

2022

Relatório Mensal

Outubro

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, ítem 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.612.502,08	4,34%	6.033.726.634,06	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.028.114,26	1,23%	4.086.335.709,28	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	528.443,36	0,63%	470.754.249,93	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	12.924.542,17	15,52%	5.839.461.409,01	0,22%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.798.805,58	11,77%	8.108.886.938,29	0,12%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.543.031,38	10,26%	8.449.071.998,91	0,10%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.043.062,48	12,06%	3.862.167.779,60	0,26%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.658.326,14	8,00%	5.646.338.902,14	0,12%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.471.325,14	5,37%	18.643.982.158,94	0,02%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	3.792.617,65	4,56%	1.288.130.355,76	0,29%	7º I b
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	3.766.866,00	4,52%	29.823.149.034,12	0,01%	7º I b
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	813.050,86	0,98%	1.200.224.364,33	0,07%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	160.512,24	0,19%	3.859.205.707,52	0,00%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.781.777,16	4,54%	12.427.649.222,70	0,03%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.304.999,38	6,37%	2.434.245.468,97	0,22%	7º III a
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	165.863,04	0,20%	30.845.683,20	0,54%	7º V a
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.093.468,73	1,31%	408.163.973,06	0,27%	8º I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	513.764,34	0,62%	1.488.244.493,95	0,03%	8º I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	953.606,79	1,15%	550.028.095,85	0,17%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	585.344,20	0,70%	596.240.734,23	0,10%	8º I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	330.885,40	0,40%	319.850.216,92	0,10%	8º I
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	416.760,57	0,50%	1.303.301.919,08	0,03%	9º III
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	1.722.511,50	2,07%	31.312.996,26	5,50%	10º I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	840.103,25	1,01%	1.767.351.817,15	0,05%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	749.941,04	0,90%	1.273.842.064,19	0,06%	10º I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	649.712,12	0,78%	135.567.993,01	0,48%	11º

Investimentos

\$ 83.249.936,86

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 83.249.936,86

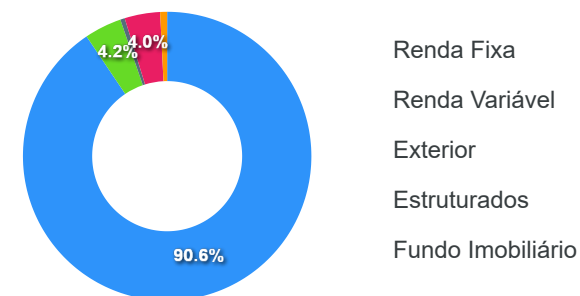
Governança (Pró Gestão)
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	79,26%	17.269.249,76
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	11,11%	40.702.673,34
7º V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	0,20%	3.996.633,80
8º I - Fundos de Ações	30,00%	4,18%	21.497.911,60
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,50%	7.908.233,12
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	3,98%	5.012.437,90
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,78%	3.512.784,72

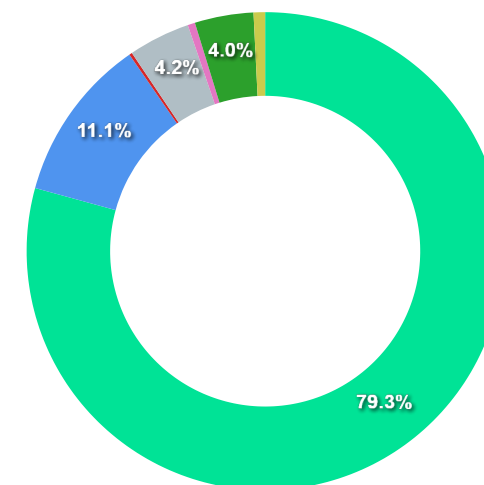
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



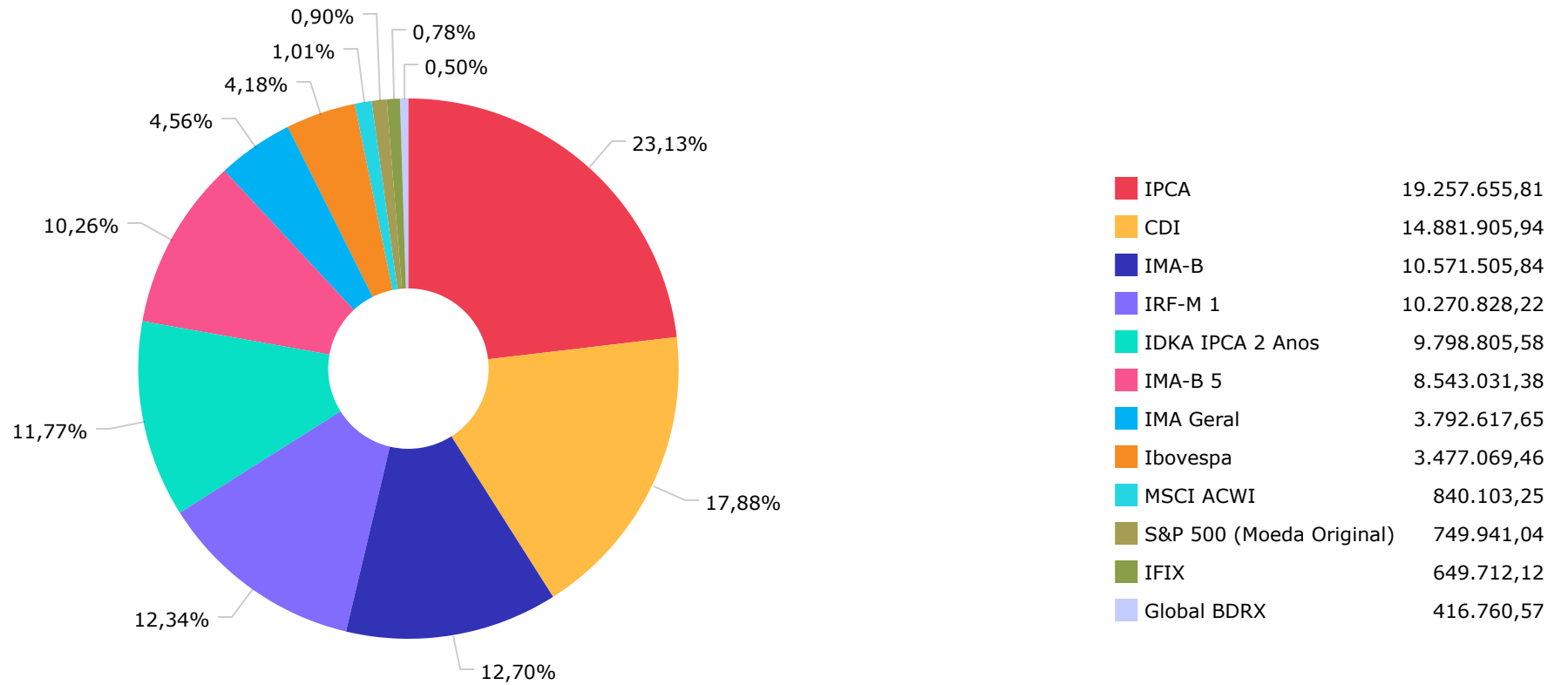
Artigos

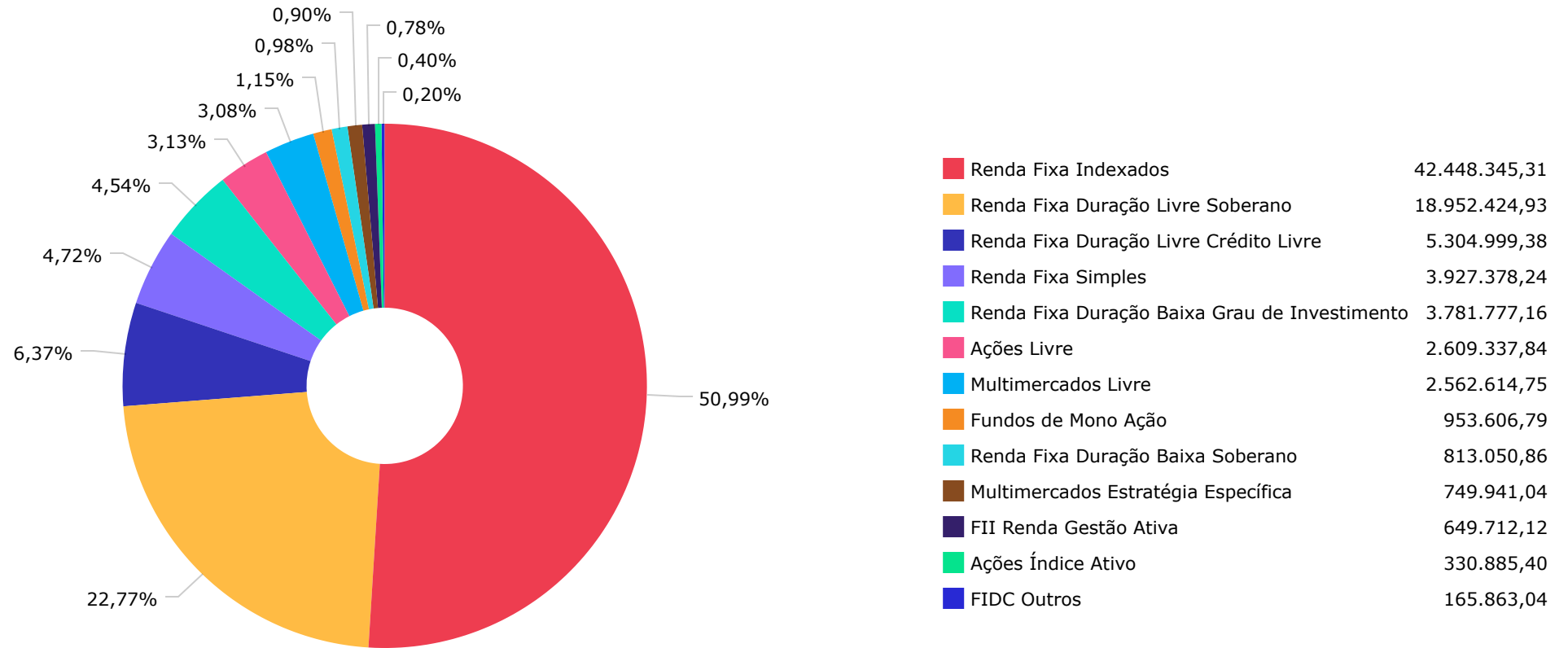


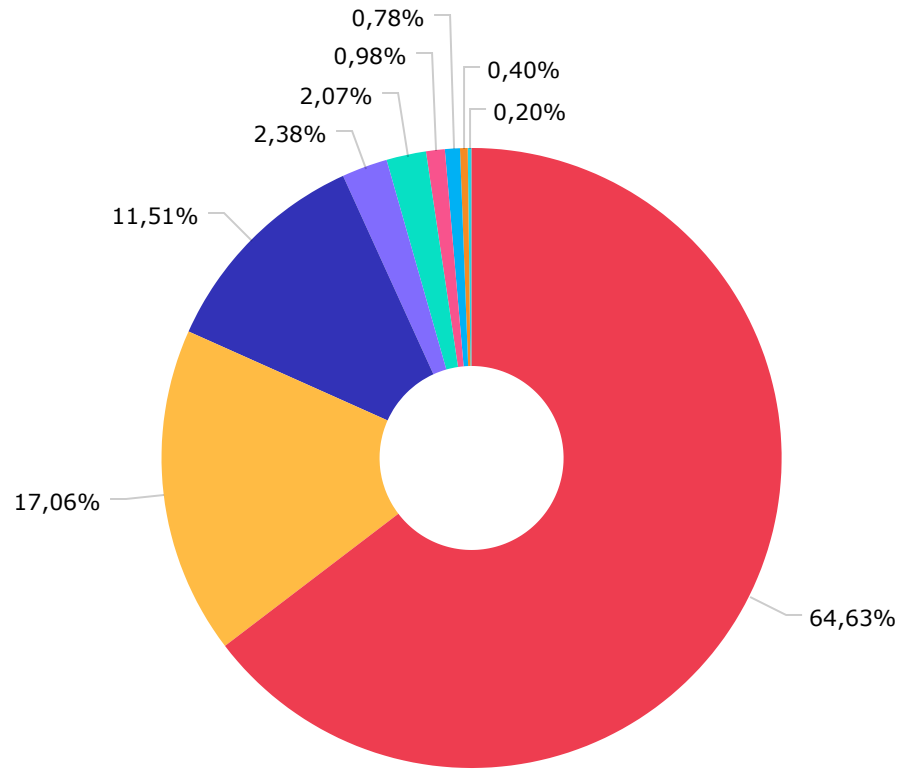
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	18,76%	59,24%	49.317.262,60	8° I - Fundos de Ações	4,18%	11,21%	12,70%	20,00%	13.172.917,91
7° I b - FI 100% Títulos TN	79,26%	14,45%	18,76%	59,24%	-16.663.424,50	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	2,24%	20,00%	16.649.987,37
7° III a - FI Referenciados RF	11,11%	12,94%	17,26%	50,00%	32.377.679,65	9° III - Ações - BDR Nível I	0,50%	3,75%	5,00%	10,00%	7.908.233,12
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	17,26%	20,00%	16.649.987,37	10° I - Fundos Multimercados	3,98%	2,09%	2,78%	10,00%	5.012.437,90
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,20%	0,00%	0,63%	0,63%	358.611,56	11° - Fundos Imobiliários	0,78%	0,00%	0,83%	3,00%	1.847.785,99
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	2,78%	5,00%	4.162.496,84	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.162.496,84

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20		
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,04	10,21	3,35	6,62	11,79	15,78	0,01	0,01
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,01	10,13	3,32	6,57	11,65	15,31	0,02	0,03
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,03	10,02	3,30	6,52	11,51	15,17	0,00	0,01
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,03	10,00	3,31	6,55	11,48	15,19	0,00	0,01
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	1,02	9,87	3,28	6,38	11,47	14,50	0,16	0,34
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,95	9,10	3,06	6,00	10,39	12,85	0,00	0,01
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,42	-59,89	-1,56	-59,70	-60,22	-62,34	0,32	0,68
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	1,33	-29,86	-9,99	-6,55	-29,14	-2,97		
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,41	-26,12	-6,13	-2,40	-24,89	1,39	14,96	31,51
IBOVESPA - BENCHMARK	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51		
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3,18	8,92	9,09	5,69	10,41	19,46	14,31	30,15
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	5,81	9,23	14,83	10,37	8,42	12,60	13,32	28,05
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4,36	6,11	9,95	3,47	8,25	28,30	14,66	30,86
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	6,95	7,34	13,29	7,65	4,78	9,46	14,54	30,62
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	15,84		8,60				21,37	45,00
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,83	8,48	2,24	3,04	11,90	16,82	0,85	1,79
IMA GERAL - BENCHMARK	1,01	8,88	3,72	5,61	11,80	12,98		
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	1,90	8,97	2,31	3,42	12,54	17,26	0,75	1,58
IMA-B - BENCHMARK	1,23	7,43	3,86	3,57	11,40	13,44		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18	7,34	3,92	3,56	11,26	13,01	1,58	3,33

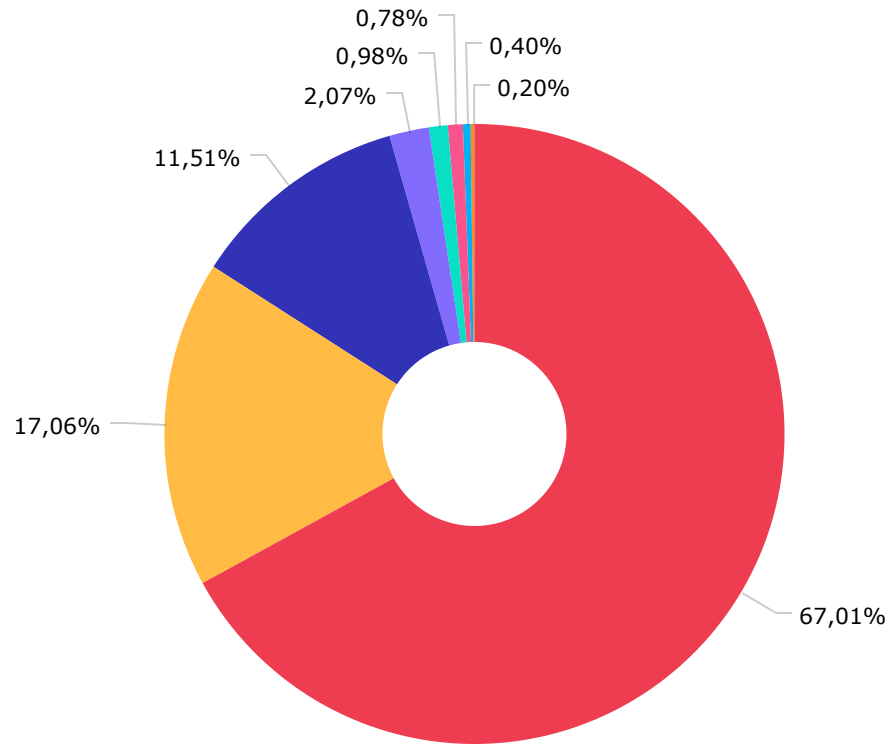
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,89	2,29	-0,63	0,15	5,95	4,16	0,85	1,80
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,91	9,12	2,35	3,50	12,73	17,73		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,88	9,05	2,36	3,51	12,60	17,31	0,75	1,57
IPCA - BENCHMARK	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,88	9,36	3,05	5,73	12,11	14,66	1,08	2,28
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,99	9,36	3,75	5,92	11,26	11,59	0,47	0,98
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,24		2,18	-0,23			0,53	1,12
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,00	9,68	3,38	6,44	11,52	13,50		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,98	9,45	3,32	6,31	11,24	12,97	0,03	0,07
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98	9,45	3,31	6,32	11,23	12,92	0,04	0,07
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	7,99	-18,76	-6,25	-6,29	-15,92	18,41		
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	8,72	-12,75	-3,84	-1,45	-8,38	32,25	13,17	27,73
MSCI ACWI - BENCHMARK	3,03	-26,82	-6,84	-4,13	-26,70	-3,07		
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8,77	-12,72	-3,83	-1,40	-8,31	32,33	13,19	27,78
IFIX - BENCHMARK	0,02	6,66	6,30	6,34	11,80	8,12		
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-5,01	36,82	-17,43	-0,79	48,63	-4,05	16,51	34,76







CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	53.807.639,50
ITAU UNIBANCO S.A.	14.199.768,27
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	9.578.785,12
CAIXA DTVM	1.981.721,05
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	1.722.511,50
CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ...	813.050,86
ZION GESTÃO DE RECURSOS LTDA	649.712,12
PLURAL INVESTIMENTOS GESTAO DE...	330.885,40
PETRA CAPITAL GESTAO DE INVEST...	165.863,04



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	55.789.360,55
ITAU UNIBANCO S.A.	14.199.768,27
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	9.578.785,12
BANCO BRADESCO S.A.	1.722.511,50
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	813.050,86
PLANNER CORRETORA DE VALORES S...	649.712,12
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	330.885,40
FINAXIS CORRETORA DE TITULOS E...	165.863,04

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	69.072.196,57	900.000,00	0,00	70.010.581,28	38.384,71	38.384,71	0,05% ▲	0,05%	0,95%	0,95%	5,26%	1,51%
Fevereiro	70.010.581,28	948.816,37	14.222,66	71.532.083,48	586.908,49	625.293,20	0,83% ▲	0,88%	1,39%	2,35%	37,45%	1,46%
Março	71.532.083,48	2.185.127,47	600.000,00	74.659.538,89	1.542.327,94	2.167.621,14	2,11% ▲	3,01%	2,06%	4,46%	67,49%	1,79%
Abril	74.659.538,89	0,00	0,00	74.912.801,28	253.262,39	2.420.883,53	0,34% ▲	3,36%	1,44%	5,96%	56,38%	0,94%
Mai	74.912.801,28	1.503.285,72	1.000.000,00	76.046.513,18	630.426,18	3.051.309,71	0,84% ▲	4,22%	0,90%	6,91%	61,07%	2,23%
Junho	76.046.513,18	1.401.139,96	0,00	77.353.855,61	-93.797,53	2.957.512,18	-0,12% ▼	4,10%	1,08%	8,07%	50,81%	1,76%
Julho	77.353.855,61	0,00	0,00	77.971.708,39	617.852,78	3.575.364,96	0,80% ▲	4,93%	-0,27%	7,78%	63,37%	1,69%
Agosto	77.971.708,39	1.438.066,45	170.000,00	79.826.715,06	586.940,22	4.162.305,18	0,74% ▲	5,71%	0,09%	7,87%	72,55%	1,76%
Setembro	79.826.715,06	562.823,33	0,00	80.864.858,12	475.319,73	4.637.624,91	0,59% ▲	6,33%	0,12%	8,00%	79,13%	1,74%
Outubro	80.864.858,12	1.063.713,66	0,00	83.249.936,86	1.321.365,08	5.958.989,99	1,61% ▲	8,05%	0,98%	9,06%	88,85%	1,70%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	2.167.621,14	3,01%	4,46%
2º Trim	789.891,04	1,06%	3,46%
1º Sem	2.957.512,18	4,10%	8,07%
3º Trim	1.680.112,73	2,15%	-0,07%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

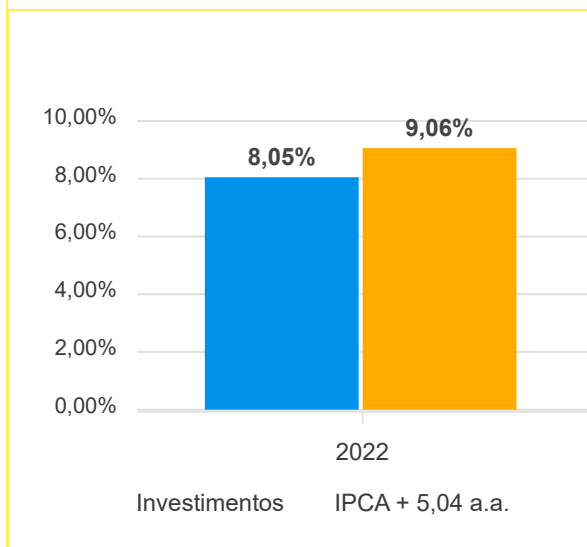


Gráfico Risco x Retorno

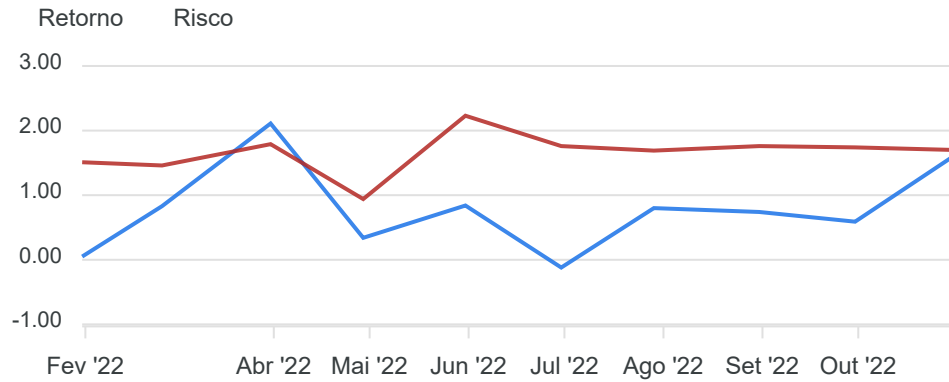
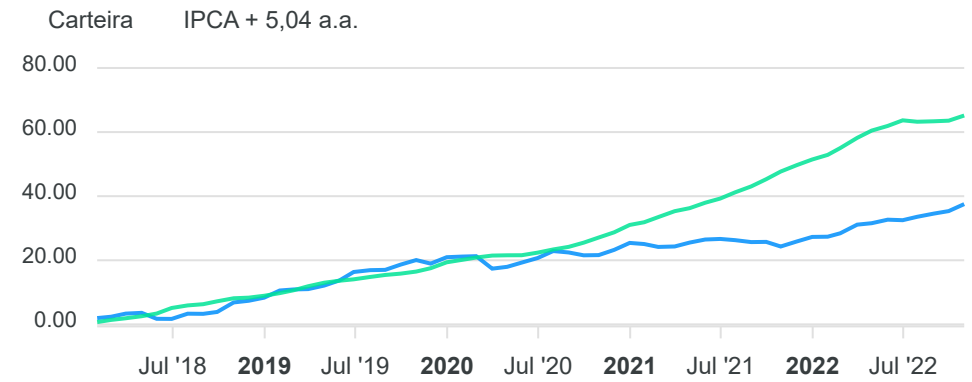
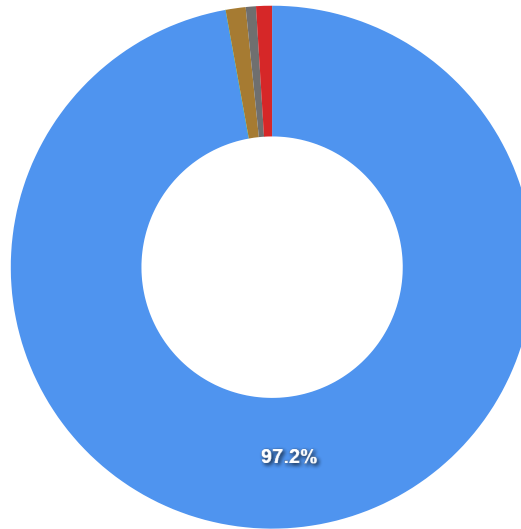


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/10/2022

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	80.877.804,08	97,15
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	1.028.114,26	1,23
Até D+720	528.443,36	0,63
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	815.575,16	0,98



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	159.001,26	0,00	0,00	160.512,24	1.510,98	0,95% ▲	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.577.308,14	0,00	0,00	3.612.502,08	35.193,94	0,98% ▲	0,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.742.884,77	0,00	0,00	3.781.777,16	38.892,39	1,04% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.005.620,61	0,00	0,00	1.028.114,26	22.493,65	2,24% ▲	0,53%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	518.634,47	0,00	0,00	528.443,36	9.808,89	1,89% ▲	0,85%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	12.798.359,54	0,00	0,00	12.924.542,17	126.182,63	0,99% ▲	0,47%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.622.705,40	0,00	0,00	9.798.805,58	176.100,18	1,83% ▲	0,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.385.765,23	0,00	0,00	8.543.031,38	157.266,15	1,88% ▲	0,75%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.926.036,68	0,00	0,00	10.043.062,48	117.025,80	1,18% ▲	1,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.430.382,97	163.713,66	0,00	6.658.326,14	64.229,51	0,97% ▲	0,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.426.483,07	0,00	0,00	4.471.325,14	44.842,07	1,01% ▲	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.258.752,69	0,00	0,00	5.304.999,38	46.246,69	0,88% ▲	1,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	3.225.344,33	500.000,00	0,00	3.792.617,65	67.273,32	1,81% ▲	0,75%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	3.728.443,23	0,00	0,00	3.766.866,00	38.422,77	1,03% ▲	0,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	166.564,80	0,00	0,00	165.863,04	-701,76	-0,42% ▼	0,32%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	406.826,65	400.000,00	0,00	813.050,86	6.224,21	0,77% ▲	0,00%
	73.379.113,84	1.063.713,66	0,00	75.393.838,92	951.011,42	1,28%	0,62%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.059.727,70	0,00	0,00	1.093.468,73	33.741,03	3,18% ▲	14,31%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	492.295,72	0,00	0,00	513.764,34	21.468,62	4,36% ▲	14,66%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	823.196,85	0,00	0,00	953.606,79	130.409,94	15,84% ▲	21,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	547.326,58	0,00	0,00	585.344,20	38.017,62	6,95% ▲	14,54%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	312.726,22	0,00	0,00	330.885,40	18.159,18	5,81% ▲	13,32%
-	3.235.273,07	0,00	0,00	3.477.069,46	241.796,39	7,47%	16,24%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRABESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	1.705.177,53	0,00	0,00	1.722.511,50	17.333,97	1,02% ▲	0,16%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	772.349,00	0,00	0,00	840.103,25	67.754,25	8,77% ▲	13,19%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	689.791,68	0,00	0,00	749.941,04	60.149,36	8,72% ▲	13,17%
-	3.167.318,21	0,00	0,00	3.312.555,79	145.237,58	4,59%	6,41%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	683.997,72	0,00	0,00	649.712,12	-34.285,60	-5,01% ▼	16,51%
-	683.997,72	0,00	0,00	649.712,12	-34.285,60	-5,01%	16,51%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	399.155,28	0,00	0,00	416.760,57	17.605,29	4,41% ▲	14,96%
	399.155,28	0,00	0,00	416.760,57	17.605,29	4,41%	0,00%

Cenário Econômico

Se o mês de setembro não foi fácil para a rentabilidade dos investimentos, o mesmo não podemos falar de outubro. No geral todas as estratégias experimentaram bons resultados, e para aqueles que possuíam carteiras bem diversificadas, apresentaram forte rentabilidade. Na renda fixa os fundos foram beneficiados pelo fechamento da curva de juros, na renda variável os fundos ligados a índices IBOVESPA subiram mais 5% e no acumulado do ano está muito próximo das metas atuárias. Por fim, os ativos ligados a índices no exterior, que vinham amargando resultados ruins nos últimos meses, tiveram bons resultados no mês.

A inflação segue como destaque, e começando pelo Brasil, o IPCA fechou pelo terceiro mês consecutivo no negativo, fato que não ocorria desde 1998. Os resultados ainda seguem impactados pela redução dos preços dos combustíveis, energia e telecomunicações. Por outro lado, alguns pontos chamam a atenção, já que suprindo esses itens, os dados ainda apresentam boa alta, como é o caso dos alimentos, que apresentam a maior inflação acumulada nos nove primeiros meses do ano desde o início do plano real. Com a estabilização dos preços dos combustíveis, para o mês de outubro os dados do IPCA-15 divulgado, apontam para o fim da série de deflação.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2022. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2022 ainda não foram integralmente atingidos.

Rentabilidade e Risco (por ativo)

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados.

Distribuição por Benchmarks

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Distribuição por Classificação ANBIMA

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

Distribuição por Gestoras e Administradoras

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

A rentabilidade consolidada da carteira no período continua demonstrando recuperação, apesar da atenção dos investidores locais ter ficado voltada para a disputa eleitoral. Todos os segmentos apresentaram bons retornos, sendo que o investimento em fundos de ações foi o principal destaque de outubro. Além do mercado de ações, a renda fixa também se destacou em outubro - efeito da taxa Selic a 13,75% ao ano.

Retorno dos Fundos de Investimentos

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2022, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos..

Rio de Janeiro, 7 de novembro de 2022.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

