. e F.I.C FI Multimercados	Art. 10, I (10%)	0,0%	1,1%	10,0%	0,8%	2.261.538,82	-
16	F.I. em Participações	Art. 10, II (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
17	F.I. Ações - Mercado de Acesso	Art. 10, III (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
18	TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	Art. 10 (15%)				0,8%	2.261.538,82	
FUNDOS IMOBILIÁRIOS								
19	F.I. Imobiliário	Art. 11 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	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%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
22	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	Art. 9º, II (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
23	Fundos de Ações - BDR Nível I	Art. 9º, III (10%)	0,0%	0,6%	10,0%	0,4%	982.551,94	-
24	TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Art. 9 (10%)				0,4%	982.551,94	
EMPRÉSTIMO CONSIGNADO								
25	Empréstimo Consignado	Art. 12 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
26	TOTAL - EMPRÉSTIMO CONSIGNADO	Art. 12 (5%)				0,0%	-	
27	DESENQUADRADO	-		100,0%		0,0%	-	-
28	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-				0,7%	1.911.001,29	
29	PATRIMÔNIO TOTAL					100,0%	266.213.144,15	5

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

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%	11,9%	31.567.625,78	-
2	IRF - M 1	0,0%	50,0%	4,4%	11.600.344,56	-
3	IRF - M	0,0%	40,0%	17,1%	45.567.537,04	-
4	IRF - M 1+	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
5	IMA - B 5	0,0%	60,0%	17,4%	46.295.532,18	-
6	IMA - B	0,0%	30,0%	19,2%	51.042.113,16	-
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%	25,8%	68.639.499,07	-
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%	2,4%	6.345.400,31	-
14	ÍNDICES DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,0%	10,0%	0,4%	982.551,94	-
15	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	0,0%	0,0%	0,7%	1.911.001,29	-

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 CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
1	10.740.658/0001-93	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	23.556.427,58	8,85%	SIM	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	83,49%	SIM
2	14.508.605/0001-00	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	22.486.318,45	8,45%	SIM			
3	11.060.913/0001-10	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	46.295.532,18	17,39%	SIM			
4	14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	20.475.648,64	7,69%	SIM			
5	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	26.603.520,48	9,99%	SIM			
6	07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	23.081.218,59	8,67%	SIM			
7	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	48.163.850,43	18,09%	SIM			
8	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	11.600.344,56	4,36%	SIM			
9	03.737.206/0001-97	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	8.053.853,08	3,03%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	12,2%	SIM
10	07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	882.165,10	0,33%	SIM			
11	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	23.513.772,70	8,83%	SIM			
(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA			254.712.651,80	95,68%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: AGOSTO

RENDA VARIÁVEL

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?
11	15.154.220/0001-47	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.554.959,40	0,58%	SIM			
12	40.209.029/0001-00	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	1.910.078,15	0,72%	SIM	F.I. Ações, Art. 8, I (30%)	2,4%	SIM
13	13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	2.880.362,76	1,08%	SIM			
14	30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	2.261.538,82	0,85%	SIM	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	0,8%	SIM
(2) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL			8.606.939,13	3,23%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: AGOSTO

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?
15	17.502.937/0001-68	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	982.551,94	0,37%	SIM	Fundos de Ações BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	0,4%	0,0%
(3) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			982.551,94	0,37%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: AGOSTO

3.1.1-DISPONIBILIDADE FINANCEIRA E TOTAL POR SEGMENTO

Nº	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		
16	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	1.850.295,53	0,70%
17	Caixa Econômica Federal	60.705,76	0,02%
(4) TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		1.911.001,29	0,72%

TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS		
(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	254.712.651,80	95,68%
(2) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	8.606.939,13	3,23%
(3) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	982.551,94	0,37%
(4) TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)	1.911.001,29	0,72%
PATRIMÔNIO LÍQUIDO TOTAL (1 + 2 + 3 + 4)	266.213.144,15	100,00%

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: AGOSTO

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	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	23.513.772,70	11.325.025.814,75	0,208%	SIM
	2	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	11.600.344,56	5.854.200.005,45	0,198%	SIM
	3	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	48.163.850,43	9.083.863.850,50	0,530%	SIM
	4	07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	23.081.218,59	3.858.033.696,96	0,598%	SIM
	5	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	26.603.520,48	5.835.905.819,70	0,456%	SIM
	6	07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	882.165,10	777.885.286,24	0,113%	SIM
	7	03.737.206/0001-97	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	8.053.853,08	14.286.717.843,06	0,056%	SIM
	8	14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	20.475.648,64	9.773.675.955,20	0,209%	SIM
	9	11.060.913/0001-10	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	46.295.532,18	9.644.358.000,69	0,480%	SIM
	10	14.508.605/0001-00	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	22.486.318,45	1.901.885.299,87	1,182%	SIM
	11	10.740.658/0001-93	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	23.556.427,58	3.845.825.844,81	0,613%	SIM
	12	30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	2.261.538,82	1.976.589.170,89	0,114%	SIM
	13	13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	2.880.362,76	510.891.282,92	0,564%	SIM
	14	40.209.029/0001-00	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	1.910.078,15	22.236.613,61	8,590%	SIM
	15	15.154.220/0001-47	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.554.959,40	661.789.432,80	0,235%	SIM
	16	17.502.937/0001-68	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	982.551,94	2.252.028.422,82	0,044%	SIM
TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO				264.302.142,86			
TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)				1.911.001,29			
PATRIMÔNIO LÍQUIDO				266.213.144,15			

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: AGOSTO

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 RF IRF - M 1 TP FIC FI	100,00%	11.600.344,56	4,36%	5.854.200.005,45	0,198%	SIM	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	SIM
BB IRF-M 1 FI DE RF	100,00%	11.600.590,57	4,36%	5.854.252.363,25	0,198157%	SIM		
BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	100,00%	23.513.772,70	8,83%	11.325.025.814,75	0,208%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	SIM
BB TOP DI RF REFERENCIADO DI LP FI	100,00%	23.514.194,54	8,83%	25.870.647.697,67	0,090891%	SIM		
FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	0,48%	1.554.959,40	0,58%	661.789.432,80	0,235%	SIM	F.I. Ações, Art. 8, I (30%)	SIM
FI CAIXA MASTER CONSERVADOR RF REFERENCIADO DI	0,48%	7.494,90	0,00%	17.197.891.577,42	0,000044%	SIM		
CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	0,65%	1.910.078,15	0,72%	22.236.613,61	8,590%	SIM		
FI CAIXA MASTER CONSERVADOR RF REFERENCIADO DI	0,65%	12.434,61	0,00%	17.197.891.577,42	0,000072%	SIM		
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	0,38%	2.880.362,76	1,08%	510.891.282,92	0,564%	SIM	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	SIM
FI CAIXA MASTER CONSERVADOR RF REFERENCIADO DI	0,38%	11.031,79	0,00%	17.197.891.577,42	0,000064%	SIM		
FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,98%	982.551,94	0,37%	2.252.028.422,82	0,044%	SIM		
FI CAIXA MASTER CONSERVADOR RF REFERENCIADO DI	0,98%	9.648,66	0,00%	17.197.891.577,42	0,000056%	SIM		

3.4-MOVIMENTAÇÃO DAS COTAS APLICADAS NOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

N°	Agência	Conta	Fundo de Investimento	CNPJ	Valor da Cota		Quantidade de Cotas			
					Inicial *	Final **	Inicial *	Aplicação	Resgate	Final **
1	2756	006.00000007-3	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	R\$ 8,3434521	R\$ 4,2212543	1907928,895480	0,0000000	0,0000000	1907928,895480
2	2756	006.00000007-3	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	14.386.926/0001-71	R\$ 2,6620099	R\$ 2,6591149	7700174,370329	0,0000000	0,0000000	7700174,370329
3	2756	006.00000007-3	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	R\$ 3,5881319	R\$ 3,5898402	12896265,390795	0,0000000	0,0000000	12896265,390795
4	2756	006.00000007-3	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	10.740.658/0001-93	R\$ 3,7570811	R\$ 3,8020231	4703377,703190	0,0000000	0,0000000	4703377,703190
5	2756	006.00000007-3	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	14.508.605/0001-00	R\$ 2,3796003	R\$ 2,4282026	9260478,772650	0,0000000	0,0000000	9260478,772650
6	2756	006.00000034-0	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	10.740.658/0001-93	R\$ 3,7570811	R\$ 3,8020231	1373750,510825	118633,0370470	0,0000000	1492383,547873
7	1917-8	12598-9	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	13.322.205/0001-35	R\$ 6,4276804	R\$ 3,2124081	5258565,131186	0,0000000	0,0000000	5258565,131186
8	1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	07.861.554/0001-22	R\$ 5,9030751	R\$ 5,9653465	147881,618696	0,0000000	0,0000000	147881,618696
9	1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	07.111.384/0001-69	R\$ 6,2038267	R\$ 6,3311202	3645676,862787	0,0000000	0,0000000	3645676,862787
10	1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	07.442.078/0001-05	R\$ 6,6544109	R\$ 6,7260157	3955316,453380	0,0000000	0,0000000	3955316,453380
11	1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	11.328.882/0001-35	R\$ 2,9634004	R\$ 2,9990878	3867957,662819	0,0000000	0,0000000	3867957,662819
12	1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	13.322.205/0001-35	R\$ 3,2138402	R\$ 3,2124081	9734501,963260	0,0000000	0,0000000	9734501,963260
13	1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.077.418/0001-49	R\$ 2,5680210	R\$ 2,5984086	9049297,661752	0,0000000	0,0000000	9049297,661752
14	2756	006.00000007-3	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	30.036.235/0001-02	R\$ 1,6060185	R\$ 1,5539969	1455304,618409	0,0000000	0,0000000	1455304,618409
15	2756	006.00000007-3	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	13.058.816/0001-18	R\$ 2,3353204	R\$ 2,4788865	1161958,329357	0,0000000	0,0000000	1161958,329357
16	2756	006.00000007-3	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	40.209.029/0001-00	R\$ 821,2615270	R\$ 902,9015980	2115,488723	0,0000000	0,0000000	2115,488723
17	2756	006.00000007-3	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	15.154.220/0001-47	R\$ 1,3625998	R\$ 1,5080314	1031118,693478	0,0000000	0,0000000	1031118,693478
18	2756	006.00000007-3	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	R\$ 5,3333687	R\$ 5,1245613	191733,865029	0,0000000	0,0000000	191733,865029

* Informação baseada no último dia útil do mês anterior (29/07/2022).

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

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.	133.844.871,87	1.458.136.306.436,50	0,0092%	SIM
2	CAIXA ASSET DTVM	130.457.271,00	490.859.466.096,94	0,0266%	SIM
TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO		264.302.142,86			
TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		1.911.001,29			
PATRIMÔNIO LÍQUIDO		266.213.144,15			

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: AGOSTO

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?	16.610.000,00	7,2%

*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)	31.567.625,78	12,4%

Referência: AGOSTO

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	6.388.461,54	2,4%

Referência: AGOSTO

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 (repasso e outras receitas).

4.1-PLANEJAMENTO FINANCEIRO

Provisão de Caixa	Banco	Agência	Conta	Valor (R\$)	Fundo de Investimento
RESERVAS DE CURTO PRAZO Reservas de Obrigações Previdenciárias no exercício e Reservas para pagto da Despesa Adm no exercício	CAIXA	2756	006.00000007-3	8.053.853,08	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO
	BB	1917-8	17002-X	23.513.772,70	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI
Total					31.567.625,78
Total					31.567.625,78

Referência: AGOSTO

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

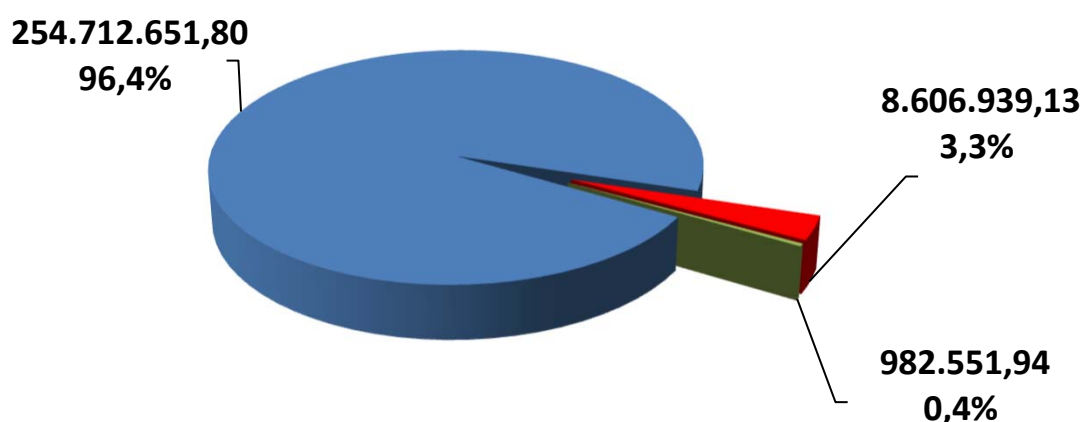
5 - DISTRIBUIÇÃO ESTATÍSTICA DA CARTEIRA

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

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
RENDA FIXA	254.712.651,80	96,4%
RENDA VARIÁVEL	8.606.939,13	3,3%
INVESTIMENTO NO EXTERIOR	982.551,94	0,4%
TOTAL	264.302.142,86	100,0%

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / SEGMENTO

■ RENDA FIXA ■ RENDA VARIÁVEL ■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR

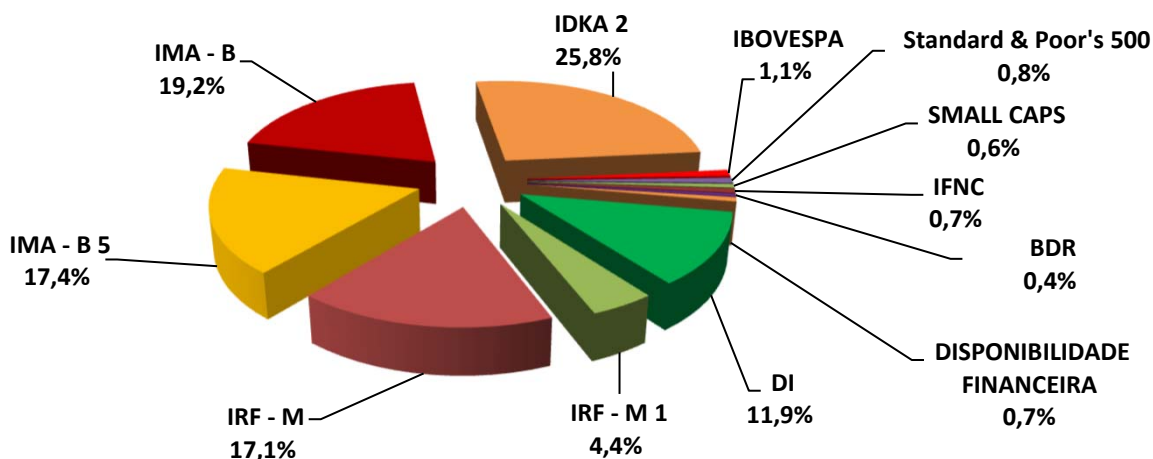


**OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).*

5.2-DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICE (Benchmark)

ÍNDICE (BENCHMARK)	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
DI	31.567.625,78	11,9%
IRF - M 1	11.600.344,56	4,4%
IRF - M	45.567.537,04	17,1%
IRF - M 1+	-	0,0%
IMA - B 5	46.295.532,18	17,4%
IMA - B	51.042.113,16	19,2%
IMA - B 5+	-	0,0%
IMA - GERAL	-	0,0%
IMA - GERAL EX - C	-	0,0%
IDKA 2	68.639.499,07	25,8%
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	2.880.362,76	1,1%
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	2.261.538,82	0,8%
IGC	-	0,0%
Petrobrás	-	0,0%
SMALL CAPS	1.554.959,40	0,6%
IFNC	1.910.078,15	0,7%
Standard & Poor's 500 (BRASIL)	-	0,0%
BDR	982.551,94	0,4%
MSCI ACWI	-	0,0%
MSCI WORLD	-	0,0%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.911.001,29	0,7%
TOTAL	266.213.144,15	100%

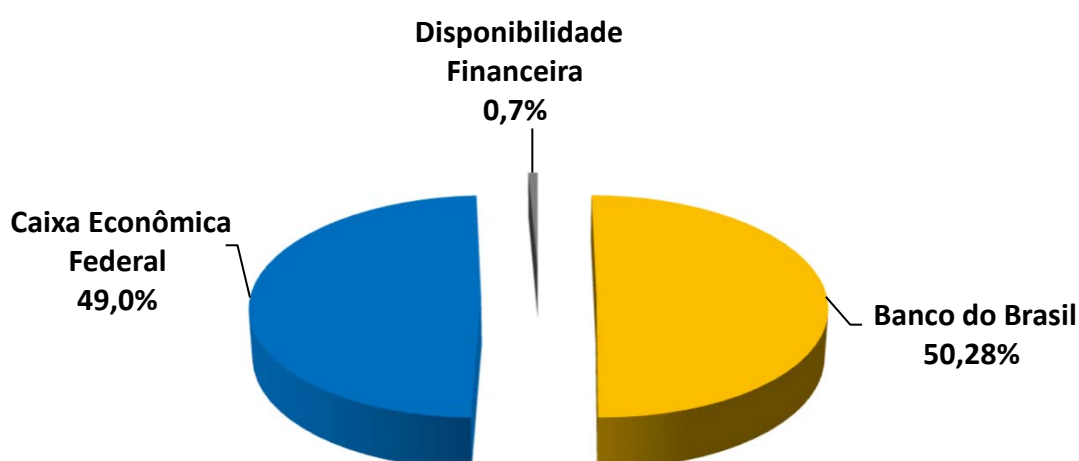
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / POR ÍNDICE



5.3-DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
Banco do Brasil	133.844.871,87	50,3%
Caixa Econômica Federal	130.457.271,00	49,0%
Disponibilidade Financeira	1.911.001,29	0,7%
TOTAL	266.213.144,15	100%

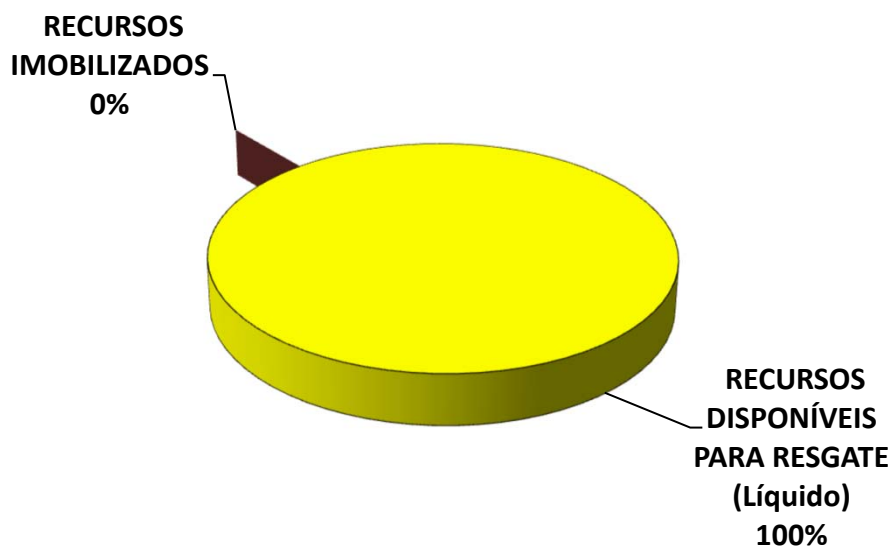
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



5.4-DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DISPONÍVEIS E IMOBILIZADO

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
RECURSOS DISPONÍVEIS PARA RESGATE (Líquido)	266.213.144,15	100,0%
RECURSOS IMOBILIZADOS	-	0,0%
TOTAL	266.213.144,15	100,0%

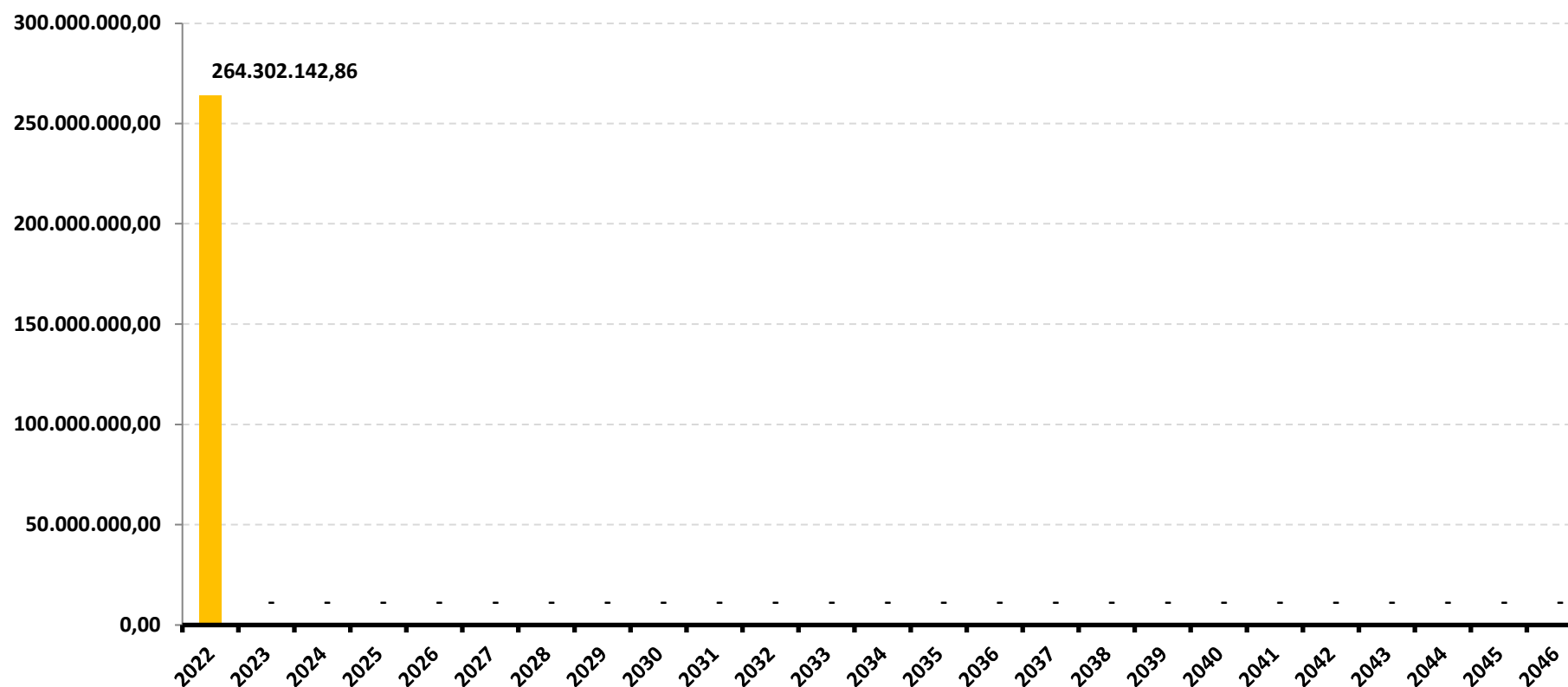
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA /POR LIQUIDEZ



5.4-DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DISPONÍVEIS E IMOBILIZADO

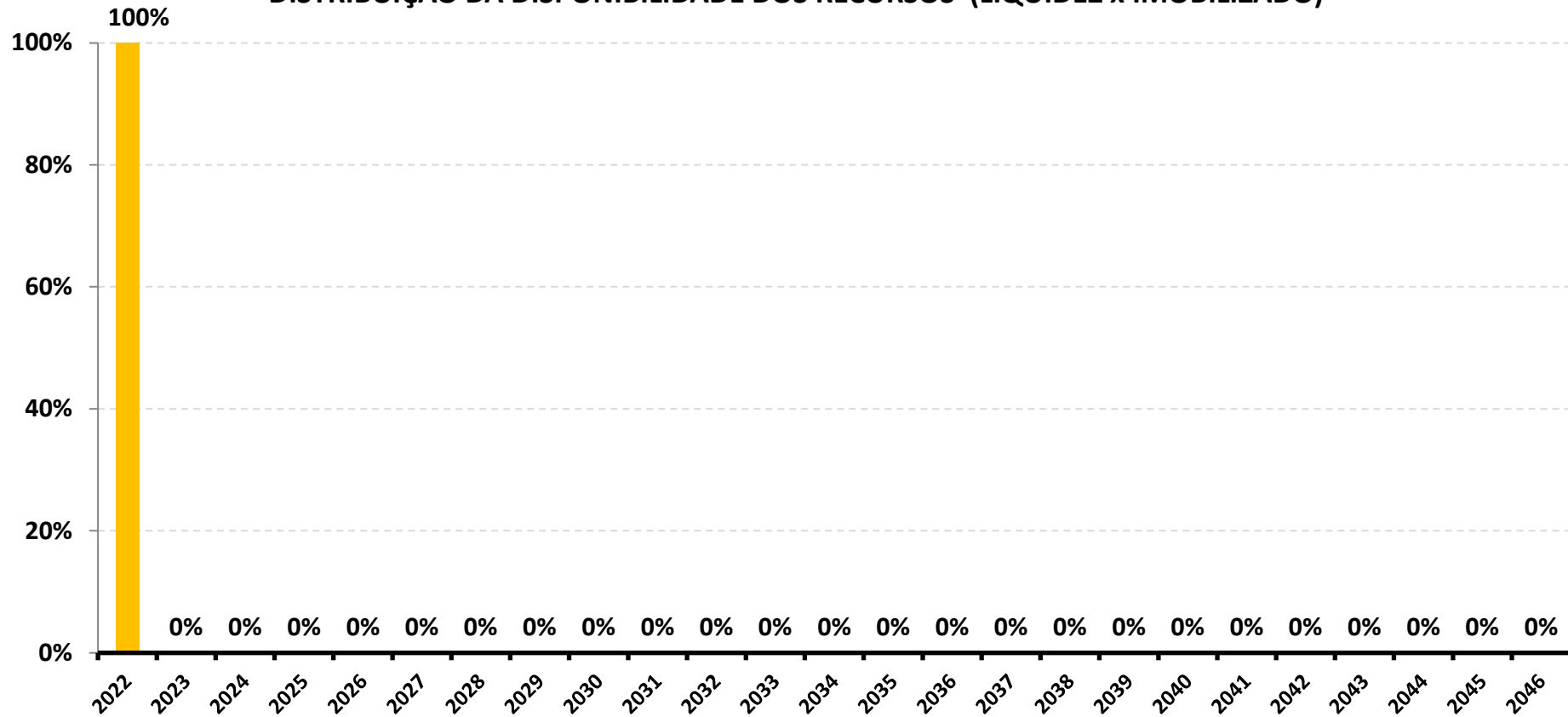
5.4.1-DISTRIBUIÇÃO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS NOS PRÓXIMOS 25 ANOS

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 REF DI LP PERFIL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI
CNPJ	13.077.418/0001-49	11.328.882/0001-35	13.322.205/0001-35	07.111.384/0001-69
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa	Renda Fixa índices	Previdência Renda Fixa	Renda Fixa índices
ÍNDICE	CDI	IRF – M 1	IDKA 2	IRF – M
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	08/12/2004
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% 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	10.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor
RESGATE MÍNIMO	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor
SALDO MÍNIMO	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor
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 **	11.325.025.814,75	5.854.200.005,45	9.083.863.850,50	3.858.033.696,96
NÚMERO DE COTISTAS **	1015	1067	1071	445
VALOR DA COTA **	2,598408581	2,99908778	3,212408117	6,331120245
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	06/08/2018	05/02/2020	05/02/2020	09/10/2017
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	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP
CNPJ	07.442.078/0001-05	07.861.554/0001-22	03.737.206/0001-97	14.386.926/0001-71
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices	Referenciado – DI	Renda Fixa índices
ÍNDICE	IMA – B	IMA – B	CDI	IDKA 2
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprio de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
DATA DE INÍCIO	24/07/2005	09/03/2006	05/07/2006	16/08/2012
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,30% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	10.000,00	10.000,00	1000	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	Qualquer valor	Qualquer valor	1.000,00	0,00
RESGATE MÍNIMO	Qualquer valor	Qualquer valor	1.000,00	0,00
SALDO MÍNIMO	Qualquer valor	Qualquer valor	1.000,00	0,00
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+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO *	5 - Muito Alto	5 - Muito Alto	2 - Baixo	3 - Médio
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	5.835.905.819,70	777.885.286,24	14.286.717.843,06	9.773.675.955,20
NÚMERO DE COTISTAS **	577	225	973	1063
VALOR DA COTA **	6,72601568	5,965346528	4,22125431	2,65911493
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	11/10/2017	23/05/2016	06/05/2019	26/09/2018
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. 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%)

* 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 IMA - B 5 TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP
CNPJ	11.060.913/0001-10	14.508.605/0001-00	10.740.658/0001-93	30.036.235/0001-02
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Investimentos Estruturados
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa índices	Renda Fixa Índices	Renda Fixa índices	Multimercados Dinâmico
ÍNDICE	IMA - B 5	IRF – M	IMA – B	S&P500
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	09/07/2010	16/08/2012	08/03/2010	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	0,00	Qualquer valor	0,00	1.000,00
RESGATE MÍNIMO	0,00	Qualquer valor	0,00	1.000,00
SALDO MÍNIMO	0,00	Qualquer valor	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 *	2 - Baixo	3 - Médio	3 - Médio	4 - Alto
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	9.644.358.000,69	1.901.885.299,87	3.845.825.844,81	1.976.589.170,89
NÚMERO DE COTISTAS **	1006	259	776	10758
VALOR DA COTA **	3,58984022	2,42820258	3,80202313	1,55399687
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	17/10/2019	26/09/2018	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	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I
CNPJ	13.058.816/0001-18	40.209.029/0001-00	15.154.220/0001-47	17.502.937/0001-68
SEGMENTO	Renda Variável	Renda Variável	Renda Variável	Investimento no Exterior
CLASSIFICAÇÃO	AÇÕES INDEXADOS	Fundo de Ações	AÇÕES SMALL CAPS	Ações Livre
ÍNDICE	IBOV	IFNC	SMLL	BDR
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de Previdência Social	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de Previdência Social	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de Previdência Social
DATA DE INÍCIO	29/07/2011	26/01/2021	01/11/2012	24/06/2013
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,50% a.a.	0,80% a.a.	1,50% a.a.	0,70% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	100,00	1.000,00	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	100,00	100,00	100,00	100,00
RESGATE MÍNIMO	100,00	100,00	100,00	100,00
SALDO MÍNIMO	500,00	50,00	500,00	500,00
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+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	4 - Alto	4 - Alto	5 - Muito Alto	4 - Alto
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	510.891.282,92	22.236.613,61	661.789.432,80	2.252.028.422,82
NÚMERO DE COTISTAS **	98	376	7760	518
VALOR DA COTA **	2,47888645	902,9015987	1,50803143	5,12456126
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	19/02/2021	17/11/2020	17/12/2020	03/11/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. Ações, Art. 8, I (30% 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)	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)

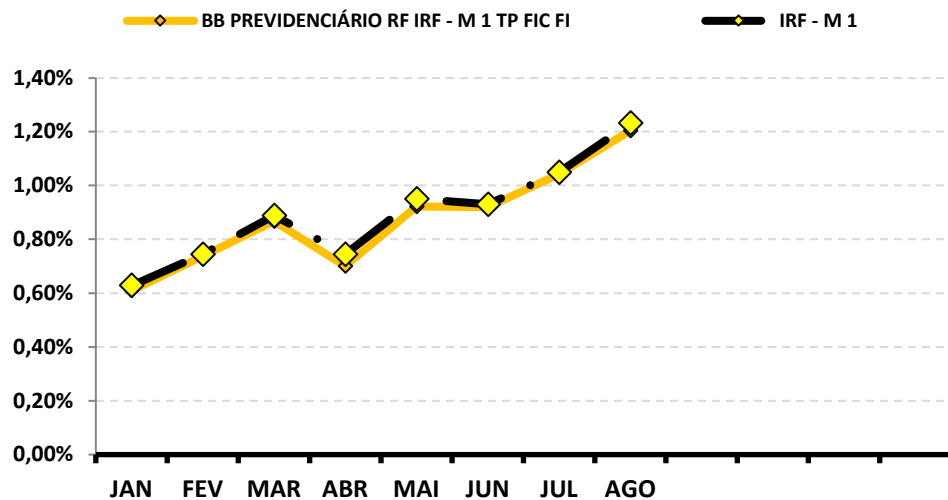
* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

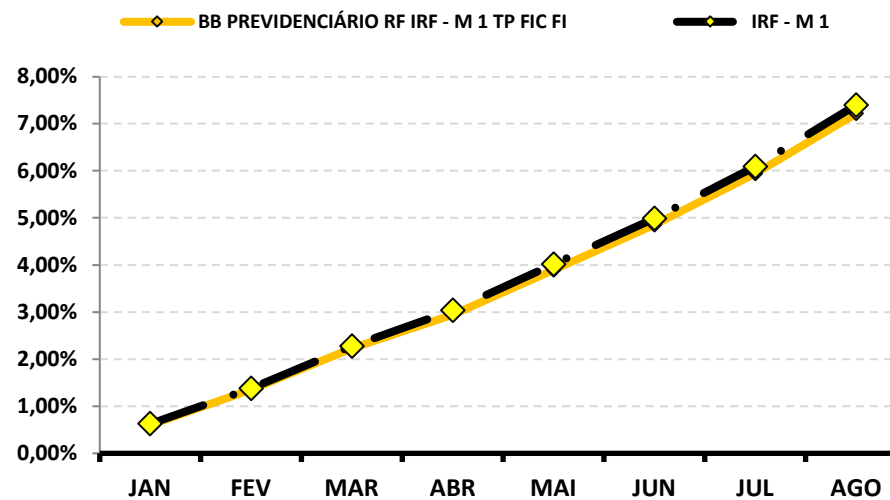
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2022 - Fundos atrelados ao IRF - M 1

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO					ACUMULADO
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	0,61%	0,74%	0,87%	0,70%	0,92%	0,92%	1,04%	1,20%					7,22%
	IRF - M 1	0,63%	0,74%	0,89%	0,75%	0,95%	0,93%	1,05%	1,23%					7,40%

Rentabilidade Mensal



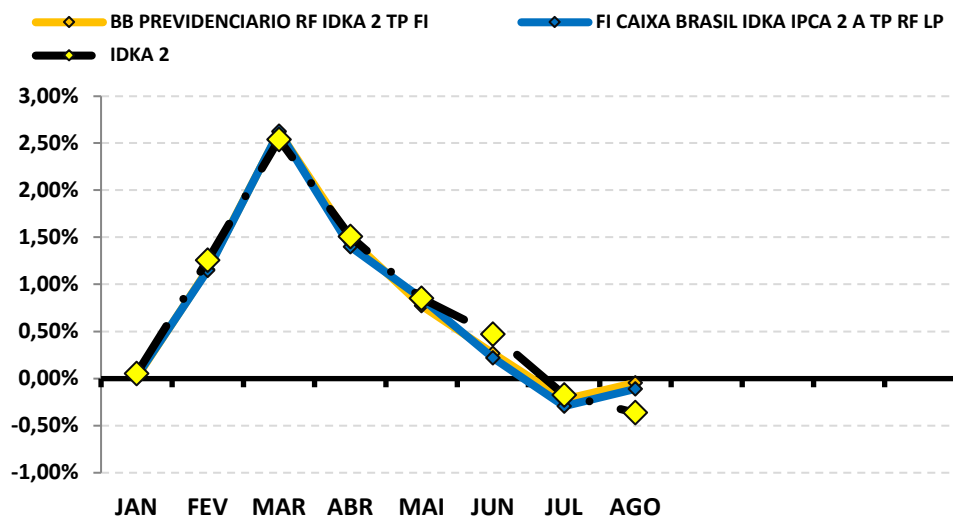
Rentabilidade Acumulada



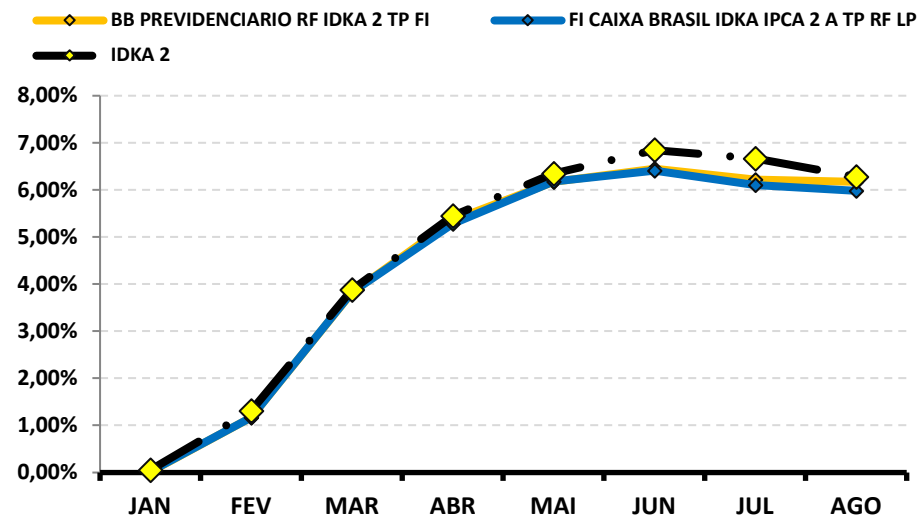
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2022 - Fundos atrelados ao IDKA 2

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO					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%					6,17%
14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	0,02%	1,15%	2,63%	1,40%	0,85%	0,22%	-0,29%	-0,11%					5,98%
	IDKA 2	0,05%	1,26%	2,54%	1,51%	0,85%	0,47%	-0,17%	-0,36%					6,28%

Rentabilidade Mensal



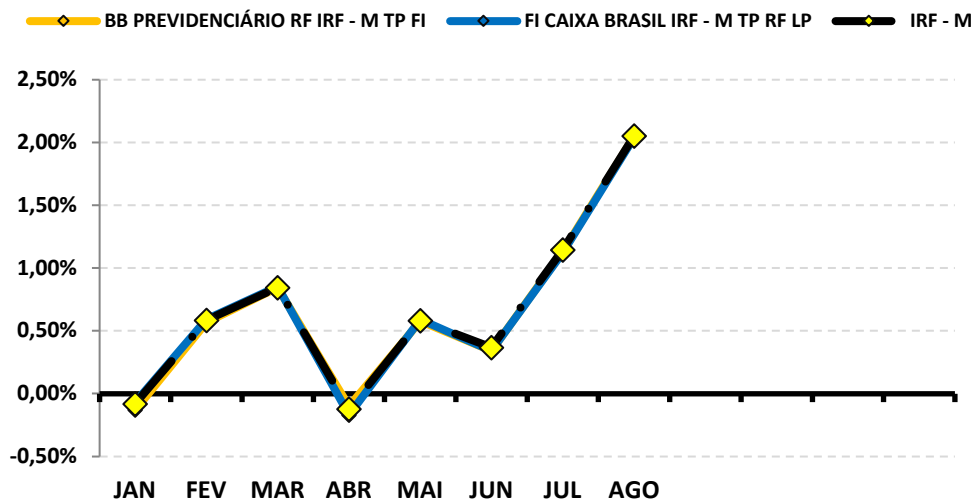
Rentabilidade Acumulada



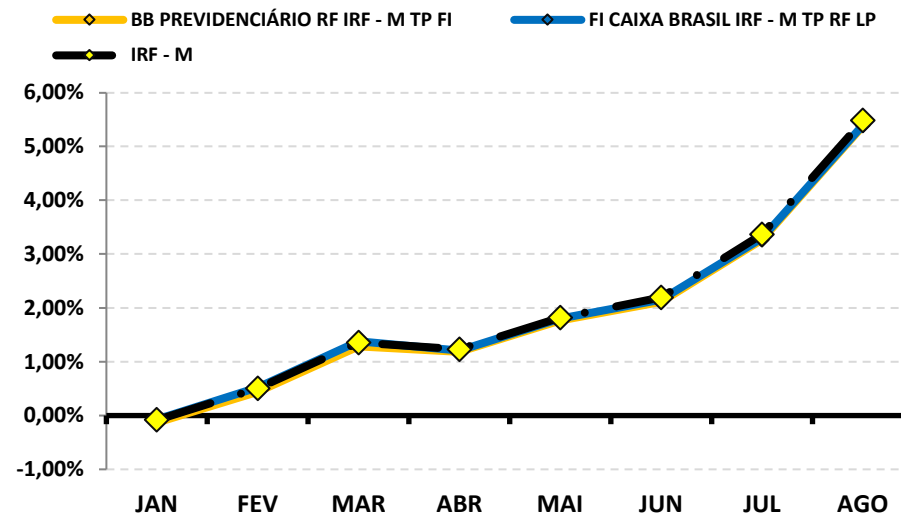
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2022 - Fundos atrelados ao IRF - M

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO					ACUMULADO
07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	-0,13%	0,57%	0,84%	-0,10%	0,58%	0,34%	1,13%	2,05%					5,39%
14.508.605/0001-00	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	-0,07%	0,59%	0,85%	-0,17%	0,59%	0,34%	1,12%	2,04%					5,40%
	IRF - M	-0,08%	0,58%	0,84%	-0,12%	0,58%	0,37%	1,15%	2,05%					5,49%

Rentabilidade Mensal



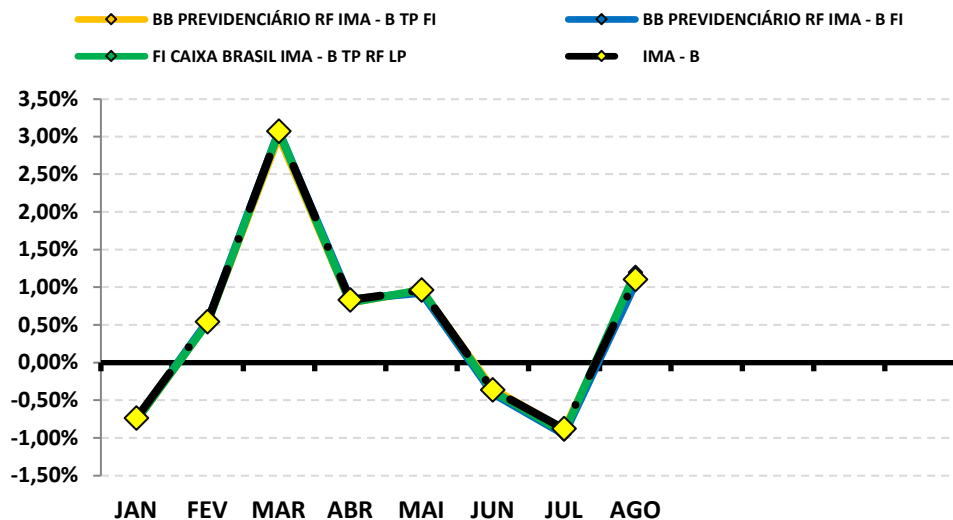
Rentabilidade Acumulada



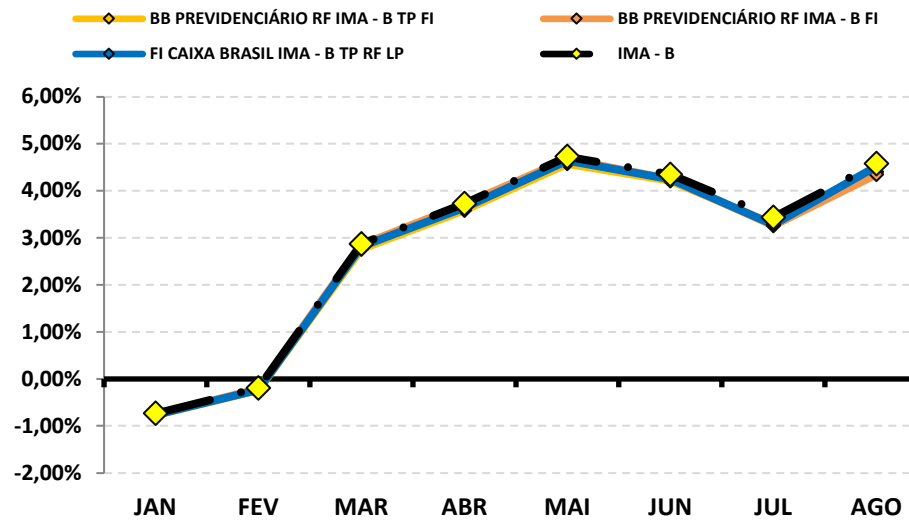
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2022 - Fundos atrelados ao IMA - B

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO					ACUMULADO
07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	-0,77%	0,53%	3,01%	0,80%	0,96%	-0,35%	-0,89%	1,08%					4,40%
07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	-0,76%	0,55%	3,07%	0,84%	0,93%	-0,41%	-0,95%	1,05%					4,35%
10.740.658/0001-93	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	-0,76%	0,53%	3,06%	0,80%	0,97%	-0,38%	-0,92%	1,20%					4,52%
	IMA - B	-0,73%	0,54%	3,07%	0,83%	0,96%	-0,36%	-0,88%	1,10%					4,58%

Rentabilidade Mensal



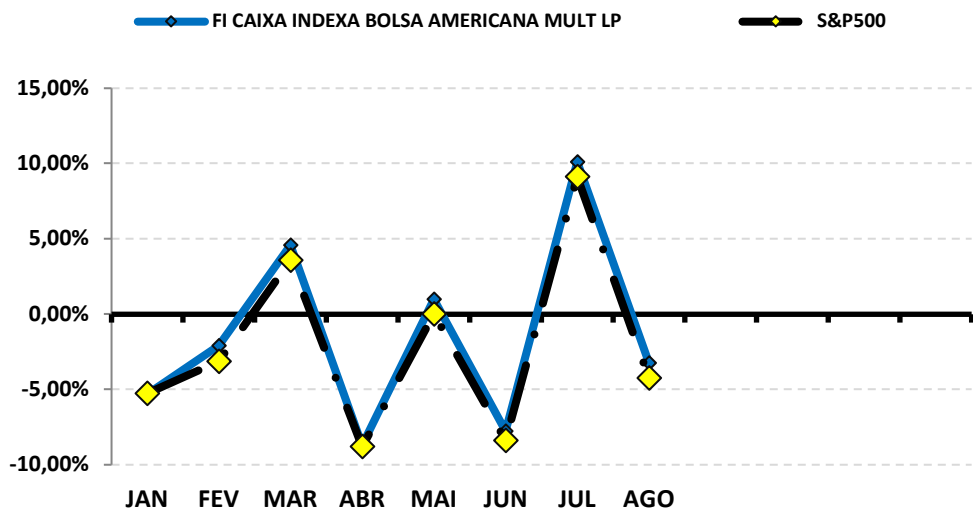
Rentabilidade Acumulada



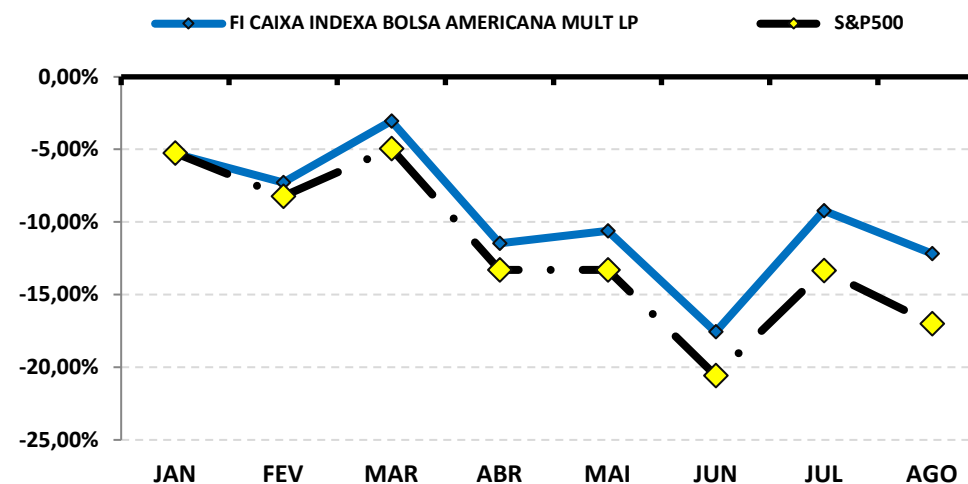
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2022 - Fundos atrelados ao S&P500

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO					ACUMULADO
30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	-5,30%	-2,09%	4,57%	-8,69%	0,97%	-7,78%	10,11%	-3,24%					-12,18%
	S&P500	-5,26%	-3,14%	3,58%	-8,80%	0,01%	-8,39%	9,11%	-4,24%					-17,02%

Rentabilidade Mensal



Rentabilidade Acumulada



8-RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

8.1-RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2022 - PREVISO

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO				
RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA	0,07%	0,72%	2,25%	0,51%	0,85%	-0,12%	0,33%	0,89%				
CDI	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%	1,17%				
IBOVESPA	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%	6,16%				
META ATUARIAL	0,94%	1,41%	2,02%	1,46%	0,87%	1,07%	-0,28%	0,04%				

A RENTABILIDADE DA CARTEIRA DO PREVISO NO MÊS DE AGOSTO FOI DE:

R\$ 2.337.710,04

A META ATUARIAL NO MÊS DE AGOSTO FOI DE:

R\$ 107.311,60

8.2-RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2022 - PREVISÃO

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO				
RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA	0,07%	0,78%	3,05%	3,57%	4,46%	4,33%	4,67%	5,60%				
CDI	0,73%	1,50%	2,44%	3,29%	4,35%	5,42%	6,50%	7,75%				
IBOVESPA	6,98%	7,93%	14,47%	2,91%	6,22%	-5,99%	-1,58%	4,48%				
META ATUARIAL	0,94%	2,37%	4,43%	5,96%	6,88%	8,03%	7,73%	7,77%				

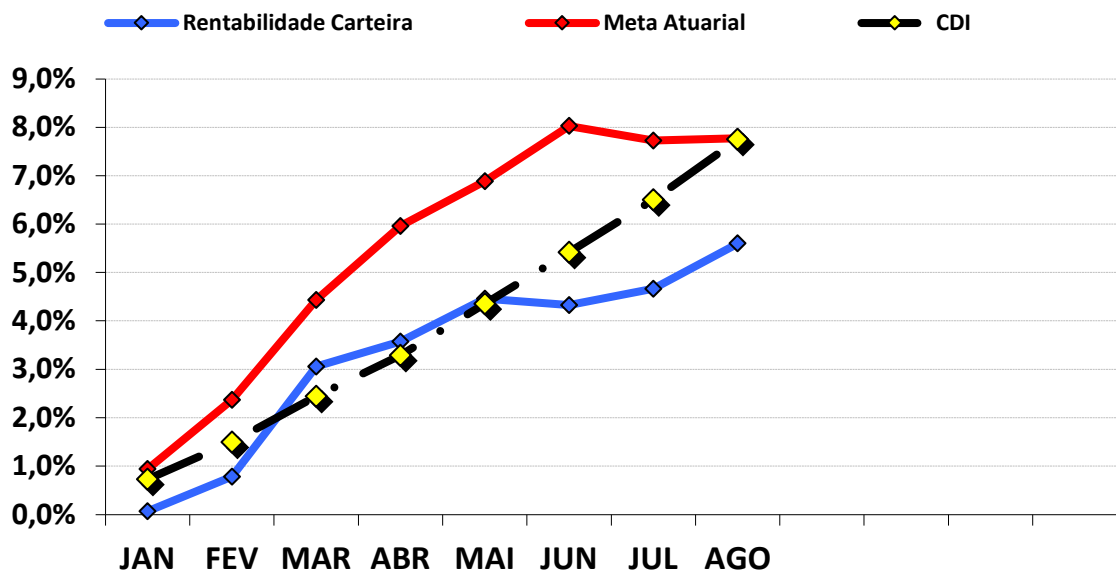
RENTABILIDADE ACUMULADA DO PREVISÃO: R\$ 13.688.394,25

META ATUARIAL ACUMULADA: R\$ 18.662.708,95

DEFASAGEM PARA O CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL R\$ (4.974.314,70)

GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL

RENTABILIDADE DA CARTEIRA (Acumulada) 2022



RENTABILIDADE e ÍNDICES ACUMULADOS

	Rentabilidade Carteira	Meta Atuarial	CDI
JAN	0,07%	0,94%	0,73%
FEV	0,78%	2,37%	1,50%
MAR	3,05%	4,43%	2,44%
ABR	3,57%	5,96%	3,29%
MAI	4,46%	6,88%	4,35%
JUN	4,33%	8,03%	5,42%
JUL	4,67%	7,73%	6,50%
AGO	5,60%	7,77%	7,75%

8.3.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA

A Carteira de Investimentos do PREVISÓ, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada de 5,60% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado de 7,75% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou até o momento, uma rentabilidade de 72,28% sobre o índice de referência do mercado.

8.4-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada do PREVISÓ é de 5,60% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 7,77%, ou seja, até o momento, a carteira alcançou uma rentabilidade de 72,08% sobre a Meta Atuarial.

9-ANÁLISE DE MERCADO

9.1-TAXA SELIC

Na reunião nos dias 02 e 03 de agosto de 2022, o COPOM decidiu elevar a Taxa Selic para 13,75% a.a. A decisão foi unânime e o COPOM informou que continuará adotando uma política mais contracionista até que se consolide o processo de desinflação e a ancoragem das expectativas em torno de suas metas, e que, a decisão de aumentar a Taxa Selic reflete as incertezas quanto ao cenário econômico e sua estratégia de convergência da inflação em torno da meta inflacionária do horizonte relevante, o que implicará na suavização das flutuações do nível de atividade econômica e fomento do pleno emprego.

O COPOM tira como base, a conjuntura macroeconômica nacional e internacional. No mercado interno, o conjunto de indicadores de atividade econômica divulgado, surpreendeu o Comitê. Os indicadores apresentaram crescimento no 2º Trimestre, no qual obteve-se uma retomada do mercado de trabalho além do esperado. Quanto ao consumidor, a inflação segue elevada em itens mais voláteis como quanto a itens associados a inflação subjacente.

Em relação ao cenário internacional, a economia se mantém volátil, apresentando revisões negativas quanto ao ambiente inflacionário que se mantém pressionado. O processo de normalização da política monetária em países avançados tem se acelerado e elevando a volatilidade dos ativos. Um dos indicadores de risco sobre a alta da inflação é a persistência das pressões inflacionárias globais, enquanto uma possível reversão do aumento dos preços das commodities internacionais diante da moeda local e dos riscos de desaceleração da economia global são fatores que podem diminuir a inflação. O Comitê pondera que a possibilidade de que medidas fiscais de estímulo à demanda se tornem permanentes e acentue os riscos de alta para o cenário inflacionário. Por outro lado, nota-se que a valorização das commodities em reais e o desestímulo da atividade econômica global também acentuam os riscos de baixa.

A principal mensagem que traz a nota sobre a reunião é que, o COPOM continuará com o ciclo de aperto monetário mais contracionista, até se consolidar o processo de desinflação. O Comitê enfatiza também que na sua próxima reunião antevê um reajuste para assegurar a convergência da inflação para suas metas. Até o final do ano o COPOM projeta a Selic em 13,75% e terminando o ano de 2023 em 11,00%.

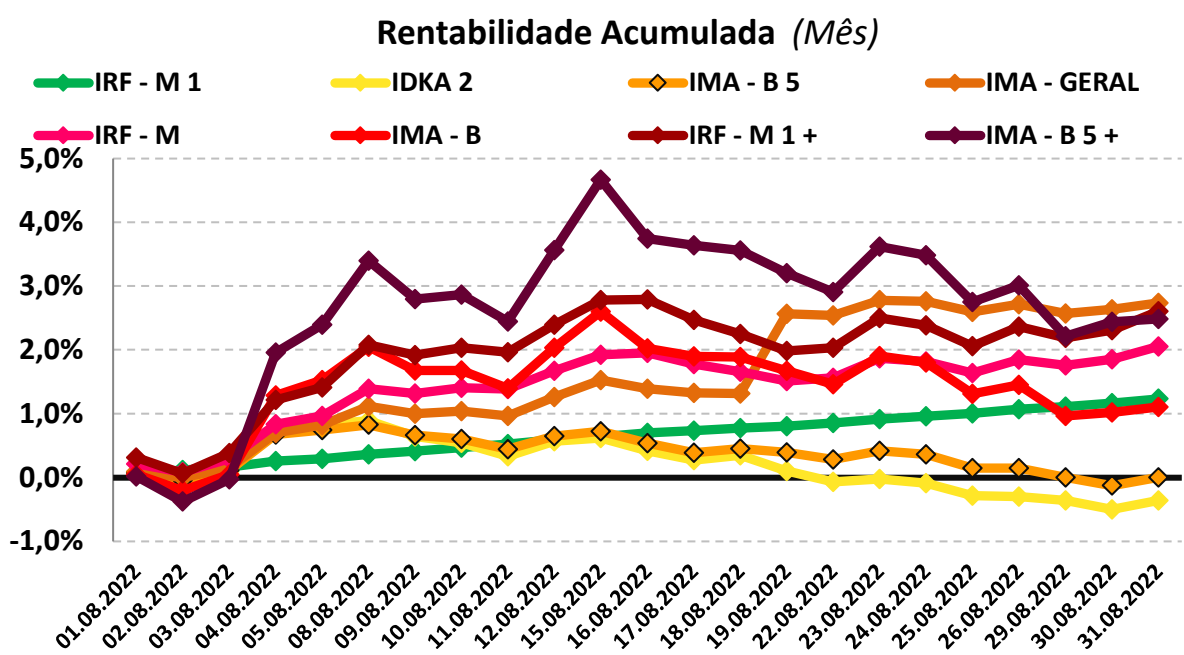
A previsão do Boletim Focus, emitido pelo Banco Central no final de dezembro/2021, projetava a taxa de juros finalizando 2022 em 11,50% a.a..

9.2-RENDA FIXA

Os Subíndices IMA iniciaram os primeiros dias do mês de agosto com uma pequena desvalorização, mas se recuperando rapidamente e mantendo o crescimento de valorização até meados do mês, quando passaram a "andar de lado". Somente os índices moderados reverteram a situação e apresentaram desempenho até mesmo negativo.

O destaque fica por conta do Ativo de Médio Prazo IDKA 2 que chegou a rentabilizar +0,89%, apresentando uma recuperação estável até a 2ª semana, mas finalizando o mês com retorno negativo de (-0,36%). Dentre os índices que apresentaram recuperação durante o mês destacam-se IMA – B e IMA – B 5+ que chegaram a rentabilizar (-0,20%) e (-0,38%) na 1ª semana de agosto e fecharam o mês com rentabilidade positiva de +1,10% e +2,49%, respectivamente.

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+
AGOSTO	1,23%	-0,36%	0,00%	1,40%	2,05%	1,10%	2,60%	2,49%
Acumulado/2022	7,40%	6,28%	6,62%	6,45%	5,49%	4,58%	4,60%	2,65%



9.3-RENDA VARIÁVEL - AÇÕES BRASILEIRAS

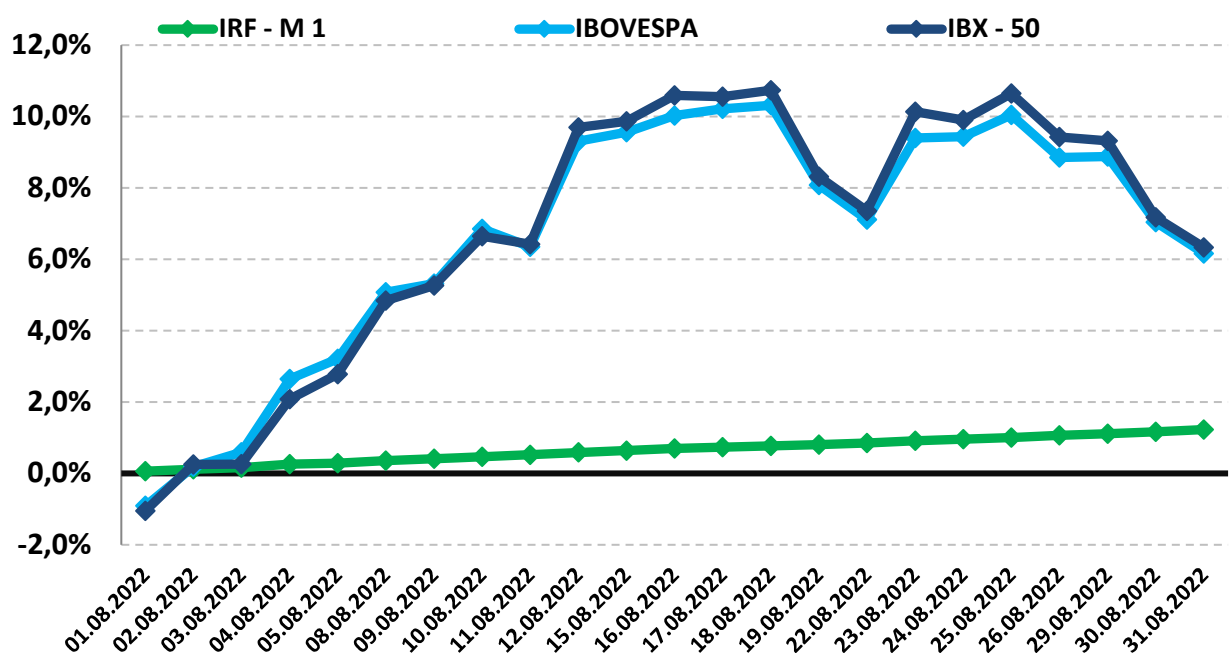
O segmento de Renda Variável iniciou o mês de agosto com rentabilidade positiva, porém, apresentando oscilação e quedas no decorrer do mês, mas se recuperando na 3ª semana de agosto e conseguindo fechar o mês de forma positiva. O aumento da demanda por commodities, principalmente de petróleo (Petrobrás), causou maiores entradas de capital estrangeiro no país, fazendo com que o IBOVESPA 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 6,16% aos 109.522,88 pontos. O índice acumula uma variação positiva de +4,48% no ano. O índice IBRX-50 que representa as 50 maiores empresas negociadas na Bolsa, finalizou o mês com uma variação positiva de 6,33% aos 18.345,64 pontos. O índice acumula uma variação positiva de +4,82% no ano.

Analisando por setor, os principais responsáveis pela valorização do IBOVESPA foram as ações de empresas ligadas ao setor de Petróleo e Small Caps negociadas na B3, com valorização de +17,30% e +11,46%, respectivamente.

PERFIL	Conservad.	(do menos) Arrojado (para o mais)		
ÍNDICE	IRF - M 1	IBOVESPA	MAIORES DESEMPENHOS	
			PETROBRÁS	SMALL CAPS
AGOSTO	1,23%	6,16%	17,30%	11,46%
Acumulado/2022	7,40%	4,48%	68,90%	-6,08%

Rentabilidade Acumulada (Mês)

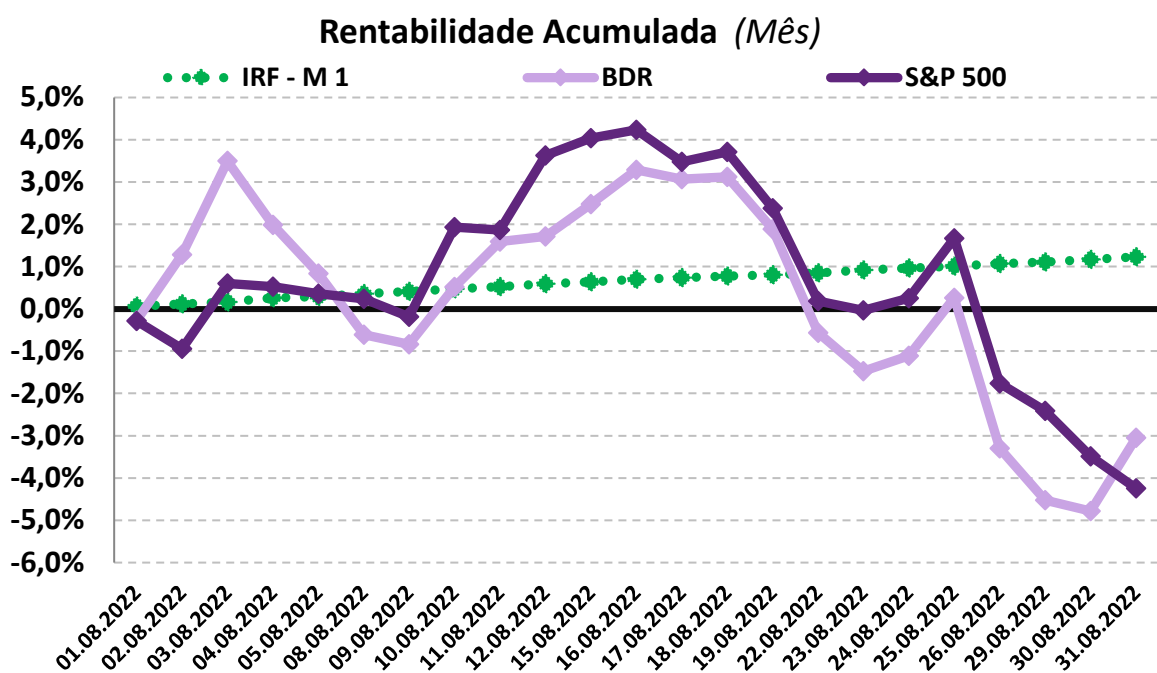


9.4-INVESTIMENTO NO EXTERIOR

O segmento de Investimento no Exterior iniciou o mês com valorização, mas perdendo força durante a 1ª semana. Durante a 2ª e 3ª semana do mês, apresentaram forte recuperação, mas, volataram a ter forte desvalorização e de forma contínua até o fechamento do mês, finalizando com rentabilidade negativa.

O índice BDR, principal indicador de ações negociadas no Brasil de empresas do exterior fechou o mês com variação negativa de -3,05% com cotação de R\$ 11.620,51. O índice acumula uma variação negativa de -24,45% 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 -4,24% com cotação de R\$ 3.955,00. O índice acumula uma variação negativa de -17,02% no ano.

PERFIL	Conservad.	(do menos) Arrojado (para o mais)	
ÍNDICE	IRF – M 1	BDR	S&P 500
AGOSTO	1,23%	-3,05%	-4,24%
Acumulado/2022	7,40%	-24,45%	-17,02%



10-ANÁLISE MACROECONÔMICA

10.1-IPCA

O IPCA de agosto/2022 (-0,36%), continuou apresentando deflação, mas, menor se comparado ao mês anterior (julho/2022 = -0,68%).

No ano, o IPCA registra alta de +4,39%. Nos últimos doze meses, o IPCA registra acumulação de +8,73%, abaixo dos últimos 12 meses anterior, que registrou acumulação de +10,07%.

Em agosto de 2021, o IPCA havia ficado em +0,87%.

10.1.1-MAIOR ALTA DE PREÇOS

O grupo que apresentou o maior impacto de alta no IPCA, foi o grupo SAÚDE E CUIDADOS PESSOAIS cujo índice apresentou inflação de 0,17%, influenciado pela alta em itens de higiene pessoal e plano de saúde.

10.1.2-MENOR ALTA DE PREÇOS

O grupo que apresentou impacto negativo no IPCA foi o grupo TRANSPORTES, cujo índice apresentou deflação de -0,72% do IPCA, influenciado pela queda dos preços dos combustíveis.

10.1.3-ALIMENTAÇÃO E BEBIDAS ¹

No mês de julho, o grupo ALIMENTAÇÃO E BEBIDAS apresentou inflação de 0,04%, um recuo em relação ao mês anterior (julho/2022 = 0,28%). Os três produtos do grupo, com a maior alta de preços foram a Cebola (5,12% a.m. e 47,17% a.a.), o Leite em pó (4,55% a.m. e 18,44% a.a.) e o Frango em pedaços (2,87% a.m. e 6,32% a.a.). Os três produtos do grupo, com a maior queda de preços foram o Tomate (-11,25% a.m. e -25,15% a.a.), a Batata-inglesa (-10,07% a.m. e 16,81% a.a.) e a Cenoura (-8,79% a.m. e 12,48% a.a.).

10.1.4-INFLAÇÃO POR REGIÃO

No mês, Vitória - ES foi a capital que apresentou a maior inflação (+0,46%), enquanto Recife - PE apresentou a menor deflação de (-1,40%). No mesmo período, o IPCA registra deflação de -0,36%.

Em 2022, Rio de Janeiro - RJ é a capital que apresenta a maior inflação (5,62%), enquanto Porto Alegre - RS apresenta inflação de 2,31%. No mesmo período, o IPCA registra alta de 4,39%.

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 agosto foi marcado por uma desaceleração econômica global, visando conter a inflação, o que impactou os preços das commodities diante de uma menor demanda nos últimos meses. Uma situação favorável das commodities apontam uma possível mudança na composição da inflação de países com menor inflação de bens, contudo, países que possuem aperto no mercado de trabalho podem não apresentar desinflação nos preços de serviços. Com isso, o controle da inflação continua sendo um assunto constante e demandando o contínuo aperto monetário em economias desenvolvidas, o que impacta os preços dos ativos. Nos EUA, o Federal Reserve (FED) voltou a prometer esforços maiores em busca da diminuição da inflação, apontando que uma desaceleração econômica e até o começo de uma recessão, não irá evitar o aperto monetário. Na China, a desaceleração econômica se mostra ainda presente. Os indicadores sobre atividade econômica apresentaram dados sutis, principalmente sobre contratação de crédito, crescimento da produção industrial e varejo. No que diz respeito a demanda, a economia ainda mostra os impactos sofridos nos choques das atividades econômicas causados pelos lockdowns visando a contenção da COVID-19 e que ainda seguem vigentes no país. No lado da oferta, o setor industrial enfrenta um período de restrições na disponibilidade energética perante as condições climáticas, enquanto o setor imobiliário passa por um período de volatilidade provocado pelo atraso de pagamento de empréstimos imobiliários. Afim de frear os choques econômicos, a China aumentou os estímulos na economia apesar de prometerem efeitos moderados nos próximos meses. Na zona do Euro, a desaceleração econômica e a inflação seguem causando preocupações. A falta de abastecimento energético continua se intensificando, principalmente com o limitado fornecimento de gás pela Rússia, causando inseguranças em empresários e consumidores em relação ao fornecimento de energia. A Europa segue com o consenso de um modelo mais rígido contra a inflação dependendo do quadro de crescimento. Na América Latina, a persistência das pressões inflacionárias dificulta o encerramento do ciclo de alta dos juros mesmo diante da resistência da atividade econômica.

BRASIL

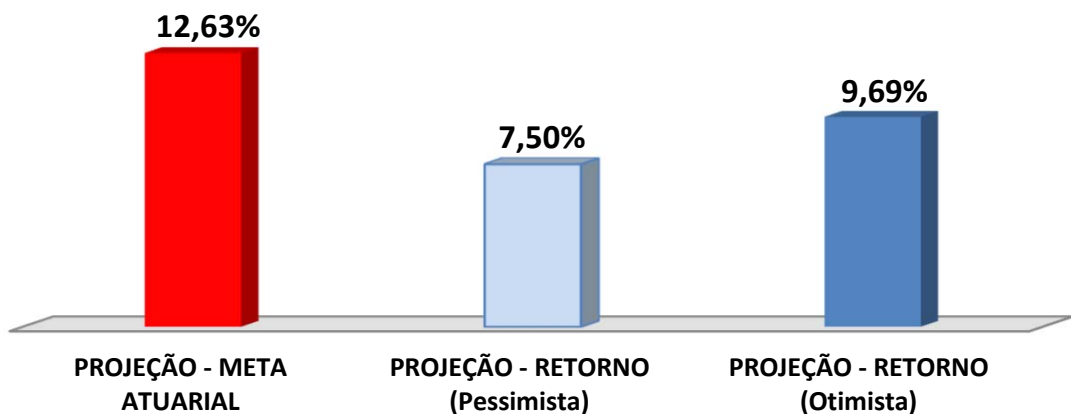
O 3º trimestre se mantém estável apesar de apresentar uma perda de tração. A atividade econômica demonstrou um melhor desempenho tendo em vista o aumento de renda disponível resultante da diminuição de impostos sobre bens de consumos e serviços essenciais, o que ajudou a frear uma alta de juros na economia. A desoneração de ICMS sobre bens de consumo e serviços duráveis e de PIS/Cofins sobre combustíveis, junto a diminuição dos valores de algumas commodities, causaram uma onda de baixa sobre as projeções de inflação. Em contrapartida, houve diminuição das pressões sobre bens de consumo duráveis. Quanto as projeções para o crescimento, a economia apresenta um desempenho satisfatório levando em consideração os dados analisados do PIB para uma forte dinâmica dos investimentos e do setor privado.

11-PROJEÇÃO DA META ATUARIAL E RENTABILIDADE DA CARTEIRA

Conforme o último Boletim FOCUS, emitido pelo Banco Central em 26/08/2022, a inflação projetada para o final do ano deverá ficar em 7,11% e a Meta Atuarial aproximadamente em 12,63%.

Se não tivermos grandes oscilações no mercado e a distribuição permanecer nos mesmos índices, conforme demonstra a página 18, a carteira deverá rentabilizar entre 7,50% a 9,69% 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 3.922/10**, alterada pela **Resolução CMN 4.695/2018**, 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