

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS Nº. 010/2022

Este parecer tem por finalidade a análise do comportamento da carteira de investimento do IPREM - Instituto de Previdência Municipal de Pouso Alegre, na competência 10/2022.

Os fundos líquidos obtiveram rentabilidade positiva de R\$ 5.328.031,71, representando 1,39%. Os fundos ilíquidos obtiveram rentabilidade negativa de -R\$ 28.374,41, representando -0,05%. Na carteira total o resultado foi de R\$ 5.299.657,30, representando 1,22%, enquanto a meta atuarial ficou em 0,98%.

Em Outubro, o IPCA acelerou 0,59%, acumulando alta de 4,70% no ano e 6,47% em 12 meses. O ambiente externo se manteve adverso, marcado por elevada volatilidade em um ambiente de inflação alta e persistente, especialmente na Europa e EUA, aperto das condições financeiras nas principais economias, continuidade da Guerra na Ucrânia, com suas consequências sobre o fornecimento de energia para a Europa, e manutenção da política de combate à Covid-19 na China, reforçando a perspectiva iminente de desaceleração do crescimento global nos próximos meses. No âmbito doméstico, o encerramento do período eleitoral diminuiu a aversão ao risco dos investidores, uma vez que a composição do congresso eleito se mostra, a princípio, disposta a prosseguir com reformas e pautas importantes para o país. Além disso, na última reunião, o Copom decidiu manter a taxa básica de juros em 13,75% aa, sinalizando que irá mantê-la por um período prolongado e, se necessário, não hesitará em retomar o ciclo de ajuste. O Ibovespa subiu 5,45%, fechando o mês aos 116 mil pontos. No ano, o índice acumula alta de 11,65%. No decorrer do mês não foram realizadas amortizações.

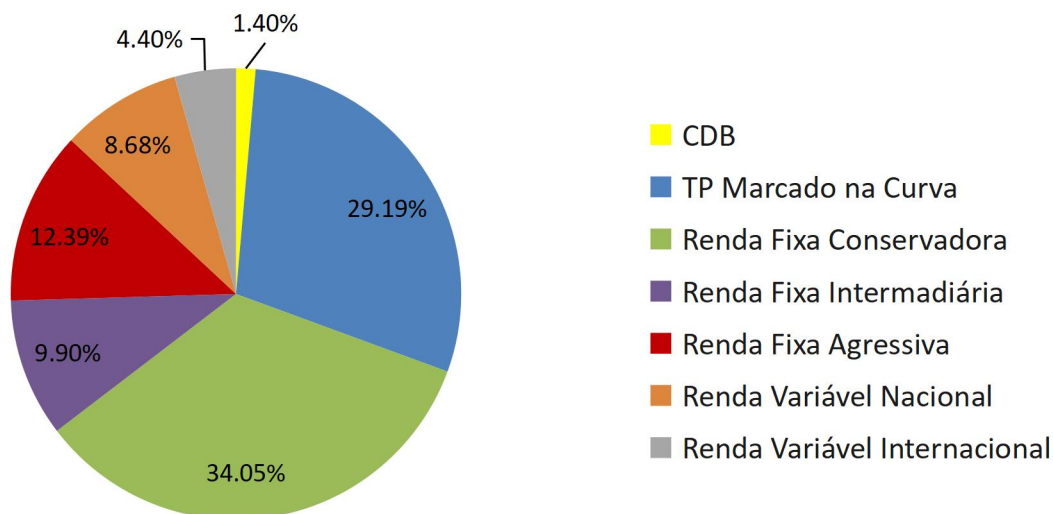
Analisando a rentabilidade dos últimos doze meses, os fundos líquidos acumulam um total de 10,05%, os ilíquidos -25,62% e a carteira total um resultado de 1,83%, frente a meta atuarial de 13,38%. O resultado negativo acumulado dos fundos ilíquidos se deve principalmente à reprecificações significativa que ocorreram.

Quanto ao enquadramento, o IPREM possui percentual de alocação superior ao permitido na Resolução nº 4963/2021 em 6 fundos, como pode ser observado no relatório em anexo. O desenquadramento é referente a aplicação nos fundos ilíquidos e ocorre devido a impossibilidade de resgate.

Conforme demonstrado no gráfico de perfil do investimento, ao final do período o IPREM contava com 1,40% do seu saldo líquido aplicados em CDB, 29,19% em Títulos Públicos Marcados na Curva, 34,05% na classe Renda Fixa Conservadora, 9,90% na classe Renda Fixa Intermediária, 12,39% na classe Renda Fixa Agressiva, 8,68% na classe Renda Variável Nacional e 4,40% na classe Renda Variável Internacional.



Perfil de Investimento



Foi feita análise de risco/retorno das carteiras por perfil de investimento no período de 12 meses. O CDB obteve rentabilidade de 0,60% no mês e 8,67% desde a aplicação. Os Títulos Públicos marcados na Curva obtiveram rentabilidade de 0,53% no mês e 4,20% desde a aplicação.

Na carteira de Renda Fixa Conservadora, os fundos CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES e BRADESCO FEDERAL EXTRA, apresentaram desempenho inferior ao CDI, ambos os fundos são usados para caixa. Em outubro, os fundos ITAÚ IMAB 5, CAIXA BRASIL IMA-B 5 e BB IDKA 2 se destacam com o melhor desempenho, com rentabilidade de 1,90%, 1,88% e 1,85% respectivamente.

Na carteira de Renda Fixa Intermediária, os fundos CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA e BB ALOCAÇÃO ATIVA apresentaram rentabilidade inferior ao índice Imab 5.

Na carteira de Renda Fixa Agressiva, em 12 meses, apenas a NTN-b 2045 apresentou desempenho inferior ao benchmark e a NTN-b 2024 se destaca com o maior retorno e menor volatilidade no período.

Na carteira de Renda Variável Nacional, os fundos CAIXA AÇÕES LIVRE, BB SETOR FINANCEIRO e CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL, apresentaram desempenho superior ao benchmark, no período de 12 meses. Em outubro, o fundo BRADESCO MID SMALL CAPS apresentou o melhor desempenho com rentabilidade de 8,43%.

Na carteira de Renda Variável Internacional, os fundos SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS e BB NORDEA GLOBAL apresentam resultado superior ao benchmark no período de 12 meses.

Os fundos têm sido monitorados em vários períodos temporais, para análise de aderência, rentabilidade e risco.

Face ao exposto e considerando a impossibilidade de resgate dos fundos ilíquidos, consideramos que as aplicações da carteira líquida estão em conformidade com o estabelecido na legislação vigente e na PAI.

Pouso Alegre, 18 de novembro de 2022.

FATIMA
APARECIDA
BELANI:45034800
659

Assinado de forma
digital por FATIMA
APARECIDA
BELANI:45034800659

Fátima A. Belani
Diretora Presidente

JULIANA MARIS
GRACIANO
PARREIRA:
06878012651

Digitally signed by JULIANA MARIS
GRACIANO PARREIRA:06878012651
DN: C=BR, O=ICP-Brasil,
OU=Secretaria da Receita Federal do
Brasil - RFB, OU=RFB e-CPF-A3,
OU=(EM BRANCO),
OU=21545437000180, CN=JULIANA
MARIS GRACIANO PARREIRA:
06878012651

Juliana Máris Graciano Parreira
Diretora de Contabilidade

DANIEL
RIBEIRO
VIEIRA:
07453549639

Assinado digitalmente por DANIEL RIBEIRO
VIEIRA:07453549639
DN: C=BR, O=ICP-Brasil, OU=Secretaria da
Receita Federal do Brasil - RFB, OU=RFB
e-CPF A3, OU=(EM BRANCO),
OU=21545437000180, CN=DANIEL
RIBEIRO VIEIRA:07453549639
Razão: Eu estou aprovando este documento
Localização: Pouso Alegre - MG
Foxit Reader Versão: 10.1.0

Daniel Ribeiro Vieira
Diretor de Finanças e Arrecadação

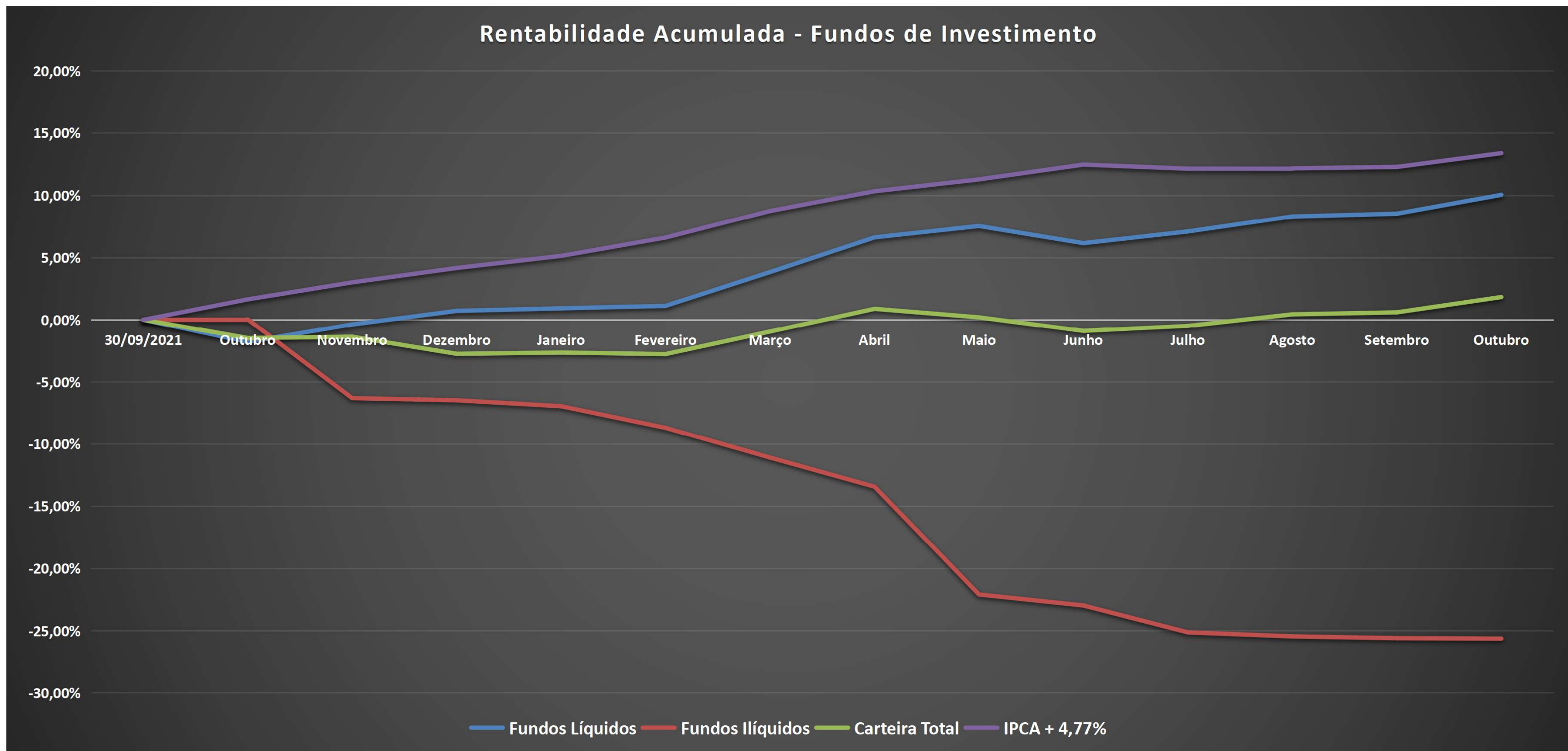
NICHOLAS
FERREIRA DA
SILVA:065720706
38

Assinado de forma digital
por NICHOLAS FERREIRA
DA SILVA:06572070638
Dados: 2022.11.22
12:44:56 -03'00'

Nicholas Ferreira da Silva
Presidente do Conselho Fiscal

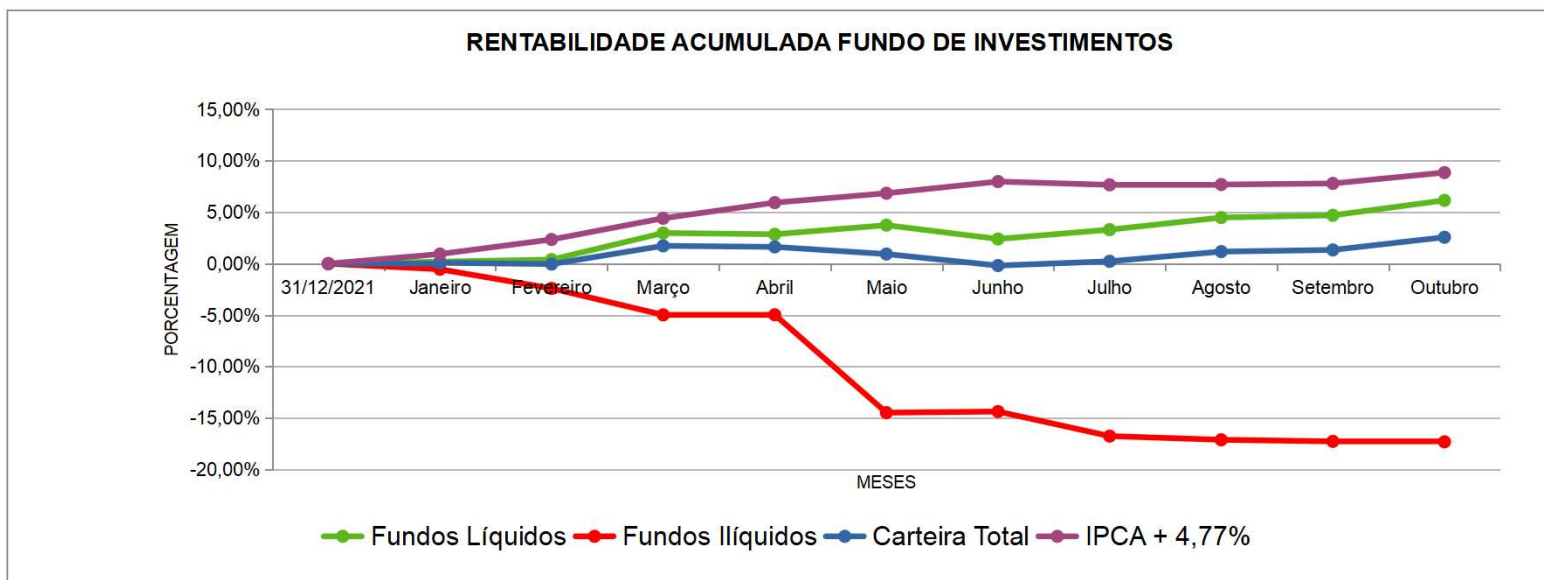


Rentabilidade Acumulada	30/09/2021	Outubro	Novembro	Dezembro	Janeiro	Fevereiro	Marco	Abril	Maiο	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro
Fundos Líquidos	0	-1,79%	-0,38%	0,72%	0,93%	1,12%	3,84%	6,62%	7,54%	6,16%	7,10%	8,32%	8,54%	10,05%
Fundos Ilíquidos	0	0,03%	-6,31%	-6,48%	-6,96%	-8,70%	-11,10%	-13,44%	-22,10%	-22,98%	-25,12%	-25,45%	-25,59%	-25,62%
Carteira Total	0	-1,48%	-1,38%	-2,75%	-2,65%	-2,77%	-0,96%	0,89%	0,20%	-0,90%	-0,49%	0,44%	0,60%	1,83%
IPCA + 4,77%	0	1,64%	3,01%	4,16%	5,13%	6,61%	8,76%	10,34%	11,29%	12,47%	12,14%	12,17%	12,28%	13,38%



EXTRATO CONSOLIDADO OUTUBRO 2022

Rentabilidade Acumulada	31/12/2021	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maió	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro
Fundos Líquidos	0	0,20%	0,39%	2,98%	2,86%	3,74%	2,40%	3,30%	4,48%	4,70%	6,15%
Fundos Ilíquidos	0	-0,54%	-2,41%	-4,97%	-4,97%	-14,48%	-14,37%	-16,75%	-17,11%	-17,27%	-17,31%
Carteira Total	0	0,08%	-0,04%	1,73%	1,63%	0,94%	-0,19%	0,23%	1,17%	1,33%	2,57%
IPCA + 4,77%	0	0,93%	2,35%	4,41%	5,93%	6,84%	7,97%	7,66%	7,69%	7,79%	8,85%



*IPCA + 4,77% MÊS OUTUBRO 2022	0,98%
**IPCA + 4,77% ANO (ACUMULADO)	8,85%
***IPCA + 4,77% 12 MESES	11,55%

FUNDOS LÍQUIDOS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES/AMORTIZAÇÕES	SALDO (APLICAÇÕES - RESGATES)	RETORNO MÊS (R\$)	SALDO ATUAL	RETORNO ANO 2022
CDB XP IPCA + 6,90%	R\$ 5.400.886,09			R\$ 0,00	R\$ 32.501,72	R\$ 5.433.387,81	R\$ 433.387,81
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2023	R\$ 10.125.073,74			R\$ 0,00	R\$ 53.968,16	R\$ 10.179.041,90	R\$ 911.084,34
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2023	R\$ 10.092.800,20			R\$ 0,00	R\$ 58.138,06	R\$ 10.150.938,26	R\$ 865.190,02
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2024	R\$ 7.847.170,26			R\$ 0,00	R\$ 150.009,84	R\$ 7.997.180,10	R\$ 633.590,17
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2024	R\$ 9.858.254,10			R\$ 0,00	R\$ 188.454,57	R\$ 10.046.708,67	R\$ 795.967,55
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2024	R\$ 9.945.594,13			R\$ 0,00	R\$ 56.245,60	R\$ 10.001.839,73	R\$ 145.825,47
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2024	R\$ 9.911.523,22			R\$ 0,00	R\$ 57.576,71	R\$ 9.969.099,93	R\$ 125.752,04
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2025	R\$ 10.225.696,49			R\$ 0,00	R\$ 53.354,02	R\$ 10.279.050,51	R\$ 908.656,24
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2026	R\$ 10.155.777,06			R\$ 0,00	R\$ 52.297,68	R\$ 10.208.074,74	R\$ 905.275,30
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2028	R\$ 10.512.889,55			R\$ 0,00	R\$ 49.905,86	R\$ 10.562.795,41	R\$ 894.285,41
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2030	R\$ 10.720.702,33			R\$ 0,00	R\$ 50.324,91	R\$ 10.771.027,24	R\$ 905.769,68

Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2032	R\$ 9.745.543,59				R\$ 0,00	R\$ 56.941,22	R\$ 9.802.484,81	R\$ 72.755,73
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2035	R\$ 16.618.112,93				R\$ 0,00	R\$ 117.059,97	R\$ 16.735.172,90	R\$ 876.051,24
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2035	R\$ 11.211.056,76				R\$ 0,00	R\$ 52.629,28	R\$ 11.263.686,04	R\$ 937.112,01
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2035	R\$ 10.343.157,18				R\$ 0,00	R\$ 55.959,02	R\$ 10.399.116,20	R\$ 237.577,84
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2045	R\$ 12.373.034,18				R\$ 0,00	R\$ 50.556,79	R\$ 12.423.590,97	R\$ 702.778,30
CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	R\$ 10.159.587,42				R\$ 0,00	R\$ 95.161,57	R\$ 10.254.748,99	R\$ 254.748,99
CAIXA FI BRASIL IMAB 5 LP	R\$ 7.955.086,81				R\$ 0,00	R\$ 149.189,90	R\$ 8.104.276,71	R\$ 3.007.785,78
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 14.587,24	R\$ 242.223,12	R\$ 241.079,55		R\$ 1.143,57	R\$ 487,83	R\$ 16.218,64	R\$ 11.973,96
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 9.181.405,21				R\$ 0,00	R\$ 94.767,85	R\$ 9.276.173,06	R\$ 338.383,29
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	R\$ 32.440.038,21				R\$ 0,00	R\$ 319.833,68	R\$ 32.759.871,89	R\$ 2.119.369,40
CAIXA FI AÇÕES CONSTRUÇÃO CIVIL	R\$ 2.337.745,39				R\$ 0,00	R\$ 44.933,99	R\$ 2.382.679,38	R\$ 250.096,71
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO*	R\$ -				R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ -	R\$ 1.036,84
CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO	R\$ 5.705.759,02				R\$ 0,00	R\$ 405.745,59	R\$ 6.111.504,61	-R\$ 106.862,74
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$ 4.610.017,17				R\$ 0,00	R\$ 266.208,26	R\$ 4.876.225,43	R\$ 727.092,58
DI INST PREMIUM	R\$ 4.776.868,60				R\$ 0,00	R\$ 50.128,61	R\$ 4.826.997,21	R\$ 73.167,52
FI IRF-M TIT PUB RF	R\$ 2.014.816,11				R\$ 0,00	R\$ 18.119,54	R\$ 2.032.935,65	R\$ 32.935,65
FI GLOBAL EQUITIES MM IE	R\$ 4.531.871,19				R\$ 0,00	R\$ 163.386,16	R\$ 4.695.257,35	-R\$ 1.917.128,23
GO GLOBAL EQUITY ESG	R\$ 2.595.507,07				R\$ 0,00	R\$ 139.555,80	R\$ 2.735.062,87	-R\$ 518.681,94
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	R\$ 6.835.773,20	R\$ 19.782,97			R\$ 19.782,97	R\$ 127.037,36	R\$ 6.982.593,53	R\$ 1.377.594,09
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FICFI	R\$ 5.714.838,49				R\$ 0,00	R\$ 57.948,29	R\$ 5.772.786,78	R\$ 134.023,58
BB PREV RF IRF-M 1+	R\$ 3.051.966,72				R\$ 0,00	R\$ 26.911,77	R\$ 3.078.878,49	R\$ 78.878,49
BB ENERGIA FI AÇÕES	R\$ 7.035.443,76				R\$ 0,00	R\$ 464.067,23	R\$ 7.499.510,99	R\$ 673.897,81
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR	R\$ -				R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ -	R\$ 61.806,42
BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO	R\$ 2.048.821,30				R\$ 0,00	R\$ 135.169,46	R\$ 2.183.990,76	R\$ 647.159,94
BB AÇÕES NORDEA	R\$ 4.590.173,84				R\$ 0,00	R\$ 69.180,41	R\$ 4.659.354,25	-R\$ 1.857.989,85
BB Previd RF Perfil	R\$ 16.165.713,18				R\$ 0,00	R\$ 167.978,24	R\$ 16.333.691,42	R\$ 379.776,62
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 8.155.993,26				R\$ 0,00	R\$ 687.591,39	R\$ 8.843.584,65	R\$ 455.903,12
BRADESCO F.I. REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	R\$ 1.319.113,95	R\$ 4.317.340,49	R\$ 4.818.996,74	-R\$ 501.656,25		R\$ 36.632,04	R\$ 854.089,74	R\$ 468.269,02
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5	R\$ -				R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ -	R\$ 54.092,12
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FICFI	R\$ 25.835.062,28				R\$ 0,00	R\$ 266.238,41	R\$ 26.101.300,69	R\$ 544.332,60
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO FICFI	R\$ 1.019.367,03				R\$ 0,00	R\$ 12.719,48	R\$ 1.032.086,51	R\$ 65.399,50
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	R\$ 5.109.109,87				R\$ 0,00	R\$ 44.930,70	R\$ 5.154.040,57	R\$ 107.317,45
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ -				R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ -	R\$ 87.669,59
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RFLP FIC	R\$ 30.108.341,88				R\$ 0,00	R\$ 300.612,19	R\$ 30.408.954,07	R\$ 2.580.810,77
ITAÚ INSTITUCIONAL GENESIS FICFIA	R\$ 1.741.734,60				R\$ 0,00	R\$ 126.765,89	R\$ 1.868.500,49	R\$ 160.169,72
ITAU AÇOS MERCADOS EMERGENTES FIC	R\$ 4.572.351,32				R\$ 0,00	-R\$ 285.820,69	R\$ 4.286.530,63	-R\$ 2.222.848,00
ITAÚ INSTITUCIONAL RF IMAB 5 FIC FI	R\$ 8.895.576,06				R\$ 0,00	R\$ 168.848,21	R\$ 9.064.424,27	R\$ 3.091.127,68
ITAÚ ACOES EUROPA FIC	R\$ 692.213,11				R\$ 0,00	R\$ 37.779,14	R\$ 729.992,25	-R\$ 316.960,65
VALOR EM CONTA CORRENTE	R\$ -				R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ -	R\$,00
TOTAL FUNDOS LÍQUIDOS	R\$ 384.302.155,10	R\$ 4.579.346,58	R\$ 5.060.076,29	-R\$ 480.729,71	R\$ 5.328.031,71	R\$ 389.149.457,10	R\$ 22.612.293,72	

*Fundos que não integram mais a Carteira do IPREM.

**Títulos Públicos marcados na Curva.

FUNDOS ILÍQUIDOS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES/AMORTIZAÇÕES	SALDO (APLICAÇÕES - RESGATES)	RETORNO (R\$)	SALDO ATUAL	RETORNO ANO 2022
FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF LP	R\$ 1.306.075,03			R\$ 0,00	-R\$ 11.887,65	R\$ 1.294.187,38	-R\$ 64.317,69
FIC RF LP IMAB 1000	R\$ 493.567,66			R\$ 0,00	-R\$ 5.901,70	R\$ 487.665,96	-R\$ 60.948,86
FI SICILIA RENDA FIXA LONGO PRAZO*	R\$ -			R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ -	R\$,00
FI RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	R\$ 2.705.738,62			R\$ 0,00	R\$ 7.582,08	R\$ 2.713.320,70	R\$ 182.072,74
TERRA NOVA IMA B FICFI RENDA FIXA	R\$ 1.279.003,81			R\$ 0,00	-R\$ 1.601,06	R\$ 1.277.402,75	-R\$ 33.495,63
SINGAPORE FI RENDA FIXA	R\$ -			R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ -	R\$,00
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	R\$ 4.321.755,62			R\$ 0,00	R\$ 1.949,46	R\$ 4.323.705,08	R\$ 5.154,12
FI BARCELONA RENDA FIXA	R\$ 4.134.887,37			R\$ 0,00	-R\$ 697,26	R\$ 4.134.190,11	-R\$ 4.147.888,47

GGR PRIME I FIDC	R\$ 5.101.308,05			R\$ 0,00	-R\$ 12.043,33	R\$ 5.089.264,72	-R\$ 373.937,06
ILLUMINATI FIDC	R\$ 4.837.154,86			R\$ 0,00	-R\$ 16.197,67	R\$ 4.820.957,19	-R\$ 816.756,86
FIDC PREMIUM	R\$ 4.368.783,36			R\$ 0,00	-R\$ 18.406,19	R\$ 4.350.377,17	-R\$ 6.494.468,50
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	R\$ 13.345.860,33			R\$ 0,00	-R\$ 29.985,30	R\$ 13.315.875,03	-R\$ 110.069,32
CONQUEST FIP	-R\$ 569.060,11			R\$ 0,00	-R\$ 202,99	-R\$ 569.263,10	-R\$ 224,19
CONQUEST FIM - EM LIQUIDAÇÃO**	-R\$ 740.364,03			R\$ 0,00	R\$ 0,00	-R\$ 740.364,03	R\$,00
GESTAO EMPRESARIAL FIP	R\$ 469.334,26			R\$ 0,00	-R\$ 1.909,06	R\$ 467.425,20	-R\$ 38.202,26
FIP LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA	R\$ 2.228.197,84			R\$ 0,00	R\$ 227,71	R\$ 2.228.425,55	R\$ 28.880,13
CAM THRONE FIP MULTIESTRATÉGIA	R\$ 505.534,82			R\$ 0,00	R\$ 206,83	R\$ 505.741,65	R\$ 30.657,16
AQUILLA FII	R\$ 3.478.353,54			R\$ 0,00	-R\$ 3.297,59	R\$ 3.475.055,95	R\$ 479.818,00
SÃO DOMINGOS FII	R\$ 4.363.244,37			R\$ 0,00	R\$ 63.789,31	R\$ 4.427.033,68	-R\$ 121.938,94
TOTAL FUNDOS ILÍQUIDOS	R\$ 51.629.375,40	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-R\$ 28.374,41	R\$ 51.601.000,990	-R\$ 11.535.665,63

*Fundo Liquidado em Outubro de 2021

**Foi feita cisão do fundo MONTE CARLO INST IMA-B 5 no dia 07 de julho de 2022, constituindo o fundo CONQUEST FIM - EM LIQUIDAÇÃO.

RENTABILIDADE DA CARTEIRA						
	Mês		Ano		Mês (R\$)	Ano (R\$)
	Rentabilidade	% IPCA+4,77%*	Rentabilidade	% IPCA+4,77%**	Rentabilidade	Rentabilidade
FUNDOS LÍQUIDOS	1,39%	141,27%	6,15%	69,47%	R\$ 5.328.031,71	R\$ 22.612.293,72
FUNDOS ILIQUIDOS	-0,05%	-5,60%	-17,31%	-195,62%	-R\$ 28.374,41	-R\$ 11.535.665,63
TOTAL	1,22%	123,88%	2,57%	28,99%	R\$ 5.299.657,30	R\$ 11.076.628,09

EVOLUÇÃO PATRIMÔNIO LÍQUIDO IPREM	MÊS	VALOR LÍQUIDO	RENTABILIDADE	VALOR ILÍQUIDO	RENTABILIDADE	VALOR TOTAL	RENTABILIDADE
	JANEIRO	R\$ 372.754.283,04	R\$ 745.297,95	R\$ 68.430.537,59	-R\$ 374.801,41	R\$ 441.184.820,63	R\$ 370.496,54
FEVEREIRO	R\$ 369.161.888,74	R\$ 728.366,44	R\$ 67.119.189,44	-R\$ 1.281.355,32	R\$ 436.281.078,18	-R\$ 552.988,88	
MARÇO	R\$ 381.058.683,29	R\$ 9.507.664,47	R\$ 62.712.117,54	-R\$ 1.765.952,83	R\$ 443.770.800,83	R\$ 7.741.711,64	
ABRIL	R\$ 379.879.318,61	-R\$ 456.616,73	R\$ 62.716.059,25	R\$ 3.941,71	R\$ 442.595.377,86	-R\$ 452.675,02	
MAIO	R\$ 383.081.859,08	R\$ 3.259.525,26	R\$ 56.249.135,90	-R\$ 6.274.513,47	R\$ 439.330.994,98	-R\$ 3.014.988,21	
JUNHO	R\$ 378.077.504,97	-R\$ 4.954.499,77	R\$ 55.908.177,94	R\$ 72.138,33	R\$ 433.985.682,91	-R\$ 4.882.361,44	
JULHO	R\$ 378.527.213,80	R\$ 3.350.476,02	R\$ 53.588.779,37	-R\$ 1.557.973,63	R\$ 432.115.993,17	R\$ 1.792.502,39	
AGOSTO	R\$ 383.318.129,58	R\$ 4.303.895,01	R\$ 52.541.435,80	-R\$ 229.968,36	R\$ 435.859.565,38	R\$ 4.073.926,65	
SETEMBRO	R\$ 384.302.155,10	R\$ 800.153,36	R\$ 51.629.375,40	-R\$ 98.806,24	R\$ 435.931.530,50	R\$ 701.347,12	
OUTUBRO	R\$ 389.149.457,10	R\$ 5.328.031,71	R\$ 51.601.000,99	-R\$ 28.374,41	R\$ 440.750.458,09	R\$ 5.299.657,30	
NOVEMBRO					R\$ -	R\$ 0,00	
DEZEMBRO					R\$ -	R\$ 0,00	
			R\$ 22.612.293,72		(R\$ 11.535.665,63)	R\$ 11.076.628,09	

Carteira Administrativa

FUNDOS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO (APLICAÇÕES - RESGATES)	RETORNO (R\$)	SALDO ATUAL	RETORNO ANO 2022
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF 127-8	R\$ 2.127,09	R\$ 92.923,65	R\$ 94.295,68	-R\$ 1.372,03	R\$ 83,49	R\$ 838,55	R\$ 2.285,79
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF - 71038-4	R\$ 1.602.728,84			R\$ 0,00	R\$ 15.801,66	R\$ 1.618.530,50	R\$ 113.457,22
CAIXA FI ALIANÇA RF - 71038-4	R\$ 1.827.701,07			R\$ 0,00	R\$ 18.315,69	R\$ 1.846.016,76	R\$ 162.318,06
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF - 127-8	R\$ 2.500.811,10			R\$ 0,00	R\$ 24.656,06	R\$ 2.525.467,16	R\$ 124.035,73
CAIXA FI ALIANÇA RF - 127-8	R\$ 2.104.657,13		R\$ 357.607,48	-R\$ 357.607,48	R\$ 20.076,01	R\$ 1.767.125,66	R\$ 269.065,96
ITAU SOBERANO - PRÓ-GESTÃO	R\$ 688.887,78		R\$ 1.200,00	-R\$ 1.200,00	R\$ 7.090,54	R\$ 694.778,32	R\$ 55.807,31
CAIXA FI ALIANÇA RF 71039	R\$ 17.473,40			R\$ 0,00	R\$ 175,10	R\$ 17.648,50	R\$ 1.573,59
BCO BRASIL - RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO	R\$ 1.571,90		R\$ 442,36	-R\$ 442,36	R\$ 10,62	R\$ 1.140,16	R\$ 33,72
VALOR EM CONTA CORRENTE	R\$ -			R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ -	R\$,00
TOTAL FUNDOS	R\$ 8.745.958,31	R\$ 92.923,65	R\$ 453.545,52	R\$ (360.621,87)	R\$ 86.209,17	R\$ 8.471.545,61	R\$ 802.603,05

COMPARATIVO META ATUARIAL EM 2022

	Líquidos	Ilíquidos	Total	IPCA+4,77%	Diferença	da Meta
Janeiro	0,20%	-0,51%	0,09%	0,93%	-0,84%	9,68%
Fevereiro	0,20%	-1,87%	-0,13%	1,40%	-1,53%	-9,29%
Março	2,68%	-2,63%	1,86%	2,01%	-0,15%	92,54%
Abril	-0,12%	-0,03%	-0,10%	1,45%	-1,55%	-6,90%
Mai	0,86%	-10,00%	-0,68%	0,86%	-1,54%	-79,07%
Junho	-1,28%	0,13%	-1,10%	1,06%	-2,16%	-103,77%
Julho	0,89%	-2,79%	0,41%	-0,29%	0,70%	141,38%
Agosto	1,14%	-0,43%	0,94%	0,03%	0,91%	3133,33%
Setembro	0,21%	-0,19%	0,16%	0,10%	0,06%	160,00%
Outubro	1,39%	-0,05%	1,22%	0,98%	0,24%	124,49%
Novembro						
Dezembro						
Acumulado	6,15%	-17,31%	2,57%	8,85%	-6,28%	29,04%

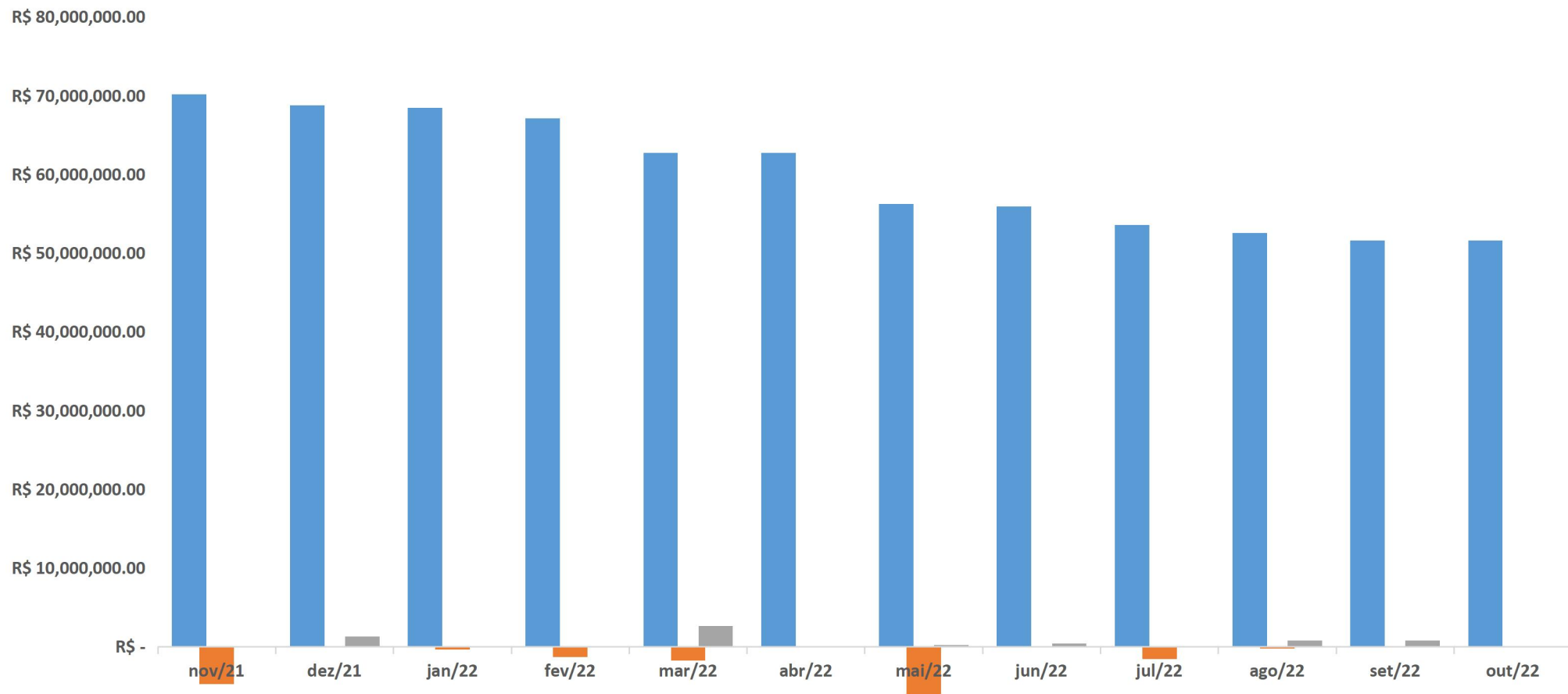
Carteira Líquida - 12 meses

Valores em Milhões de reais





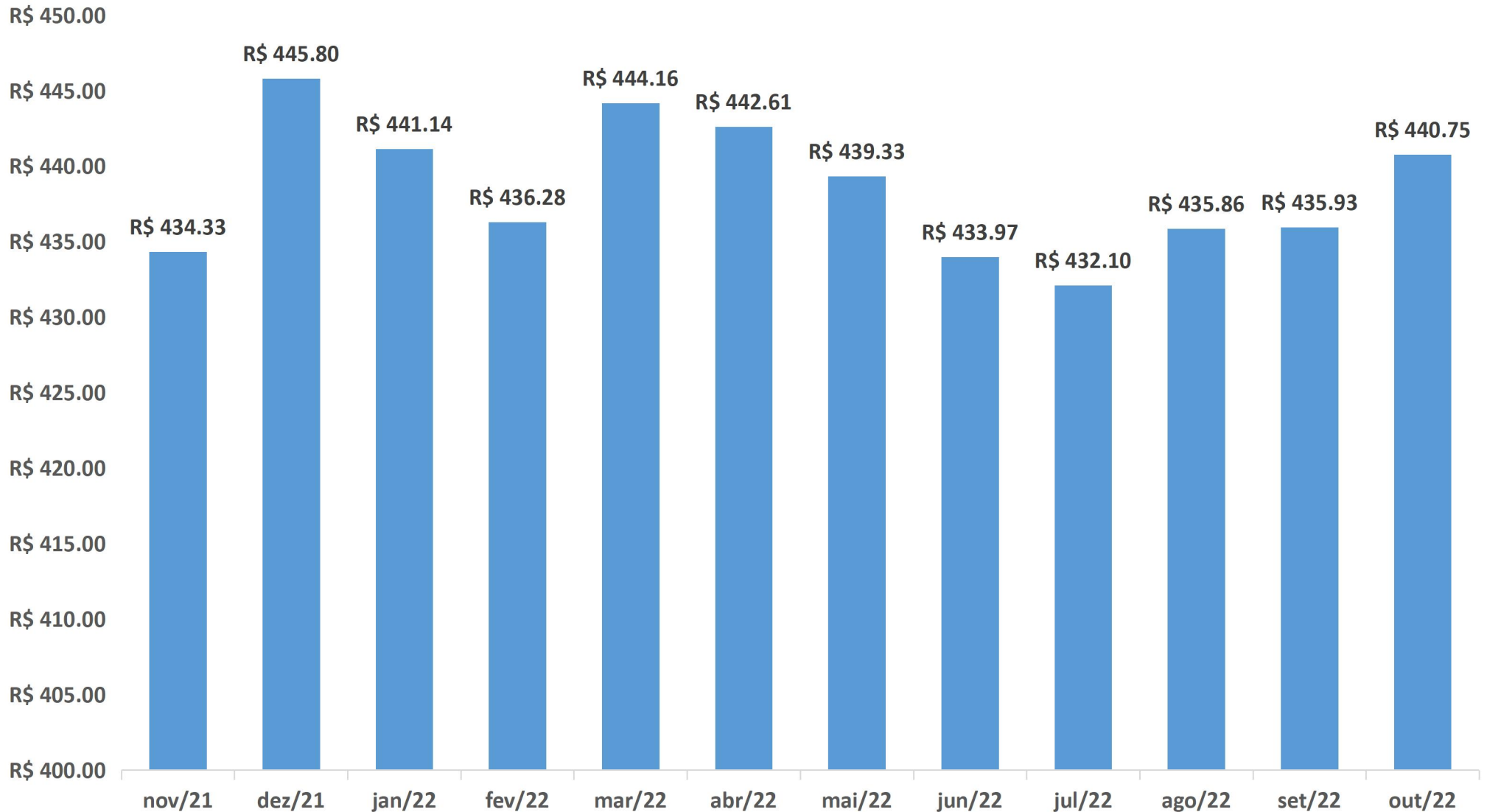
Carteira Líquida - 12 meses



	nov/21	dez/21	jan/22	fev/22	mar/22	abr/22	mai/22	jun/22	jul/22	ago/22	set/22	out/22
Saldo	R\$ 70,204,827.9	R\$ 68,781,497.9	R\$ 68,430,537.5	R\$ 67,119,189.4	R\$ 62,712,117.5	R\$ 62,716,059.2	R\$ 56,249,135.9	R\$ 55,908,177.9	R\$ 53,588,779.3	R\$ 52,541,435.8	R\$ 51,629,375.4	R\$ 51,601,000.9
Retorno	-R\$ 4,744,755.71	-R\$ 120,905.38	-R\$ 374,801.41	-R\$ 1,281,355.32	-R\$ 1,765,952.83	R\$ 3,941.71	-R\$ 6,274,513.47	R\$ 72,138.33	-R\$ 1,557,973.63	-R\$ 229,968.36	-R\$ 98,806.24	-R\$ 28,374.41
Amortização		R\$ 1,302,424.57		R\$ 29,992.83	R\$ 2,641,119.81		R\$ 192,409.90	R\$ 413,096.31	R\$ 21,060.92	R\$ 817,375.21	R\$ 813,254.16	R\$ -

Carteira Total - 12 meses

Valores em Milhões de reais



:: LÂMINA COMPARAÇÃO ATIVOS

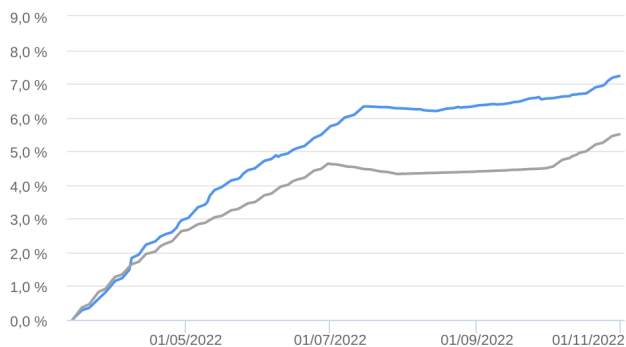
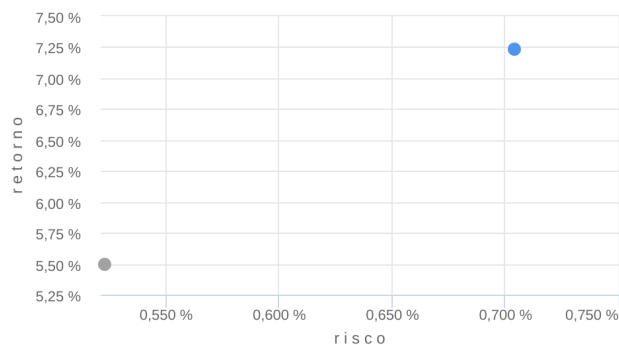
16/11/2022

Resumo 12 meses

Nome	Retorno (%)				PL Médio	Aplicação Mínima	Início do Fundo	Taxa de Administração	Taxa de Performance
	Mês	Ano	06 meses	12 meses					
CDB IPCA+6,90 Banco XP	0,64	-	3,78	-	-	-	-	-	-

Retorno Mensal (%)

Nome	out/22	set/22	ago/22	jul/22	jun/22	mai/22	abr/22	mar/22	fev/22	jan/22	dez/21	nov/21
CDB IPCA+6,90 Banco XP	0,63	0,21	0,06	0,56	1,08	1,55	1,86	-	-	-	-	-
CDI	1,02	1,07	1,17	1,03	1,01	1,03	0,83	0,92	0,75	0,73	0,76	0,59
Dólar	-2,77	4,39	-0,18	-0,95	10,77	-3,87	3,83	-7,81	-4,07	-4,00	-0,70	-0,41
Euro	-1,75	1,49	-1,53	-3,47	8,05	-2,12	-1,35	-9,07	-3,78	-4,96	-0,12	-2,93
Ibovespa	5,45	0,47	6,16	4,69	-11,50	3,22	-10,10	6,06	0,89	6,98	2,85	-1,53
IBX	5,57	-0,05	6,15	4,40	-11,56	3,23	-10,11	5,96	1,46	6,87	3,14	-1,69
IGP-M	-0,97	-0,95	-0,70	0,21	0,59	0,52	1,41	1,74	1,83	1,82	0,87	0,02

Gráficos
Retorno Acumulado - 15/03/2022 a 31/10/2022 (diária)

Risco x Retorno - 15/03/2022 a 31/10/2022 (diária)

■ CDB IPCA+6,90 Banco XP

■ Meta IPCA+4,77%

:: PORTFÓLIO E ATIVOS

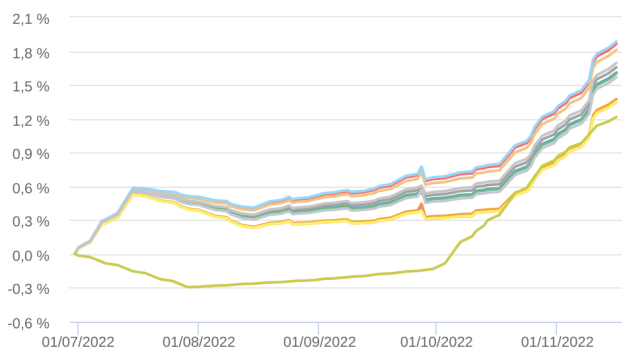
16/11/2022

Resumo												Mês
Nome	Retorno (%)					Sharpe	VaR	Volatilidade				
	Mês	12 meses	36 meses	48 meses	60 meses							
TP Marcado na Curva	0,58	-	-	-	-	2,99	0,30%	0,63%				
NTN-B 2023 IPCA+5,63 (Curva)	0,59	-	-	-	-	3,21	0,30%	0,63%				
NTN-B 2023 IPCA+6,20 (Curva)	0,61	-	-	-	-	4,07	0,30%	0,63%				
NTN-B 2024 IPCA+6,06 (Curva)	0,60	-	-	-	-	3,80	0,30%	0,63%				
NTN-B 2024 IPCA+6,265 (Curva)	0,61	-	-	-	-	4,11	0,30%	0,63%				
NTN-B 2025 IPCA+5,48 (Curva)	0,58	12,31	-	-	-	2,98	0,30%	0,63%				
NTN-B 2026 IPCA+5,39 (Curva)	0,58	12,21	-	-	-	2,79	0,30%	0,63%				
NTN-B 2028 IPCA+4,86 (Curva)	0,56	11,65	-	-	-	1,99	0,30%	0,63%				
NTN-B 2030 IPCA+4,79 (Curva)	0,56	11,57	-	-	-	1,88	0,30%	0,63%				
NTN-B 2035 IPCA+4,79 (Curva)	0,56	11,57	-	-	-	1,92	0,30%	0,63%				
NTN-B 2035 IPCA+5,735 (Curva)	0,59	-	-	-	-	3,36	0,30%	0,63%				

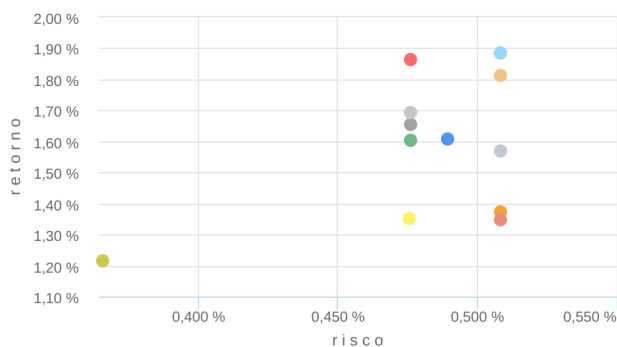
Retorno Mensal (%)												
Nome	out/22	set/22	ago/22	jul/22	jun/22	mai/22	abr/22	mar/22	fev/22	jan/22	dez/21	nov/21
TP Marcado na Curva	0,52	0,10	-0,06	0,45	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B 2023 IPCA+5,63 (Curva)	0,53	0,11	-0,05	0,46	0,98	1,45	1,77	1,75	1,11	1,13	-	-
NTN-B 2023 IPCA+6,20 (Curva)	0,58	0,15	0,00	0,51	1,03	1,49	1,81	1,79	1,15	-	-	-
NTN-B 2024 IPCA+6,06 (Curva)	0,57	0,14	-0,01	0,50	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B 2024 IPCA+6,265 (Curva)	0,58	0,16	0,01	0,51	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B 2025 IPCA+5,48 (Curva)	0,52	0,10	-0,06	0,45	0,97	1,43	1,75	1,73	1,10	1,12	1,25	1,68
NTN-B 2026 IPCA+5,39 (Curva)	0,51	0,09	-0,07	0,44	0,96	1,42	1,75	1,73	1,10	1,11	1,24	1,67
NTN-B 2028 IPCA+4,86 (Curva)	0,47	0,05	-0,11	0,40	0,92	1,38	1,71	1,68	1,06	1,07	1,20	1,63
NTN-B 2030 IPCA+4,79 (Curva)	0,47	0,04	-0,12	0,40	0,92	1,37	1,70	1,68	1,05	1,06	1,19	1,63
NTN-B 2035 IPCA+4,79 (Curva)	0,47	0,04	-0,12	0,40	0,92	1,37	1,70	1,68	1,05	1,06	1,19	1,63
NTN-B 2035 IPCA+5,735 (Curva)	0,54	0,12	-0,04	0,47	0,99	-	-	-	-	-	-	-
CDI	1,02	1,07	1,17	1,03	1,01	1,03	0,83	0,92	0,75	0,73	0,76	0,59
Ibovespa	5,45	0,47	6,16	4,69	-11,50	3,22	-10,10	6,06	0,89	6,98	2,85	-1,53
IMA-B 5+	0,65	2,39	2,49	-1,84	-1,10	1,16	0,08	3,56	0,01	-1,61	-0,34	4,47
IMA-B 5	1,91	0,42	0,00	0,01	0,33	0,78	1,56	2,61	1,06	0,11	0,79	2,50
MSCI World	4,14	-5,49	-4,51	6,84	1,05	-4,02	-4,93	-5,56	-6,54	-9,13	3,46	-2,70

Gráficos

Retorno Acumulado - 01/07/2022 a 16/11/2022 (diária)



Risco x Retorno - 01/07/2022 a 16/11/2022 (diária)



TP Mercado na Curva
NTN-B 2023 IPCA+5,63 (Curva)
NTN-B 2023 IPCA+6,20 (Curva)
NTN-B 2024 IPCA+6,06 (Curva)
NTN-B 2024 IPCA+6,265 (Curva)
NTN-B 2025 IPCA+5,48 (Curva)
NTN-B 2026 IPCA+5,39 (Curva)
NTN-B 2028 IPCA+4,86 (Curva)
NTN-B 2030 IPCA+4,79 (Curva)
NTN-B 2035 IPCA+4,79 (Curva)
NTN-B 2035 IPCA+5,735 (Curva)
Meta IPCA+4,77%

:: PORTFÓLIO E ATIVOS

11/11/2022

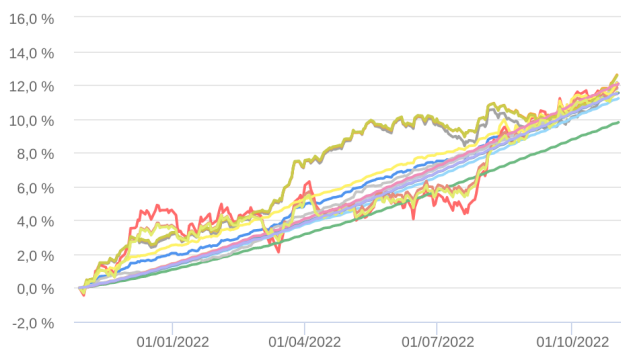
Resumo												Mês
Nome	Retorno (%)					Sharpe	VaR	Volatilidade				
	Mês	12 meses	36 meses	48 meses	60 meses							
Carteira Renda Fixa Conservadora	-0,34	10,80	19,33	-	-	-10,81	1,03%	2,18%				
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,00	9,78	23,00	37,10	49,40	-12,75	1,65%	3,48%				
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,83	7,44	6,28	-	-	-9,45	5,16%	10,86%				
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,41	11,97	19,30	26,45	34,74	3,13	0,03%	0,07%				
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,39	11,39	18,45	25,55	33,57	-66,12	0,00%	0,01%				
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,35	9,97	15,34	21,44	28,37	-302,57	0,00%	0,01%				
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,42	11,94	19,31	26,46	34,55	10,58	0,02%	0,04%				
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,91	10,27	22,55	39,18	52,15	-13,22	1,49%	3,14%				
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,76	8,79	10,57	26,14	38,67	-9,38	3,47%	7,30%				
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-2,19	8,72	15,73	31,58	41,02	-9,92	3,93%	8,27%				
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	-0,14	10,85	22,48	-	-	-11,15	0,74%	1,55%				
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	-0,91	10,20	22,66	39,15	51,83	-13,24	1,49%	3,14%				
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,40	11,72	18,92	26,09	34,19	-24,22	0,00%	0,01%				
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,42	12,25	19,67	26,98	35,21	20,52	0,01%	0,02%				
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,80	8,48	10,23	25,99	38,20	-9,37	3,53%	7,44%				

Retorno Mensal (%)												
Nome	out/22	set/22	ago/22	jul/22	jun/22	mai/22	abr/22	mar/22	fev/22	jan/22	dez/21	nov/21
Carteira Renda Fixa Conservadora	1,16	1,02	0,99	0,79	0,79	0,95	0,83	1,36	0,85	0,45	0,84	1,20
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,85	0,53	-0,04	-0,22	0,27	0,77	1,48	2,62	1,16	0,01	0,71	2,43
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88	1,53	2,60	1,18	0,01	0,40	-0,54	0,91	0,48	-0,58	2,29	2,26
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,04	1,09	1,18	1,04	1,03	1,07	0,78	0,96	0,80	0,78	0,80	0,63
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,01	1,05	1,16	1,01	1,00	1,03	0,70	0,90	0,77	0,74	0,74	0,57
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,89	0,93	1,02	0,90	0,88	0,89	0,71	0,79	0,64	0,61	0,63	0,47
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03	1,11	1,19	1,01	1,06	1,08	0,80	0,93	0,82	0,79	0,75	0,62
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,88	0,43	0,05	0,02	0,33	0,76	1,54	2,59	1,05	0,09	0,77	2,47
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,94	1,37	2,04	1,12	0,34	0,59	-0,17	0,85	0,59	-0,07	1,87	1,81
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,88	1,53	0,61	0,80	0,79	0,99	0,78	1,16	0,93	0,52	0,86	1,64
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,00	1,08	0,90	0,84	0,95	1,10	0,91	1,48	0,89	0,45	0,46	0,88
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	1,90	0,41	0,00	0,00	0,32	0,77	1,54	2,59	1,05	0,10	0,77	2,48
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,03	1,07	1,16	1,02	1,02	1,04	0,77	0,92	0,81	0,75	0,76	0,59
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05	1,12	1,21	1,05	1,06	1,10	0,83	0,97	0,82	0,80	0,82	0,63
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90	1,36	2,03	1,15	0,42	0,50	-0,20	0,71	0,58	-0,05	1,84	1,78
CDI	1,02	1,07	1,17	1,03	1,01	1,03	0,83	0,92	0,75	0,73	0,76	0,59
Ibovespa	5,45	0,47	6,16	4,69	-11,50	3,22	-10,10	6,06	0,89	6,98	2,85	-1,53
IMA-B 5+	0,65	2,39	2,49	-1,84	-1,10	1,16	0,08	3,56	0,01	-1,61	-0,34	4,47
IMA-B 5	1,91	0,42	0,00	0,01	0,33	0,78	1,56	2,61	1,06	0,11	0,79	2,50
MSCI World	4,14	-5,49	-4,51	6,84	1,05	-4,02	-4,93	-5,56	-6,54	-9,13	3,46	-2,70

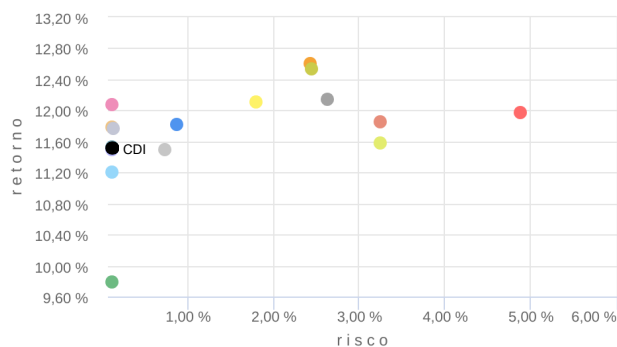
Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
 Fonte: Quantum Axis.

Gráficos

Retorno Acumulado - 31/10/2021 a 31/10/2022 (diária)



Risco x Retorno - 31/10/2021 a 31/10/2022 (diária)



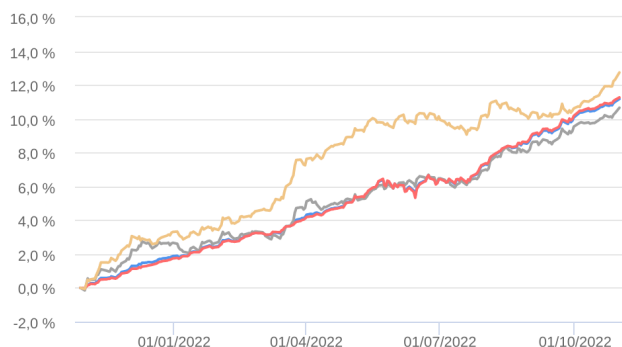
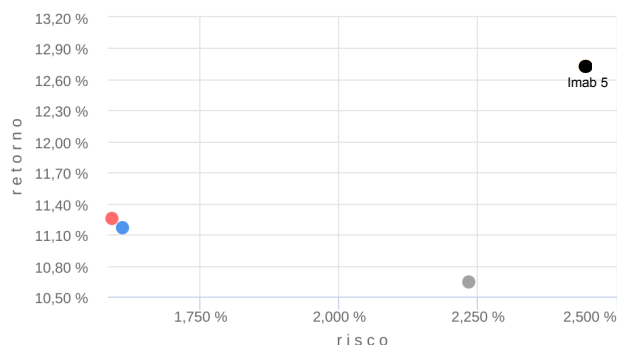
Carteira Renda Fixa Conservadora
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
CDI

Resumo Mês

Nome	Retorno (%)					Sharpe	VaR	Volatilidade
	Mês	12 meses	36 meses	48 meses	60 meses			
Carteira Renda Fixa Intermediária	-0,73	9,79	15,35	35,78	46,09	-9,49	1,79%	3,77%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,07	8,45	11,72	28,54	40,42	-10,24	2,16%	4,55%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,67	10,03	15,99	37,06	47,09	-9,30	1,73%	3,65%

Retorno Mensal (%)

Nome	out/22	set/22	ago/22	jul/22	jun/22	mai/22	abr/22	mar/22	fev/22	jan/22	dez/21	nov/21
Carteira Renda Fixa Intermediária	0,99	1,24	1,43	0,73	0,25	1,03	0,85	0,90	0,78	0,57	0,84	1,03
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01	1,24	1,21	0,41	0,33	0,82	0,52	1,34	0,62	0,04	0,91	1,73
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,99	1,24	1,47	0,79	0,23	1,07	0,91	0,82	0,81	0,67	0,83	0,91
CDI	1,02	1,07	1,17	1,03	1,01	1,03	0,83	0,92	0,75	0,73	0,76	0,59
Ibovespa	5,45	0,47	6,16	4,69	-11,50	3,22	-10,10	6,06	0,89	6,98	2,85	-1,53
IMA-B 5+	0,65	2,39	2,49	-1,84	-1,10	1,16	0,08	3,56	0,01	-1,61	-0,34	4,47
IMA-B 5	1,91	0,42	0,00	0,01	0,33	0,78	1,56	2,61	1,06	0,11	0,79	2,50
MSCI World	4,14	-5,49	-4,51	6,84	1,05	-4,02	-4,93	-5,56	-6,54	-9,13	3,46	-2,70

Gráficos
Retorno Acumulado - 31/10/2021 a 31/10/2022 (diária)

Risco x Retorno - 31/10/2021 a 31/10/2022 (diária)

■ Carteira Renda Fixa Intermediária

■ BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

■ CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA

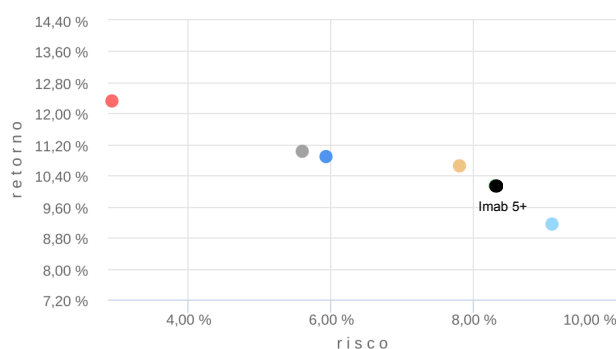
■ IMA-B 5

Resumo										Mês
Nome	Retorno (%)					Sharpe	VaR	Volatilidade		
	Mês	12 meses	36 meses	48 meses	60 meses					
Carteira Renda Fixa Agressivo	-2,40	5,86	8,64	40,49	57,19	-10,54	4,00%	8,42%		
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-2,89	5,40	9,27	40,17	55,48	-10,58	4,69%	9,88%		
NTN-B 760199 20240815	-0,81	10,06	21,81	45,11	60,76	-12,03	-	3,20%		
NTN-B 760199 20350515	-3,07	4,35	3,15	38,96	55,81	-10,67	-	10,34%		
NTN-B 760199 20450515	-3,75	1,85	-3,13	35,87	54,02	-9,07	-	14,56%		

Retorno Mensal (%)

Nome	out/22	set/22	ago/22	jul/22	jun/22	mai/22	abr/22	mar/22	fev/22	jan/22	dez/21	nov/21
Carteira Renda Fixa Agressivo	1,09	1,66	1,48	-1,35	-0,58	1,03	0,60	3,36	0,44	-1,12	0,02	3,92
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,25	1,47	0,86	-1,10	-0,65	0,92	0,74	3,50	0,76	-1,09	0,08	3,89
NTN-B 760199 20240815	1,91	0,50	-0,16	-0,31	0,24	0,91	1,27	2,68	1,08	-0,01	0,87	2,73
NTN-B 760199 20350515	0,70	2,02	2,10	-1,97	-0,68	0,96	0,40	4,09	-0,07	-2,07	0,16	4,77
NTN-B 760199 20450515	0,41	2,89	3,08	-2,06	-1,63	1,32	-0,12	3,34	0,17	-1,46	-1,41	4,53
CDI	1,02	1,07	1,17	1,03	1,01	1,03	0,83	0,92	0,75	0,73	0,76	0,59
Ibovespa	5,45	0,47	6,16	4,69	-11,50	3,22	-10,10	6,06	0,89	6,98	2,85	-1,53
IMA-B 5+	0,65	2,39	2,49	-1,84	-1,10	1,16	0,08	3,56	0,01	-1,61	-0,34	4,47
IMA-B 5	1,91	0,42	0,00	0,01	0,33	0,78	1,56	2,61	1,06	0,11	0,79	2,50
MSCI World	4,14	-5,49	-4,51	6,84	1,05	-4,02	-4,93	-5,56	-6,54	-9,13	3,46	-2,70

Gráficos
Retorno Acumulado - 31/10/2021 a 31/10/2022 (diária)

Risco x Retorno - 31/10/2021 a 31/10/2022 (diária)


■ Carteira Renda Fixa Agressivo
■ ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA
■ NTN-B 760199 20240815
■ NTN-B 760199 20350515
■ NTN-B 760199 20450515
■ IMA-B 5+

:: PORTFÓLIO E ATIVOS

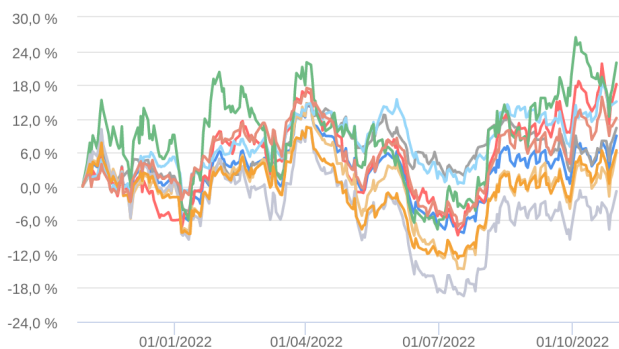
11/11/2022

Resumo													Mês
Nome	Retorno (%)					Sharpe	VaR	Volatilidade					
	Mês	12 meses	36 meses	48 meses	60 meses								
Carteira Renda Variável Nacional	-7,02	-6,15	-2,90	-	-	-6,69	16,71%	35,19%					
BB ENERGIA FI AÇÕES	-3,82	0,48	5,88	51,83	92,99	-4,01	15,43%	32,49%					
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-12,66	-1,79	-24,22	1,09	20,00	-11,54	17,67%	37,21%					
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-7,72	-10,70	-3,18	35,60	63,24	-7,05	17,42%	36,69%					
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,99	6,52	31,59	-	-	-3,07	15,98%	33,65%					
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-15,24	-10,38	-43,98	-10,02	-12,15	-10,47	23,46%	49,41%					
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-8,04	-17,22	-16,19	17,61	23,88	-6,49	19,58%	41,23%					
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-6,60	-7,76	-6,07	-	-	-7,47	14,17%	29,85%					

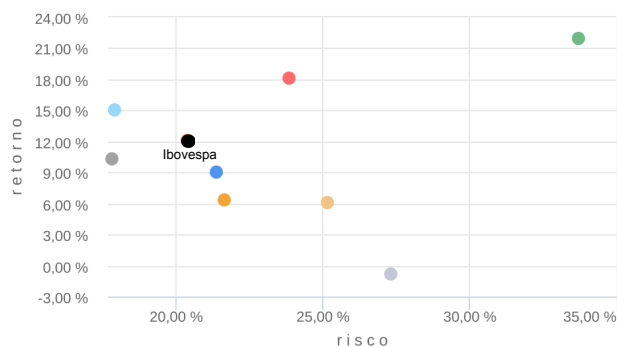
Retorno Mensal (%)												
Nome	out/22	set/22	ago/22	jul/22	jun/22	mai/22	abr/22	mar/22	fev/22	jan/22	dez/21	nov/21
Carteira Renda Variável Nacional	6,76	-1,10	6,39	4,81	-11,83	0,52	-6,78	7,93	-2,06	4,63	2,87	-1,21
BB ENERGIA FI AÇÕES	6,60	-4,35	1,13	2,93	-5,11	-0,45	-2,42	8,46	-0,46	2,60	0,09	1,74
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	6,60	3,00	9,80	3,45	-12,57	6,10	-11,99	7,25	-1,43	16,79	-3,97	-2,13
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	8,43	-1,34	6,88	5,81	-15,24	1,54	-9,42	9,09	-1,44	3,96	3,89	-3,17
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,77	-3,22	6,37	4,16	-10,52	3,07	-3,02	6,67	-0,38	1,40	5,78	-0,52
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1,92	11,99	6,68	8,38	-12,03	-4,55	-6,71	5,49	-7,04	10,22	6,31	2,66
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	7,11	-1,94	10,67	4,98	-16,29	-1,92	-8,34	8,57	-5,20	3,98	4,24	-3,24
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	7,28	-0,26	6,84	5,88	-10,27	0,79	-10,56	5,38	0,00	5,13	0,81	-2,69
CDI	1,02	1,07	1,17	1,03	1,01	1,03	0,83	0,92	0,75	0,73	0,76	0,59
Ibovespa	5,45	0,47	6,16	4,69	-11,50	3,22	-10,10	6,06	0,89	6,98	2,85	-1,53
IMA-B 5+	0,65	2,39	2,49	-1,84	-1,10	1,16	0,08	3,56	0,01	-1,61	-0,34	4,47
IMA-B 5	1,91	0,42	0,00	0,01	0,33	0,78	1,56	2,61	1,06	0,11	0,79	2,50
MSCI World	4,14	-5,49	-4,51	6,84	1,05	-4,02	-4,93	-5,56	-6,54	-9,13	3,46	-2,70

Gráficos

Retorno Acumulado - 31/10/2021 a 31/10/2022 (diária)



Risco x Retorno - 31/10/2021 a 31/10/2022 (diária)

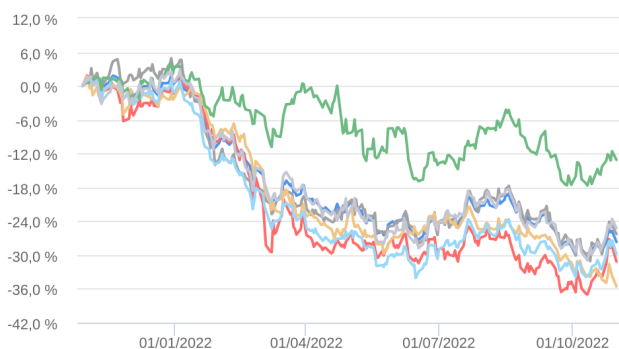
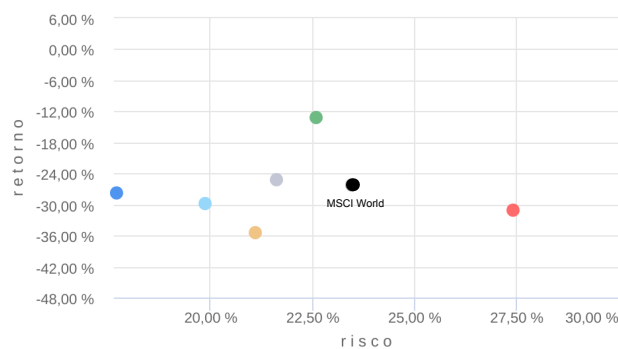


- Carteira Renda Variável Nacional
- BB ENERGIA FI AÇÕES
- BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES
- BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES
- CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES
- CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES
- CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES
- ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES
- Ibovespa

Resumo									Mês
Nome	Retorno (%)					Sharpe	VaR	Volatilidade	
	Mês	12 meses	36 meses	48 meses	60 meses				
Carteira Renda Variável Internacional	9,52	-19,70	-	-	-	6,96	19,25%	40,55%	
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	9,37	-18,68	78,60	126,68	-	6,77	19,50%	41,06%	
ITAÚ EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	15,94	-18,35	-	-	-	8,58	26,03%	54,82%	
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	14,01	-25,11	-	-	-	12,59	15,39%	32,42%	
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	7,57	-22,43	56,66	80,62	106,51	4,49	24,25%	51,07%	
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	4,40	-8,62	-	-	-	3,33	18,49%	38,94%	

Retorno Mensal (%)

Nome	out/22	set/22	ago/22	jul/22	jun/22	mai/22	abr/22	mar/22	fev/22	jan/22	dez/21	nov/21
Carteira Renda Variável Internacional	0,93	-6,84	-2,26	5,51	-1,29	-3,75	-2,97	-5,21	-5,06	-10,47	2,14	-1,61
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1,51	-6,84	-2,28	8,45	-2,23	-4,92	-0,87	-2,76	-5,77	-15,52	1,25	1,84
ITAÚ EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	5,46	-4,71	-6,16	3,96	-1,98	-1,42	-2,89	-10,66	-7,34	-8,45	4,81	-5,80
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-6,25	-8,34	0,54	-0,36	2,25	-4,25	-1,41	-10,53	-5,46	-6,32	1,80	-3,88
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	3,61	-5,52	-3,13	6,78	-0,53	-4,83	-3,92	-6,90	-5,29	-12,56	0,89	-2,01
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	5,38	-7,33	-4,11	7,94	-6,36	0,26	-7,35	3,29	-2,25	-5,30	5,61	-2,12
CDI	1,02	1,07	1,17	1,03	1,01	1,03	0,83	0,92	0,75	0,73	0,76	0,59
Ibovespa	5,45	0,47	6,16	4,69	-11,50	3,22	-10,10	6,06	0,89	6,98	2,85	-1,53
IMA-B 5+	0,65	2,39	2,49	-1,84	-1,10	1,16	0,08	3,56	0,01	-1,61	-0,34	4,47
IMA-B 5	1,91	0,42	0,00	0,01	0,33	0,78	1,56	2,61	1,06	0,11	0,79	2,50
MSCI World	4,14	-5,49	-4,51	6,84	1,05	-4,02	-4,93	-5,56	-6,54	-9,13	3,46	-2,70

Gráficos
Retorno Acumulado - 31/10/2021 a 31/10/2022 (diária)

Risco x Retorno - 31/10/2021 a 31/10/2022 (diária)


■ Carteira Renda Variável Internacional
■ BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES
■ ITAÚ EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES
■ ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES
■ SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO
■ SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO
■ MSCI World

Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
 Fonte: Quantum Axis.