

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.



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	11.708.170,44	12,90%	520	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	4.623.221,14	5,09%	336	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	13.459.262,75	14,83%	269	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	7.625.861,22	8,40%	280	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.143.893,65	4,57%	808	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	346.179,07	0,38%	281	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.494.029,67	2,75%	10.334	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.424.308,34	9,28%	868	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	136.135,25	0,15%	16.724	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.786.795,42	5,27%	241	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	8.569.891,70	9,44%	846	0,74%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	895.057,79	0,99%	702	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	6.343.341,25	6,99%	29.074	0,48%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.338.658,58	1,48%	1.898	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.630.000,57	2,90%	1.678	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.873.479,45	2,06%	25.273	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.165.352,09	1,28%	12.871	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	806.300,27	0,89%	714	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	346.981,61	0,38%	1.419	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	190.558,78	0,21%	16.154	0,04%	Artigo 8º, Inciso I



CRÉDITO
& MERCADO

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	256.180,48	0,28%	3.338	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.040.296,73	3,35%	15.427	0,44%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	5.547.291,17	6,11%	98	4,65%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução		90.751.247,42					



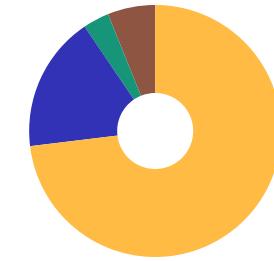
**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	18,41%	59,24%	53.761.038,97
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	44.400.617,94	48,93%	13,81%	18,41%	100,00%	46.350.629,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	21.917.130,71	24,15%	12,62%	16,83%	50,00%	23.458.493,00
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	16,83%	20,00%	18.150.249,48
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,79%	5,00%	4.537.562,37
Total Renda Fixa	100,00%	66.317.748,65	73,08%	26,43%	73,27%	234,24%	



- █ RENDA FIXA 66.317.748,65
- █ RENDA VARIÁVEL 15.845.910,87
- █ EXTERIOR 3.040.296,73
- █ ESTRUTURADOS 5.547.291,17



**CRÉDITO
& MERCADO**

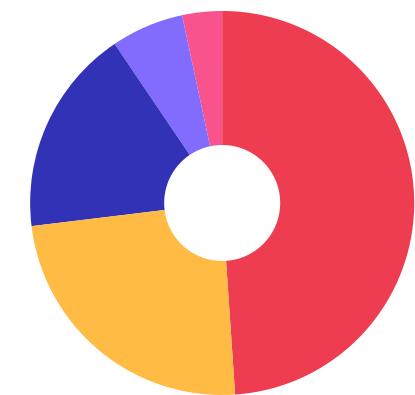
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	15.845.910,87	17,46%	0,00%	16,11%	20,00%	2.304.338,61
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,84%	20,00%	18.150.249,48
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.547.291,17	6,11%	2,09%	2,78%	10,00%	3.527.833,57
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	21.393.202,04	23,57%	2,09%	21,73%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.040.296,73	3,35%	0,00%	5,00%	10,00%	6.034.828,01
Total Exterior	10,00%	3.040.296,73	3,35%	0,00%	5,00%	10,00%	



■ 7º I b	■ 7º III a	■ 8º I	■ 10º I
■ 9º II	■ 9º III		



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	61.048.440,30	67,27	-
CAIXA DTVM	13.045.790,06	14,38	-
SICREDI	11.063.921,37	12,19	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	4.786.795,42	5,27	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	806.300,27	0,89	0,00

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	59,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	44.400.617,94	48,93	13,81	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	13.347.239,01	14,71	12,62	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	15.845.910,87	17,46	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	3.040.296,73	3,35	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.547.291,17	6,11	2,09	10,00



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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
IRF-M (Benchmark)	1,40%	6,96%	4,66%	5,53%	8,01%	6,91%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,37%	6,84%	4,60%	5,39%	7,88%	6,53%	1,56%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	7,15%	0,02%	3,11%	8,79%	15,18%	0,75%	0,04%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,86%	6,90%	2,65%	4,99%	8,26%	9,50%	0,00%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	-	-0,02%	2,35%	-	-	1,46%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,99%	8,08%	3,06%	5,77%	9,78%	11,85%	0,00%	0,01%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	1,08%	8,84%	3,30%	6,22%	10,84%	14,05%	0,00%	0,01%
IPCA (Benchmark)	-0,29%	4,09%	-1,32%	0,86%	7,17%	18,15%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,24%	8,29%	3,54%	5,84%	9,44%	10,38%	0,79%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,26%	7,50%	3,07%	5,15%	9,00%	12,03%	1,12%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,53%	8,40%	2,97%	5,62%	10,74%	13,75%	2,07%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,08%	-	0,02%	-0,25%	-	-	0,75%	-



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	-6,83%	-	-7,08%	-	-	-	12,60%	-
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,04%	8,05%	2,81%	4,58%	10,11%	11,71%	0,68%	0,02%
Ibovespa (Benchmark)	0,47%	4,97%	11,66%	-8,30%	-0,85%	16,31%	-	-
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-0,36%	1,67%	9,61%	-8,81%	-1,48%	22,12%	11,01%	0,21%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-0,13%	3,58%	11,14%	-9,22%	-3,03%	14,00%	11,04%	0,23%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,34%	-1,51%	7,67%	-9,41%	-4,02%	24,18%	10,89%	0,20%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-3,86%	8,48%	9,99%	-3,81%	4,03%	20,49%	10,84%	0,22%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-1,71%	5,56%	11,15%	-6,34%	-0,17%	14,77%	10,10%	0,21%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,69%	2,56%	11,57%	-6,47%	-8,05%	3,01%	10,03%	0,22%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-5,60%	-28,67%	-2,27%	-10,43%	-19,81%	-0,31%	-	-
S&P 500 (Benchmark)	-9,34%	-24,77%	-5,28%	-20,85%	-16,76%	6,62%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-8,03%	-20,16%	-2,85%	-17,28%	-10,39%	15,59%	11,08%	0,22%
SMILL (Benchmark)	-1,84%	-8,06%	14,47%	-13,82%	-18,43%	-5,58%	-	-



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-1,34%	-2,76%	11,58%	-13,01%	-14,44%	0,72%	12,51%	0,27%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-1,70%	-7,67%	14,32%	-14,39%	-18,76%	-9,54%	12,45%	0,29%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-5,60%	-28,67%	-2,27%	-10,43%	-19,81%	-0,31%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,39%	-29,77%	-3,31%	-14,12%	-21,19%	-6,54%	9,65%	0,21%

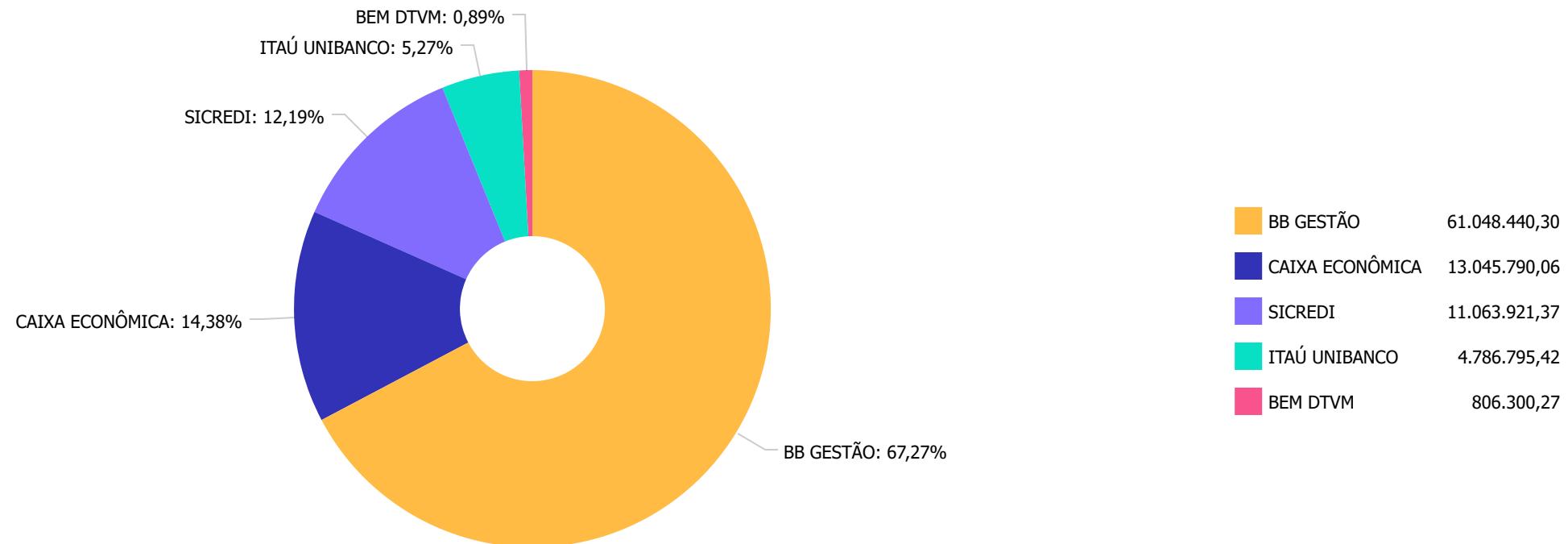


CRÉDITO
& MERCADO

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022



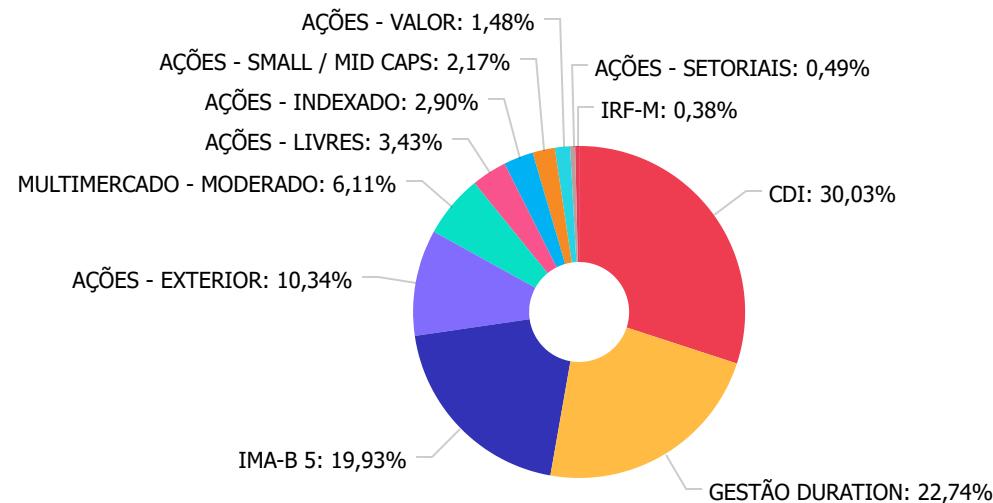


CRÉDITO
& MERCADO

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022



■ CDI	27.250.226,18	■ GESTÃO DURATION	20.638.859,51	■ IMA-B 5	18.082.483,89	■ AÇÕES - EXTERIOR	9.383.637,98
■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.547.291,17	■ AÇÕES - LIVRES	3.115.518,85	■ AÇÕES - INDEXADO	2.630.000,57	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.971.652,36
■ AÇÕES - VALOR	1.338.658,58	■ AÇÕES - SETORIAIS	446.739,26	■ IRF-M	346.179,07		



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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	85.552.823,02	2.390.023,42	3.876.712,66	83.633.208,53	-432.925,25	-432.925,25	-0,51%	-0,51%	0,95%	0,95%	-53,11%	3,43%
Fevereiro	83.633.208,53	5.472.725,52	4.923.698,75	84.095.637,06	-86.598,24	-519.523,49	-0,10%	-0,61%	1,39%	2,35%	-25,88%	3,11%
Março	84.095.637,06	3.542.424,26	2.889.784,60	86.617.773,21	1.869.496,49	1.349.973,00	2,21%	1,58%	2,06%	4,46%	35,54%	3,72%
Abril	86.617.773,21	2.208.180,40	1.591.525,10	86.678.063,63	-556.364,88	793.608,12	-0,64%	0,94%	1,44%	5,96%	15,72%	3,40%
Maio	86.678.063,63	6.075.734,39	3.046.659,83	89.548.810,97	-158.327,22	635.280,90	-0,18%	0,76%	0,90%	6,91%	10,97%	3,55%
Junho	89.548.810,97	36.056.844,98	38.965.012,15	84.988.820,62	-1.651.823,18	-1.016.542,28	-1,84%	-1,10%	1,08%	8,07%	-13,64%	3,52%
Julho	84.988.820,62	7.292.344,15	4.582.591,90	89.338.953,87	1.640.381,00	623.838,72	1,87%	0,75%	-0,27%	7,78%	9,64%	2,75%
Agosto	89.338.953,87	2.200.880,97	3.336.410,64	88.857.430,74	654.006,54	1.277.845,26	0,73%	1,49%	0,09%	7,87%	18,89%	3,05%
Setembro	88.857.430,74	16.854.630,33	14.682.918,91	90.751.247,42	-277.894,74	999.950,52	-0,31%	1,18%	0,12%	8,00%	14,71%	2,93%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

ANO

36M

Evolução do Patrimônio



- 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
- 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



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA...	4.714.556,51	0,00	0,00	4.786.795,42	72.238,91	1,53%	1,53%	2,07%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	341.516,27	0,00	0,00	346.179,07	4.662,80	1,37%	1,37%	1,56%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	11.563.081,61	0,00	0,00	11.708.170,44	145.088,83	1,25%	1,25%	1,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.093.078,01	0,00	0,00	4.143.893,65	50.815,64	1,24%	1,24%	0,79%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFEREN...	8.478.626,03	0,00	0,00	8.569.891,70	91.265,67	1,08%	1,08%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	9.518.298,26	4.225.286,17	5.424.802,08	8.424.308,34	105.525,99	0,77%	0,99%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	86.460,41	48.796,61	0,00	136.135,25	878,23	0,65%	0,86%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	13.394.260,59	0,00	0,00	13.459.262,75	65.002,16	0,49%	0,49%	1,46%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	7.593.448,28	0,00	7.625.861,22	32.412,94	0,43%	0,08%	0,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.120.347,20	2.493.069,60	0,00	4.623.221,14	9.804,34	0,21%	0,08%	0,75%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,00	2.494.029,67	0,00	2.494.029,67	0,00	0,00%	1,08%	0,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.602.296,56	0,00	7.593.448,28	0,00	-8.848,28	-0,12%	0,51%	1,50%
Total Renda Fixa	61.912.521,45	16.854.630,33	13.018.250,36	66.317.748,65	568.847,23	0,87%		0,84%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.633.461,77	0,00	0,00	2.630.000,57	-3.461,20	-0,13%	-0,13%	11,04%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.880.158,97	0,00	0,00	1.873.479,45	-6.679,52	-0,36%	-0,36%	11,01%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	349.404,38	0,00	0,00	346.981,61	-2.422,77	-0,69%	-0,69%	10,03%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	817.215,93	0,00	0,00	806.300,27	-10.915,66	-1,34%	-1,34%	12,51%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.356.812,51	0,00	0,00	1.338.658,58	-18.153,93	-1,34%	-1,34%	10,89%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.185.498,99	0,00	0,00	1.165.352,09	-20.146,90	-1,70%	-1,70%	12,45%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	910.655,78	0,00	0,00	895.057,79	-15.597,99	-1,71%	-1,71%	10,10%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	266.460,01	0,00	0,00	256.180,48	-10.279,53	-3,86%	-3,86%	10,84%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	204.520,86	0,00	0,00	190.558,78	-13.962,08	-6,83%	-6,83%	12,60%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	6.897.307,99	0,00	0,00	6.343.341,25	-553.966,74	-8,03%	-8,03%	11,08%
Total Renda Variável	16.501.497,19	0,00	0,00	15.845.910,87	-655.586,32	-3,97%		11,16%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO FUNDAMENTALISMO SUSTENTABILIDADE E GESTÃO DE RISCOS	1.705.093,03	0,00	1.664.668,55	0,00	-40.424,48	-2,37%	-6,84%	10,40%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.248.288,46	0,00	0,00	3.040.296,73	-207.991,73	-6,40%	-6,40%	9,65%
Total Exterior	4.953.381,49	0,00	1.664.668,55	3.040.296,73	-248.416,21	-5,02%		9,65%



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	11.359.304,40	0,00	0,00	11.708.170,44	348.866,04	3,07%	3,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	10.073.076,45	9.318.487,95	11.315.628,18	8.424.308,34	348.372,12	1,80%	3,06%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFEREN...	5.661.121,00	2.676.788,72	0,00	8.569.891,70	231.981,98	2,78%	3,31%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.002.215,95	0,00	0,00	4.143.893,65	141.677,70	3,54%	3,54%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.012.061,90	1.638.343,99	0,00	4.786.795,42	136.389,53	2,93%	2,97%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	7.593.448,28	0,00	7.625.861,22	32.412,94	0,43%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	330.968,46	0,00	0,00	346.179,07	15.210,61	4,60%	4,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.121.694,83	2.493.069,60	0,00	4.623.221,14	8.456,71	0,18%	0,02%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	905,00	133.687,24	0,00	136.135,25	1.543,01	1,15%	2,65%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,00	2.494.029,67	0,00	2.494.029,67	0,00	0,00%	3,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	13.850.265,49	0,00	389.832,45	13.459.262,75	-1.170,29	-0,01%	-0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.632.896,18	0,00	7.593.448,28	0,00	-39.447,90	-0,52%	0,11%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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
Total Renda Fixa	58.044.509,66	26.347.855,45	19.298.908,91	66.317.748,65	1.224.292,45	1,88%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.366.431,25	0,00	0,00	2.630.000,57	263.569,32	11,14%	11,14%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.709.168,32	0,00	0,00	1.873.479,45	164.311,13	9,61%	9,61%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	5.395.914,32	0,00	0,00	5.547.291,17	151.376,85	2,81%	2,81%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.019.415,85	0,00	0,00	1.165.352,09	145.936,24	14,32%	14,32%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.243.283,76	0,00	0,00	1.338.658,58	95.374,82	7,67%	7,67%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	805.305,92	0,00	0,00	895.057,79	89.751,87	11,15%	11,15%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	722.632,39	0,00	0,00	806.300,27	83.667,88	11,58%	11,58%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	311.001,34	0,00	0,00	346.981,61	35.980,27	11,57%	11,57%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	232.922,21	0,00	0,00	256.180,48	23.258,27	9,99%	9,99%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.650.625,47	0,00	1.638.343,99	0,00	-12.281,48	-0,74%	12,40%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	205.070,72	0,00	0,00	190.558,78	-14.511,94	-7,08%	-7,08%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	6.529.316,26	0,00	0,00	6.343.341,25	-185.975,01	-2,85%	-2,85%
Total Renda Variável	22.191.087,81	0,00	1.638.343,99	21.393.202,04	840.458,22	3,79%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2022

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO FUNDAMENTALISMO SUSTENTABILIDADE E GESTÃO DE RISCOS	1.608.936,62	0,00	1.664.668,55	0,00	55.731,93	3,46%	-1,27%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.144.286,53	0,00	0,00	3.040.296,73	-103.989,80	-3,31%	-3,31%
Total Exterior	4.753.223,15	0,00	1.664.668,55	3.040.296,73	-48.257,87	-1,02%	



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 1.467, de 02 de junho de 2022. 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.

