

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

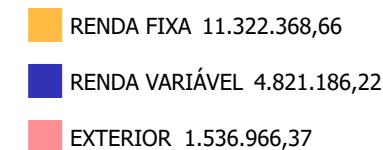
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	600.255,23	3,40%	389	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	454.579,11	2,57%	520	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	607.899,72	3,44%	1.050	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	119.326,78	0,67%	796	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	85.686,55	0,48%	575	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	584.385,88	3,31%	1.087	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	823.328,03	4,66%	461	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	773.225,17	4,37%	336	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	502.183,57	2,84%	97	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	560.865,02	3,17%	269	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.514.702,32	8,57%	3.243	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	265.879,01	1,50%	52.408	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	35.646,71	0,20%	868	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.405.319,97	7,95%	1.028	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	620.676,39	3,51%	241	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	811.961,10	4,59%	194	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.040.050,48	5,88%	84	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 du	Não há	516.397,62	2,92%	46.671	0,03%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	115.758,25	0,65%	29.074	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	697.671,57	3,95%	1.898	0,07%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	461.527,07	2,61%	3.616	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	482.629,63	2,73%	6.275	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	715.465,37	4,05%	25.273	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	145.441,46	0,82%	12.871	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	38.004,33	0,21%	232	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	505.988,80	2,86%	81	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	131.106,59	0,74%	15.302	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	822.034,47	4,65%	157	0,06%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	342.125,16	1,94%	21.090	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	372.806,74	2,11%	2.992	0,28%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	138.626,10	0,78%	98	0,12%	Artigo 10º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	447.806,31	2,53%	183	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	714.844,37	4,04%	53.451	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	226.316,37	1,28%	887	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			17.680.521,25				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2022)

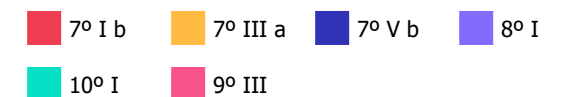
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	18,00%	59,24%	10.473.940,79
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	6.626.437,38	37,48%	13,87%	28,00%	59,24%	3.847.503,41
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	4.179.533,66	23,64%	12,66%	16,88%	50,00%	4.660.726,97
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	6,88%	20,00%	3.536.104,25
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	516.397,62	2,92%	0,00%	2,78%	5,00%	367.628,44
Total Renda Fixa	100,00%	11.322.368,66	64,04%	26,53%	72,54%	193,48%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3.293.593,07	18,63%	11,21%	15,89%	20,00%	242.511,18
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,80%	20,00%	3.536.104,25
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.527.593,15	8,64%	2,09%	3,77%	10,00%	240.458,98
Total Renda Variável	30,00%	4.821.186,22	27,27%	13,30%	22,46%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.536.966,37	8,69%	3,75%	5,00%	10,00%	231.085,76
Total Exterior	10,00%	1.536.966,37	8,69%	3,75%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.902.510,51	67,32	-
ITAÚ UNIBANCO	3.126.234,41	17,68	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	2.031.099,94	11,49	0,02
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	620.676,39	3,51	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	59,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	6.626.437,38	37,48	13,87	59,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	4.179.533,66	23,64	12,66	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	516.397,62	2,92	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	3.293.593,07	18,63	11,21	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	1.536.966,37	8,69	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.527.593,15	8,64	2,09	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,62%	6,94%	0,09%	2,94%	8,91%	15,68%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	6,74%	0,26%	2,81%	8,72%	15,30%	1,42%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,11%	8,59%	3,43%	6,17%	9,81%	12,55%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	8,39%	3,37%	6,02%	9,57%	11,94%	0,13%	0,02%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,42%	7,07%	0,43%	3,14%	9,25%	15,75%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,40%	6,90%	0,40%	3,05%	8,97%	15,18%	1,27%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	-	-0,02%	2,35%	-	-	1,46%	-
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,46%	6,65%	0,55%	3,07%	8,60%	13,91%	1,19%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	1,48%	6,12%	1,70%	3,16%	7,25%	12,30%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45%	5,92%	1,63%	3,07%	6,95%	11,76%	2,43%	0,06%
IRF-M (Benchmark)	1,40%	6,96%	4,66%	5,53%	8,01%	6,91%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,38%	6,84%	4,63%	5,48%	7,83%	6,48%	1,56%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,99%	8,08%	3,06%	5,77%	9,78%	11,85%	0,00%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,09%	9,08%	3,35%	6,35%	11,18%	14,77%	0,02%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,24%	6,69%	2,87%	4,60%	7,75%	9,64%	1,12%	0,03%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,06%	-	3,01%	6,71%	-	-	0,34%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,08%	8,93%	2,85%	5,92%	11,31%	16,36%	0,52%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1,19%	9,83%	3,25%	6,60%	12,90%	-	0,36%	0,01%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,18%	9,95%	3,60%	6,91%	12,40%	18,49%	0,03%	0,01%
IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,26%	7,50%	3,07%	5,15%	9,00%	12,03%	1,12%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	-	0,44%	-	-	-	2,06%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	7,15%	0,02%	3,11%	8,79%	15,18%	0,75%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,53%	8,40%	2,97%	5,62%	10,74%	13,75%	2,07%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	-9,34%	-24,77%	-5,28%	-20,85%	-16,76%	6,62%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-8,03%	-20,16%	-2,85%	-17,28%	-10,39%	15,59%	11,08%	0,22%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-8,62%	-19,75%	-2,62%	-17,18%	-9,30%	18,63%	11,67%	0,22%
Ibovespa (Benchmark)	0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,23%	3,44%	11,20%	-8,87%	-2,48%	12,62%	11,10%	0,22%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-0,82%	4,29%	9,27%	-7,40%	-2,92%	20,36%	9,88%	0,20%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,34%	-1,51%	7,67%	-9,41%	-4,02%	24,18%	10,89%	0,20%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,36%	1,67%	9,61%	-8,81%	-1,48%	22,12%	11,01%	0,21%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-1,60%	2,44%	11,81%	-8,69%	-	-	10,15%	0,22%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,36%	6,13%	7,62%	-8,09%	5,72%	23,10%	9,98%	0,19%
SMLL (Benchmark)	-1,84%	-8,06%	14,47%	-13,82%	-18,43%	-5,58%	-	-
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-1,70%	-7,67%	14,32%	-14,39%	-18,76%	-9,54%	12,45%	0,29%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-1,28%	-3,00%	13,28%	-10,06%	-12,71%	6,31%	9,61%	0,25%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,24%	8,76%	3,65%	5,75%	10,85%	14,76%	0,40%	0,01%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,04%	8,05%	2,81%	4,58%	10,11%	11,71%	0,68%	0,02%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,81%	9,18%	3,44%	5,42%	10,60%	14,70%	0,65%	0,02%



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

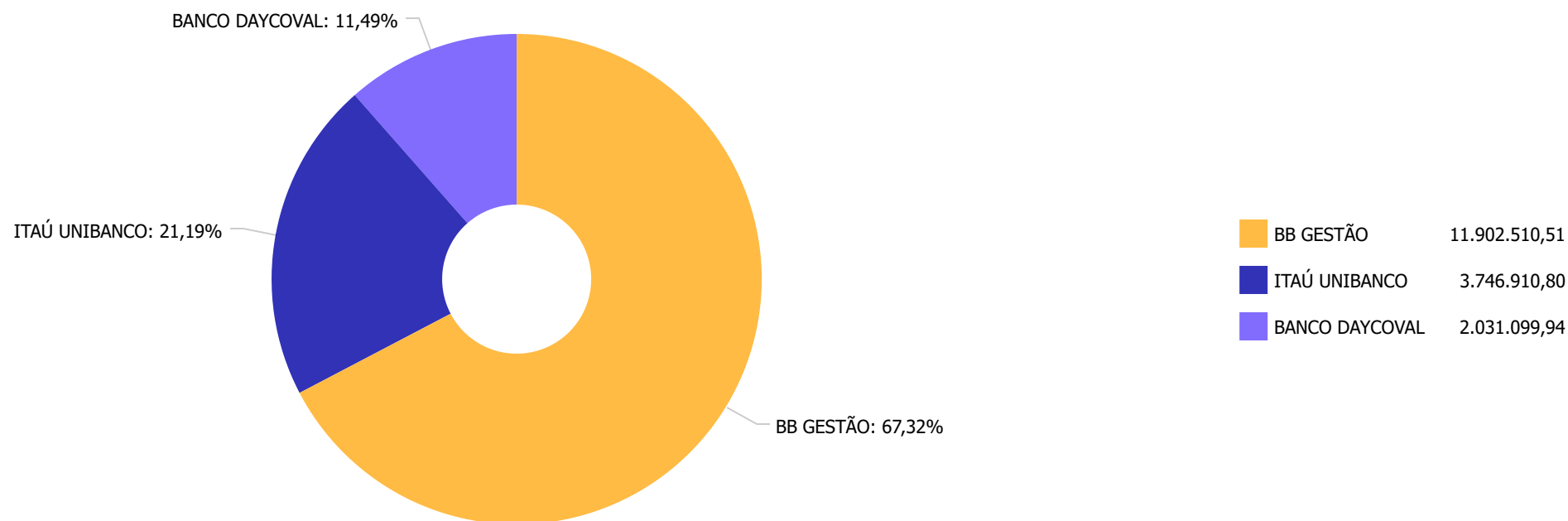
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,18%	9,95%	3,60%	6,91%	12,40%	18,49%	0,03%	0,01%



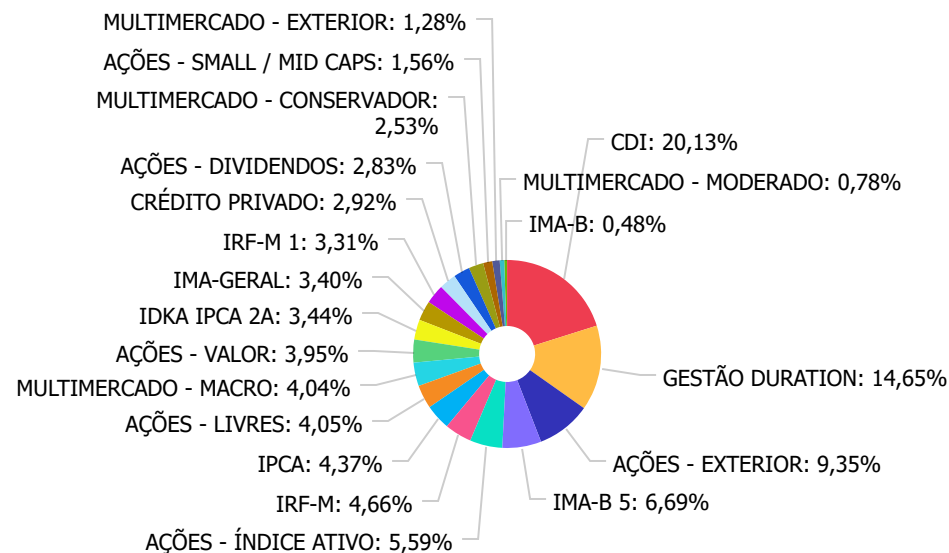
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-8,38%	-30,78%	-4,37%	-14,20%	-22,27%	-5,91%	-	-
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,33%	-29,24%	-3,06%	-12,36%	-20,40%	-4,58%	9,65%	0,21%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,25%	-21,11%	14,89%	-12,17%	-28,37%	-17,30%	8,82%	0,23%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,63%	-21,27%	-4,53%	-8,92%	-13,80%	8,07%	8,21%	0,17%

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



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

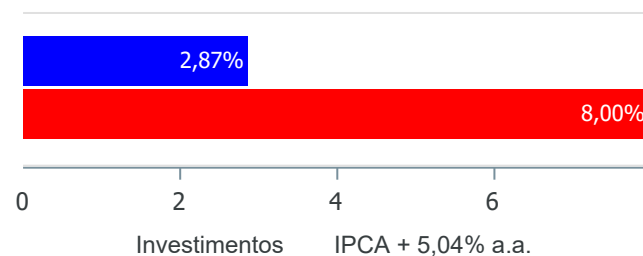


■ CDI	3.558.857,27	■ GESTÃO DURATION	2.589.957,82	■ AÇÕES - EXTERIOR	1.652.724,62
■ IMA-B 5	1.182.375,37	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	988.618,43	■ IRF-M	823.328,03
■ IPCA	773.225,17	■ AÇÕES - LIVRES	715.465,37	■ MULTIMERCADO - MACRO	714.844,37
■ AÇÕES - VALOR	697.671,57	■ IDKA IPCA 2A	607.899,72	■ IMA-GERAL	600.255,23
■ IRF-M 1	584.385,88	■ CRÉDITO PRIVADO	516.397,62	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	499.531,40
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	447.806,31	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	276.548,05	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	226.316,37
■ MULTIMERCADO - MODERADO	138.626,10	■ IMA-B	85.686,55		

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	14.519.410,01	0,00	115.393,89	14.462.684,47	58.668,35	58.668,35	0,40%	0,40%	0,95%	0,95%	42,41%	3,61%
Fevereiro	14.462.684,47	1.038.382,95	628.714,67	14.876.681,66	4.328,91	62.997,26	0,03%	0,43%	1,39%	2,35%	18,43%	2,99%
Março	14.876.681,66	390.258,59	139.115,17	15.459.209,15	331.384,07	394.381,33	2,19%	2,63%	2,06%	4,46%	59,09%	3,75%
Abril	15.459.209,15	2.018.684,19	1.642.811,12	15.572.203,95	-262.878,27	131.503,06	-1,66%	0,93%	1,44%	5,96%	15,61%	3,29%
Mai	15.572.203,95	466.397,72	175.678,90	15.981.812,85	118.890,08	250.393,14	0,75%	1,69%	0,90%	6,91%	24,39%	3,49%
Junho	15.981.812,85	2.325.698,81	2.521.196,50	15.464.824,27	-321.490,89	-71.097,75	-2,01%	-0,36%	1,08%	8,07%	-4,46%	3,12%
Julho	15.464.824,27	5.211.510,57	4.412.699,85	16.592.720,17	329.085,18	257.987,43	2,02%	1,66%	-0,27%	7,78%	21,30%	3,13%
Agosto	16.592.720,17	918.848,36	374.569,96	17.370.587,17	233.588,60	491.576,03	1,36%	3,04%	0,09%	7,87%	38,65%	3,55%
Setembro	17.370.587,17	704.787,01	364.851,86	17.680.521,25	-30.001,07	461.574,96	-0,17%	2,87%	0,12%	8,00%	35,85%	3,56%

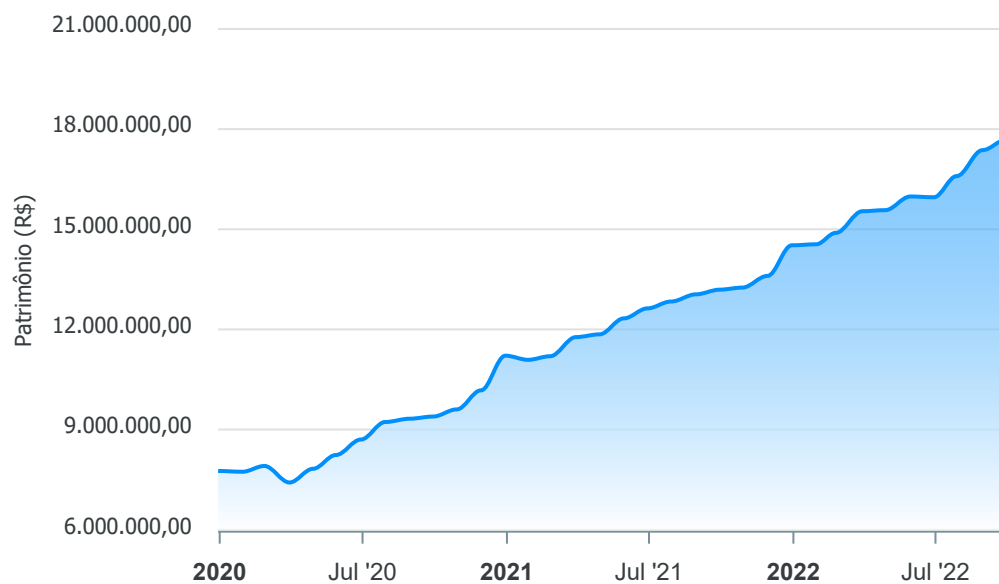
Investimentos x Meta de Rentabilidade



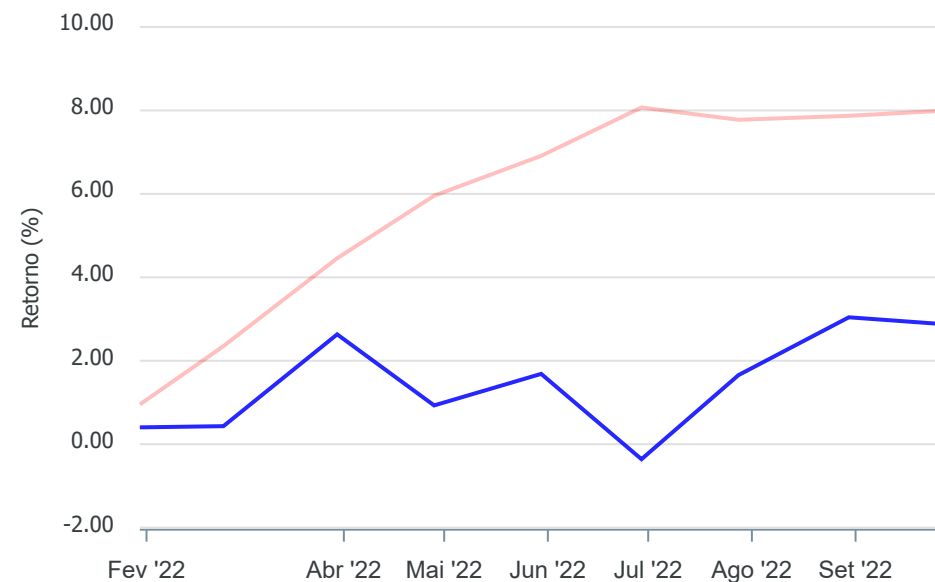
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B

IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1

IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	611.309,59	0,00	0,00	620.676,39	9.366,80	1,53%	1,53%	2,07%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	84.461,48	0,00	0,00	85.686,55	1.225,07	1,45%	1,45%	2,43%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	809.639,65	2.545,76	0,00	823.328,03	11.142,62	1,37%	1,38%	1,56%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	448.945,92	0,00	0,00	454.579,11	5.633,19	1,25%	1,25%	1,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	592.915,84	0,00	0,00	600.255,23	7.339,39	1,24%	1,24%	1,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.027.807,09	0,00	0,00	1.040.050,48	12.243,39	1,19%	1,19%	0,36%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	510.394,61	0,00	0,00	516.397,62	6.003,01	1,18%	1,18%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.427.581,36	118.001,95	156.395,06	1.405.319,97	16.131,72	1,04%	1,09%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	437.043,79	366.816,80	0,00	811.961,10	8.100,51	1,01%	1,08%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	478.568,52	100.000,00	0,00	584.385,88	5.817,36	1,01%	1,09%	0,13%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	173.102,84	90.863,50	0,00	265.879,01	1.912,67	0,72%	1,06%	0,34%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	604.697,65	0,00	0,00	607.899,72	3.202,07	0,53%	0,53%	1,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	558.156,30	0,00	0,00	560.865,02	2.708,72	0,49%	0,49%	1,46%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.507.785,01	0,00	0,00	1.514.702,32	6.917,31	0,46%	0,46%	1,19%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	216.436,49	26.559,00	208.456,80	35.646,71	1.108,02	0,46%	0,99%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	500.023,23	0,00	0,00	502.183,57	2.160,34	0,43%	0,43%	2,06%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	118.850,54	0,00	0,00	119.326,78	476,24	0,40%	0,40%	1,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	772.579,00	0,00	0,00	773.225,17	646,17	0,08%	0,08%	0,75%
Total Renda Fixa	10.880.298,91	704.787,01	364.851,86	11.322.368,66	102.134,60	0,91%		0,90%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	442.341,02	0,00	0,00	447.806,31	5.465,29	1,24%	1,24%	0,40%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	137.195,16	0,00	0,00	138.626,10	1.430,94	1,04%	1,04%	0,68%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	709.089,71	0,00	0,00	714.844,37	5.754,66	0,81%	0,81%	0,65%
BB IBOVSPA ATIVO FIC AÇÕES	481.533,10	0,00	0,00	482.629,63	1.096,53	0,23%	0,23%	11,10%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	718.016,22	0,00	0,00	715.465,37	-2.550,85	-0,36%	-0,36%	11,01%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	465.341,21	0,00	0,00	461.527,07	-3.814,14	-0,82%	-0,82%	9,88%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	132.811,32	0,00	0,00	131.106,59	-1.704,73	-1,28%	-1,28%	9,61%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	707.132,89	0,00	0,00	697.671,57	-9.461,32	-1,34%	-1,34%	10,89%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	38.529,85	0,00	0,00	38.004,33	-525,52	-1,36%	-1,36%	9,98%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	514.214,95	0,00	0,00	505.988,80	-8.226,15	-1,60%	-1,60%	10,15%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	147.955,89	0,00	0,00	145.441,46	-2.514,43	-1,70%	-1,70%	12,45%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	125.867,47	0,00	0,00	115.758,25	-10.109,22	-8,03%	-8,03%	11,08%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	247.661,95	0,00	0,00	226.316,37	-21.345,58	-8,62%	-8,62%	11,67%
Total Renda Variável	4.867.690,74	0,00	0,00	4.821.186,22	-46.504,52	-0,96%		8,02%



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	350.015,39	0,00	0,00	342.125,16	-7.890,23	-2,25%	-2,25%	8,82%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	395.046,54	0,00	0,00	372.806,74	-22.239,80	-5,63%	-5,63%	8,21%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	877.535,59	0,00	0,00	822.034,47	-55.501,12	-6,32%	-6,32%	9,65%
Total Exterior	1.622.597,52	0,00	0,00	1.536.966,37	-85.631,15	-5,28%		9,12%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.357.737,94	1.219.651,28	1.231.253,26	1.405.319,97	59.184,01	2,30%	3,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.007.351,39	0,00	0,00	1.040.050,48	32.699,09	3,25%	3,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	602.768,44	0,00	0,00	620.676,39	17.907,95	2,97%	2,97%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	583.491,04	0,00	0,00	600.255,23	16.764,19	2,87%	2,87%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	500.000,00	0,00	516.397,62	16.397,62	3,28%	3,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	429.523,76	366.816,80	0,00	811.961,10	15.620,54	1,96%	2,85%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	807.968,45	0,00	823.328,03	15.359,58	1,90%	4,63%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,00	1.500.000,00	0,00	1.514.702,32	14.702,32	0,98%	0,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.146.882,65	0,00	2.705.402,45	454.579,11	13.098,91	0,42%	3,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	571.750,08	0,00	584.385,88	12.635,80	2,21%	3,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	570.000,00	16.244,83	560.865,02	7.109,85	1,25%	-0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	173.321,52	70.594,79	213.206,80	35.646,71	4.937,20	2,02%	3,06%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,00	263.083,80	0,00	265.879,01	2.795,21	1,06%	3,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	500.000,00	0,00	0,00	502.183,57	2.183,57	0,44%	0,44%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	606.306,51	0,00	0,00	607.899,72	1.593,21	0,26%	0,26%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	84.308,90	0,00	0,00	85.686,55	1.377,65	1,63%	1,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	773.070,02	0,00	0,00	773.225,17	155,15	0,02%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.112.094,26	0,00	986.014,33	119.326,78	-6.753,15	-0,61%	0,40%
Total Renda Fixa	10.376.856,43	5.869.865,20	5.152.121,67	11.322.368,66	227.768,70	2,05%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	571.321,22	81.354,00	0,00	715.465,37	62.790,15	9,62%	9,61%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	452.544,83	0,00	0,00	505.988,80	53.443,97	11,81%	11,81%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	434.006,92	0,00	0,00	482.629,63	48.622,71	11,20%	11,20%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	267.250,70	383.926,74	0,00	697.671,57	46.494,13	7,14%	7,67%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	85.416,54	340.000,00	0,00	461.527,07	36.110,53	8,49%	9,27%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	691.071,86	0,00	0,00	714.844,37	23.772,51	3,44%	3,44%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	127.227,93	0,00	0,00	145.441,46	18.213,53	14,32%	14,32%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	432.044,38	0,00	0,00	447.806,31	15.761,93	3,65%	3,65%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	115.737,73	0,00	0,00	131.106,59	15.368,86	13,28%	13,28%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	134.843,21	0,00	0,00	138.626,10	3.782,89	2,81%	2,81%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	35.312,15	0,00	0,00	38.004,33	2.692,18	7,62%	7,62%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	119.152,07	0,00	0,00	115.758,25	-3.393,82	-2,85%	-2,85%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	232.415,66	0,00	0,00	226.316,37	-6.099,29	-2,62%	-2,62%
Total Renda Variável	3.698.345,20	805.280,74	0,00	4.821.186,22	317.560,28	7,05%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	207.434,62	100.000,00	0,00	342.125,16	34.690,54	11,28%	14,89%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	390.483,38	0,00	0,00	372.806,74	-17.676,64	-4,53%	-4,53%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	791.704,64	60.000,00	0,00	822.034,47	-29.670,17	-3,48%	-3,06%
Total Exterior	1.389.622,64	160.000,00	0,00	1.536.966,37	-12.656,27	-0,82%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.