Mais Valia
Consultoria & Educação

# 2022 Relatório Mensal

# Outubro

## Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, ítem 3.2.6 Nivel I, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.

| Ativo | Saldo Atual | % Carteira | PL R$ | % PL | Lei |
|---|---|---|---|---|---|
| BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 9.804.762,88 | 3,86% | 165.437.180,86 | 5,93% | 7º I b |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 14.464.572,95 | 5,70% | 4.560.818.666,19 | 0,32% | 7º I b |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 26.894.330,80 | 10,59% | 6.120.033.935,05 | 0,44% | 7º I b |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 29.408.717,74 | 11,59% | 821.537.216,90 | 3,58% | 7º I b |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 5.786.932,18 | 2,28% | 5.996.659.178,04 | 0,10% | 7º I b |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 5.268.914,91 | 2,08% | 3.736.730.846,68 | 0,14% | 7º I b |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.001.595,12 | 0,39% | 3.695.172.196,04 | 0,03% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.438.969,07 | 0,57% | 470.754.249,93 | 0,31% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 8.978.853,53 | 3,54% | 5.839.461.409,01 | 0,15% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 18.667.476,84 | 7,35% | 8.449.071.998,91 | 0,22% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 16.503.552,83 | 6,50% | 1.174.260.901,84 | 1,41% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 11.779.646,21 | 4,64% | 3.862.167.779,60 | 0,31% | 7º I b |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA | 5.263.614,93 | 2,07% | 157.193.553,75 | 3,35% | 7º III a |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | 8.501.364,97 | 3,35% | 184.099.864,96 | 4,62% | 7º III a |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 11.341.110,83 | 4,47% | 3.446.775.272,58 | 0,33% | 7º III a |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 1.734.792,49 | 0,68% | 1.643.788.352,60 | 0,11% | 8º I |
| BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 8.578.708,92 | 3,38% | 1.534.573.593,33 | 0,56% | 8º I |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | 3.006.567,35 | 1,18% | 907.112.837,29 | 0,33% | 8º I |
| BB I INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES | 5.409.301,08 | 2,13% | 272.791.726,85 | 1,98% | 8º I |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 4.047.599,45 | 1,59% | 727.308.936,83 | 0,56% | 8º I |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES | 6.579.121,15 | 2,59% | 533.817.936,67 | 1,23% | 8º I |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES | 242.519,46 | 0,10% | 241.413.999,35 | 0,10% | 8º I |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 18.443.586,37 | 7,27% | 993.864.350,04 | 1,86% | 8º I |
| OCCAM FIC AÇÕES | 980.509,37 | 0,39% | 1.110.138.510,35 | 0,09% | 8º I |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | 907.867,63 | 0,36% | 358.954.822,33 | 0,25% | 8º I |
| TARPON GT 30 FIC AÇÕES | 2.880.790,58 | 1,13% | 1.470.442.939,97 | 0,20% | 8º I |
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 5.296.555,16 | 2,09% | 429.089.925,09 | 1,23% | 9º III |

Investimentos

$ 253.850.773,68

Disponibilidades Financeiras

$ 613.269,48

Total Carteira

$ 254.464.043,16

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 12.402.981,24 | 4,89% | 2.030.078.847,62 | 0,61% | 9º III |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 1.999.442,22 | 0,79% | 205.946.058,46 | 0,97% | 10º I |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO | 2.063.185,94 | 0,81% | 130.113.979,03 | 1,59% | 10º I |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO | 780.263,70 | 0,31% | 163.443.498,63 | 0,48% | 10º I |
| SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 2.506.911,78 | 0,99% | 40.912.800,18 | 6,13% | 10º I |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 885.654,00 | 0,35% | 109.200.168,00 | 0,81% | 11º |

Investimentos

$ 253.850.773,68

Disponibilidades Financeiras

$ 613.269,48

Total Carteira

$ 254.464.043,16

Governança (Pró Gestão)

Não possui



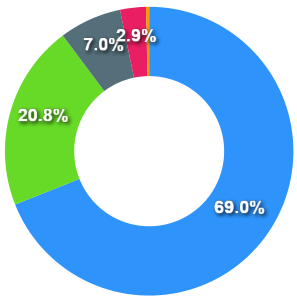
Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

| Artigos | Limite (%) | | Utilizado | | Livre |
|---|---|---|---|---|---|
| 7º I b - FI 100% Títulos TN | 100,00% | 59,09% | 149.998.325,06 | 40,91% | 103.852.448,62 |
| 7º III a - FI Referenciados RF | 60,00% | 9,89% | 25.106.090,73 | 50,11% | 127.204.373,48 |
| 8º I - Fundos de Ações | 30,00% | 20,80% | 52.811.363,85 | 9,20% | 23.343.868,25 |
| 9º III - Ações - BDR Nível I | 10,00% | 6,97% | 17.699.536,40 | 3,03% | 7.685.540,97 |
| 10º I - Fundos Multimercados | 10,00% | 2,90% | 7.349.803,64 | 7,10% | 18.035.273,73 |
| 11º - Fundos Imobiliários | 5,00% | 0,35% | 885.654,00 | 4,65% | 11.806.884,68 |

Governança (Pró Gestão)

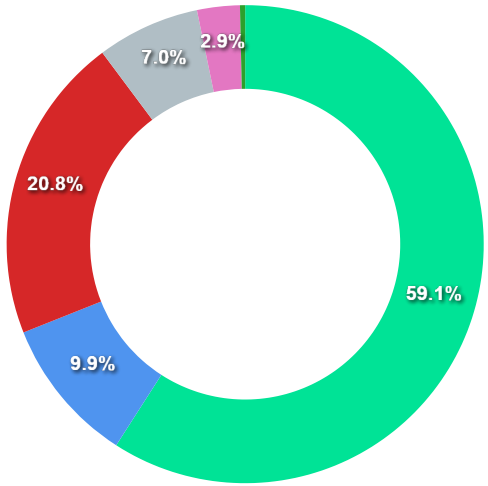
Não possui

Segmentos




Renda Fixa
Renda Variável
Exterior
Estruturados
Fundo Imobiliário

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% | 253.850.773,68 |
| 7º I b - FI 100% Títulos TN | 59,09% | 0,00% | 40,00% | 100,00% | 103.852.448,62 |
| 7º III a - FI Referenciados RF | 9,89% | 0,00% | 10,00% | 60,00% | 127.204.373,48 |

| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|---|---|---|---|---|---|
| 8º I - Fundos de Ações | 20,80% | 0,00% | 26,00% | 30,00% | 23.343.868,25 |
| 9º III - Ações - BDR Nível I | 6,97% | 0,00% | 10,00% | 10,00% | 7.685.540,97 |
| 10º I - Fundos Multimercados | 2,90% | 0,00% | 3,00% | 10,00% | 18.035.273,73 |
| 11º - Fundos Imobiliários | 0,35% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 11.806.884,68 |



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 - BENCHMARK** | | | | | | | | |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 0,49 | | | | | | 0,77 | 1,63 |
| | | | | | | | | |
| **CDI - BENCHMARK** | **1,02** | **10,00** | **3,30** | **6,51** | **11,49** | **15,20** | | |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1,07 | 10,56 | 3,52 | 6,86 | 12,18 | 17,31 | 0,06 | 0,12 |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA | 1,04 | 9,69 | 3,48 | 6,20 | 11,57 | 14,22 | 0,22 | 0,46 |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,00 | 9,79 | 3,23 | 6,38 | 11,24 | 14,73 | 0,00 | 0,00 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,01 | 7,77 | 3,50 | 5,11 | 10,65 | 10,83 | 0,69 | 1,45 |
| SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | | | | | | | | |
| | | | | | | | | |
| **GLOBAL BDRX - BENCHMARK** | **1,33** | **-29,86** | **-9,99** | **-6,55** | **-29,14** | **-2,97** | | |
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 6,24 | -15,47 | -5,51 | -5,97 | -13,63 | | 11,75 | 24,76 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 1,70 | -29,79 | -9,82 | -6,27 | -29,23 | -5,49 | 16,62 | 34,99 |
| | | | | | | | | |
| **IBOVESPA - BENCHMARK** | **5,45** | **10,70** | **12,48** | **7,57** | **12,11** | **23,51** | | |
| TARPON GT 30 FIC AÇÕES | 11,14 | 34,30 | 26,95 | 24,90 | 36,48 | 96,45 | 10,70 | 22,53 |
| OCCAM FIC AÇÕES | 6,75 | 13,34 | 14,19 | 11,04 | 14,16 | 21,83 | 14,51 | 30,55 |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES | 5,36 | 10,73 | 12,37 | 7,63 | 12,15 | 23,07 | 14,04 | 29,57 |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | 5,63 | 9,42 | 12,43 | 6,59 | 11,18 | 21,41 | 14,23 | 29,97 |
| BB I INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES | 5,36 | 9,74 | 12,16 | 7,04 | 11,07 | 21,25 | 14,07 | 29,63 |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 7,88 | 10,63 | 14,51 | 9,41 | 10,38 | 13,28 | 13,53 | 28,50 |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | 4,53 | 6,34 | 12,13 | 4,63 | 6,09 | 16,01 | 14,20 | 29,91 |
| BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 7,73 | 6,97 | 13,55 | 9,35 | -0,82 | -16,45 | 14,66 | 30,88 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO | 2,11 | | 6,02 | 5,81 | | | 4,41 | 9,29 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO | -0,39 | | 4,79 | | | | 2,71 | 5,71 |
| | | | | | | | | |
| **IBX - BENCHMARK** | **5,57** | **10,25** | **12,01** | **6,76** | **11,78** | **23,41** | | |



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 | 8,89 | 3,12 | 12,88 | 3,14 | 1,30 | 11,17 | 14,32 | 30,16 |
| | | | | | | | | |
| **IDIV - BENCHMARK** | **4,03** | **13,61** | **6,51** | **3,76** | **16,46** | **32,51** | | |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 6,04 | 14,91 | 9,71 | 6,36 | 15,89 | 28,52 | 13,78 | 29,02 |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES | 3,84 | 12,45 | 6,12 | 3,09 | 15,09 | 27,50 | 13,26 | 27,92 |
| | | | | | | | | |
| **IMA-B - BENCHMARK** | **1,23** | **7,43** | **3,86** | **3,57** | **11,40** | **13,44** | | |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,18 | 7,34 | 3,92 | 3,56 | 11,26 | 13,01 | 1,58 | 3,33 |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | 1,10 | 7,27 | 4,14 | 3,64 | 11,13 | 10,93 | 1,53 | 3,22 |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,19 | 7,18 | 3,77 | 3,47 | 11,09 | 12,87 | 1,55 | 3,26 |
| BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,21 | 6,68 | 4,05 | 3,65 | 10,21 | 8,82 | 1,48 | 3,11 |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,89 | 2,29 | -0,63 | 0,15 | 5,95 | 4,16 | 0,85 | 1,80 |
| | | | | | | | | |
| **IMA-B 5 - BENCHMARK** | **1,91** | **9,12** | **2,35** | **3,50** | **12,73** | **17,73** | | |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,88 | 9,05 | 2,36 | 3,51 | 12,60 | 17,31 | 0,75 | 1,57 |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1,89 | 8,92 | 2,30 | 3,42 | 12,47 | 17,14 | 0,75 | 1,58 |
| | | | | | | | | |
| **IMA-B 5+ - BENCHMARK** | **0,65** | **5,79** | **5,62** | **3,73** | **10,15** | **9,03** | | |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,64 | 5,61 | 5,60 | 3,61 | 9,83 | 8,35 | 2,41 | 5,08 |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,65 | 5,50 | 5,54 | 3,57 | 9,82 | 8,34 | 2,42 | 5,09 |
| | | | | | | | | |
| **IPCA - BENCHMARK** | **0,59** | **4,70** | **-0,06** | **0,39** | **6,47** | **17,83** | | |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,24 | 9,55 | 2,18 | 3,12 | 12,46 | 18,19 | 0,53 | 1,12 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 0,99 | 9,36 | 3,75 | 5,92 | 11,26 | 11,59 | 0,47 | 0,98 |
| | | | | | | | | |
| **IFIX - BENCHMARK** | **0,02** | **6,66** | **6,30** | **6,34** | **11,80** | **8,12** | | |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | -0,90 | 1,55 | 10,00 | 6,58 | -2,37 | -53,49 | 6,16 | 12,98 |

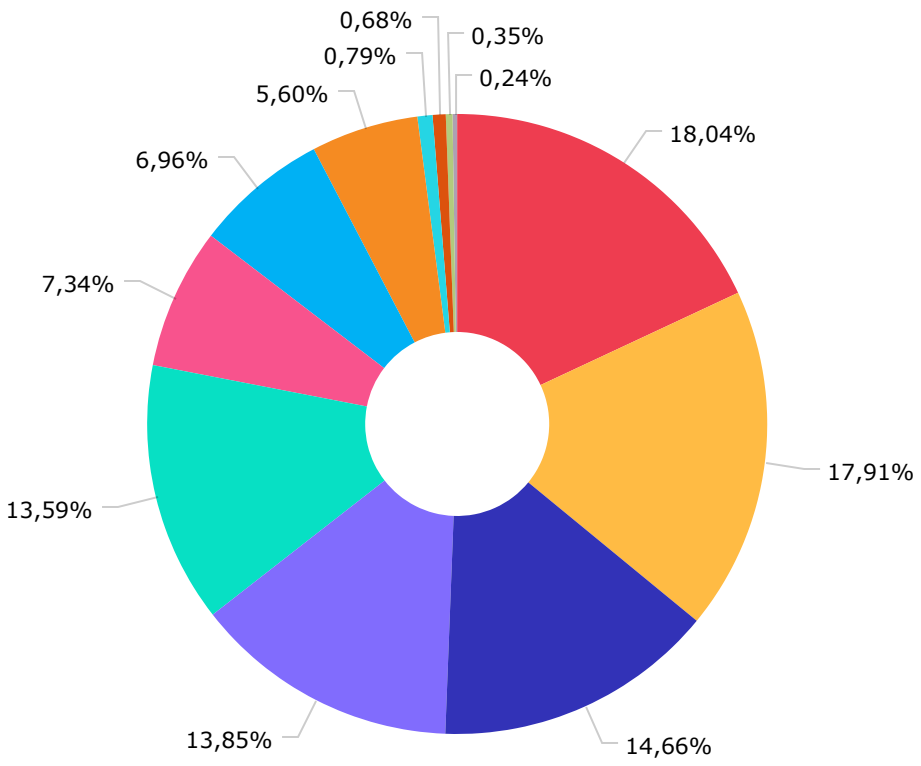


Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

| Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|---|---|---|---|---|---|---|



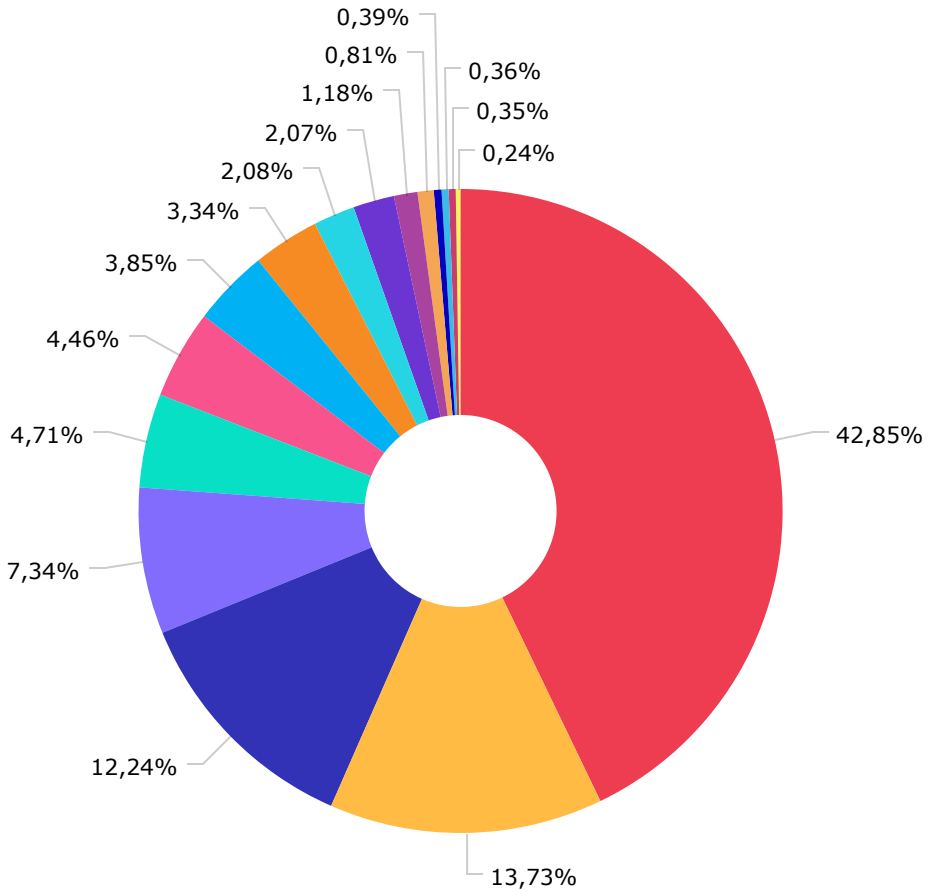
Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777




| | |
|---|---|
| IMA-B 5+ | 45.912.270,57 |
| IMA-B 5 | 45.561.807,64 |
| IMA-B | 37.311.675,31 |
| Ibovespa | 35.233.915,17 |
| CDI | 34.577.805,61 |
| IDIV | 18.686.105,83 |
| Global BDRX | 17.699.536,40 |
| IPCA | 14.247.768,44 |
| Não definido | 1.999.442,22 |
| IBX | 1.734.792,49 |
| IFIX | 885.654,00 |
| Disponibilidades Financeiras | 613.269,48 |



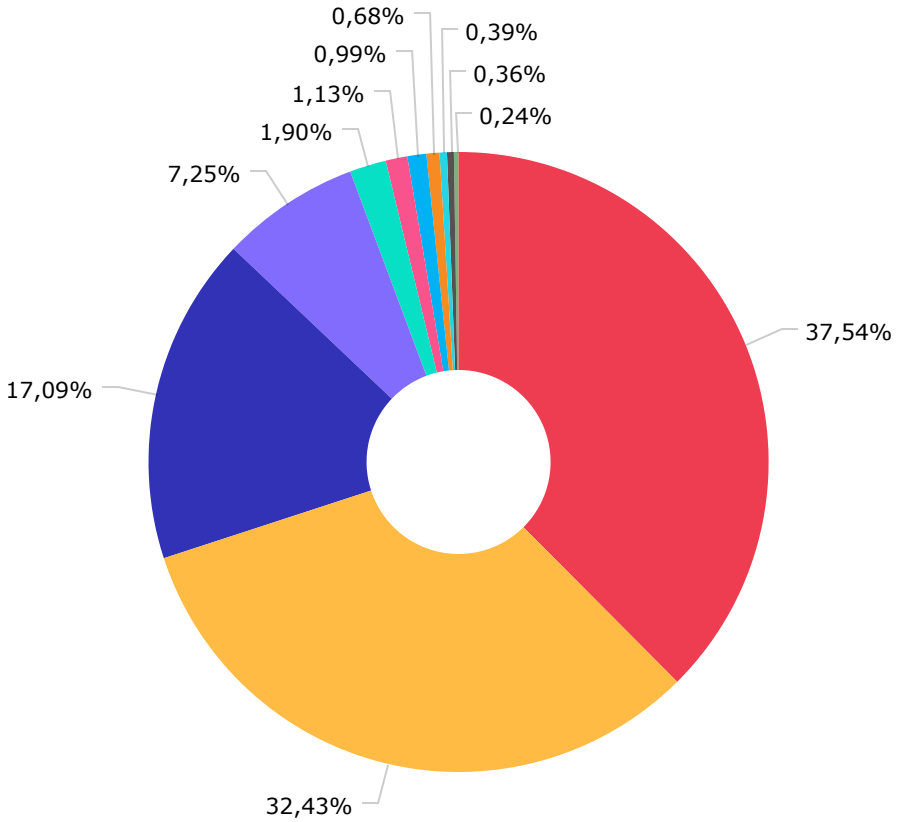
Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777




| | |
|---|---|
| Renda Fixa Indexados | 109.040.656,60 |
| Ações Livre | 34.941.427,84 |
| Renda Fixa Duração Livre Soberano | 31.152.905,58 |
| Ações Dividendos | 18.686.105,83 |
| Ações Indexados | 11.988.422,23 |
| Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento | 11.341.110,83 |
| Renda Fixa Duração Alta Soberano | 9.804.762,88 |
| Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento | 8.501.364,97 |
| Não classificado | 5.286.617,70 |
| Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento | 5.263.614,93 |
| Ações Sustentabilidade/Governança | 3.006.567,35 |
| Multimercados Livre | 2.063.185,94 |
| Ações Valor/Crescimento | 980.509,37 |
| Ações Índice Ativo | 907.867,63 |
| FII TVM Gestão Ativa | 885.654,00 |
| Disponibilidades Financeiras | 613.269,48 |

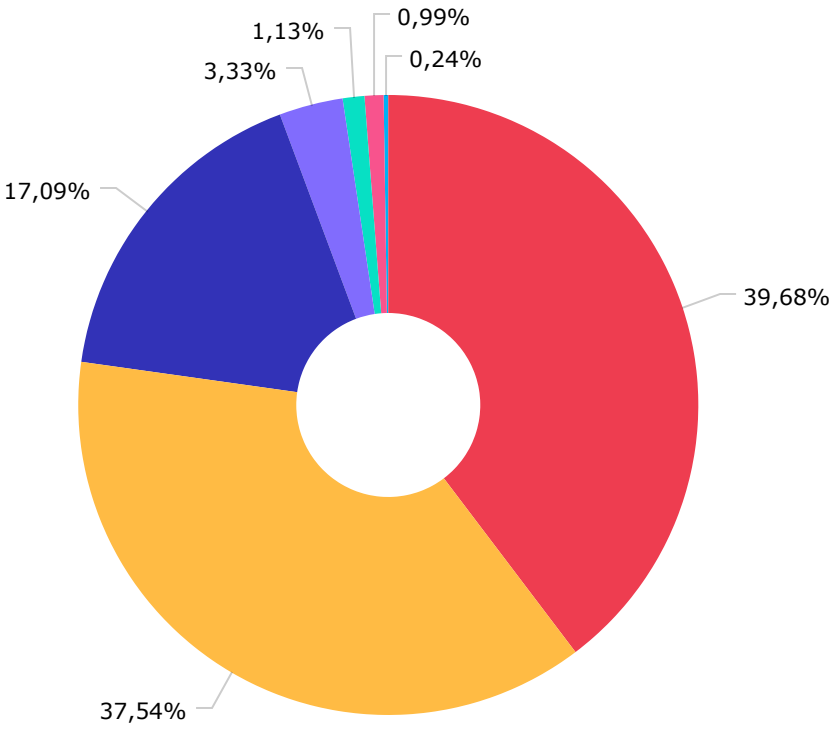


Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777




| | |
|---|---|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 95.535.892,17 |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 82.527.968,90 |
| BANESTES DISTRIBUIDORA DE TITU... | 43.489.562,53 |
| VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU... | 18.443.586,37 |
| RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA | 4.842.891,86 |
| TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA | 2.880.790,58 |
| SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA. | 2.506.911,78 |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA. | 1.734.792,49 |
| OCCAM BRASIL GESTAO DE RECURSO... | 980.509,37 |
| SOMMA INVESTIMENTOS S.A. | 907.867,63 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 613.269,48 |


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 | 100.971.555,27 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 95.535.892,17 |
| BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO... | 43.489.562,53 |
| BEM DTVM | 8.466.061,35 |
| BANCO DAYCOVAL S.A. | 2.880.790,58 |
| SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA. | 2.506.911,78 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 613.269,48 |



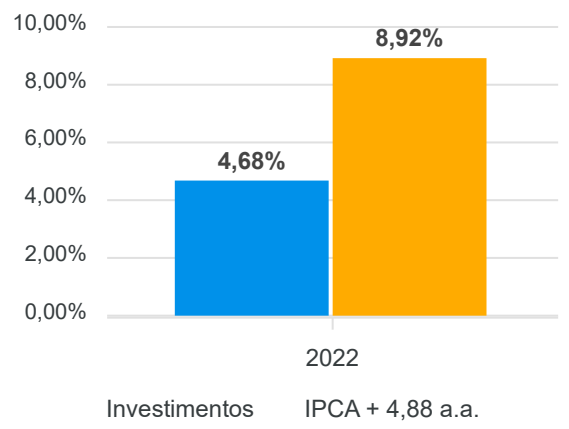
Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno $ | Retorno Acumulado $ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Janeiro | 232.069.557,82 | 4.607.647,27 | 6.757.029,00 | 230.155.645,41 | 235.469,32 | 235.469,32 | 0,10% ▲ | 0,10% | 0,94% | 0,94% | 10,64% | 4,49% |
| Fevereiro | 230.155.645,41 | 7.000.000,00 | 5.006.517,80 | 231.302.578,54 | -846.549,07 | -611.079,75 | -0,36% ▼ | -0,26% | 1,37% | 2,33% | -11,16% | 3,96% |
| Março | 231.302.578,54 | 7.233.576,52 | 5.412.495,27 | 240.168.733,78 | 7.045.073,99 | 6.433.994,24 | 3,02% ▲ | 2,75% | 2,04% | 4,42% | 62,22% | 5,09% |
| Abril | 240.168.733,78 | 4.597.513,48 | 836.517,80 | 238.819.569,69 | -5.110.159,77 | 1.323.834,47 | -2,09% ▼ | 0,60% | 1,42% | 5,90% | 10,17% | 3,36% |
| Maio | 238.819.569,69 | 3.160.000,00 | 1.747.953,86 | 242.416.371,77 | 2.184.755,94 | 3.508.590,41 | 0,91% ▲ | 1,51% | 0,89% | 6,85% | 22,04% | 4,40% |
| Junho | 242.416.371,77 | 2.000.000,00 | 2.000.000,00 | 236.514.523,13 | -5.901.848,64 | -2.393.258,23 | -2,43% ▼ | -0,96% | 1,07% | 7,99% | -12,02% | 4,26% |
| Julho | 236.514.523,13 | 5.634.700,00 | 2.600.000,00 | 242.621.826,20 | 3.072.603,07 | 679.344,84 | 1,28% ▲ | 0,31% | -0,28% | 7,68% | 4,04% | 3,98% |
| Agosto | 242.621.826,20 | 2.048.106,28 | 1.214.471,12 | 247.312.434,17 | 3.856.972,81 | 4.536.317,65 | 1,58% ▲ | 1,90% | 0,07% | 7,76% | 24,48% | 4,55% |
| Setembro | 247.312.434,17 | 3.045.000,00 | 2.000.000,30 | 248.884.544,12 | 527.110,25 | 5.063.427,90 | 0,21% ▲ | 2,12% | 0,11% | 7,88% | 26,90% | 4,29% |
| Outubro | 248.884.544,12 | 4.295.468,00 | 5.568.495,17 | 253.850.773,68 | 6.239.256,73 | 11.302.684,63 | 2,51% ▲ | 4,68% | 0,97% | 8,92% | 52,47% | 4,88% |

Retorno Acululado (Períodos)

| 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% |

**Gráfico Retorno e Meta Acumulado**

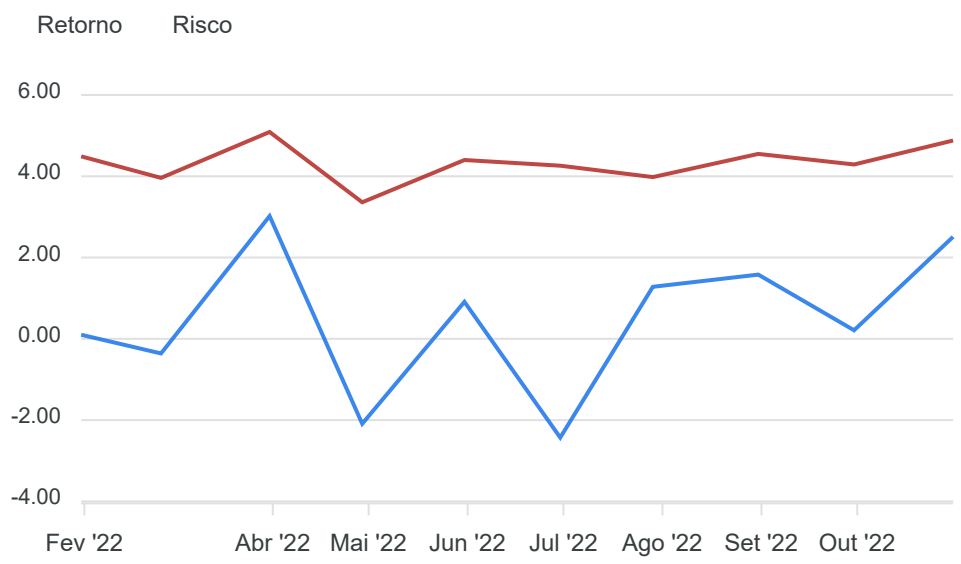




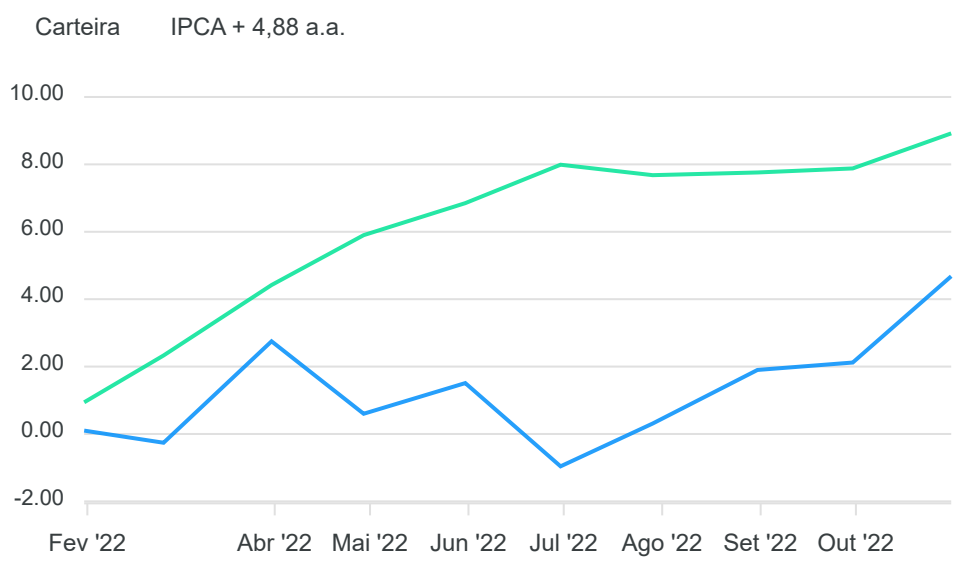

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

**Gráficos**

## Gráfico Risco x Retorno




## Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade






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 | 5.209.596,45 | 0,00 | 0,00 | 5.263.614,93 | 54.018,48 | 1,04% ▲ | 0,22% |
| BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 9.687.149,04 | 0,00 | 0,00 | 9.804.762,88 | 117.613,84 | 1,21% ▲ | 1,48% |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | 8.408.633,07 | 0,00 | 0,00 | 8.501.364,97 | 92.731,90 | 1,10% ▲ | 1,53% |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 10.855.601,50 | 1.795.468,00 | 1.430.000,00 | 11.341.110,83 | 120.041,33 | 0,95% ▲ | 0,06% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 14.319.374,91 | 0,00 | 0,00 | 14.464.572,95 | 145.198,04 | 1,01% ▲ | 0,69% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 26.395.476,35 | 0,00 | 0,00 | 26.894.330,80 | 498.854,45 | 1,89% ▲ | 0,75% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 29.219.898,31 | 0,00 | 0,00 | 29.408.717,74 | 188.819,43 | 0,65% ▲ | 2,42% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 5.718.685,64 | 0,00 | 0,00 | 5.786.932,18 | 68.246,54 | 1,19% ▲ | 1,55% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 5.153.348,47 | 0,00 | 0,00 | 5.268.914,91 | 115.566,44 | 2,24% ▲ | 0,53% |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 991.657,54 | 0,00 | 0,00 | 1.001.595,12 | 9.937,58 | 1,00% ▲ | 0,00% |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.412.259,13 | 0,00 | 0,00 | 1.438.969,07 | 26.709,94 | 1,89% ▲ | 0,85% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 8.891.193,24 | 0,00 | 0,00 | 8.978.853,53 | 87.660,29 | 0,99% ▲ | 0,47% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 18.323.831,22 | 0,00 | 0,00 | 18.667.476,84 | 343.645,62 | 1,88% ▲ | 0,75% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 16.398.271,99 | 0,00 | 0,00 | 16.503.552,83 | 105.280,84 | 0,64% ▲ | 2,41% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 11.642.384,09 | 0,00 | 0,00 | 11.779.646,21 | 137.262,12 | 1,18% ▲ | 1,58% |
| | 172.627.360,95 | 1.795.468,00 | 1.430.000,00 | 175.104.415,79 | 2.111.586,84 | 1,22% | 1,26% |



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

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno $ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 1.593.124,99 | 0,00 | 0,00 | 1.734.792,49 | 141.667,50 | 8,89% ▲ | 14,32% |
| BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 7.962.823,37 | 0,00 | 0,00 | 8.578.708,92 | 615.885,55 | 7,73% ▲ | 14,66% |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | 2.846.259,65 | 0,00 | 0,00 | 3.006.567,35 | 160.307,70 | 5,63% ▲ | 14,23% |
| BB I INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES | 5.134.039,51 | 0,00 | 0,00 | 5.409.301,08 | 275.261,57 | 5,36% ▲ | 14,07% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 3.752.010,39 | 0,00 | 0,00 | 4.047.599,45 | 295.589,06 | 7,88% ▲ | 13,53% |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES | 6.244.328,29 | 0,00 | 0,00 | 6.579.121,15 | 334.792,86 | 5,36% ▲ | 14,04% |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES | 233.542,31 | 0,00 | 0,00 | 242.519,46 | 8.977,15 | 3,84% ▲ | 13,26% |
| CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES | 2.056.503,51 | 0,00 | 2.315.589,62 | 0,00 | 259.086,11 | 12,60% ▲ | 21,37% |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 17.392.354,50 | 0,00 | 0,00 | 18.443.586,37 | 1.051.231,87 | 6,04% ▲ | 13,78% |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 1.795.232,28 | 0,00 | 1.822.905,55 | 0,00 | 27.673,27 | 1,54% ▲ | 13,19% |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 893.705,40 | 0,00 | 0,00 | 885.654,00 | -8.051,40 | -0,90% ▼ | 6,16% |
| OCCAM FIC AÇÕES | 918.531,65 | 0,00 | 0,00 | 980.509,37 | 61.977,72 | 6,75% ▲ | 14,51% |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 1.989.682,10 | 0,00 | 0,00 | 1.999.442,22 | 9.760,12 | 0,49% ▲ | 0,77% |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO | 2.020.509,36 | 0,00 | 0,00 | 2.063.185,94 | 42.676,58 | 2,11% ▲ | 4,41% |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO | 783.338,22 | 0,00 | 0,00 | 780.263,70 | -3.074,52 | -0,39% ▼ | 2,71% |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | 868.493,29 | 0,00 | 0,00 | 907.867,63 | 39.374,34 | 4,53% ▲ | 14,20% |
| TARPON GT 30 FIC AÇÕES | 2.592.023,64 | 0,00 | 0,00 | 2.880.790,58 | 288.766,94 | 11,14% ▲ | 10,70% |
| SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 0,00 | 2.500.000,00 | 0,00 | 2.506.911,78 | 6.911,78 | 0,28% ▲ | - |
| - | 59.076.502,46 | 2.500.000,00 | 4.138.495,17 | 61.046.821,49 | 3.608.814,20 | 6,11% | 12,81% |



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 | 4.985.386,01 | 0,00 | 0,00 | 5.296.555,16 | 311.169,15 | 6,24% ▲ | 11,75% |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 12.195.294,70 | 0,00 | 0,00 | 12.402.981,24 | 207.686,54 | 1,70% ▲ | 16,62% |
| | 17.180.680,71 | 0,00 | 0,00 | 17.699.536,40 | 518.855,69 | 3,02% | 3,52% |



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**

Se o mês de setembro não foi fácil para a rentabilidade dos investimentos, o mesmo não podemos falar de outubro. No geral todos as estratégias experimentaram bons resultados, e para aqueles que possuíam carteiras bem diversificadas, apresentaram forte rentabilidade. Na renda fixa os fundos foram beneficiados pelo fechamento da curva de juros, na renda variável os fundos ligados a índices IBOVESPA subiram mais 5% e no acumulado do ano está muito próximo das metas atuarias. Por fim, os ativos ligados a índices no exterior, que vinham amargando resultados ruins nos últimos meses, tiveram bons resultados no mês.

A inflação segue como destaque, e começando pelo Brasil, o IPCA fechou pelo terceiro mês consecutivo no negativo, fato que não ocorria desde 1998. Os resultados ainda seguem impactados pela redução dos preços dos combustíveis, energia e telecomunicações. Por outro lado, alguns pontos chamam a atenção, já que suprindo esses itens, os dados ainda apresentam boa alta, como é o caso dos alimentos, que apresentam a maior inflação acumulada nos nove primeiros meses do ano desde o início do plano real. Com a estabilização dos preços dos combustíveis, para o mês de outubro os dados do IPCA-15 divulgado, apontam para o fim da série de deflação.

**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, apesar da atenção dos investidores locais ter ficado voltada para a disputa eleitoral. Todos os segmentos apresentaram bons retornos, sendo que o investimento em fundos de ações foi o principal destaque de outubro. Além do mercado de ações, a renda fixa também se destacou em outubro - efeito da taxa Selic a 13,75% ao ano.

**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, 7 de novembro 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