



ATA DA 138ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO FISCAL DA TABOÃOPREV – AUTARQUIA PREVIDENCIÁRIA DO MUNICÍPIO DE TABOÃO DA SERRA – MANDATO DO QUADRIÊNIO 2019/2023.

REUNIÃO CONJUNTA COM CONSELHO DELIBERATIVO E COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos vinte e seis dias do mês de outubro de 2022, às 9:30 horas, na sede da Taboãoprev, reuniram-se os membros do Conselho Fiscal: **Jair José dos Santos** – Conselheiro Eleito Aposentados, **Silvonei Rogério Guedes** – Conselheiro Indicado pelo Poder Legislativo, **Thomaz Martin Gonçalves Oyamaguchi** - Conselheiro Eleito Servidores Ativos e o conselheiro **Laércio Calmon dos Santos** – Conselheiro Indicado pelo Chefe do Poder Executivo. Estavam presentes na reunião a Superintendente Autárquica Dra. Eliana Bendini Lantyer, a Diretora Financeira Sra. Thaysa Pinheiro Monteiro e o Diretor de Previdência Sr. Daniel César, após a confirmação das presenças, a Sr. Jair José dos Santos, convidou o conselheiro Thomaz Martin Gonçalves Oyamaguchi para secretariar a reunião, que leu a pauta do dia: REUNIÃO CONJUNTA COM O COMITÊ DE INVESTIMENTOS E CONSELHO DELIBERATIVO.

1º Aprovação da Ata da reunião anterior; 2º Avaliação Econômica de Setembro de 2022; 3º Avaliação da Carteira de Investimentos da Taboãoprev no mês de Setembro de 2022; 4º Aprovação das contas de Setembro de 2022 e Evolução dos Investimentos e Rentabilidade Acumulada até Setembro de 2022; 5º Aprovar e referendar os investimentos apresentados no Relatório Analítico dos Investimentos Base: Setembro de 2022; 6º Acompanhamento da Evolução da execução do orçamento da Taboãoprev; 7º Aplicação dos recursos repassados para a Taboãoprev; 8º Fato Relevante - QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CNPJ Nº 09.289.072/0001-75; 9º Credenciamento das Instituições Financeiras; 10º Outros Assuntos. De acordo com a pauta, ficou deliberado o que segue: **1º APROVAÇÃO DA ATA DA REUNIÃO ANTERIOR:** Foi feita a leitura da ata da reunião anterior, foi perguntado se alguém tinha algum adendo a fazer, não havendo nada a acrescentar, a referida ata foi aprovada por todos os presentes; **2º AVALIAÇÃO ECONÔMICA DE SETEMBRO DE 2022:** O cenário mundial tem piorado, tanto em termos dos dados recentes, quanto em termos das expectativas. A inflação alta e persistente provocou o início de ciclos de aperto monetário nos Estados Unidos e na Europa, com discursos cada vez mais duros dos dirigentes dos bancos centrais e taxas de juros esperadas maiores. Adicionalmente, destacam-se o prolongamento do conflito na Ucrânia e de suas consequências econômicas; na China, os *lockdowns* para levar a cabo a política de “*covid zero*” e a grave crise no mercado imobiliário; e a reversão das políticas fiscais expansionistas face ao recuo da pandemia e



à necessidade de combater a inflação. Em consequência, as projeções de crescimento no mundo têm se reduzido de forma substancial. Retrospectiva - O comitê de política monetária do Federal Reserve elevou a meta de juros dos Fed Funds em 0,75pp, levando a taxa para o intervalo entre 3-3,75%. O FED reforçou a necessidade de novos aumentos nos juros para que a inflação americana retorne à meta de 2% e sinalizou que os juros devem subir até 4,6% no ano que vem. A intensa e rápida alta de juros nos EUA aumenta a probabilidade de recessão na maior economia do mundo e foi um dos fatores para a queda das bolsas pelo mundo essa semana. O S&P 500, principal índice da bolsa americana, recuou -4,65% na semana. No ano, a queda chega a -23,00%. O secretário do tesouro britânico, Kwasi Kwarteng, anunciou o pacote fiscal para estimular a economia britânica e inclui medidas como ampla redução de impostos e subsídios para a energia nos próximos dois anos. Após o anúncio, a libra caiu para o menor nível em relação ao dólar desde 1985. O gasto será financiado por meio de endividamento público, e será da ordem de 150 bilhões de libras nos próximos dois anos. O Presidente do Banco Central do Japão (BoJ), Haruhiko Kuroda, sinalizou que a condução de política monetária ultra-expansionista ficaria inalterada por dois a três anos. Após tal comunicação, o iene atingiu uma mínima de 24 anos, levando a intervenção no mercado cambial pela primeira vez desde o final dos anos 90. O Banco da Inglaterra elevou a taxa de juros em 0,5pp, para 2,25%, de acordo com parte das expectativas do mercado. No país, o mercado de trabalho segue apertado e a inflação elevada. O Banco Popular da China manteve as taxas de juros na terça-feira, buscando um equilíbrio entre afrouxar a política monetária e conter mais perdas em um yuan já enfraquecido. O banco manteve em 3,65% a taxa de empréstimo de um ano, que determina as taxas de juros que os maiores bancos do país cobram de seus clientes, enquanto a taxa de cinco anos, que incide sobre hipotecas permaneceu em 4,30%. A medida ocorre depois que o banco central cortou inesperadamente as taxas de empréstimo em agosto, em uma tentativa de sustentar o crescimento econômico que foi severamente impactado pelos bloqueios relacionados ao Covid-19 este ano. O PBoC agora precisa manter um delicado equilíbrio de afrouxar a política para estimular o crescimento econômico, ao mesmo tempo em que não garante mais depreciação do yuan. O presidente russo Vladimir Putin anunciou que as forças armadas do país convocariam suas reservas imediatamente e ameaçou com uso de armas nucleares. O movimento representou um importante aumento da escala da guerra contra a Ucrânia. O exército russo está se movendo para anexar os territórios ucranianos ocupados no leste e sul do país. O ataque russo vem como resposta à recente contra-ofensiva ucraniana que impôs derrotas significativas ao seu adversário. O dólar fechou a

8
✓
C
S
S
S



semana com queda de 0,24%. Em 2022, a moeda norte-americana acumula recuo de 5,86. NO BRASIL - O Comitê de Política Monetária do Banco Central do Brasil, o Copom, manteve a taxa Selic em 13,75%, em linha com as expectativas. A decisão significou interrupção no processo de alta de juros iniciado em março de 2021, quando a taxa básica estava em 2,00%. O comunicado que acompanhou a decisão trouxe elementos que sugerem que, apesar da manutenção dos juros, o Copom segue preocupado com a inflação. O comitê tentou sinalizar que a decisão representa uma pausa para avaliação, não necessariamente o fim do ciclo de aperto monetário. O Ibovespa encerra a semana com alta acumulada de 2,22%, aos 111.716 pontos. RELATÓRIO FOCUS - Quanto o relatório focus dessa semana, as projeções para 2022 seguem da seguinte forma: Para o IPCA a projeção diminuiu de 6,00% para 5,88%. O PIB aumentou de 2,65% para 2,67%. Já a taxa de câmbio não houve alterações, sendo R\$5,20. Quanto a taxa selic, a projeção permanece em 13,75%. EXPECTATIVA - Na próxima semana, o destaque continua sendo a política monetária nos Estados Unidos, com discursos de dirigentes do Fed e a divulgação do índice de inflação preferido pelo Fed, o deflator dos gastos com consumo, que devem dar o tom para o mercado. Além disso, nos EUA teremos o dado de PIB do segundo trimestre, sondagens empresariais de setembro na China e inflação ao consumidor de agosto na Europa. A próxima semana será marcada pela reta final do primeiro turno das eleições e pela ata da última reunião do Copom. Na seara de dados econômicos, os destaques no Brasil serão o IPCA-15 de setembro, para o qual esperamos deflação de -0,16% e os dados de setor externo e mercado de trabalho de agosto. O aperto monetário interno e a manutenção de um arcabouço de regras fiscais compatível com o compromisso com a disciplina fiscal – que mantenha, portanto, sob controle o risco associado à evolução das contas públicas – devem permitir a gradual redução da inflação ao longo de 2023 e propiciar as condições para a recuperação do crescimento ao longo do próximo ano. Para 2023, projeta-se crescimento do PIB de 1,6%. Esse crescimento deverá ser puxado pelo setor agropecuário, que, após cair em 2022, deve crescer 10,9% em 2023. Para a indústria e os serviços, projetam-se taxas de crescimento de 0,8% e 0,7%. Quanto à inflação, ao contrário do que vem ocorrendo em grande parte dos países, nos últimos três meses, a inflação brasileira surpreendeu favoravelmente, beneficiada, sobretudo, pela melhora no comportamento dos preços administrados. E, nas últimas semanas, o cenário prospectivo para a inflação vem se tornando melhor. As novas projeções do Grupo de Conjuntura do Ipea indicam variação menor do Índice de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA), em 2022, de 5,7%, comparativamente à estimada na edição anterior da Visão Geral da Carta de Conjuntura



de 6,6%, há três meses. No caso do Índice Nacional de Preços ao Consumidor (INPC), a projeção também foi revista para baixo, e a taxa estimada recuou de 6,3% para 6,0%. Para 2023, as projeções de inflação foram mantidas em 4,7%, tanto para o IPCA, quanto para o INPC.

3º AVALIAÇÃO CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA TABOÃOOPREV: SETEMBRO DE 2022:

Sub-segmento	Valor	%	Característica
TÍTULOS PÚBLICOS	45.170.457,31	5,60%	TÍTULOS PÚBLICOS - R\$ 45.170.457,31
TÍTULOS PRIVADOS - LETRAS FINANCEIRAS	40.058.125,02	4,96%	TÍTULOS PRIVADOS - R\$ 40.058.125,02
IMA-B	264.876.142,73	32,83%	LONGO PRAZO - R\$ 272.117.541,77
FIDC	0,01	0,00%	
CRÉDITO PRIVADO	7.241.399,03	0,90%	
IMA-B 5	98.263.937,41	12,18%	MÉDIO PRAZO - R\$ 105.963.061,85
IDKA IPCA 2A	7.699.124,44	0,95%	
CDI	121.077.242,80	15,01%	CURTO PRAZO - R\$ 121.077.242,80
AÇÕES - VALOR	11.574.561,36	1,43%	AÇÕES - R\$ 98.848.275,26
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	30.456.584,63	3,77%	
AÇÕES - LIVRES	16.246.779,81	2,01%	
AÇÕES - DIVIDENDOS	13.865.322,49	1,72%	
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	26.705.026,97	3,31%	
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	17.613.220,85	2,18%	MULTIMERCADO - R\$ 17.613.220,85
FUNDO IMOBILIÁRIO	7.548.433,34	0,94%	FUNDO IMOBILIÁRIO - R\$ 7.548.433,34
FIP	1.177.575,57	0,15%	FIP - R\$ 1.177.575,57
AÇÕES - EXTERIOR	32.729.512,89	4,06%	EXTERIOR - R\$ 97.323.237,38
MULTIMERCADO - EXTERIOR	64.593.724,49	8,01%	

Os membros do Conselho Fiscal acompanharam a Carteira de Investimentos da Taboãooprev e concluíram que os investimentos estão abrangendo os vértices de Longo, Médio e Curto Prazo, e observaram que as recomendações de investimentos têm sido seguidas com a devida cautela, respeitando os limites da política de investimentos e as exigências da Resolução nº 4.963/2021. Os membros do Conselho Fiscal também analisaram a rentabilidade mensal em percentual de todos os investimentos em Renda Fixa, Renda Variável e no Exterior da Taboãooprev até o mês de Setembro/2022. **4º Aprovação das contas de Julho de 2022 e Evolução dos Investimentos e Rentabilidade Acumulada até Julho de 2022:** o Sr. Daniel César tomou a palavra e explicou aos conselheiros que até a presente data a Prefeitura Municipal de Taboão da Serra e a Câmara Municipal **estão em dia com o repasse da contribuição dos Servidores e Patronal**. Os acordos de parcelamento, em especial o ACORDO DE PARCELAMENTO nº 513/2021, estão sendo pagos em dia, conforme demonstrado abaixo:



TABOÃOOPREV

Autarquia Previdenciária



Termos de Parcelamento em vigor: Base Setembro/2022

ACORDOS DE PARCELAMENTO	PARCELA Nº	VALORES ATUALIZADOS	LEGISLAÇÃO
0573/2015	086/240	523.348,27	Lei nº 2.228/2015
0238/2016	079/240	12.930,54	Lei nº 2.246/2016
0513/2021	018/60	668.052,13	Lei nº 2.368/2021
TOTAL MENSAL		R\$ 1.204.330,94	

Na sequência foi explicado aos conselheiros o Demonstrativo de Receita, Despesas e saldo, constatou-se saldo financeiro no valor de **R\$ 806.907.588,34** (Oitocentos e Seis Milhões, Novecentos e Sete Mil, Quinhentos e Oitenta e Oito Reais e Trinta e Quatro Centavos), referentes à prestação de contas/saldo financeiro do mês de Setembro de 2022, que foi apreciada pelos conselheiros, o Conselho Fiscal também apreciou a Evolução dos Investimentos e a Rentabilidade Acumulada das Aplicações que totalizam **R\$ 800.868.837,81** (Oitocentos Milhões, Oitocentos e Sessenta e Oito Mil, Oitocentos e Trinta e Sete Reais e Oitenta e Um Centavos), distribuídos em Renda Fixa R\$ 538.299.970,41, Renda Variável R\$ 177.109.834,31 e Investimentos no Exterior R\$ 45.400.908,09, apresentando uma rentabilidade negativa no mês de **R\$ -2.039.077,71**, **mas positiva no ano no valor de R\$ 9.605.634,76** equivalendo a um retorno de -0,25% no mês, sendo que a meta atuarial acumulada no ano está em 7,85% a.a. e a rentabilidade acumulada da Taboãooprev está em 1,24% a.a., ou seja, **a Taboãooprev está 6,61% abaixo da meta atuarial**. De acordo com a Resolução nº 4.963/2021 que dispõe sobre as aplicações dos recursos dos Regimes Próprios de Previdência Social, foi constatado que as aplicações estão sendo feitas de acordo com a legislação, portanto, os membros do Conselho Fiscal consideraram aprovadas as contas e os investimentos referentes ao mês de Setembro de 2022, e juntamente com o Comitê de Investimentos e com o Conselho Deliberativo, estarão acompanhando com atenção os investimentos. **5º Aprovar e referendar os investimentos apresentados no Relatório Analítico dos Investimentos Base: Setembro/2022:** Os conselheiros analisaram o relatório analítico dos investimentos que reflete o que é apresentado mensalmente ao conselho em relação aos investimentos da Taboãooprev, os membros do Comitê de Investimentos aprovaram os investimentos por estarem de acordo com a Política de Investimentos de 2022 e de acordo com a legislação vigente. **6º Acompanhamento da Evolução da execução do orçamento da Taboãooprev:** Como forma de acompanhar o correto andamento da Gestão Previdenciária, os conselheiros analisaram a “Evolução da Execução do Orçamento” de 2022 da Taboãooprev. Foram analisadas as RECEITAS



TABOÃOOPREV

Autarquia Previdenciária



ORÇAMENTÁRIAS, sendo as principais: Contribuições (*do ente, servidores, aposentados e pensionistas, Parcelamentos devidos pelo ente, Rendimentos das aplicações financeiras e investimentos patrimoniais e Recursos da compensação financeira previdenciária COMPREV (tem por finalidade ressarcir o regime instituidor do benefício (RPPS) dos valores recolhidos ao regime de origem do segurado (RGPS)). Também foram analisadas as DESPESAS ORÇAMENTÁRIAS, sendo as principais: Pagamento de Aposentados e Pensionistas, Despesas da compensação financeira previdenciária COMPREV (tem por finalidade ressarcir regime instituidor do benefício (RGPS) dos valores recolhidos ao regime de origem do segurado (RPPS)) e Despesas relacionadas à Taxa de Administração da Autarquia (destinada exclusivamente ao custeio das despesas correntes e de capital necessárias à organização e ao funcionamento da Unidade Gestora do RPPS, inclusive para a conservação do seu patrimônio). A seguir apresentamos o quadro resumido da execução orçamentária:*

Receitas 2022	R\$	Despesas 2022	R\$
Valor Previsto	92.137.000,00	Fixado Final	94.547.000,00
Transferências Financeiras	2.410.000,00		
Valor Arrecadado	84.413.675,88	Realizado	50.586.506,87
Percentual Arrecadado sobre o Previsto	89,28%	Percentual Realizado sobre o Fixado	53,50%

Superáviz Orçamentário de R\$ 33.827.169,01 (Valor Arrecado das Receitas - Valor Realizado das Despesas)

Conforme o quadro resumo, até a presente data, cerca de 89,28% das Receitas Previstas foram arrecadadas e cerca de 53,50% das Despesas Fixadas já foram realizadas pela autarquia. Em relação às receitas, as Contribuições Previdenciárias dos servidores e dos entes tem sido repassadas sem atrasos, os parcelamentos têm sido pagos em dia e sem atrasos, a autarquia tem recebido o COMPREV de acordo com o cronograma da Secretaria de Previdência e os rendimentos das aplicações financeiras no acumulado do ano estão apresentando um resultado positivo. Destacamos que a elevação da arrecadação da Receita, em parte, é reflexo da Lei Complementar nº 381/2022 que reajustou o "Piso Salarial" dos educadores do Quadro do Magistério Municipal. Em relação às Despesas, a autarquia tem percebido uma elevação nos pagamentos de aposentados e pensionistas, devido ao aumento nos pedidos de aposentadoria, assim como aumento de falecimentos de beneficiários, os pagamentos do COMPREV estão em ordem, de acordo com o cronograma da Secretaria de Previdência, em relação as



despesas relacionadas a Taxa de Administração, até a presente data, todas encontram-se equilibradas e sem aumentos significativos. **7º Aplicação dos recursos repassados para a Taboãooprev e Proposta de aquisição de Títulos Públicos Federais e Letras Financeiras:** A maioria dos membros do Comitê de Investimentos da Taboãooprev estão devidamente certificados, conforme estabelece a Regra Transitória do Ministério da Previdência, apesar disto, a Diretoria Executiva continua enfatizando aos membros do Comitê de Investimentos, sobre a necessidade de todos os conselheiros estarem devidamente certificados.

Os membros do Comitê de Investimentos estão propondo aos conselheiros, enquanto não investimos em Títulos Públicos, o que segue:

1) Investimento no fundo MAG CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO, conforme a lâmina em anexo, o fundo está apresentando 8,48%a.a. de rentabilidade e nossa meta atuarial está em 7,74%a.a.. A Crédito e Mercado já analisou e aprovou tal investimento. A administração do fundo é da BEM DTVM (Bradesco), gestão da Mongeral Aegon Investimentos Ltda e custódia do Banco Bradesco S.A. – todos devidamente credenciados na Taboãooprev. A proposta de investimento no fundo MAG CRÉDITO PRIVADO é para diversificarmos a nossa carteira de Renda Fixa com um produto que está apresentando uma boa rentabilidade. Proposta: Investir R\$ 10 milhões, sendo retirados de fundo IMA B de longo prazo.

2) Investimento no fundo RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO, conforme a apresentação enviada aos conselheiros, o fundo tem a função de “proteger” os investimentos em Bolsa Americana. A Crédito e Mercado já analisou e recomendou que podemos fazer esse investimento, desde que os recursos venham do mesmo segmento. A administração do fundo é da BEM DTVM (Bradesco), gestão da Rio Bravo Investimentos Ltda e custódia do Banco Bradesco S.A. – todos devidamente credenciados na Taboãooprev. Proposta: Investir em torno de R\$ 15 milhões, sendo retirados de fundo WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO, que é do **mesmo segmento**. As duas propostas apresentadas foram aprovadas pelos conselheiros do Conselho Deliberativo e Comitê de Investimentos.

O Comitê de Investimentos está analisando a aquisição de Títulos Públicos Federais, assim como, novas possibilidades de investimentos, até que essas análises estejam concluídas os novos recursos recebidos pela Taboãooprev ainda deverão ser investidos em CDI, por ser um investimento de baixíssimo risco e estar apresentando uma boa rentabilidade. Os membros do Comitê de Investimentos também estarão analisando novas possibilidades de investimentos, visando o atingimento da meta atuarial. **8º Fato**



Relevante - QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CNPJ Nº 09.289.072/0001-75: No dia 18/10/2022 a Administradora do fundo Queluz Valor Fia, publicou o seguinte "Fato Relevante":

"A **BEM Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.**, inscrita no CNPJ/ME sob o nº 00.066.670/0001-00 ("Administradora"), na qualidade de administradora do **QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES**, inscrito no CNPJ/ME sob nº 09.289.072/0001-75 ("Fundo"), vem, pelo presente, **INFORMAR** que o Fundo sofreu impacto negativo correspondente a 28,7% (vinte e oito vírgula setenta por cento) do Patrimônio Líquido do Fundo, apurado para a cota de fechamento do dia 14 de outubro de 2022, originado por operações em derivativos realizadas pela gestora do Fundo **QLZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.**

Em razão do fato acima, esta Administradora requereu da gestora as medidas e providências adotadas para o caso."

A Distribuidora Atina Investimentos enviou no dia 21/10/2022 um comunicado da Gestora do Fundo a QLZ Gestão de Recursos Financeiros:

COMUNICADO AO MERCADO

QUELUZ VALOR FIA – CNPJ 09.289.072/0001-75 ("Fundo")

No último dia 14/10/2022 (sexta-feira), em ato unilateral e isolado, o gestor do Fundo e Diretor de Renda Variável da Queluz montou posição em derivativos em volume superior àqueles usualmente praticados, em desobediência às políticas internas e regulamento do Fundo, o que acarretou impacto considerável na cota do Fundo, conforme divulgado pelo Administrador em Fato Relevante.

Ao tomar conhecimento do fato, as áreas de controle imediatamente determinaram o encerramento da posição.

Como consequência a Queluz imediatamente desligou o gestor do Fundo e Diretor de Renda Variável responsável pela montagem da posição, além de iniciar a adoção de medidas de responsabilização perante os órgãos competentes, tais como a CVM.

Nessa mesma linha, a Queluz irá contratar uma auditoria independente com objetivo de identificar se houve qualquer irregularidade na condução das operações realizadas, cujo resultado será compartilhado com os cotistas tão logo esteja concluído.

Cumprir destacar que se trata de evento isolado, o que é facilmente verificável pelo histórico do Fundo, que possui mais de 12 (doze) anos de atividade.

Soma-se a isso o histórico de atuação da Queluz no mercado, de mais de 30 (trinta) anos, sem que qualquer evento de natureza semelhante tenha ocorrido ao longo de todo esse tempo, com zelo e responsabilidade perante seus clientes

A Atina Investimentos também realizou uma reunião por videoconferência, via zoom, no dia 19/10/2022 às 10 horas com os membros da Diretoria Executiva, explicando que apesar dos fatos apresentados, a gestora estará se empenhando para recuperar a rentabilidade do fundo. Na ocasião dos fatos narrados a rentabilidade do fundo na carteira



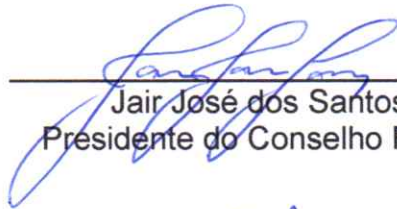
da Taboãoprev apresentou uma rentabilidade negativa de -25,45% em 17/10/2022, o último levantamento apresentado com data de 21/10/2022 mostram que houve uma pequena recuperação da cota do fundo e a rentabilidade negativa caiu para -22,57%. O último comparativo que temos, referente a Setembro/2022 demonstra que o fundo Queluz Valor FIA vinha apresentando boa rentabilidade e na comparação ao longo do tempo, de 2012 à 2022, apresentava uma rentabilidade positiva:

Ano	Retorno (%)	Meta (%)
2022	-22,57%	7,85%
2021	-22,37%	16,49%
2020	-8,47%	10,63%
2019	35,95%	10,58%
2018	15,28%	9,91%
2017	21,20%	9,04%
2016	18,72%	12,63%
2015	-7,94%	17,27%
2014	2,91%	12,82%
2013	0,14%	12,29%
2012	5,29%	2,34%


Após a explanação, os conselheiros fizeram uma série de ponderações e decidiram que devemos solicitar o resgate total do investimento imediatamente, pois desta forma não correremos o risco de uma maior desvalorização do referido fundo. **9º Credenciamento das Instituições Financeiras:** A Diretoria Executiva informou que está em andamento o Credenciamento das Instituições Financeiras, bem como, os fundos de investimentos nos quais a Taboãoprev tem valores investidos, em conformidade com a Resolução CMN nº 4.963 de 25/11/2021 do Banco Central do Brasil, a Portaria MTP nº 1.467 de 02/02/2022 do Ministério da Previdência Social e alterações posteriores. **11º Política de Investimentos 2023:** Os conselheiros estarão recebendo nos próximos dias a minuta da Política de Investimentos para análise e propostas, também deveremos realizar uma reunião com a Consultoria Financeira – Crédito & Mercado para esclarecimentos, a data provável será 16/11/2022, podendo sofrer alteração que será comunicada aos conselheiros por whatsapp. **12º Curso para obtenção da certificação de conselheiro – Itapecerica da Serra:** A Diretoria Executiva informa que será realizado nos dias 28, 29 e 30/11/2022 um curso preparatório para obtenção da certificação profissional exigida para os conselheiros e dirigentes de RPPS, tal curso ocorrerá em Itapecerica da Serra e os conselheiros interessados deverão se manifestar para que sejam efetuadas as inscrições.

Nada mais havendo a tratar, o presidente conselheiro Jair José dos Santos deu por encerrada a reunião, na qual foi lavrada e assinada por mim, Thomaz Martin Gonçalves Oyamaguchi, que secretariei esta reunião do Conselho e por todos os presentes.





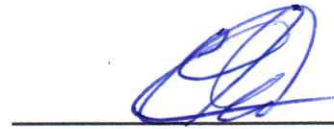
Jair José dos Santos
Presidente do Conselho Fiscal




Thomaz Martin Gonçalves Oyamaguchi
Secretário do Conselho Fiscal



Silvonei Rogério Guedes
Conselheiro do Conselho Fiscal



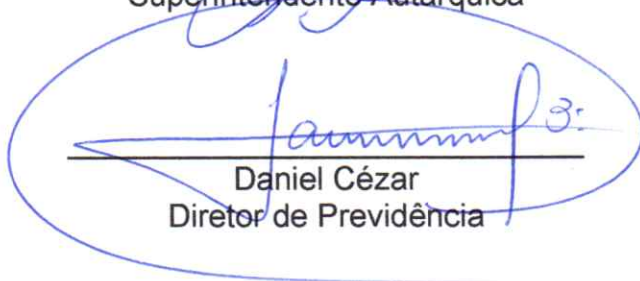
Laércio Calmon dos Santos
Conselheiro do Conselho Fiscal



Eliana Bendini Lantyer
Superintendente Autárquica



Thaysa Pinheiro Monteiro
Diretora Financeira



Daniel César
Diretor de Previdência

QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
CNPJ/ME Nº 09.289.072/0001-75

FATO RELEVANTE

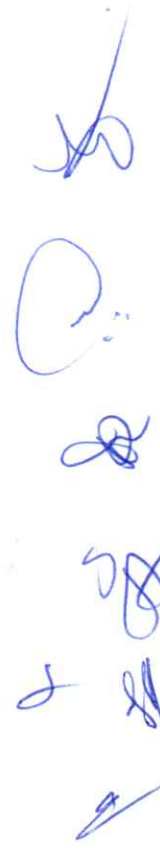
18.10.2022

A **BEM Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.**, inscrita no CNPJ/ME sob o nº 00.066.670/0001-00 ("Administradora"), na qualidade de administradora do **QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES**, inscrito no CNPJ/ME sob nº 09.289.072/0001-75 ("Fundo"), vem, pelo presente, **INFORMAR** que o Fundo sofreu impacto negativo correspondente a 28,7% (vinte e oito vírgula setenta por cento) do Patrimônio Líquido do Fundo, apurado para a cota de fechamento do dia 14 de outubro de 2022, originado por operações em derivativos realizadas pela gestora do Fundo **QLZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.**

Em razão do fato acima, esta Administradora requereu da gestora as medidas e providências adotadas para o caso.

Atenciosamente,

BEM Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda.



COMUNICADO AO MERCADO

QUELUZ VALOR FIA – CNPJ 09.289.072/0001-75 (“Fundo”)

No último dia 14/10/2022 (sexta-feira), em ato unilateral e isolado, o gestor do Fundo e Diretor de Renda Variável da Queluz montou posição em derivativos em volume superior àqueles usualmente praticados, em desobediência às políticas internas e regulamento do Fundo, o que acarretou impacto considerável na cota do Fundo, conforme divulgado pelo Administrador em Fato Relevante.

Ao tomar conhecimento do fato, as áreas de controle imediatamente determinaram o encerramento da posição.

Como consequência a Queluz imediatamente desligou o gestor do Fundo e Diretor de Renda Variável responsável pela montagem da posição, além de iniciar a adoção de medidas de responsabilização perante os órgãos competentes, tais como a CVM.

Nessa mesma linha, a Queluz irá contratar uma auditoria independente com objetivo de identificar se houve qualquer irregularidade na condução das operações realizadas, cujo resultado será compartilhado com os cotistas tão logo esteja concluído.

Cumpramos destacar que se trata de evento isolado, o que é facilmente verificável pelo histórico do Fundo, que possui mais de 12 (doze) anos de atividade.

Soma-se a isso o histórico de atuação da Queluz no mercado, de mais de 30 (trinta) anos, sem que qualquer evento de natureza semelhante tenha ocorrido ao longo de todo esse tempo, com zelo e responsabilidade perante seus clientes

Ficamos à disposição.

São Paulo, 19 de outubro de 2022.

QLZ Gestão de Recursos Financeiros Ltda

07.250.864/0001-00



Queluz desliga gestor após perda de 28% na cota com derivativos

Segundo gestora, posições alavancadas em derivativos ligados ao Ibovespa causaram desvalorização

Por Adriana Cotias, Valor — São Paulo

20/10/2022 18h27 Atualizado há 19 minutos

A **Queluz** comunicou ao mercado o desligamento do seu diretor e gestor de renda variável, **Felipe Taylor**, após uma operação equivocada que trouxe uma desvalorização de 28% para a **cota** do seu **fundo de ações** em 11 de outubro.

Questionado pelo **Valor**, representante da gestora explicou que foram posições alavancadas em derivativos ligados ao Ibovespa que causaram as perdas. A casa identificou que foi assumido um risco acima dos limites do mandato temporariamente, o mecanismo de “stop loss” foi acionado e a posição foi zerada.

O fundo, que tinha valorização de 11,92% no ano, ante 9,54% do índice até aquela data, agora acumula uma desvalorização de 21% no acumulado de 2022. Com o tombo, o patrimônio recuou de R\$ 91 milhões para R\$ 67 milhões. Em junho de 2021, o patrimônio chegou a R\$ 137 milhões. A gestão era então tocada por Fernando Tendolini, que foi para a BV Asset em outubro passado. Em 12 anos, a carteira ainda exibe ganhos de 92%, 21 pontos percentuais acima do Ibovespa.

A preocupação da gestora agora é mostrar que esse foi um fato isolado, numa estratégia unilateral adotada pelo gestor, que vinha com um histórico de acertos. Ainda não há um nome fechado para o seu posto.

Taylor chegou à Queluz em janeiro, vindo da MAG Investimentos, ligada ao grupo Mongeral. Ele tinha sido sócio-fundador da Navi, em 2018, e antes passou pela Kondor.



TABOÃOPREV

Autarquia Previdenciária



Rentabilidade acumulada das aplicações – Base Setembro/2022

RENDA FIXA			
Rentabilidade dos Ativos	No Ano	No Mês	SALDO
TÍTULOS PÚBLICOS	14,35%	-0,26%	45.170.457,31
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIX...	9,30%	1,12%	98.856.816,66
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA L...	9,03%	1,09%	16.192.092,82
META ATUARIAL (IPCA+4,85% a.a.)	7,85%	0,10%	
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO P...	7,80%	0,56%	7.241.399,03
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	6,91%	0,40%	98.263.937,41
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREV...	6,74%	0,53%	7.699.124,44
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	6,09%	1,50%	114.746.933,37
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	5,92%	1,45%	150.129.209,36
LETRAS FINANCEIRAS	0,15%	0,15%	40.058.125,02
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIA	0,00%	0,00%	0,01

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
Rentabilidade dos Ativos	No Ano	No Mês	SALDO
META ATUARIAL (IPCA+4,85% a.a.)	7,85%	0,10%	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES B...	-20,44%	-7,95%	8.082.884,84
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTER	-25,46%	-5,59%	12.671.395,20
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVES	-29,50%	-6,57%	19.057.985,72
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO	-41,21%	-3,03%	5.588.642,33



TABOÃO PREV

Autarquia Previdenciária



Rentabilidade acumulada das aplicações – Base Setembro/2022

RENDA VARIÁVEL			
Rentabilidade dos Ativos	No Ano	No Mês	SALDO
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	12,42%	5,94%	4.744.000,00
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	9,26%	1,11%	2.475.169,59
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	9,00%	-0,21%	784.887,84
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,82%	-0,84%	4.821.665,07
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC ...	8,36%	-0,09%	2.159.846,56
META ATUARIAL (IPCA+4,85% a.a.)	7,85%	0,10%	
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	5,20%	-0,20%	11.574.561,36
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,90%	0,48%	3.693.804,18
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4,25%	-2,36%	2.897.322,95
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	3,24%	1,40%	30.456.584,63
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2,98%	-0,45%	8.140.538,11
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	1,37%	-0,17%	788.480,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,91%	0,84%	15.138.051,26
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,13%	-0,75%	5.114.348,80
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	0,00%	0,00%	0,01
BTG PACTUAL FUNDO DE CRI FII - FEXC11	-0,67%	3,22%	388.960,00
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,74%	-0,31%	3.284.576,63
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR1...	-3,99%	-0,87%	1.622.338,34
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-5,30%	-2,18%	26.705.026,97
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIES...	-18,26%	-0,05%	392.687,72
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	-19,58%	-8,56%	8.464.516,05
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-19,75%	-8,61%	43.457.813,24
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII...	-64,47%	-6,67%	4.655,00



TABOÃOPREV

Autarquia Previdenciária



Resolução nº 4.963/2021 e a Política de Investimentos de 2022

Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/21 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS
Certificado pelo Pró-Gestão! **TABOÃOPREV NÍVEL II DO PRÓ-GESTÃO RPPS**

Base Setembro/2022

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação Limite - 2022			GAP*
	Pró Gestão Nível 2	\$	%	Inferior	Alvo	Superior	Superior
				%	%	%	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	45.170.457,31	5,60%	5,00%	9,00%	40,00%	277.588.411,15
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	370.839.204,58	45,96%	30,00%	40,00%	80,00%	274.678.532,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	121.077.242,80	15,01%	10,00%	17,00%	60,00%	363.061.059,89
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	40.058.125,02	4,96%	0,00%	1,00%	2,00%	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	10,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,10%	2,00%	16.137.943,41
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10,00%	7.241.399,03	0,90%	0,00%	2,00%	5,00%	33.103.459,53
Total Renda Fixa	100,00%	584.386.428,75	72,42%	45,00%	69,10%	189,00%	
Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP*
	Pró Gestão Nível 2	\$	%	Inferior	Alvo	Superior	Superior
				%	%	%	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	98.848.275,26	12,25%	10,00%	13,00%	40,00%	223.910.593,20
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	80.689.717,12
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	69.535.550,14	8,62%	5,00%	8,00%	10,00%	11.154.166,98
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	1.177.575,57	0,15%	0,00%	0,20%	0,50%	2.856.910,29
Artigo 11º	10,00%	7.159.473,34	0,89%	0,00%	1,00%	2,00%	8.978.470,08
Desenquadrado - RV	0,00%	388.960,00	0,05%	0,00%	0,00%	0,00%	-388.960,00
Total Renda Variável	40,00%	177.109.834,31	21,95%	15,00%	22,20%	62,50%	
Artigos - Exterior	Resolução %	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP*
	Pró Gestão Nível 2	\$	%	Inferior	Alvo	Superior	Superior
				%	%	%	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	37.318.023,25	4,62%	2,00%	7,00%	10,00%	43.371.693,87
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	8.082.884,84	1,00%	1,00%	1,70%	10,00%	72.606.832,28
Total Exterior	10,00%	45.400.908,09	5,63%	3,00%	8,70%	20,00%	

*O GAP indica o valor que a Taboãoprev ainda pode investir em cada artigo da Resolução nº 4.963/2021.

Artigo 7º, Inciso I, Alínea A - Até 100% (cem por cento) em títulos de emissão do Tesouro Nacional, registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia SELIC.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B - Até 100% (cem por cento) cotas de fundos de investimento, constituídos sob a forma de condomínio aberto, cujos regulamentos prevejam que suas respectivas carteiras sejam representadas exclusivamente pelos títulos definidos na alínea 'a' deste inciso e cuja política de investimento assuma o compromisso de buscar o retorno de um dos subíndices do Índice de Mercado Anbima (IMA) ou do Índice de Duração Constante Anbima (IDkA), com exceção de qualquer subíndice atrelado à taxa de juros de um dia.
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A - até 60% (sessenta por cento) no somatório dos seguintes ativos: a) cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários, constituídos sob a forma de condomínio aberto (fundos de renda fixa);
Artigo 7º, Inciso V, Alínea A - até 5% (cinco por cento) em: a) cotas de classe sênior de fundos de investimento em direitos creditórios (FIDC);
Artigo 7º, Inciso V, Alínea B - até 5% (cinco por cento) em: b) cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa com sufixo "crédito privado" constituídos sob a forma de condomínio aberto, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários (fundos de renda fixa);
Artigo 8º, Inciso I - Até 30% (vinte por cento) cotas de fundos de investimento classificados como ações, constituídos sob a forma de condomínio aberto, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários (fundos de renda variável);
Artigo 10º, Inciso I - No segmento de investimentos estruturados, as aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social subordinam-se ao limite global de até 15% (quinze por cento), e adicionalmente aos seguintes: I - até 10% (dez por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como multimercado (FIM) e em cotas de fundos de investimento em cotas de fundos de investimento classificados como multimercado (FICFIM);
Artigo 10º, Inciso II - No segmento de investimentos estruturados, as aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social subordinam-se ao limite global de até 15% (quinze por cento), e adicionalmente aos seguintes: II - até 5% (cinco por cento) em cotas de fundos de investimento em participações (FIP), constituídos sob a forma de condomínio fechado, vedada a subscrição em distribuições de cotas subsequentes, salvo se para manter a mesma proporção já investida nesses fundos;
Artigo 11º , No segmento de fundos imobiliários, as aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social sujeitam-se ao limite de até 5% (cinco por cento) em cotas de fundos de investimento imobiliários (FII) negociadas nos pregões de bolsa de valores.
Artigo 9º, Inciso II - No segmento de investimentos no exterior, as aplicações dos recursos dos regimes próprios de previdência social subordinam-se ao limite de até 10% (dez por cento) no conjunto de: II - cotas de fundos de investimento constituídos no Brasil sob a forma de condomínio aberto com o sufixo "Investimento no Exterior", nos termos da regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários, que invistam, no mínimo, 67% (sessenta e sete por cento) do seu patrimônio líquido em cotas de fundos de investimento constituídos no exterior;
Artigo 9º, Inciso III - No segmento de investimentos no exterior, as aplicações dos recursos dos regimes próprios de previdência social subordinam-se ao limite de até 10% (dez por cento) no conjunto de: III - cotas dos fundos da classe "Ações - BDR Nível I", nos termos da regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários.

Taboãoprev – Autarquia Previdenciária do Município de Taboão da Serra

Rua Mario Latorre, 130 – Parque Pinheiros – CEP 06767-230 – Taboão da Serra – SP

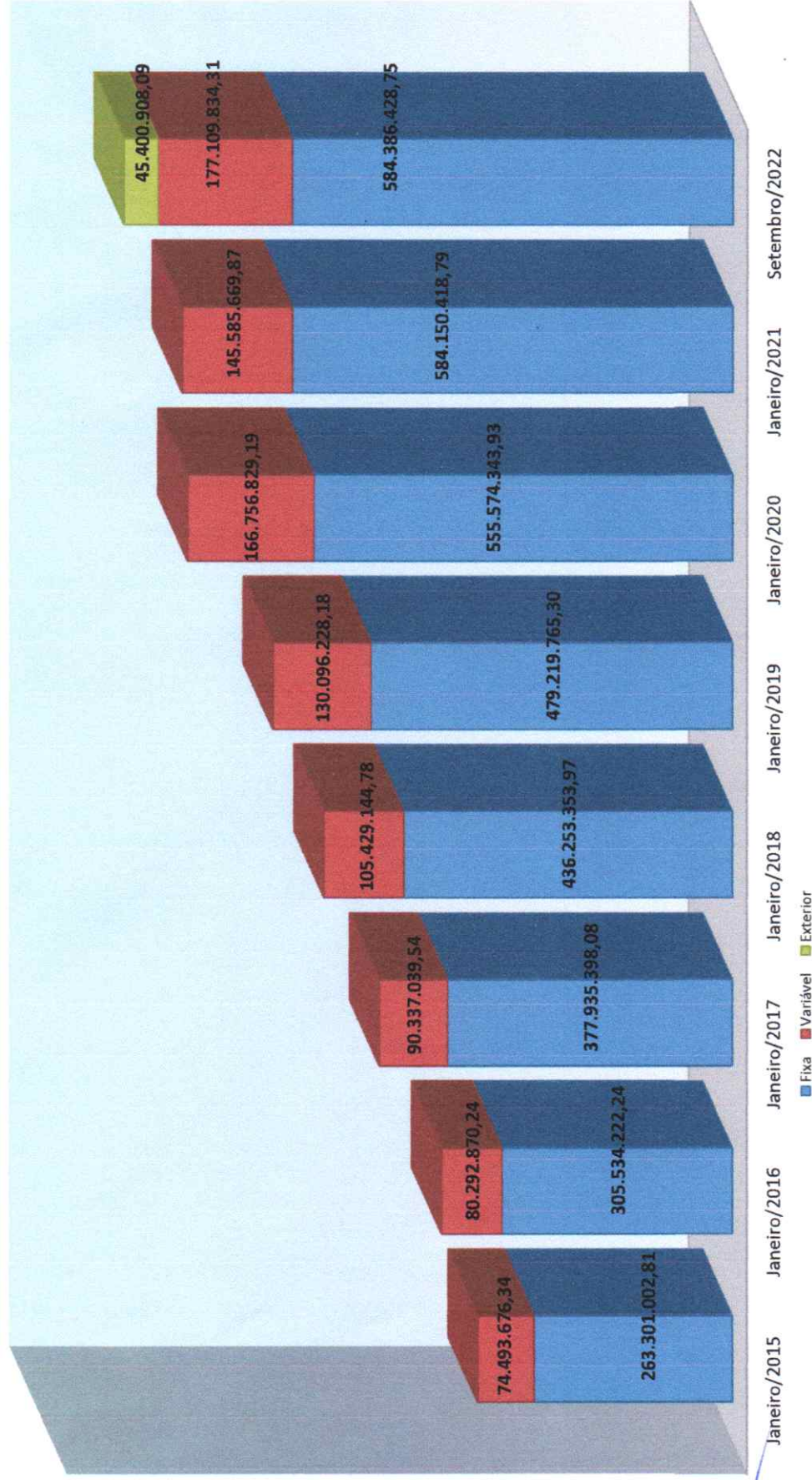
Tels: (11) 4787-6029 / 4135-4977 / 4701-6344

www.taboaoprev.com.br

3



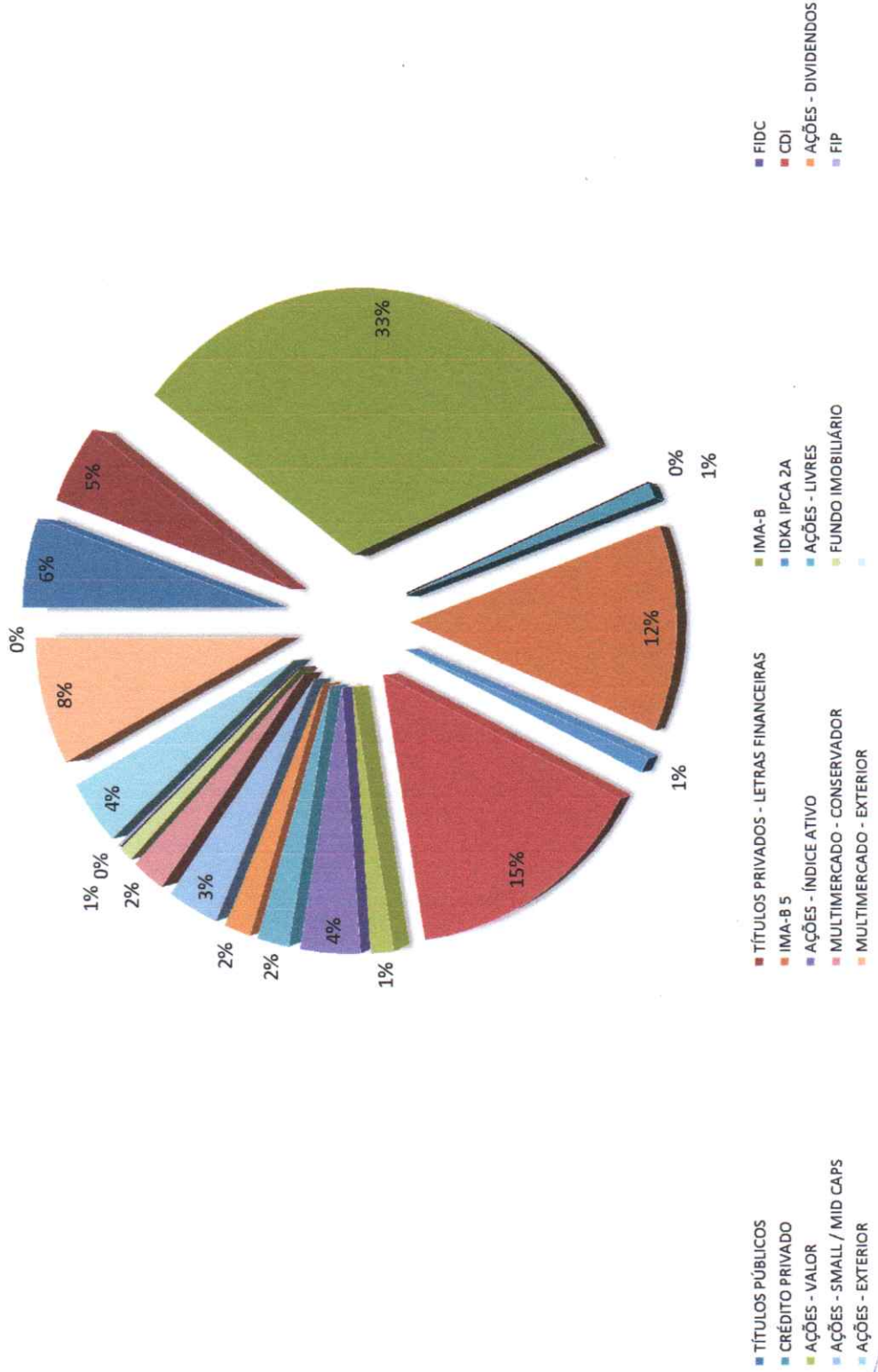
Evolução dos Investimentos da TaboãoPrev de Jan/2015 à Set/2022



[Handwritten signatures and initials in blue ink]



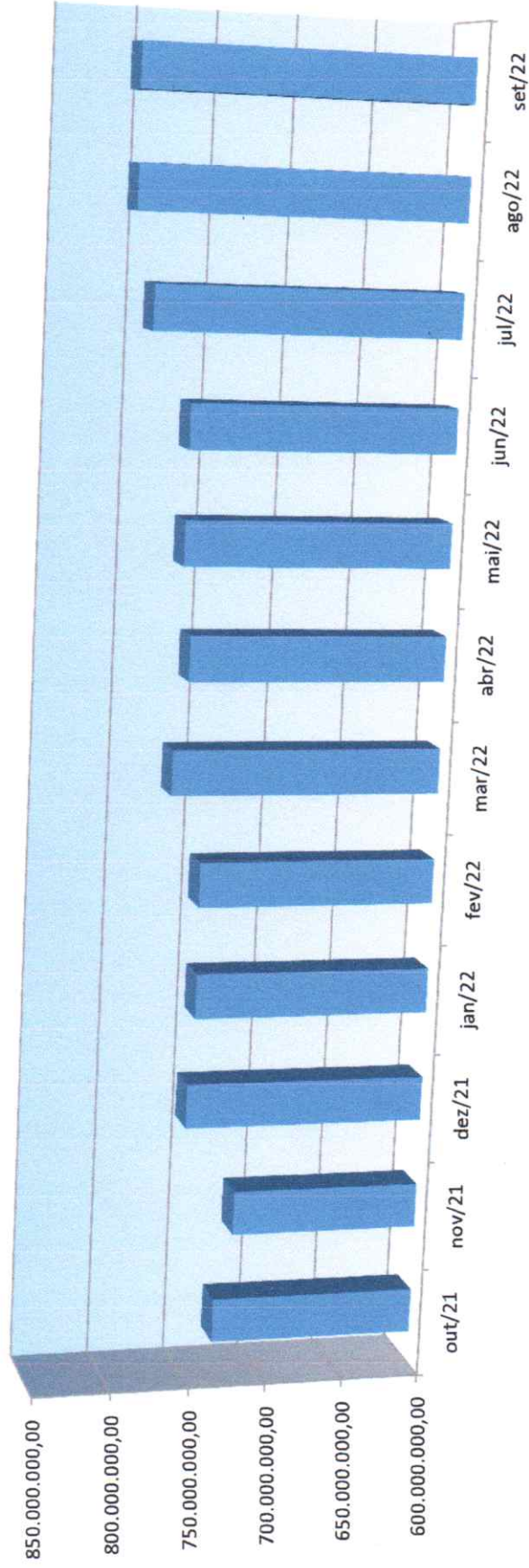
Distribuição dos Investimentos por Segmento Setembro/2022



[Handwritten signatures and initials in blue ink]



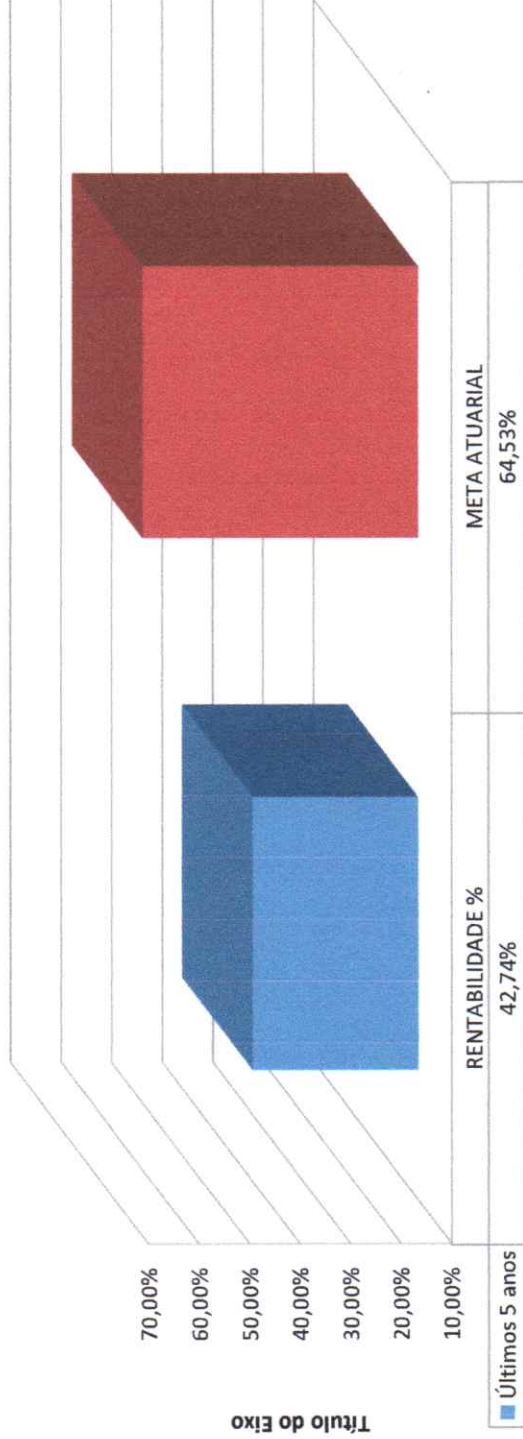
Evolução dos Investimentos últimos 12 meses



[Handwritten signatures and initials in blue ink]



Rentabilidade Acumulada nos últimos 5 anos

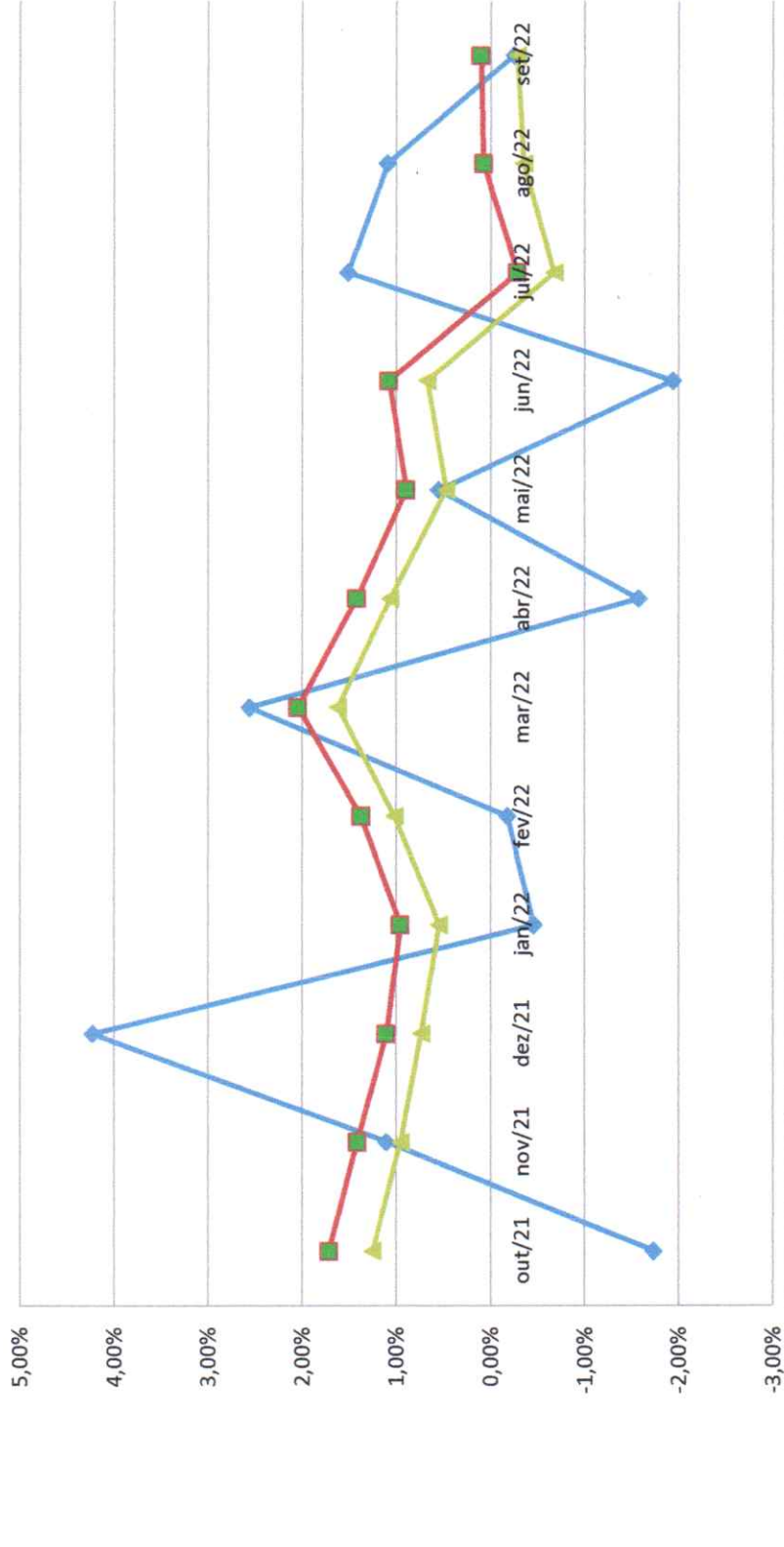


ANO	RENTABILIDADE EM R\$	RENTABILIDADE %	META ATUARIAL
2017	52.185.685,35	11,24%	9,04%
2018	49.574.529,27	9,26%	9,92%
2019	100.490.559,08	16,71%	10,59%
2020	30.800.872,25	4,34%	10,63%
2021	-473.634,92	-0,05%	16,50%
2022	9.605.634,76	1,24%	7,85%
Últimos 5 anos	242.183.645,79	42,74%	64,53%

[Handwritten signatures and initials]



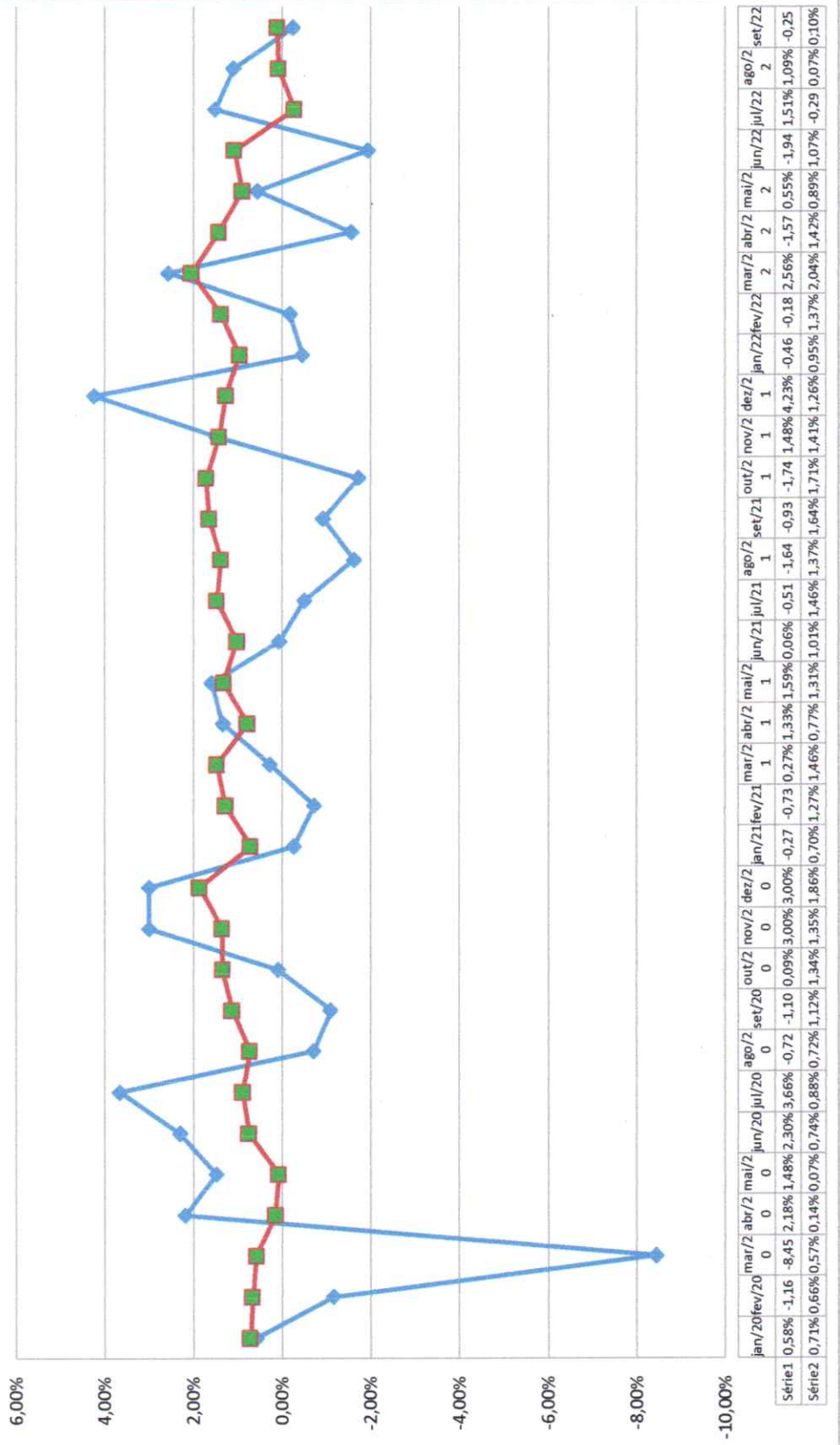
Comparativo da Meta Atuarial e Retorno da Carteira de Investimentos



[Handwritten signatures and initials]



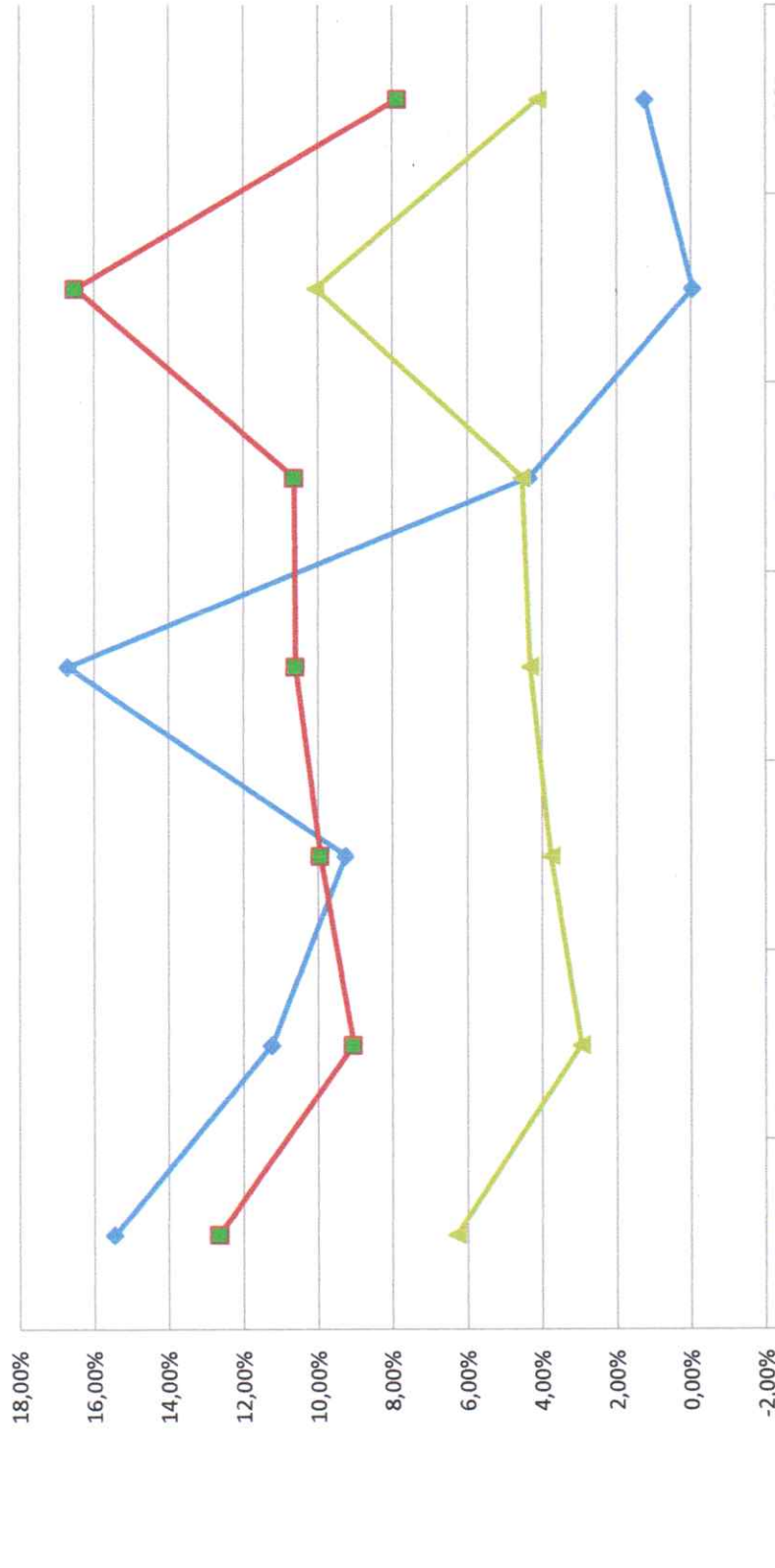
Comparativo Retorno x Meta (2019-2022)



Handwritten signatures and initials in blue ink.



Comparativo da Meta x Retorno Anual

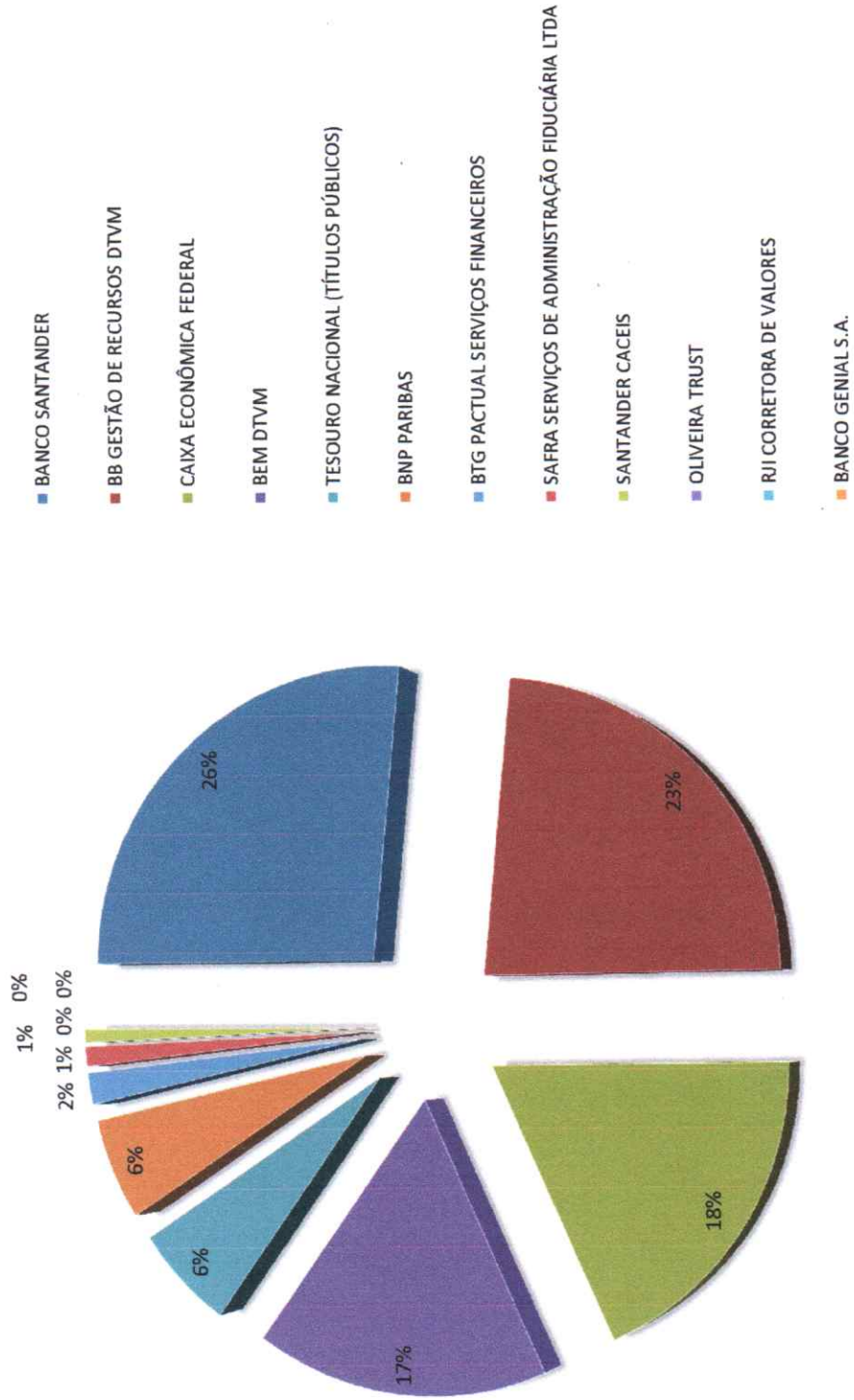


	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022
Retorno		11,24%	9,26%	16,71%	4,34%	-0,05%	1,24%
Meta Atuarial (%)	12,64%	9,04%	9,92%	10,59%	10,63%	16,50%	7,85%
IPCA%	6,28%	2,94%	3,75%	4,31%	4,52%	10,06%	4,09%

[Handwritten signatures and initials in blue ink]



Distribuição dos Investimentos por Administrador Setembro/2022



[Handwritten signatures and initials in blue ink]

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2022



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

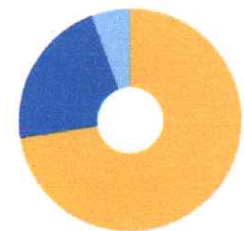
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			45.170.457,31	5,60%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	7.699.124,44	0,95%	1.050	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	150.129.209,36	18,61%	575	2,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	114.746.933,37	14,22%	773	2,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	98.263.937,41	12,18%	140	11,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.192.092,82	2,01%	623	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	104.885.149,98	13,00%	481	3,87%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info		9.993.217,75	1,24%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SAFRA	S/Info		30.064.907,27	3,73%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%	1	100,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	7.241.399,03	0,90%	112	3,31%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	5.114.348,80	0,63%	14	0,61%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	8.140.538,11	1,01%	5.193	2,45%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	26.705.026,97	3,31%	4.177	1,69%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	3.284.576,63	0,41%	3.431	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.897.322,95	0,36%	466	5,91%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	2.159.846,56	0,27%	167	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.693.804,18	0,46%	3.735	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.821.665,07	0,60%	1.640	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	30.456.584,63	3,77%	17.965	10,06%	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
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	11.574.561,36	1,43%	68	12,89%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	12.671.395,20	1,57%	62	1,09%	Artigo 9º, Inciso II
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXT...	D+6 du	Não há	5.588.642,33	0,69%	10	35,29%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	19.057.985,72	2,36%	316	7,23%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	8.082.884,84	1,00%	29.600	1,93%	Artigo 9º, Inciso III
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	2.475.169,59	0,31%	29	3,16%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	15.138.051,26	1,88%	22	11,88%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	8.464.516,05	1,05%	119	1,20%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	43.457.813,24	5,39%	33.964	4,09%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRA...	Não se ...	Não se aplica	392.687,72	0,05%	21	0,22%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	784.887,84	0,10%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	S/Info	Não se aplica	1.622.338,34	0,20%		0,09%	Artigo 11º
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	S/Info	Não se aplica	788.480,00	0,10%		0,05%	Artigo 11º
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	S/Info	Não se aplica	4.744.000,00	0,59%		0,84%	Artigo 11º
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - ...	S/Info	Não se aplica	4.655,00	0,00%		1,05%	Artigo 11º
BTG PACTUAL FUNDO DE CRI FII - FEXC11	S/Info	Não se aplica	388.950,00	0,05%		0,13%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			806.897.171,15				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	45.170.457,31	5,60%	5,00%	9,00%	40,00%	277.588.411,15
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	370.839.204,58	45,96%	30,00%	38,00%	80,00%	274.678.532,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	121.077.242,80	15,01%	10,00%	16,00%	60,00%	363.061.059,89
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	40.058.125,02	4,96%	0,00%	5,00%	20,00%	121.321.309,21
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	10,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,10%	2,00%	16.137.943,41
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10,00%	7.241.399,03	0,90%	0,00%	2,00%	5,00%	33.103.459,53
Total Renda Fixa	100,00%	584.386.428,75	72,42%	45,00%	70,10%	207,00%	

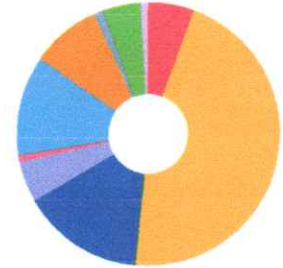


RENDA FIXA 584.386.428,75
RENDA VARIÁVEL 177.109.834,00
EXTERIOR 45.400.900,00

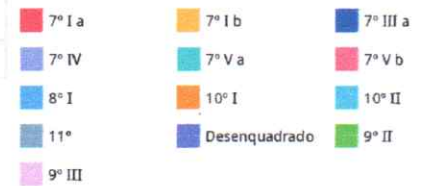
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	98.848.275,26	12,25%	10,00%	13,00%	40,00%	223.910.593,20
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	80.689.717,12
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	69.535.550,14	8,62%	5,00%	8,00%	10,00%	11.154.166,98
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	1.177.575,57	0,15%	0,00%	0,20%	0,50%	2.856.910,29
Artigo 11º	10,00%	7.159.473,34	0,89%	0,00%	1,00%	2,00%	8.978.470,08
Desenquadrado - RV	0,00%	388.960,00	0,05%	0,00%	0,00%	0,00%	-388.960,00
Total Renda Variável	40,00%	177.109.834,31	21,95%	15,00%	22,20%	62,50%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	37.318.023,25	4,62%	2,00%	6,00%	10,00%	43.371.693,87
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	8.082.884,84	1,00%	1,00%	1,70%	10,00%	72.606.832,28
Total Exterior	10,00%	45.400.908,09	5,63%	3,00%	7,70%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	203.149.087,39	25,18	0,05
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	178.582.613,84	22,13	-
CAIXA DTVM	140.340.271,78	17,39	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	45.170.457,31	5,60	-
WESTERN ASSET	43.457.813,24	5,39	0,09
AZ QUEST INVESTIMENTOS	34.845.565,08	4,32	0,10
GENIAL INVESTIMENTOS	30.456.584,63	3,77	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	19.057.985,72	2,36	0,22
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	15.138.051,26	1,88	1,16
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	11.574.561,36	1,43	-
BANCO J. SAFRA S/A	8.464.516,05	1,05	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	6.481.989,13	0,80	0,00
MIRAE ASSET	5.588.642,33	0,69	-
ARX INVESTIMENTOS	5.114.348,80	0,63	0,01
NAVI CAPITAL	4.821.665,07	0,60	0,36
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIR...	4.744.000,00	0,59	0,00
ICATU VANGUARDA	3.693.804,18	0,46	0,01
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	3.284.576,63	0,41	0,00
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	2.475.169,59	0,31	0,02
BRZ INVESTIMENTOS	392.687,72	0,05	0,02
RB CAPITAL ASSET MANAGEMENT	4.655,00	0,00	0,00
PLURAL	0,02	0,00	0,00

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'	45.170.457,31	5,60	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	370.839.204,58	45,96	30,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	121.077.242,80	15,01	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	0,01	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	7.241.399,03	0,90	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	98.848.275,26	12,25	10,00	40,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	37.318.023,25	4,62	2,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	8.082.884,84	1,00	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	69.535.550,14	8,62	5,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	1.177.575,57	0,15	0,00	0,50
Artigo 11º	7.159.473,34	0,89	0,00	2,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,20%	8,74%	0,17%	3,87%	13,60%	32,72%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,56%	7,80%	0,93%	3,74%	9,33%	13,52%	1,11%	0,04%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,42%	7,07%	0,43%	3,14%	9,25%	15,75%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,40%	6,91%	0,39%	3,03%	9,03%	15,26%	1,27%	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%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50%	6,09%	1,76%	3,18%	7,15%	11,91%	2,47%	0,06%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09%	9,03%	3,33%	6,29%	11,10%	14,29%	0,02%	0,01%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	9,30%	3,41%	6,53%	11,54%	15,48%	0,02%	0,01%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 1	-	0,00%	0,00%	0,00%	900,00%	900,00%	-	-

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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,54%	12,18%	1,25%	6,07%	18,42%	44,21%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
S&P 500 (Benchmark)	-9,34%	-24,77%	-5,28%	-20,85%	-16,76%	6,62%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-8,61%	-19,75%	-2,61%	-17,32%	-9,32%	18,56%	11,68%	0,22%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,35%	10,27%	0,65%	4,85%	15,74%	37,77%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-0,21%	9,00%	2,86%	3,89%	3,90%	11,30%	-	-
IDIV (Benchmark)	-1,80%	9,21%	4,42%	-5,43%	7,21%	28,20%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-0,09%	8,36%	6,94%	-6,33%	4,58%	21,26%	9,68%	0,18%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,48%	4,90%	10,25%	-7,40%	-3,65%	3,03%	9,96%	0,19%
IBX (Benchmark)	-0,05%	4,43%	10,77%	-9,10%	-1,33%	16,26%	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-0,20%	5,20%	8,32%	-7,91%	-3,62%	-6,12%	11,38%	0,21%
Ibovespa (Benchmark)	0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	1,40%	3,24%	14,12%	-6,09%	-4,39%	5,65%	10,16%	0,21%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-2,36%	4,25%	6,23%	-7,15%	-8,07%	-1,11%	8,62%	0,19%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,31%	-0,74%	14,38%	-9,67%	-20,04%	-23,90%	9,85%	0,26%

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
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-0,45%	2,98%	11,20%	-7,71%	-7,02%	0,43%	10,40%	0,22%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,84%	8,82%	11,56%	0,63%	3,05%	27,00%	10,00%	0,19%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,75%	0,13%	10,37%	-11,83%	-3,48%	-	10,13%	0,23%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,84%	-	5,42%	0,41%	-	-	3,54%	-
SMLL (Benchmark)	-1,84%	-8,06%	14,47%	-13,82%	-18,43%	-5,58%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-2,18%	-5,30%	7,57%	-10,89%	-13,12%	0,05%	9,77%	0,18%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	-8,56%	-18,58%	-2,80%	-17,10%	-9,29%	18,31%	11,60%	0,22%
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	0,47%	11,42%	1,01%	5,58%	17,35%	41,61%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,05%	-18,26%	-2,87%	-9,31%	-18,36%	29,10%	0,01%	0,11%
IFIX (Benchmark)	0,49%	6,63%	6,98%	7,58%	10,13%	7,01%	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	-0,87%	-3,99%	12,77%	3,41%	-5,42%	-23,31%	7,87%	0,34%
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - RBDS11	-6,67%	-64,47%	9,03%	-16,47%	-78,13%	-88,39%	8,86%	0,58%
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	5,94%	12,42%	18,72%	15,94%	14,56%	-20,05%	9,64%	0,20%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	-0,17%	1,37%	13,08%	6,83%	-2,34%	-20,60%	4,17%	0,18%
BTG PACTUAL FUNDO DE CRI FII - FEXC11	3,22%	-0,67%	1,84%	-2,15%	3,76%	-12,43%	8,04%	0,14%

Página 8 de 24

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------



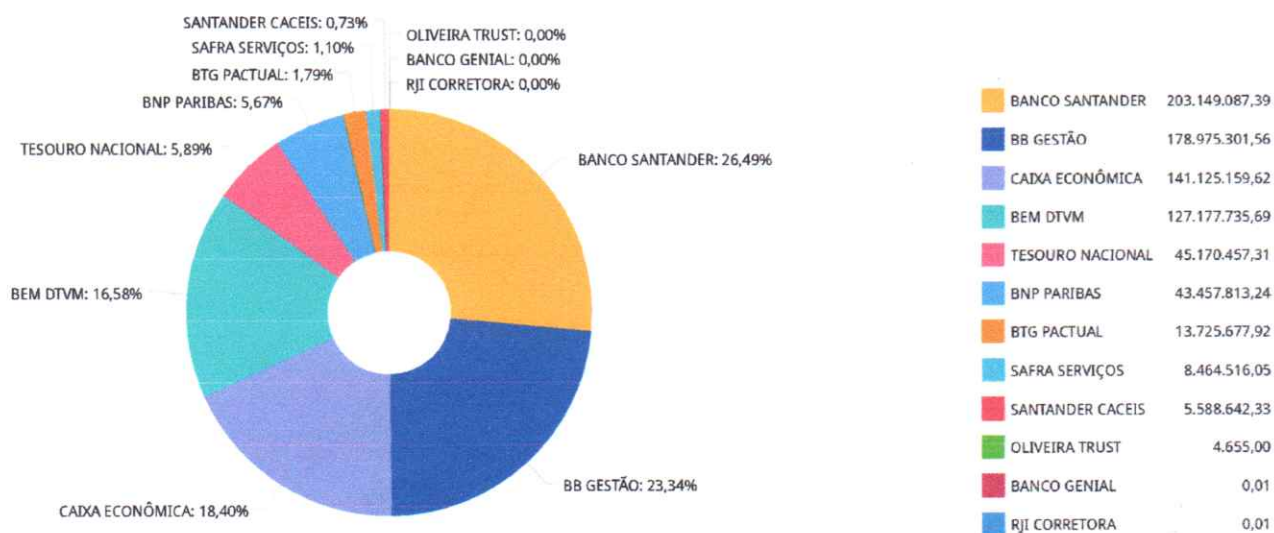
Página 9 de 24

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

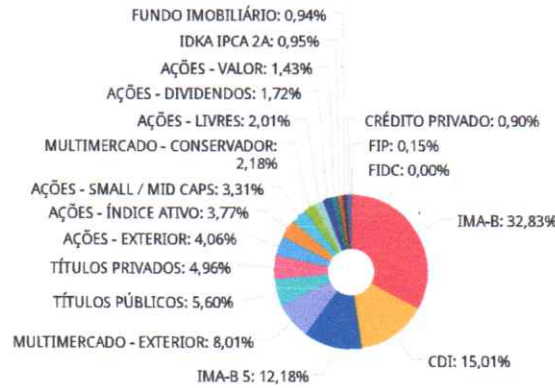
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,95%	-20,44%	-5,71%	-17,76%	-13,90%	-	10,57%	0,18%
MSCI WORLD (Benchmark)	-5,49%	-28,69%	-3,57%	-11,09%	-21,36%	-3,69%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-5,59%	-25,46%	0,08%	-9,77%	-17,90%	6,31%	9,17%	0,18%
Ibovespa (Benchmark)	0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-3,03%	-41,21%	1,85%	-16,38%	-45,82%	-	15,83%	0,29%
MSCI ACWI (Benchmark)	-5,78%	-28,97%	-4,29%	-11,25%	-22,48%	-6,15%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	-6,57%	-29,50%	-3,00%	-11,58%	-24,72%	-2,41%	9,68%	0,20%

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



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



IMA-B	264.876.142,73	CDI	121.077.242,80	IMA-B 5	98.263.937,41
MULTIMERCADO - EXTERIOR	64.593.724,49	TÍTULOS PÚBLICOS	45.170.457,31	TÍTULOS PRIVADOS	40.058.125,02
AÇÕES - EXTERIOR	32.729.512,89	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	30.456.584,63	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	26.705.026,97
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	17.613.220,85	AÇÕES - LIVRES	16.246.779,81	AÇÕES - DIVIDENDOS	13.865.322,49
AÇÕES - VALOR	11.574.561,36	IDKA IPCA 2A	7.699.124,44	FUNDO IMOBILIÁRIO	7.548.433,34
CRÉDITO PRIVADO	7.241.399,03	FIP	1.177.575,57	FIDC	0,01

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2022)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/01/2031	02/07/2004	3.100	2.696,277829	9.819,664635	8.358.461,27	30.440.960,37	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/01/2031	07/12/2004	1.500	2.874,269396	9.819,664635	4.311.404,09	14.729.496,85	Mercado



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

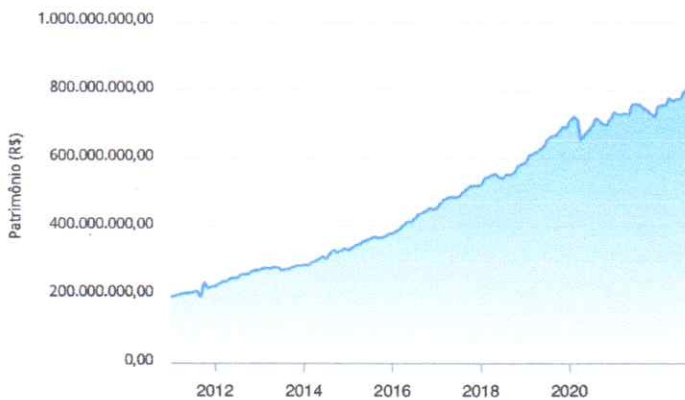
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	748.544.710,08	27.845.000,00	22.668.194,89	750.235.796,61	-3.487.718,58	-3.487.718,58	-0,46%	-0,46%	0,94%	0,94%	-49,35%	3,91%
Fevereiro	750.235.796,61	7.711.000,00	5.715.077,72	750.855.442,41	-1.376.276,48	-4.863.995,06	-0,18%	-0,64%	1,37%	2,32%	-27,77%	4,33%
Março	750.855.442,41	6.331.000,00	5.304.837,91	771.152.875,56	19.271.271,06	14.407.276,00	2,56%	1,90%	2,04%	4,41%	43,12%	4,45%
Abril	771.152.875,56	8.669.000,00	4.785.199,91	762.895.046,85	-12.141.628,80	2.265.647,20	-1,57%	0,31%	1,42%	5,89%	5,18%	4,03%
Mai	762.895.046,85	10.274.755,56	8.243.185,10	769.146.948,44	4.220.331,13	6.485.978,33	0,55%	0,86%	0,89%	6,83%	12,57%	4,32%
Junho	769.146.948,44	22.521.000,00	7.804.952,90	768.687.117,79	-15.175.877,75	-8.689.899,42	-1,94%	-1,09%	1,07%	7,97%	-13,72%	3,92%
Julho	768.687.117,79	12.890.280,00	5.668.024,76	787.608.657,27	11.699.284,24	3.009.384,82	1,51%	0,40%	-0,29%	7,68%	5,19%	3,68%
Agosto	787.608.657,27	7.978.800,00	4.269.737,68	799.953.047,24	8.635.327,65	11.644.712,47	1,09%	1,49%	0,07%	7,74%	19,29%	4,14%
Setembro	799.953.047,24	76.587.000,00	73.632.131,70	800.868.837,83	-2.039.077,71	9.605.634,76	-0,25%	1,24%	0,10%	7,85%	15,73%	3,99%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

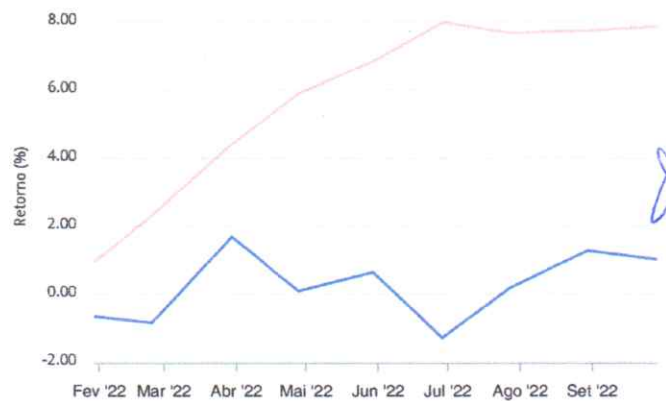


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 (%)	(%) Instít	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	113.055.128,98	0,00	0,00	114.746.933,37	1.691.804,39	1,50%	1,50%	2,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	147.982.794,31	0,00	0,00	150.129.209,36	2.146.415,05	1,45%	1,45%	2,43%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.862.709,31	157.000,00	1.300,00	16.192.092,82	173.683,51	1,08%	1,08%	0,02%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	13.476.307,56	0,00	13.584.063,21	0,00	107.755,65	0,80%	1,34%	2,48%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	111.655.961,94	36.430.000,00	44.345.578,00	104.885.149,98	1.144.766,04	0,77%	1,12%	0,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	15.672.949,58	0,00	15.784.684,73	0,00	111.735,15	0,71%	1,45%	2,45%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	7.201.157,67	0,00	0,00	7.241.399,03	40.241,36	0,56%	0,56%	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.658.569,84	0,00	0,00	7.699.124,44	40.554,60	0,53%	0,53%	1,42%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	97.871.204,68	0,00	0,00	98.263.937,41	392.732,73	0,40%	0,40%	1,27%
LETRA FINANCEIRA SAFRA	0,00	30.000.000,00	0,00	30.064.907,27	64.907,27	0,22%	0,00%	0,00%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	0,00	10.000.000,00	0,00	9.993.217,75	-6.782,25	-0,07%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	45.289.451,66	0,00	0,00	45.170.457,31	-118.994,35	-0,26%	-	-
Total Renda Fixa	575.726.235,54	76.587.000,00	73.715.625,94	584.386.428,75	5.788.819,15	1,00%		1,50%

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 (%)	(%) Instít	Var - Mês
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	4.478.000,00	0,00	35.738,14	4.744.000,00	301.738,14	6,74%	5,94%	9,64%
BTG PACTUAL FUNDO DE CRI FII - FEXC11	376.816,00	0,00	3.960,00	388.960,00	16.104,00	4,27%	3,22%	8,04%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	30.036.980,53	0,00	0,00	30.456.584,63	419.604,10	1,40%	1,40%	10,16%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	2.447.990,20	0,00	0,00	2.475.169,59	27.179,39	1,11%	1,11%	1,08%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	15.011.282,91	0,00	0,00	15.138.051,26	126.768,35	0,84%	0,84%	3,54%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	789.600,00	0,00	6.160,00	788.480,00	4.840,00	0,61%	-0,17%	4,17%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.676.252,13	0,00	0,00	3.693.804,18	17.552,05	0,48%	0,48%	9,96%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉ...	392.883,33	0,00	0,00	392.687,72	-195,61	-0,05%	-0,05%	0,01%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.161.791,53	0,00	0,00	2.159.846,56	-1.944,97	-0,09%	-0,09%	9,68%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	1.636.518,40	0,00	10.925,62	1.622.338,34	-3.254,44	-0,20%	-0,87%	7,87%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	11.598.199,42	0,00	0,00	11.574.561,36	-23.638,06	-0,20%	-0,20%	11,38%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	786.505,09	0,00	0,00	784.887,84	-1.617,25	-0,21%	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.294.926,86	0,00	0,00	3.284.576,63	-10.350,23	-0,31%	-0,31%	9,85%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	8.177.067,40	0,00	0,00	8.140.538,11	-36.529,29	-0,45%	-0,45%	10,40%
ARK INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.152.874,97	0,00	0,00	5.114.348,80	-38.526,17	-0,75%	-0,75%	10,13%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.862.388,03	0,00	0,00	4.821.665,07	-40.722,96	-0,84%	-0,84%	10,00%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	27.301.414,77	0,00	0,00	26.705.026,97	-596.387,80	-2,18%	-2,18%	9,77%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.967.253,41	0,00	0,00	2.897.322,95	-69.930,46	-2,36%	-2,36%	8,62%
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - RB...	4.987,50	0,00	0,00	4.655,00	-332,50	-6,67%	-6,67%	8,96%

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
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	9.256.770,88	0,00	0,00	8.464.516,05	-792.254,83	-8,56%	-8,56%	11,60%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	47.552.749,17	0,00	0,00	43.457.813,24	-4.094.935,93	-8,61%	-8,61%	11,68%
Total Renda Variável	181.963.452,54	0,00	56.783,76	177.109.834,31	-4.796.834,47	-2,64%		9,81%

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
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTER...	5.763.511,73	0,00	0,00	5.588.642,33	-174.869,40	-3,03%	-3,03%	15,83%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	13.421.017,10	0,00	0,00	12.671.395,20	-749.621,90	-5,59%	-5,59%	9,17%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	20.398.943,26	0,00	0,00	19.057.985,72	-1.340.957,54	-6,57%	-6,57%	9,68%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	8.781.211,18	0,00	0,00	8.082.884,84	-698.326,34	-7,95%	-7,95%	10,57%
Total Exterior	48.364.683,27	0,00	0,00	45.400.908,09	-2.983.775,18	-6,13%		10,45%



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
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	96.590.963,98	57.360.260,00	52.672.747,82	104.885.149,98	3.606.673,82	2,34%	3,41%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	147.715.458,76	0,00	0,00	150.129.209,36	2.413.750,60	1,63%	1,63%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	112.761.605,79	0,00	0,00	114.746.933,37	1.985.327,58	1,76%	1,76%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.196.869,39	484.800,00	1.300,00	16.192.092,82	511.723,43	3,26%	3,33%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	97.884.592,75	0,00	0,00	98.263.937,41	379.344,66	0,39%	0,39%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	13.428.522,36	0,00	13.584.063,21	0,00	155.540,85	1,16%	1,70%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	15.647.612,39	0,00	15.784.684,73	0,00	137.072,34	0,88%	1,62%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	7.174.912,50	0,00	0,00	7.241.399,03	66.486,53	0,93%	0,93%
LETRA FINANCEIRA SAFRA	0,00	30.000.000,00	0,00	30.064.907,27	64.907,27	0,22%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.678.946,29	0,00	0,00	7.699.124,44	20.178,15	0,26%	0,26%
TÍTULOS PÚBLICOS	46.890.014,17	0,00	1.738.134,82	45.170.457,31	18.577,96	0,04%	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÉN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
LETRA FINANCEIRA BTG	0,00	10.000.000,00	0,00	9.993.217,75	-6.782,25	-0,07%	-
Total Renda Fixa	560.969.498,39	97.845.060,00	83.780.930,58	584.386.428,75	9.352.800,94	1,63%	

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
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	26.689.153,95	0,00	0,00	30.456.584,63	3.767.430,68	14,12%	14,12%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	24.824.919,30	0,00	0,00	26.705.026,97	1.880.107,67	7,57%	7,57%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	10.686.050,68	0,00	0,00	11.574.561,36	888.510,68	8,31%	8,31%
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	3.996.000,00	0,00	107.253,75	4.744.000,00	855.253,75	21,40%	18,72%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7.320.742,36	0,00	0,00	8.140.538,11	819.795,75	11,20%	11,20%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	14.359.466,35	0,00	0,00	15.138.051,26	778.584,91	5,42%	5,42%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.321.976,49	0,00	0,00	4.821.665,07	499.688,58	11,56%	11,56%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.633.662,16	0,00	0,00	5.114.348,80	480.686,64	10,37%	10,37%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.871.771,84	0,00	0,00	3.284.576,63	412.804,79	14,37%	14,37%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.350.516,97	0,00	0,00	3.693.804,18	343.287,21	10,25%	10,25%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	1.438.694,94	0,00	32.776,86	1.622.338,34	216.420,26	15,04%	12,76%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.727.467,75	0,00	0,00	2.897.322,95	169.855,20	6,23%	6,23%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.019.689,50	0,00	0,00	2.159.846,56	140.157,06	6,94%	6,94%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCCF11	697.290,00	0,00	18.920,00	788.480,00	110.110,00	15,79%	13,08%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	2.391.501,17	0,00	0,00	2.475.169,59	83.668,42	3,50%	3,50%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	763.041,69	0,00	14.558,95	784.887,84	36.405,10	4,77%	2,86%
BTG PACTUAL FUNDO DE CRI FII - FEXC11	381.920,00	0,00	13.849,08	388.960,00	20.889,08	5,47%	1,84%
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - RB...	4.269,30	0,00	0,00	4.655,00	385,70	9,03%	9,03%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉ...	404.271,65	0,00	11.052,74	392.687,72	-531,19	-0,13%	-2,87%

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
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	8.690.067,69	0,00	0,00	8.464.516,05	-225.551,64	-2,60%	-2,60%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	44.621.958,85	0,00	0,00	43.457.813,24	-1.164.145,61	-2,61%	-2,61%
Total Renda Variável	167.194.432,65	0,00	198.411,38	177.109.834,31	10.113.813,04	6,05%	

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
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTER...	5.487.363,76	0,00	0,00	5.588.642,33	101.278,57	1,85%	1,85%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	12.660.903,40	0,00	0,00	12.671.395,20	10.491,80	0,08%	0,08%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	8.572.740,79	0,00	0,00	8.082.884,84	-489.855,95	-5,71%	-5,71%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	19.647.974,32	0,00	0,00	19.057.985,72	-589.988,60	-3,00%	-3,00%
Total Exterior	46.368.982,27	0,00	0,00	45.400.908,09	-968.074,18	-2,09%	



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.

