Mais Valia
Consultoria & Educação

2022 Relatório

Mensal e 3º trimestre de 2022

Setembro Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MPS nº 519 de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V, e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.2, ítem 3.2.6, aprovado pela Portaria SPREV nº 3030, de 15 de Março de 2021.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R$	% PL	Lei
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.687.149,04	3,89%	162.982.660,94	5,94%	7º I b
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.319.374,91	5,75%	4.594.008.809,74	0,31%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	26.395.476,35	10,61%	6.260.416.458,58	0,42%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.219.898,31	11,74%	827.244.788,64	3,53%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.718.685,64	2,30%	5.858.339.074,80	0,10%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.153.348,47	2,07%	3.601.305.672,83	0,14%	7º I b
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	991.657,54	0,40%	3.629.793.773,71	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.412.259,13	0,57%	462.016.175,66	0,31%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.891.193,24	3,57%	5.850.800.339,33	0,15%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.323.831,22	7,36%	8.885.835.879,64	0,21%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.398.271,99	6,59%	1.171.846.641,79	1,40%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.642.384,09	4,68%	3.871.147.074,69	0,30%	7º I b
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	5.209.596,45	2,09%	155.395.300,98	3,35%	7º III a
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	8.408.633,07	3,38%	182.584.700,29	4,61%	7º III a
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.855.601,50	4,36%	3.426.668.833,01	0,32%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.593.124,99	0,64%	1.578.947.384,18	0,10%	8º I
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.962.823,37	3,20%	1.434.568.432,69	0,56%	8º I
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2.846.259,65	1,14%	882.000.687,94	0,32%	8º I
BB I INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	5.134.039,51	2,06%	267.398.619,25	1,92%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.752.010,39	1,51%	678.381.558,66	0,55%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6.244.328,29	2,51%	508.895.498,49	1,23%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	233.542,31	0,09%	234.755.585,42	0,10%	8º I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	2.056.503,51	0,83%	502.378.239,21	0,41%	8º I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	17.392.354,50	6,99%	936.393.220,76	1,86%	8º I
OCCAM FIC AÇÕES	918.531,65	0,37%	1.041.484.858,97	0,09%	8º I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	868.493,29	0,35%	346.642.277,15	0,25%	8º I
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	2.592.023,64	1,04%	1.293.545.032,18	0,20%	8º I

Investimentos

$ 248.884.544,12

Disponibilidades Financeiras

$ 1.774.811,83

Total Carteira

$ 250.659.355,95

Governança (Pró Gestão)

Não possui

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R$	% PL	Lei
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.985.386,01	2,00%	419.299.667,94	1,19%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12.195.294,70	4,90%	2.057.509.929,37	0,59%	9º III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.795.232,28	0,72%	1.721.873.439,88	0,10%	10º I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1.989.682,10	0,80%	204.941.312,38	0,97%	10º I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	2.020.509,36	0,81%	127.422.588,29	1,59%	10º I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	783.338,22	0,31%	164.087.524,45	0,48%	10º I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	893.705,40	0,36%	110.192.896,80	0,81%	11º

Investimentos

$ 248.884.544,12

Disponibilidades Financeiras

$ 1.774.811,83

Total Carteira

$ 250.659.355,95

Governança (Pró Gestão)

Não possui

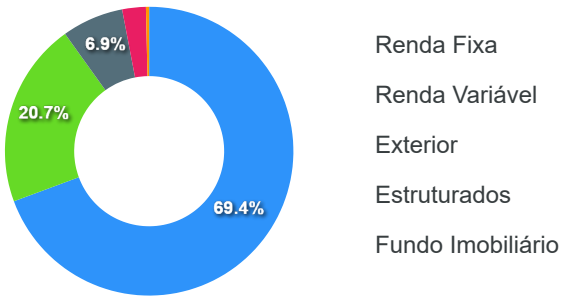
Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

Artigos	Limite (%)		Utilizado		Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	59,53%	148.153.529,93	40,47%	100.731.014,19
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	9,83%	24.473.831,02	50,17%	124.856.895,45
8º I - Fundos de Ações	30,00%	20,73%	51.594.035,10	9,27%	23.071.328,14
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	6,90%	17.180.680,71	3,10%	7.707.773,70
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	2,65%	6.588.761,96	7,35%	18.299.692,45
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,36%	893.705,40	4,64%	11.550.521,81

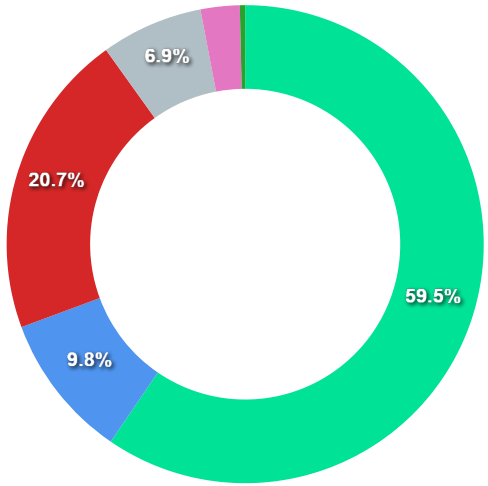
Governança (Pró Gestão)

Não possui

Segmentos



Artigos



Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	10,00%	100,00%	248.884.544,12
7º I b - FI 100% Títulos TN	59,53%	0,00%	40,00%	100,00%	100.731.014,19
7º III a - FI Referenciados RF	9,83%	0,00%	10,00%	60,00%	124.856.895,45

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	20,73%	0,00%	26,00%	30,00%	23.071.328,14
9º III - Ações - BDR Nível I	6,90%	0,00%	10,00%	10,00%	7.707.773,70
10º I - Fundos Multimercados	2,65%	0,00%	3,00%	10,00%	18.299.692,45
11º - Fundos Imobiliários	0,36%	0,00%	1,00%	5,00%	11.550.521,81

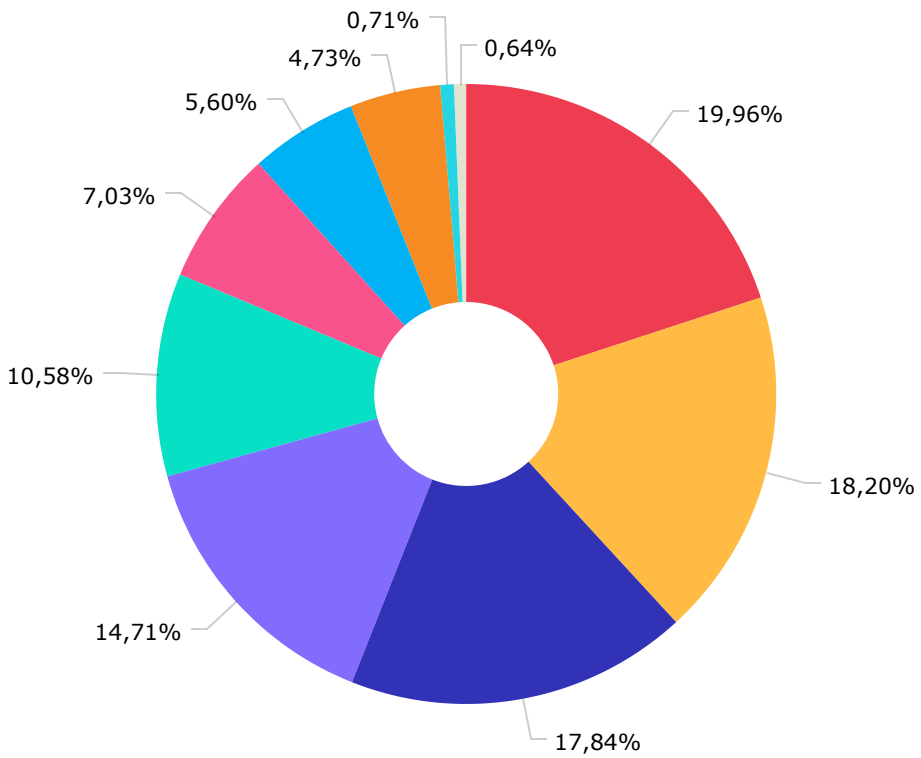
Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	1,18	8,57	3,17	5,93	10,45	13,24	0,31	0,66
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,24	6,69	2,87	4,60	7,75	9,64	1,12	2,37
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,48	2,48	10,51	8,13	-2,90	-62,20	5,02	10,57
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-0,13	3,58	11,14	-9,22	-3,03	14,00	11,04	23,25
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,69	2,56	11,57	-6,47	-8,05	3,01	10,03	21,13
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-8,62	-19,76	-2,65	-17,23	-9,27	18,60	11,70	24,65
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,95	-20,44	-5,71	-17,75	-13,90		10,57	22,26
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,72	-30,97	-4,35	-14,12	-22,81	-8,72	9,55	20,12
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	-6,83		-7,08				12,60	26,55
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO								
CDI - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	**1,07**	**8,89**	**3,31**	**6,31**	**10,90**	**14,21**		
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17	9,39	3,49	6,61	11,57	16,11	0,06	0,13
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05	8,70	3,25	6,19	10,64	13,82	0,00	0,00
IBOVESPA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	**0,47**	**4,97**	**11,66**	**-8,30**	**-0,85**	**16,31**		
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	3,71	20,84	25,28	5,18	19,66	73,30	8,75	18,42
OCCAM FIC AÇÕES	-0,13	6,17	10,62	-5,02	1,71	13,78	10,37	21,84
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	0,47	5,10	11,59	-8,05	-0,78	15,95	11,03	23,24
BB I INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	0,39	4,16	11,36	-8,69	-1,74	14,14	11,06	23,30
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	0,37	1,73	11,80	-8,19	-6,04	9,94	10,96	23,08
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,30	-0,71	14,31	-9,53	-19,91	-23,78	9,78	20,60
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,84		5,42	0,41			3,54	7,45
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,82		2,27				1,54	3,24
IBX - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	**-0,05**	**4,43**	**10,77**	**-9,10**	**-1,33**	**16,26**		

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

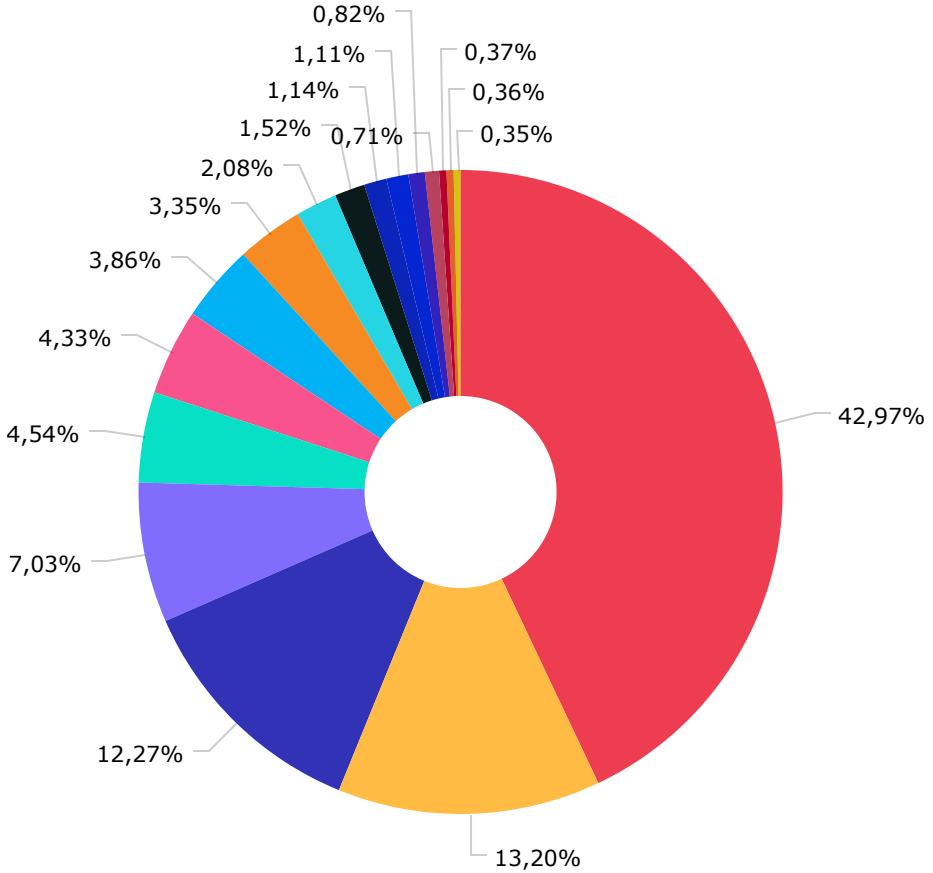
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-2,18	-5,30	7,57	-10,89	-13,12	0,05	9,77	20,59
IDIV - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	**-1,80**	**9,21**	**4,42**	**-5,43**	**7,21**	**28,20**		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,87	8,29	4,08	-5,75	6,09	22,82	9,75	20,54
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-0,09	8,36	6,94	-6,33	4,58	21,26	9,68	20,39
IMA-B - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	**1,48**	**6,12**	**1,70**	**3,16**	**7,25**	**12,30**		
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,53	6,10	1,81	3,23	7,25	10,81	2,30	4,85
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50	6,09	1,76	3,18	7,15	11,91	2,47	5,20
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45	5,92	1,63	3,07	6,95	11,76	2,43	5,11
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,44	5,40	1,75	3,00	5,48	8,50	2,32	4,89
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48	0,39	-2,79	-0,49	2,43	2,04	1,46	3,07
IMA-B 5 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	**0,42**	**7,07**	**0,43**	**3,14**	**9,25**	**15,75**		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43	7,04	0,50	3,16	9,15	15,36	1,26	2,66
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,40	6,90	0,40	3,05	8,97	15,18	1,27	2,67
IMA-B 5+ - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	**2,39**	**5,10**	**3,01**	**3,14**	**5,19**	**8,56**		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,36	4,82	2,92	2,95	4,83	7,86	3,63	7,65
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,37	4,93	2,93	3,00	4,78	7,89	3,62	7,62
IPCA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	**-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	1,66
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08	7,15	0,02	3,10	8,79	15,18	0,75	1,57

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777



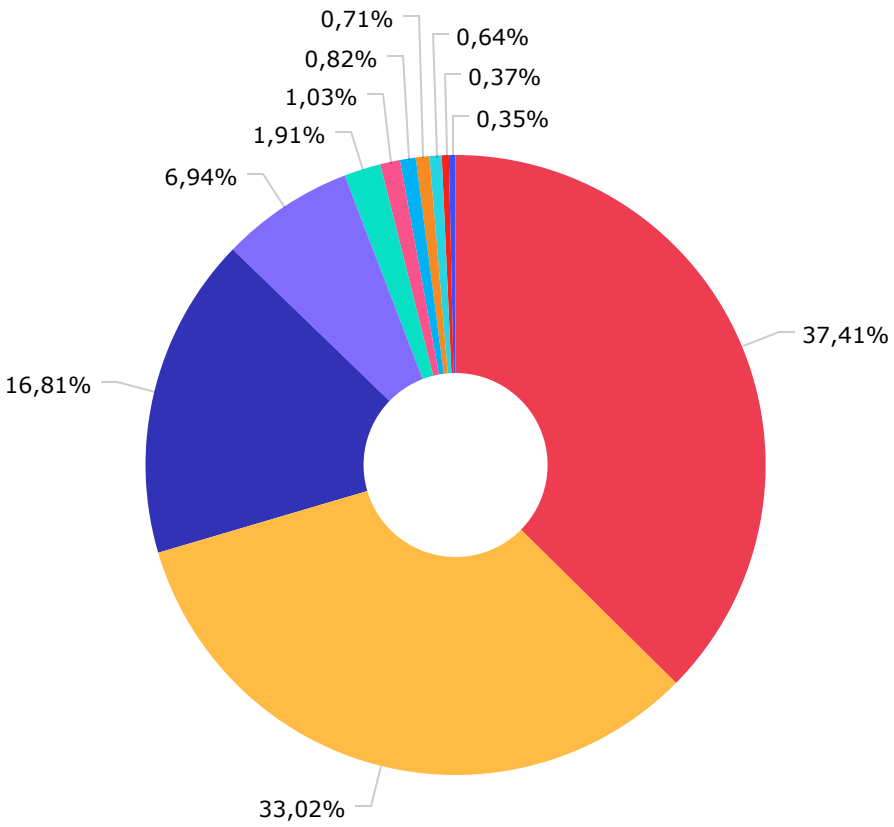
Não definido	50.043.045,40
IMA-B 5+	45.618.170,30
IMA-B 5	44.719.307,57
IMA-B	36.869.110,97
Ibovespa	26.524.087,33
IDIV	17.625.896,81
IPCA	14.044.541,71
CDI	11.847.259,04
Disponibilidades Financeiras	1.774.811,83
IBX	1.593.124,99

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777



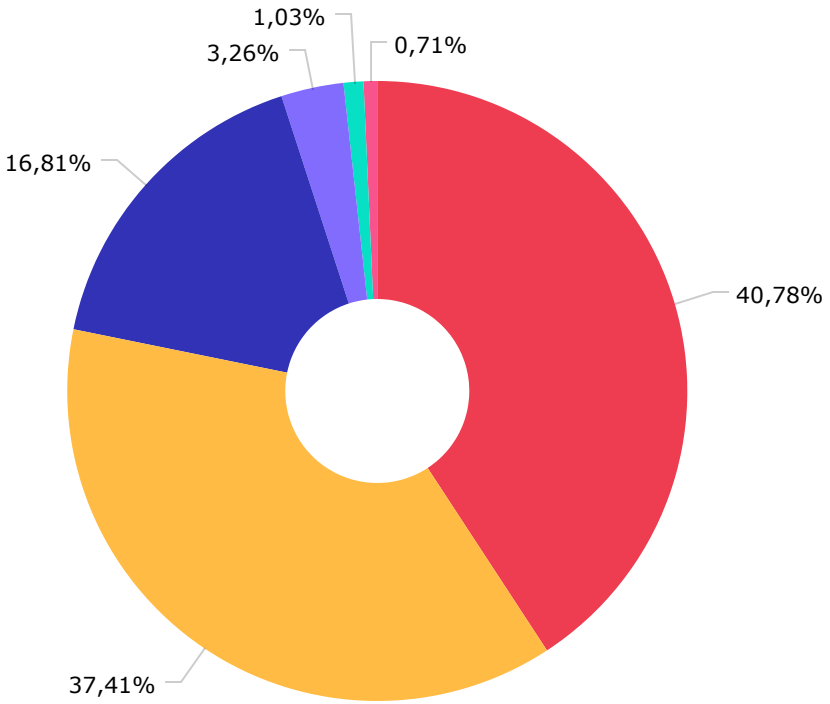
Renda Fixa Indexados	107.698.547,60
Ações Livre	33.080.663,10
Renda Fixa Duração Livre Soberano	30.767.833,29
Ações Dividendos	17.625.896,81
Ações Indexados	11.378.367,80
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	10.855.601,50
Renda Fixa Duração Alta Soberano	9.687.149,04
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	8.408.633,07
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	5.209.596,45
Multimercados Livre	3.815.741,64
Ações Sustentabilidade/Governança	2.846.259,65
Não classificado	2.773.020,32
Fundos de Mono Ação	2.056.503,51
Disponibilidades Financeiras	1.774.811,83
Ações Valor/Crescimento	918.531,65
FII TVM Gestão Ativa	893.705,40
Ações Índice Ativo	868.493,29

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	93.772.468,85
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	82.773.710,58
BANESTES DISTRIBUIDORA DE TITU...	42.123.803,43
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU...	17.392.354,50
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	4.793.529,68
TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA	2.592.023,64
CAIXA DTVM	2.056.503,51
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.774.811,83
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	1.593.124,99
OCCAM BRASIL GESTAO DE RECURSO...	918.531,65
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	868.493,29

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777



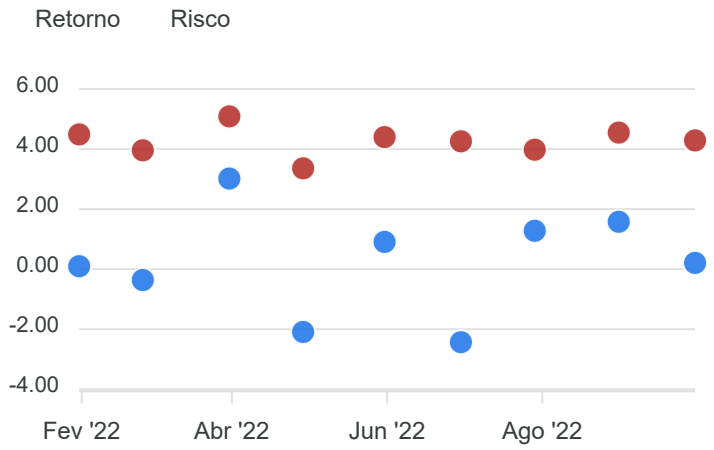
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	102.222.568,59
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	93.772.468,85
BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO...	42.123.803,43
BEM DTVM	8.173.679,61
BANCO DAYCOVAL S.A.	2.592.023,64
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.774.811,83

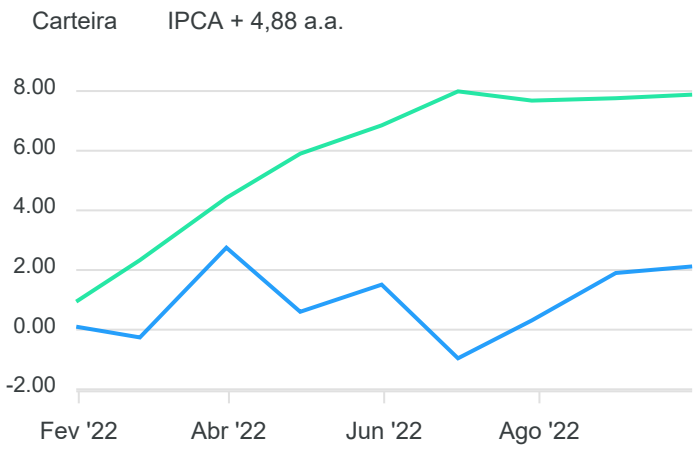
Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

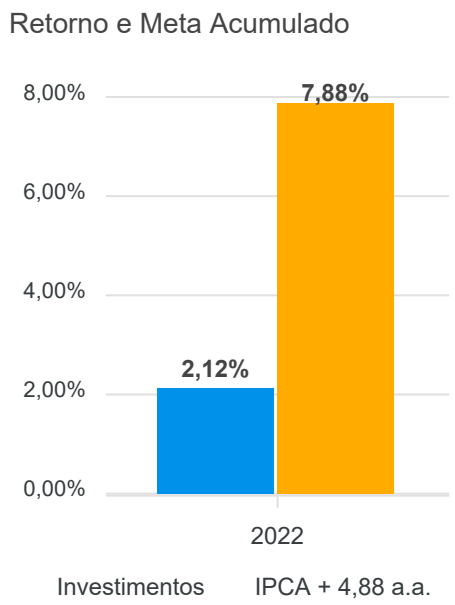
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	232.069.557,82	4.607.647,27	6.757.029,00	230.155.645,41	235.469,32	0,10% ▲	0,94%	4,49%
Fevereiro	230.155.645,41	7.000.000,00	5.006.517,80	231.302.578,54	-846.549,07	-0,36% ▼	1,37%	3,96%
Março	231.302.578,54	7.233.576,52	5.412.495,27	240.168.733,78	7.045.073,99	3,02% ▲	2,04%	5,09%
Abril	240.168.733,78	4.597.513,48	836.517,80	238.819.569,69	-5.110.159,77	-2,09% ▼	1,42%	3,36%
Maio	238.819.569,69	3.160.000,00	1.747.953,86	242.416.371,77	2.184.755,94	0,91% ▲	0,89%	4,40%
Junho	242.416.371,77	2.000.000,00	2.000.000,00	236.514.523,13	-5.901.848,64	-2,43% ▼	1,07%	4,26%
Julho	236.514.523,13	5.634.700,00	2.600.000,00	242.621.826,20	3.072.603,07	1,28% ▲	-0,28%	3,98%
Agosto	242.621.826,20	2.048.106,28	1.214.471,12	247.312.434,17	3.856.972,81	1,58% ▲	0,07%	4,55%
Setembro	247.312.434,17	3.045.000,00	2.000.000,30	248.884.544,12	527.110,25	0,21% ▲	0,11%	4,29%
				Acumulado	5.063.427,90	2,12% ▲	7,88%	

Retorno Aculuado

Período	Retorno $	Retorno %	Meta %
1º Trim	6.433.994,24	2,75%	4,42%
2º Trim	-8.827.252,47	-3,61%	3,42%
1º Sem	-2.393.258,23	-0,96%	7,99%
3º Trim	7.456.686,13	3,11%	-0,10%







Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno %	Risco - VaR
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	5.148.800,63	0,00	0,00	5.209.596,45	60.795,82	1,18% ▲	0,31%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.549.854,57	0,00	0,00	9.687.149,04	137.294,47	1,44% ▲	2,32%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	8.281.575,24	0,00	0,00	8.408.633,07	127.057,83	1,53% ▲	2,30%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.695.304,21	1.045.000,00	0,00	10.855.601,50	115.297,29	1,07% ▲	0,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.144.290,40	0,00	0,00	14.319.374,91	175.084,51	1,24% ▲	1,12%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	26.290.130,76	0,00	0,00	26.395.476,35	105.345,59	0,40% ▲	1,27%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.546.998,81	0,00	0,00	29.219.898,31	672.899,50	2,36% ▲	3,63%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.636.924,92	0,00	0,00	5.718.685,64	81.760,72	1,45% ▲	2,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.149.041,88	0,00	0,00	5.153.348,47	4.306,59	0,08% ▲	0,75%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	981.331,91	0,00	0,00	991.657,54	10.325,63	1,05% ▲	0,00%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.405.446,90	0,00	0,00	1.412.259,13	6.812,23	0,48% ▲	1,46%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.782.162,54	0,00	0,00	8.891.193,24	109.030,70	1,24% ▲	0,79%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.245.896,06	0,00	0,00	18.323.831,22	77.935,16	0,43% ▲	1,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.017.946,87	0,00	0,00	16.398.271,99	380.325,12	2,37% ▲	3,62%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.470.731,26	0,00	0,00	11.642.384,09	171.652,83	1,50% ▲	2,47%
	169.346.436,96	1.045.000,00	0,00	172.627.360,95	2.235.923,99	1,31%	1,96%

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.628.703,32	0,00	0,00	1.593.124,99	-35.578,33	-2,18% ▼	9,77%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.987.052,02	0,00	0,00	7.962.823,37	-24.228,65	-0,30% ▼	9,78%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2.850.005,45	0,00	0,00	2.846.259,65	-3.745,80	-0,13% ▼	11,04%
BB I INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	5.113.872,30	0,00	0,00	5.134.039,51	20.167,21	0,39% ▲	11,06%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.778.208,47	0,00	0,00	3.752.010,39	-26.198,08	-0,69% ▼	10,03%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6.215.034,30	0,00	0,00	6.244.328,29	29.293,99	0,47% ▲	11,03%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	237.991,13	0,00	0,00	233.542,31	-4.448,82	-1,87% ▼	9,75%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	2.207.181,70	0,00	0,00	2.056.503,51	-150.678,19	-6,83% ▼	12,60%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	17.408.016,53	0,00	0,00	17.392.354,50	-15.662,03	-0,09% ▼	9,68%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.973.020,72	0,00	2.000.000,30	1.795.232,28	-177.788,14	-4,47% ▼	11,70%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	870.318,00	0,00	0,00	893.705,40	23.387,40	2,69% ▲	5,02%
OCCAM FIC AÇÕES	919.692,00	0,00	0,00	918.531,65	-1.160,35	-0,13% ▼	10,37%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	2.003.589,31	0,00	0,00	2.020.509,36	16.920,05	0,84% ▲	3,54%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	776.993,98	0,00	0,00	783.338,22	6.344,24	0,82% ▲	1,54%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	865.290,53	0,00	0,00	868.493,29	3.202,76	0,37% ▲	10,96%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	2.499.417,46	0,00	0,00	2.592.023,64	92.606,18	3,71% ▲	8,75%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	1.989.682,10	-10.317,90	-0,52% ▼	-
-	59.334.387,22	2.000.000,00	2.000.000,30	59.076.502,46	-257.884,46	-0,43%	9,81%

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5.416.101,83	0,00	0,00	4.985.386,01	-430.715,82	-7,95% ▼	10,57%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.215.508,16	0,00	0,00	12.195.294,70	-1.020.213,46	-7,72% ▼	9,55%
	18.631.609,99	0,00	0,00	17.180.680,71	-1.450.929,28	-7,79%	3,07%

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno %
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	5.049.573,57	0,00	0,00	5.209.596,45	160.022,88	3,17% ▲
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.520.445,41	0,00	0,00	9.687.149,04	166.703,63	1,75% ▲
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	8.259.135,20	0,00	0,00	8.408.633,07	149.497,87	1,81% ▲
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.586.815,39	6.727.806,28	1.774.000,00	10.855.601,50	314.979,83	2,56% ▲
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.919.457,16	0,00	0,00	14.319.374,91	399.917,75	2,87% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	26.289.315,04	0,00	0,00	26.395.476,35	106.161,31	0,40% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.391.928,80	0,00	0,00	29.219.898,31	827.969,51	2,92% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.626.741,64	0,00	0,00	5.718.685,64	91.944,00	1,63% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.152.314,45	0,00	0,00	5.153.348,47	1.034,02	0,02% ▲
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	960.454,72	0,00	0,00	991.657,54	31.202,82	3,25% ▲
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.452.827,27	0,00	40.471,12	1.412.259,13	-97,02	-0,01% ▼
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.587.207,71	0,00	0,00	8.891.193,24	303.985,53	3,54% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.233.442,52	0,00	0,00	18.323.831,22	90.388,70	0,50% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.931.637,59	0,00	0,00	16.398.271,99	466.634,40	2,93% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.440.950,01	0,00	0,00	11.642.384,09	201.434,08	1,76% ▲
	164.402.246,48	6.727.806,28	1.814.471,12	172.627.360,95	3.311.779,31	1,96%

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno %
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.480.964,59	0,00	0,00	1.593.124,99	112.160,40	7,57% ▲
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.966.016,85	0,00	0,00	7.962.823,37	996.806,52	14,31% ▲
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	4.529.859,95	0,00	2.000.000,00	2.846.259,65	316.399,70	6,98% ▲
BB I INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	4.610.473,25	0,00	0,00	5.134.039,51	523.566,26	11,36% ▲
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.362.945,55	0,00	0,00	3.752.010,39	389.064,84	11,57% ▲
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	5.595.913,19	0,00	0,00	6.244.328,29	648.415,10	11,59% ▲
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	224.391,74	0,00	0,00	233.542,31	9.150,57	4,08% ▲
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	2.213.115,89	0,00	0,00	2.056.503,51	-156.612,38	-7,08% ▼
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	16.263.727,48	0,00	0,00	17.392.354,50	1.128.627,02	6,94% ▲
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.729.165,55	0,00	2.000.000,30	1.795.232,28	66.067,03	1,77% ▲
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	808.718,40	0,00	0,00	893.705,40	84.987,00	10,51% ▲
OCCAM FIC AÇÕES	830.378,93	0,00	0,00	918.531,65	88.152,72	10,62% ▲
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	1.989.682,10	-10.317,90	-0,52% ▼
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1.916.589,90	0,00	0,00	2.020.509,36	103.919,46	5,42% ▲
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	765.975,19	0,00	0,00	783.338,22	17.363,03	2,27% ▲
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	776.825,53	0,00	0,00	868.493,29	91.667,76	11,80% ▲
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.592.023,64	592.023,64	29,60% ▲
	54.075.061,99	4.000.000,00	4.000.000,30	59.076.502,46	5.001.440,77	9,25%

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5.287.520,84	0,00	0,00	4.985.386,01	-302.134,83	-5,71% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12.749.693,82	0,00	0,00	12.195.294,70	-554.399,12	-4,35% ▼
	18.037.214,66	0,00	0,00	17.180.680,71	-856.533,95	-4,75%

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

Cenário Econômico

O cenário macroeconômico do 3º trimestre de 2022 manteve o tom do ano em curso, ou seja, com volatilidades provocadas pela inflação persistente, e em elevação, notadamente, nos países do bloco europeu e nos Estados Unidos. Valores não verificados nos últimos 40 anos e ao redor dos 2 dígitos. Como estes países também adotam a política monetária de meta de inflação, as suas respectivas taxas de juros são o principal instrumento de contenção dos preços via sua elevação, que os Bancos Centrais lançam mão visando trazer a inflação para suas respectivas metas.

O Banco Central do Brasil iniciou este movimento antes dos demais países citados. Assim, ao final do 3º trimestre o nosso BC já estabelecia a parada deste movimento enquanto banco central americano (FED) e o banco central europeu (BOE) se debatem em que patamar farão suas próximas elevações, ainda em 2022.

No caso brasileiro, o poder executivo, alinhado com os secretários de fazenda dos estados, executou ação de política fiscal visando também conter a inflação. A escolha negociada foi a redução de parcela dos impostos incidentes sobre a gasolina, diesel, energia elétrica e gás de cozinha. Como estes itens tem elevada participação no cálculo do índice oficial da inflação brasileira, o IPCA, este apresentou deflação em julho e agosto.

Em resumo, o trimestre foi de muitas incertezas e volatilidades quanto a definição do preço mais importante de todas as economias, sua taxa básica de juros, e "temperando" este aspecto, no cenário internacional tivemos a manutenção da guerra na Ucrânia e, a nível nacional, nossas eleições para presidente, para a Câmara Federal, e para as Câmaras Estaduais assim como a renovação de 1/3 do Senado Federal.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

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

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

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

Rentabilidade e Risco (por ativo)

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

Distribuição por Benchmarks

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

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

Distribuição por Classificação ANBIMA

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

Distribuição por Gestoras e Administradoras

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

Retorno da Carteira de Investimentos

A rentabilidade consolidada da carteira no período continua demonstrando recuperação face o aumento das taxas de juros visando à contenção do processo inflacionário, combinado com o crescimento do fluxo de capital estrangeiro para a Bolsa, que vem impactando de forma favorável o desempenho das Bolsas.

Retorno dos Fundos de Investimentos

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

Rio de Janeiro, 06 de outubro de 2022.

Mais Valia Consultoria Ltda EPP

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777