

REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE  
**ARRAIAS / TO**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL  
DE  
INVESTIMENTOS**

**3º TRIMESTRE  
2022**

28 de outubro de 2022

## ÍNDICE

<b>1 – INTRODUÇÃO .....</b>	<b>3</b>
<b>2 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA, POLÍTICA DE INVESTIMENTOS, ENQUADRAMENTO: RESOLUÇÃO CMN 4.963/2021 .....</b>	<b>4</b>
2.1 - Movimentação da Carteira .....	4
2.2 - PAI - Limite de Segmento .....	5
2.3 - Enquadramento sobre Segmentos e Fundos de Investimento .....	6
2.3.1 - Disponibilidade Financeira e Total por Segmento .....	9
<b>3 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO .....</b>	<b>10</b>
<b>4 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RENDA FIXA .....</b>	<b>15</b>
<b>5 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS .....</b>	<b>22</b>
5.1 - Melhor Desempenho Trimestral dos Investimentos .....	24
5.2 - Pior Desempenho Trimestral dos Investimentos .....	25
<b>6 – RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO .....</b>	<b>26</b>
6.1 - Rentabilidade Mensal da Carteira de Investimentos .....	26
6.2 - Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos .....	27
6.3 - Análise da Carteira de Investimento .....	29
<b>7 – CONCLUSÃO .....</b>	<b>30</b>
7.1 - Rentabilidade da Carteira Trimestral .....	30
7.2 - Meta Atuarial .....	31
7.3 - Riscos .....	31
7.3.1 - Risco de Mercado .....	31
7.3.2 - Risco de Crédito .....	33
7.3.2.1 - Fundo de Investimento .....	33
7.3.2.2 - Instituição Financeira .....	34
7.3.3 - Risco de Liquidez .....	34
7.4 - Aderência ao PAI .....	35
7.4.1 - Perfil de Risco (Mercado) .....	35
7.4.2 - Risco de Crédito .....	36
7.4.3 - Risco de Liquidez .....	36
7.4.3.1 - Obrigações Previdenciárias - Curto Prazo .....	36
7.4.3.2 - Obrigações Previdenciárias - Médio e Longo Prazo .....	37

## 1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o Relatório Trimestral dos investimentos, referente ao 3º TRIMESTRE, sobre o desempenho das rentabilidades e os riscos das aplicações financeiras do ARRAIAS-PREV.

Este relatório vem atender o **Inciso V, do Art. 3º da Portaria MPS 519/2011**, que exige a elaboração de **Relatórios Trimestrais**, para acompanhamento dos riscos e desempenho das aplicações financeiras.

*Art. 3. V – Elaborar relatórios detalhados, no mínimo, trimestralmente, sobre a rentabilidade, os riscos das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos dos RPPS e a aderência à política anual de investimentos e suas revisões e submetê-las as instâncias superiores de deliberação e controle.*

## 2.1-MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2022 - ARRAIAS-PREV

Nº	MESES	SALDO INICIAL	APORTES (Aplicação)	RESGATES	VARIÇÃO PU - TÍTULOS PÚBLICOS	RENTABILIDADE			SALDO FINAL
						Positiva (a)	Negativa (b)	Consolidado c = (a) - (b)	
1	JANEIRO	5.978.629,43	727.048,60	(596.370,95)	-	15.767,60	(59.165,18)	(43.397,58)	6.065.909,50
2	FEVEREIRO	6.065.909,50	258.082,43	(79.561,69)	-	42.940,49	(34.548,88)	8.391,61	6.252.821,86
3	MARÇO	6.252.821,86	409.255,75	(239.354,22)	-	123.544,91	(17.169,82)	106.375,09	6.529.098,47
4	ABRIL	6.529.098,47	205.126,13	(43.288,26)	-	52.006,93	(60.307,22)	(8.300,29)	6.682.636,05
5	MAIO	6.682.636,05	703.936,88	(480.919,80)	-	64.238,68	(16.934,34)	47.304,34	6.952.957,47
6	JUNHO	6.952.957,47	204.758,02	(272.536,11)	-	34.406,98	(76.709,72)	(42.302,74)	6.842.876,64
7	JULHO	6.842.876,64	306.521,86	(87.369,00)	-	85.259,07	(4.846,72)	80.412,34	7.142.441,84
8	AGOSTO	7.142.441,84	466.551,59	(96.529,10)	-	73.077,49	(22.173,12)	50.904,37	7.563.368,70
9	SETEMBRO	7.563.368,70	974.966,03	(731.452,01)	-	60.665,37	(53.686,97)	6.978,41	7.813.861,13
10	OUTUBRO	7.813.861,13	-	-	-	-	-	-	7.813.861,13
11	NOVEMBRO	7.813.861,13	-	-	-	-	-	-	7.813.861,13
12	DEZEMBRO	7.813.861,13	-	-	-	-	-	-	7.813.861,13
13	ANO	5.978.629,43	4.256.247,29	(2.627.381,14)	-	551.907,51	(345.541,97)	206.365,55	7.813.861,13

\*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

## 2.2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2022 - LIMITE DE SEGMENTO - ARRAIAS-PREV

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.963/2021	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.963/2021	Limites do PAI			Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
<b>RENDA FIXA</b>								
1	Títulos Públicos Federal	Art. 7, I, a (100%)	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
2	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, b (100%)	0,0%	71,9%	100,0%	62,4%	4.877.497,62	-
3	F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, c (100%)	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7, II (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
5	F.I. de Renda Fixa	Art. 7, III, a (60%)	0,0%	0,0%	60,0%	20,9%	1.635.040,82	-
6	F.I. de Índice de Renda Fixa	Art. 7, III, b (0%)	0,0%	9,1%	60,0%	0,0%	-	-
7	Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F.	Art. 7, IV (20%)	0,0%	0,0%	20,0%	0,0%	-	-
8	FIDC - Classe Sênior	Art. 7, V, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
9	F.I. Renda Fixa de "Crédito Privado"	Art. 7, V, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
10	F.I. em 85% de Debêntures	Art. 7, V, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
11	<b>TOTAL - RENDA FIXA</b>					<b>83,3%</b>	<b>6.512.538,44</b>	
<b>RENDA VARIÁVEL</b>								
12	F.I. Ações	Art. 8, I (30%)	0,0%	8,1%	30,0%	6,7%	526.766,21	-
13	F.I. Ações em Índices de Renda Variável	Art. 8, II (30%)	0,0%	0,0%	30,0%	0,0%	-	-
14	<b>TOTAL - RENDA VARIÁVEL</b>	Art. 8, §1º (30%)				<b>6,7%</b>	<b>526.766,21</b>	
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>								
15	F.I. e F.I.C FI Multimercados	Art. 10, I (10%)	0,0%	6,4%	10,0%	4,7%	366.998,10	-
16	F.I. em Participações	Art. 10, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
17	F.I. Ações - Mercado de Acesso	Art. 10, III (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
18	<b>TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>	Art. 10 (15%)				<b>4,7%</b>	<b>366.998,10</b>	
<b>FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>								
19	F.I. Imobiliário	Art. 11 (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
20	<b>TOTAL - FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>	Art. 11 (5%)				<b>0,0%</b>	<b>-</b>	
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>								
21	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9º, I (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
22	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	Art. 9º, II (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
23	Fundos de Ações - BDR Nível I	Art. 9º, III (10%)	0,0%	4,5%	10,0%	5,2%	407.558,38	-
24	<b>TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	Art. 9 (10%)				<b>5,2%</b>	<b>407.558,38</b>	
<b>EMPRÉSTIMO CONSIGNADO</b>								
25	Empréstimo Consignado	Art. 12 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
26	<b>TOTAL - EMPRÉSTIMO CONSIGNADO</b>	Art. 12 (5%)				<b>0,0%</b>	<b>-</b>	
27	DESENQUADRADO	-		100,0%		0,0%	-	-
28	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-				0,0%	-	-
29	<b>PATRIMÔNIO TOTAL</b>					<b>100,0%</b>	<b>7.813.861,13</b>	<b>5</b>

## 2.1-ENQUADRAMENTO SOBRE SEGMENTOS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS

### RENDA FIXA

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
1	42.592.315/0001-15	BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI	263.474,22	3,37%	SIM	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	62,42%	SIM
2	44.345.590/0001-60	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	637.813,02	8,16%	SIM			
3	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	75.187,72	0,96%	SIM			
4	13.327.340/0001-73	BB PREVIDENCIARIO RF IMA - B 5 + FI	91.312,74	1,17%	SIM			
5	07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	188.682,85	2,41%	SIM			
6	14.964.240/0001-10	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TP FI	463.481,26	5,93%	SIM			
7	03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	1.134.765,83	14,52%	SIM			
8	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	1.139.931,76	14,59%	SIM			
9	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	882.848,21	11,30%	SIM			
10	35.292.588/0001-89	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	795.014,38	10,17%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	20,9%	SIM
11	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	839.766,47	10,75%	SIM			
12	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	259,97	0,003%	SIM			
<b>(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA</b>			<b>6.512.538,44</b>	<b>83,35%</b>				

\* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: SETEMBRO

**RENDA VARIÁVEL**

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
13	36.178.569/0001-99	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	79.755,09	1,02%	SIM			
14	40.054.357/0001-77	BB AÇÕES AGRO FIC FI	267.227,50	3,42%	SIM	F.I. Ações, Art. 8, I (30%)	6,7%	SIM
15	05.100.213/0001-09	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	179.783,62	2,30%	SIM			
16	06.015.368/0001-00	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	366.998,10	4,70%	SIM	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	4,7%	SIM
<b>(2) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL</b>			<b>893.764,31</b>	<b>11,44%</b>				

\* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: SETEMBRO

**INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
17	22.632.237/0001-28	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	407.558,38	5,22%	SIM	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	5,2%	0,0%
<b>(3) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>			<b>407.558,38</b>	<b>5,22%</b>				

\* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: SETEMBRO



### 2.3.1-DISPONIBILIDADE FINANCEIRA E TOTAL POR SEGMENTO

Nº	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		
18		-	
<b>(4) TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)</b>		-	<b>0,00%</b>

TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS		
(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	6.512.538,44	83,35%
(2) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	893.764,31	11,44%
(3) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	407.558,38	5,22%
(4) TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)	-	0,00%
<b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO TOTAL ( 1 + 2 + 3 + 4 )</b>	<b>7.813.861,13</b>	<b>100,00%</b>

\* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: SETEMBRO

### 3-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

1

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI
CNPJ	13.077.415/0001-05	13.077.418/0001-49	11.328.882/0001-35	13.322.205/0001-35
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Previdência Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa índices	Previdência Renda Fixa
ÍNDICE	CDI	CDI	IRF – M 1	IDKA 2
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Banco do Brasil S.A.	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	30.822.936/0001-69	00.000.000/0001.91	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
AUDITORIA	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	KPMG Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes
DATA DE INÍCIO	28/04/2011	28/04/2011	08/12/2009	28/04/2011
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,00% a.a.	0,20% a.a.	0,10% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	1.000,00	1.000,00	10.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	Qualquer valor	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor
RESGATE MÍNIMO	Qualquer valor	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor
SALDO MÍNIMO	Qualquer valor	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	2 - Baixo	2 - Baixo	2 - Baixo	1 - Muito baixo
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

2

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TP FI	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI
CNPJ	03.543.447/0001-03	14.964.240/0001-10	35.292.588/0001-89	07.111.384/0001-69
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa Índices	Renda Fixa Índices	Fundo de Renda Fixa	Renda Fixa índices
ÍNDICE	IMA - B 5	IMA – GERAL ex – C	IPCA	IRF – M
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Investidores qualificados	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	Banco do Brasil S.A.	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Banco do Brasil S.A.	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	00.000.000/0001.91	30.822.936/0001-69	00.000.000/0001.91	30.822.936/0001-69
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
AUDITORIA	KPMG Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores Independentes	KPMG Auditores Independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes
DATA DE INÍCIO	17/12/1999	16/04/2012	16/03/2020	08/12/2004
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20%a.a.	0,20% a.a.	0,50% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	1.000,00	10.000,00	10.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	Qualquer valor	1.000,00	Qualquer valor
RESGATE MÍNIMO	0,01	Qualquer valor	1.000,00	Qualquer valor
SALDO MÍNIMO	0,01	Qualquer valor	1.000,00	Qualquer valor
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	4 - Alto	4 - Alto	3 - Médio	4 - Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

3

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B 5 + FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I
CNPJ	13.327.340/0001-73	07.442.078/0001-05	06.015.368/0001-00	22.632.237/0001-28
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Investimentos Estruturados	Investimento no Exterior
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa	Renda Fixa índices	Multimercados Juros e Moedas	Ações Livre
ÍNDICE	IMA – B 5 +	IMA – B	CDI	IBOV
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Pessoas físicas e jurídicas
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
AUDITORIA	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	KPMG Auditores Independentes	KPMG Auditores independentes
DATA DE INÍCIO	28/04/2011	24/07/2005	29/06/2006	29/12/2015
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,50% a.a.	1,90% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	20% DI	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	10.000,00	10.000,00	0,01	200,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	<b>0,01</b>	<b>Qualquer valor</b>	<b>0,01</b>	<b>200,00</b>
RESGATE MÍNIMO	0,01	Qualquer valor	0,01	200,00
SALDO MÍNIMO	0,01	Qualquer valor	0,01	200,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	5 - Muito Alto	5 - Muito Alto	3 - Médio	5 - Muito Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

4

INFORMAÇÕES	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	BB AÇÕES AGRO FIC FI	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI
CNPJ	05.100.213/0001-09	40.054.357/0001-77	36.178.569/0001-99	44.345.590/0001-60
SEGMENTO	Renda Variável	Renda Variável	Renda Variável	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Ações Livre	Fundo de Ações	Fundo de Ações	Renda Fixa índice
ÍNDICE	IBOV	IBOV	S&P500	IPCA + 5,00%
PÚBLICO ALVO	Pessoas físicas e jurídicas	Regimes Próprios de Previdência Social	Pessoas físicas e jurídicas e Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	00.000.000/0001.91	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
AUDITORIA	KPMG Auditores independentes	KPMG Auditores Independentes	-	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores Independentes
DATA DE INÍCIO	22/07/2002	11/02/2021	04/05/2020	24/01/2022
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	3,00% a.a.	1,00% a.a.	1,00% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	20% IBOV	10% do S&P 500	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	200,00	0,01	0,01	100.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	<b>200,00</b>	<b>0,01</b>	<b>0,01</b>	<b>100.000,00</b>
RESGATE MÍNIMO	200,00	0,01	0,01	100.000,00
SALDO MÍNIMO	200,00	0,01	0,01	100.000,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Até dia 15/08/2024
CRÉDITO DO RESGATE	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO*	5 - Muito Alto	4 - Alto	4 - Alto	3 - Médio
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

5

INFORMAÇÕES	BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI			
CNPJ	42.592.315/0001-15			
SEGMENTO	Renda Fixa			
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa			
ÍNDICE	CDI			
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social			
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a			
CNPJ	30.822.936/0001-69			
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a			
CNPJ	30.822.936/0001-69			
CUSTODIANTE	Banco do Brasil S.A.			
CNPJ	00.000.000/0001.91			
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.			
CNPJ	00.000.000/0001.91			
AUDITORIA	KPMG Auditores Independentes			
DATA DE INÍCIO	30/09/2021			
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	4,00% a.a.			
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui			
APLICAÇÃO INICIAL	0,01			
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01			
RESGATE MÍNIMO	0,01			
SALDO MÍNIMO	0,01			
CARÊNCIA	Não possui			
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)			
RISCO DE MERCADO*	1 - Muito baixo			
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)			

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

## 4.2 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - BANCO DO BRASIL

BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI						
1	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	1.130.201,86	-	-	34,04	1.130.167,82	-0,003%
AGOSTO	1.130.167,82	-	-	69,11	1.130.236,93	0,006%
SETEMBRO	1.130.236,93	-	-	4.528,90	1.134.765,83	0,399%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI						
2	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	180.339,09	-	-	2.040,12	182.379,21	1,119%
AGOSTO	182.379,21	-	-	3.742,16	186.121,37	2,011%
SETEMBRO	186.121,37	-	-	2.561,48	188.682,85	1,358%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI						
3	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	73.978,86	-	-	655,11	73.323,75	-0,893%
AGOSTO	73.323,75	-	-	789,00	74.112,75	1,065%
SETEMBRO	74.112,75	-	-	1.074,97	75.187,72	1,430%

**BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI**

4	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	760.141,63	-	-	7.921,68	768.063,31	1,031%
AGOSTO	768.063,31	-	-	9.249,56	777.312,87	1,190%
SETEMBRO	777.312,87	-	-	8.440,22	785.753,09	1,074%

**BB PREVIDENCIARIO RF IMA - B 5 + FI**

5	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	88.725,32	-	-	1.646,14	87.079,18	-1,890%
AGOSTO	87.079,18	-	-	2.130,74	89.209,92	2,388%
SETEMBRO	89.209,92	-	-	2.102,82	91.312,74	2,303%

**BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI**

6	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	1.136.944,19	-	-	2.511,43	1.134.432,76	-0,221%
AGOSTO	1.134.432,76	-	-	505,51	1.133.927,25	-0,045%
SETEMBRO	1.133.927,25	-	-	6.004,51	1.139.931,76	0,527%



**BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI**

7	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	812.555,49	-	-	8.419,81	820.975,30	1,026%
AGOSTO	820.975,30	-	-	9.714,65	830.689,95	1,169%
SETEMBRO	830.689,95	-	-	9.076,52	839.766,47	1,081%

**BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TP FI**

8	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	449.049,92	-	-	2.102,68	451.152,60	0,466%
AGOSTO	451.152,60	-	-	6.470,35	457.622,95	1,414%
SETEMBRO	457.622,95	-	-	5.858,31	463.481,26	1,264%

**BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI**

9	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	771.325,49	-	-	4.927,32	776.252,81	0,635%
AGOSTO	776.252,81	-	-	8.909,67	785.162,48	1,135%
SETEMBRO	785.162,48	-	-	9.851,90	795.014,38	1,239%

### BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI

10	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	11,20	290.949,86 -	53.211,32	638,94	238.388,68	0,268%
AGOSTO	238.388,68	448.161,49 -	60.155,22	4.975,22	631.370,17	0,788%
SETEMBRO	631.370,17	324.338,95 -	696.084,85	3.849,95	263.474,22	1,461%

### BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI

11	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	149.887,05	- -	18.660,00	1.501,74	132.728,79	1,131%
AGOSTO	132.728,79	- -	18.490,00	1.551,22	115.790,01	1,340%
SETEMBRO	115.790,01	- -	19.900,00	1.205,11	97.095,12	1,241%

### BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI

12	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	81,68	15.572,00 -	15.497,68	10,50	166,50	6,306%
AGOSTO	166,50	18.390,10 -	17.883,88	15,31	688,03	2,226%
SETEMBRO	688,03	15.025,10 -	15.467,16	14,00	259,97	5,384%

BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI						
13	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	-	-	-	-	-	-
AGOSTO	-	-	-	-	-	-
SETEMBRO	-	635.601,98	-	2.211,04	<b>637.813,02</b>	<b>0,347%</b>

## 4.2 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - RENDA VARIÁVEL

### BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI

14	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	178.848,69	-	-	6.467,50	185.316,19	3,490%
AGOSTO	185.316,19	-	-	3.928,49	189.244,68	2,076%
SETEMBRO	189.244,68	-	-	9.461,06	179.783,62	-5,262%

### BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI

15	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	356.790,05	-	-	2.773,07	359.563,12	0,771%
AGOSTO	359.563,12	-	-	3.549,35	363.112,47	0,977%
SETEMBRO	363.112,47	-	-	3.885,63	366.998,10	1,059%

### BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I

16	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	421.498,44	-	-	32.610,56	454.109,00	7,181%
AGOSTO	454.109,00	-	-	18.668,88	435.440,12	-4,287%
SETEMBRO	435.440,12	-	-	27.881,74	407.558,38	-6,841%

**BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA**

<b>17</b>	<b>SALDO INICIAL</b> (R\$)	<b>Aportes</b> (R\$)	<b>Resgates</b> (R\$)	<b>Rentabilidade</b> (R\$)	<b>SALDO FINAL</b> (R\$)	<b>Taxa de Retorno</b>
<b>JULHO</b>	<b>82.093,36</b>	-	-	7.625,50	<b>89.718,86</b>	<b>8,499%</b>
<b>AGOSTO</b>	<b>89.718,86</b>	-	-	2.998,73	<b>86.720,13</b>	<b>-3,458%</b>
<b>SETEMBRO</b>	<b>86.720,13</b>	-	-	6.965,04	<b>79.755,09</b>	<b>-8,733%</b>

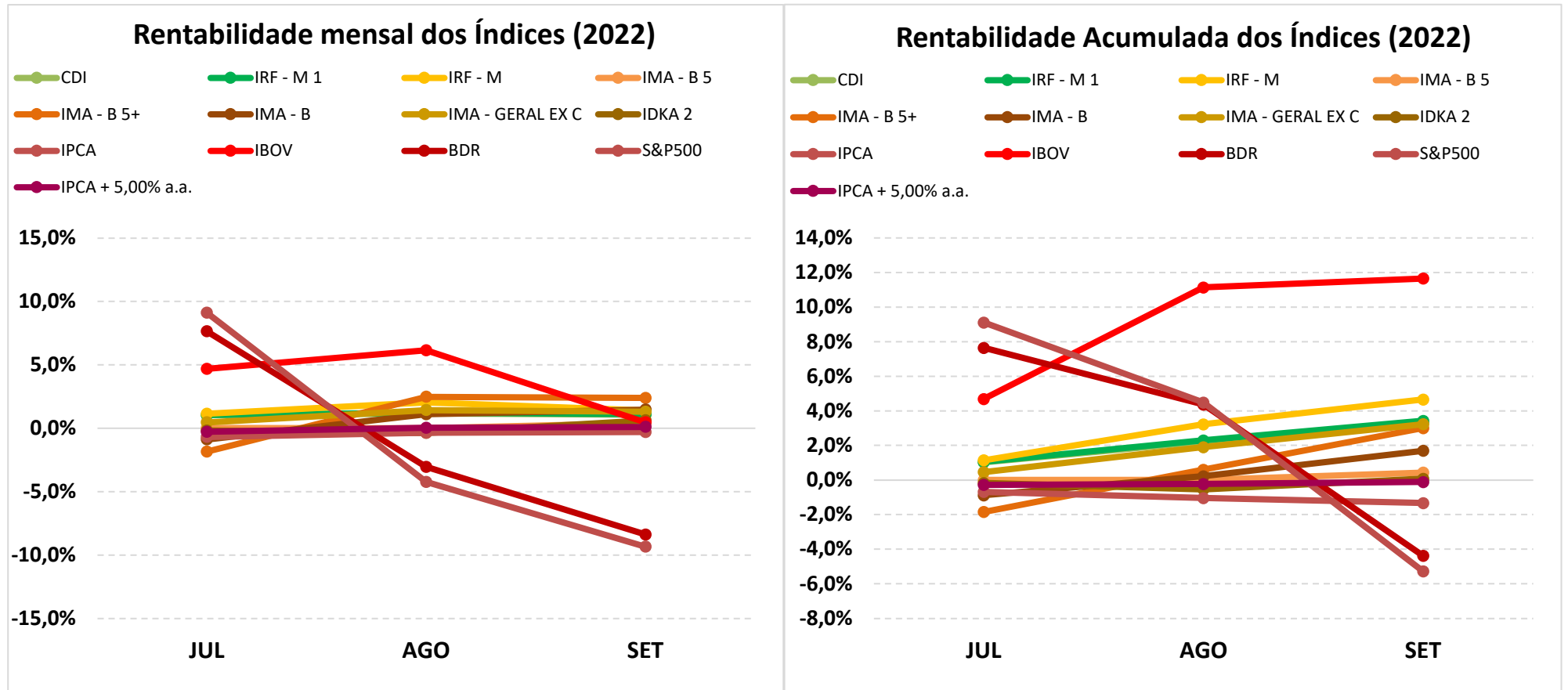
**BB AÇÕES AGRO FIC FI**

<b>18</b>	<b>SALDO INICIAL</b> (R\$)	<b>Aportes</b> (R\$)	<b>Resgates</b> (R\$)	<b>Rentabilidade</b> (R\$)	<b>SALDO FINAL</b> (R\$)	<b>Taxa de Retorno</b>
<b>JULHO</b>	<b>250.404,34</b>	-	-	8.219,62	<b>258.623,96</b>	<b>3,178%</b>
<b>AGOSTO</b>	<b>258.623,96</b>	-	-	17.982,67	<b>276.606,63</b>	<b>6,501%</b>
<b>SETEMBRO</b>	<b>276.606,63</b>	-	-	9.379,13	<b>267.227,50</b>	<b>-3,510%</b>

## 5-TABELA DE RENTABILIDADE

INVESTIMENTOS	JUL	AGO	SET	ACUMULADO
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	0,95%	1,08%	0,99%	<b>3,06%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,04%	1,18%	1,09%	<b>3,35%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	1,04%	1,20%	1,09%	<b>3,37%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	-0,22%	-0,04%	0,53%	<b>0,26%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	-0,003%	0,01%	0,40%	<b>0,40%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TP FI	0,47%	1,43%	1,28%	<b>3,21%</b>
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,64%	1,15%	1,25%	<b>3,07%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	1,13%	2,05%	1,38%	<b>4,63%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B 5 + FI	-1,86%	2,44%	2,36%	<b>2,90%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	-0,89%	1,08%	1,45%	<b>1,63%</b>
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,78%	0,99%	1,07%	<b>2,86%</b>
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	7,74%	-4,11%	-6,40%	<b>-3,31%</b>
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	3,62%	2,12%	-5,00%	<b>0,52%</b>
BB AÇÕES AGRO FIC FI	3,28%	6,95%	-3,39%	<b>6,72%</b>
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	9,29%	-3,34%	-8,03%	<b>-2,85%</b>
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	-0,33%	-0,17%	0,49%	<b>-0,02%</b>
BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI	0,81%	0,92%	0,85%	<b>2,61%</b>
<b>CDI</b>	<b>1,03%</b>	<b>1,17%</b>	<b>1,07%</b>	<b>3,31%</b>
<b>IRF - M 1</b>	<b>1,05%</b>	<b>1,23%</b>	<b>1,11%</b>	<b>3,43%</b>
<b>IRF - M</b>	<b>1,15%</b>	<b>2,05%</b>	<b>1,40%</b>	<b>4,66%</b>
<b>IMA - B 5</b>	<b>0,01%</b>	<b>0,001%</b>	<b>0,42%</b>	<b>0,43%</b>
<b>IMA - B 5+</b>	<b>-1,84%</b>	<b>2,49%</b>	<b>2,39%</b>	<b>3,01%</b>
<b>IMA - B</b>	<b>-0,88%</b>	<b>1,10%</b>	<b>1,48%</b>	<b>1,70%</b>
<b>IMA - GERAL EX C</b>	<b>0,46%</b>	<b>1,44%</b>	<b>1,30%</b>	<b>3,23%</b>
<b>IDKA 2</b>	<b>-0,17%</b>	<b>-0,36%</b>	<b>0,62%</b>	<b>0,09%</b>
<b>IPCA</b>	<b>-0,68%</b>	<b>-0,36%</b>	<b>-0,29%</b>	<b>-1,32%</b>
<b>IBOV</b>	<b>4,69%</b>	<b>6,16%</b>	<b>0,47%</b>	<b>11,66%</b>
<b>BDR</b>	<b>7,65%</b>	<b>-3,05%</b>	<b>-8,38%</b>	<b>-4,38%</b>
<b>S&amp;P500</b>	<b>9,11%</b>	<b>-4,24%</b>	<b>-9,34%</b>	<b>-5,28%</b>
<b>IPCA + 5,00% a.a.</b>	<b>-0,27%</b>	<b>0,05%</b>	<b>0,12%</b>	<b>-0,11%</b>

## GRÁFICO COMPARATIVO DE RENTABILIDADE DOS ÍNDICES

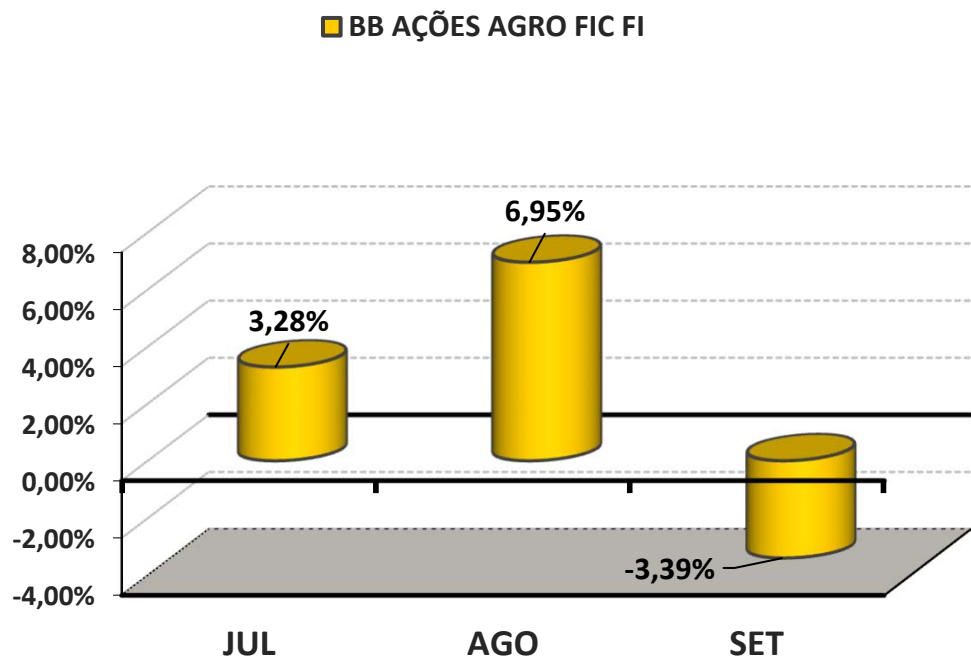


## 5.1-MELHOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

### COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDO DE INVESTIMENTO	JUL	AGO	SET
BB AÇÕES AGRO FIC FI	3,28%	6,95%	-3,39%

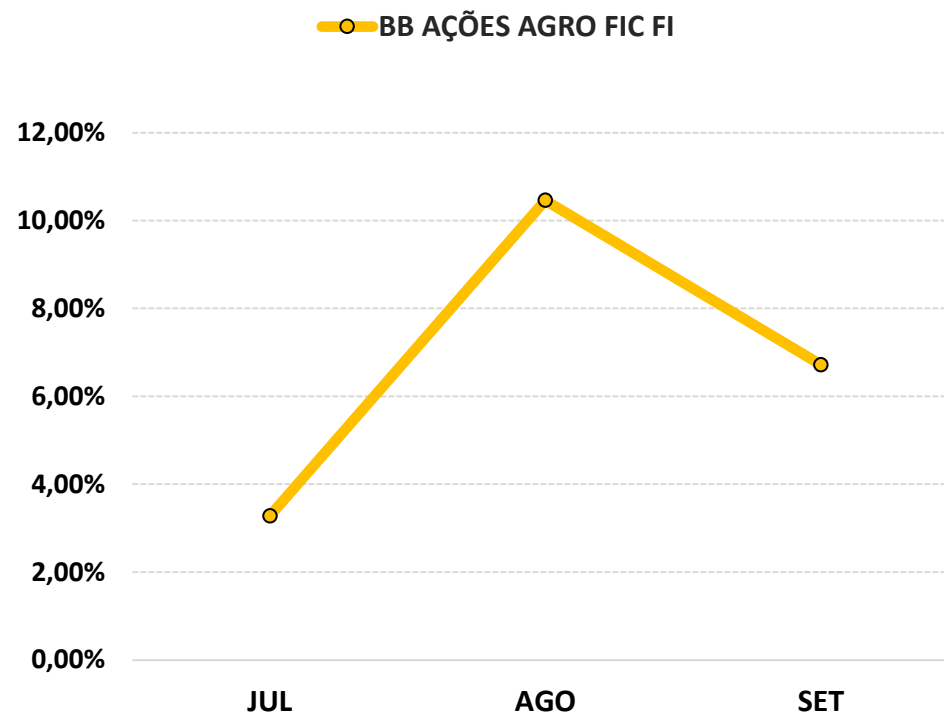
Comportamento MENSAL no Trimestre



### COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDO DE INVESTIMENTO	JUL	AGO	SET
BB AÇÕES AGRO FIC FI	3,28%	10,46%	6,72%

Comportamento ACUMULADO no Trimestre





## 5.2-PIOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

### COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDO DE INVESTIMENTO	JUL	AGO	SET
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	7,74%	-4,11%	-6,40%

### COMPORTAMENTO ACUMULADO

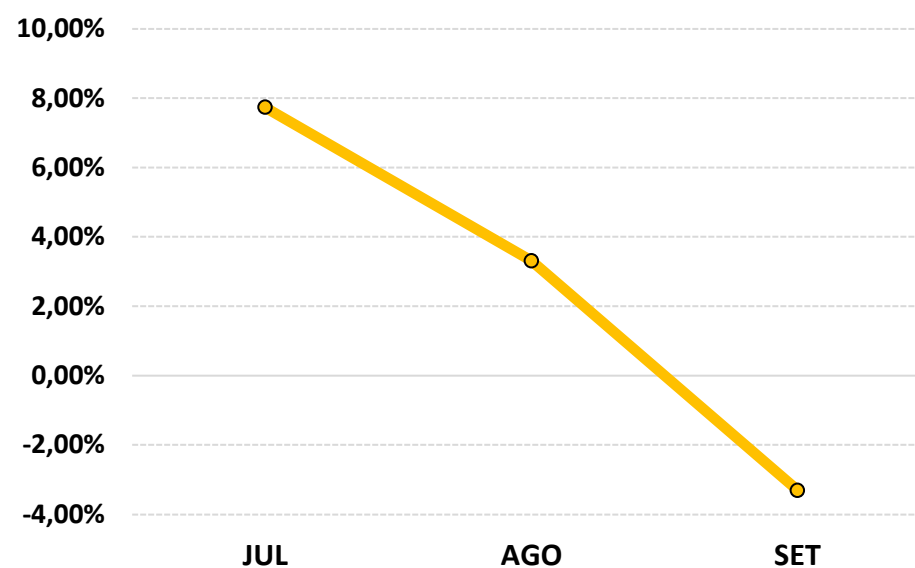
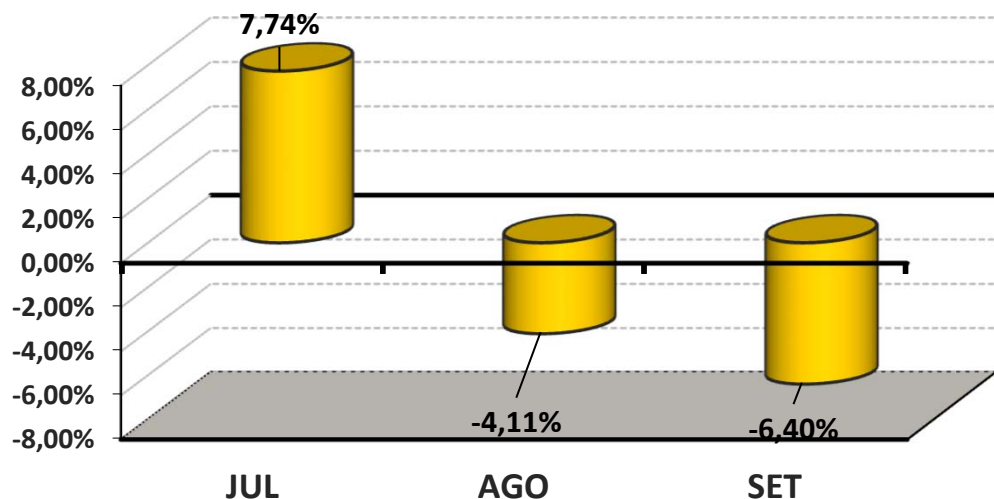
FUNDO DE INVESTIMENTO	JUL	AGO	SET
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	7,74%	3,31%	-3,31%

#### Comportamento MENSAL no Trimestre

#### Comportamento ACUMULADO no Trimestre

■ BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I

● BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I



## 6-RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

### 6.1-RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2022 - ARRAIAS-PREV

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET			
RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA	-0,73%	0,14%	1,70%	-0,13%	0,71%	-0,61%	1,18%	0,71%	0,09%			
CDI	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%	1,17%	1,07%			
IBOVESPA	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%	6,16%	0,47%			
META ATUARIAL	0,94%	1,41%	2,02%	1,46%	0,87%	1,07%	-0,28%	0,04%	0,11%			

A RENTABILIDADE DA CARTEIRA DO ARRAIAS-PREV NO MÊS DE SETEMBRO FOI DE:

R\$ 6.978,41

A META ATUARIAL NO MÊS DE SETEMBRO FOI DE:

R\$ 8.277,35

## 6.2-RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2022 - ARRAIAS-PREV

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET			
<b>RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA</b>	<b>-0,73%</b>	<b>-0,59%</b>	<b>1,10%</b>	<b>0,97%</b>	<b>1,69%</b>	<b>1,07%</b>	<b>2,26%</b>	<b>2,99%</b>	<b>3,08%</b>			
<b>CDI</b>	<b>0,73%</b>	<b>1,50%</b>	<b>2,44%</b>	<b>3,29%</b>	<b>4,35%</b>	<b>5,42%</b>	<b>6,50%</b>	<b>7,75%</b>	<b>8,90%</b>			
<b>IBOVESPA</b>	<b>6,98%</b>	<b>7,93%</b>	<b>14,47%</b>	<b>2,91%</b>	<b>6,22%</b>	<b>-5,99%</b>	<b>-1,58%</b>	<b>4,48%</b>	<b>4,97%</b>			
<b>META ATUARIAL</b>	<b>0,94%</b>	<b>2,36%</b>	<b>4,43%</b>	<b>5,95%</b>	<b>6,87%</b>	<b>8,02%</b>	<b>7,71%</b>	<b>7,76%</b>	<b>7,87%</b>			

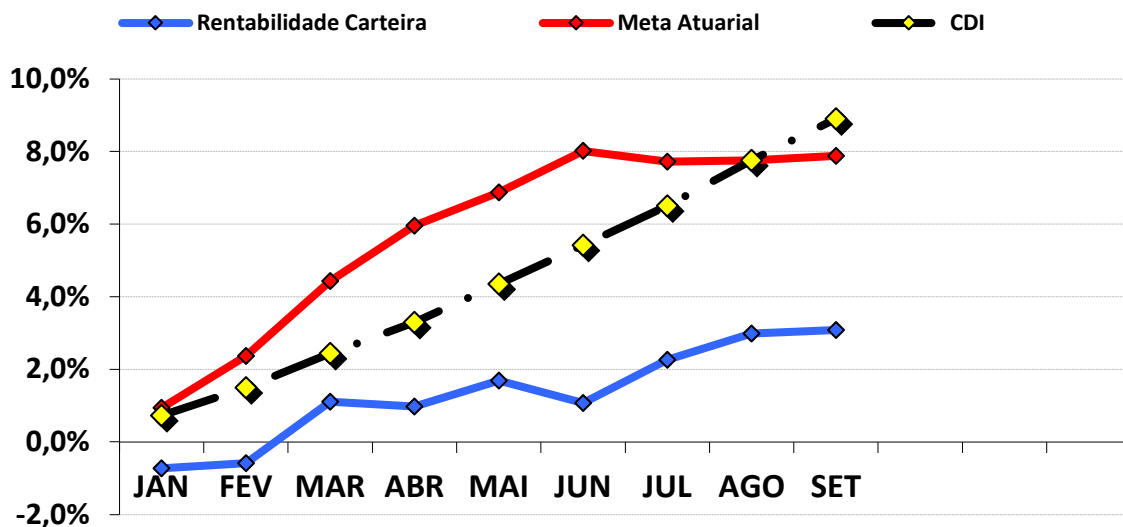
**RENTABILIDADE ACUMULADA DO ARRAIAS-PREV: R\$ 206.365,55**

**META ATUARIAL ACUMULADA: R\$ 487.576,46**

**DEFASAGEM PARA O CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL R\$ (281.210,91)**

**GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL**

**RENTABILIDADE DA CARTEIRA (Acumulada) 2022**



**RENTABILIDADE e ÍNDICES ACUMULADOS**

	Rentabilidade Carteira	Meta Atuarial	CDI
JAN	-0,73%	0,94%	0,73%
FEV	-0,59%	2,36%	1,50%
MAR	1,10%	4,43%	2,44%
ABR	0,97%	5,95%	3,29%
MAI	1,69%	6,87%	4,35%
JUN	1,07%	8,02%	5,42%
JUL	2,26%	7,71%	6,50%
AGO	2,99%	7,76%	7,75%
SET	3,08%	7,87%	8,90%



### 6.3-ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - 3º TRIMESTRE - 2022

	JUL	AGO	SET
<b>MENSAL</b>	1,18%	0,71%	0,09%
<b>CDI</b>	1,03%	1,17%	1,07%
<b>IBOVESPA</b>	4,69%	6,16%	0,47%
<b>META ATUARIAL</b>	-0,28%	0,04%	0,11%

	JUL	AGO	SET
<b>ACUMULADO DO TRIMESTRE</b>	1,18%	1,90%	1,99%
<b>CDI</b>	1,03%	2,21%	3,31%
<b>IBOVESPA</b>	4,69%	11,14%	11,66%
<b>META ATUARIAL</b>	-0,28%	-0,24%	-0,13%

RENTABILIDADE ACUMULADA DO TRIMESTRE DO ARRAIAS-PREV: R\$ 138.295,12

META ATUARIAL ACUMULADA DO TRIMESTRE: R\$ (8.104,03)

GANHO SOBRE A META ATUARIAL R\$ 146.399,15

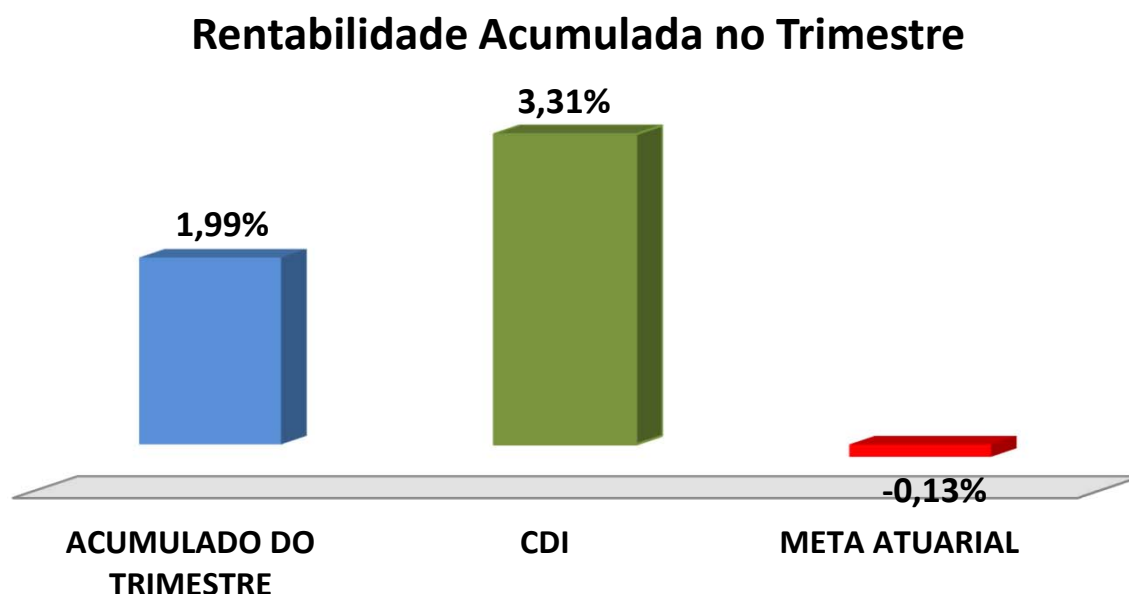
## 7-CONCLUSÃO

Atendendo o Art. 3, V, da Portaria MPS 519, detalhado na página 3 deste relatório, segue abaixo uma análise da Carteira de Investimento do ARRAIAS-PREV, no 3º Trimestre/2022, analisando rentabilidade, risco das operações e aderência ao PAI/2022.

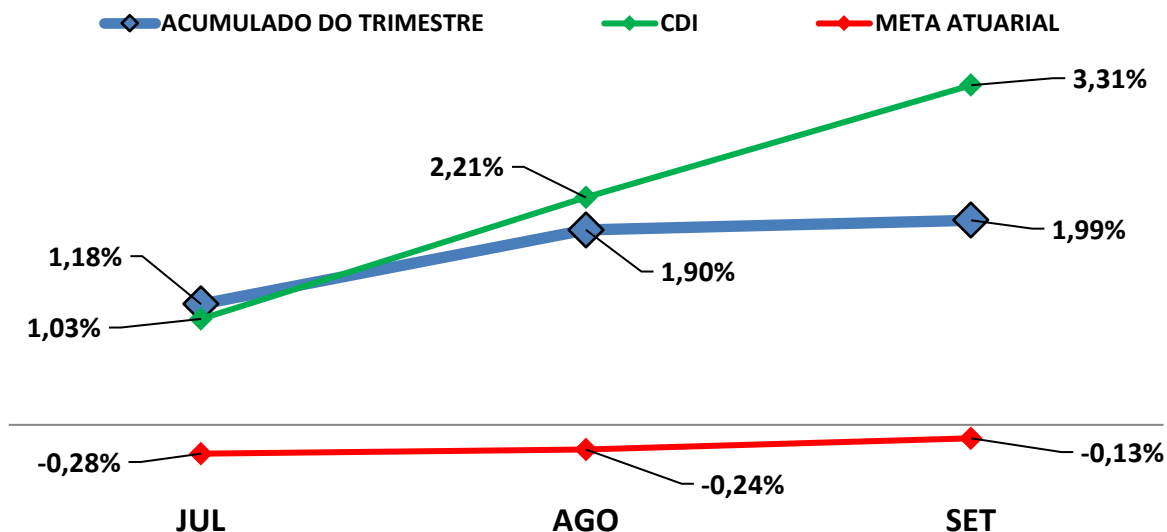
### 7.1.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA TRIMESTRAL

A Carteira de Investimentos do ARRAIAS-PREV, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada no trimestre de 1,99% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado no trimestre de 3,31% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou no período, uma rentabilidade de 60,21% sobre o índice de referência do mercado.

#### GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL



## Rentabilidade Acumulada no Trimestre



### 7.2-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada no trimestre do ARRAIAS-PREV é de 1,99% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de -0,13%, representando -1507,12% sobre a Meta Atuarial.

### 7.3-RISCOS

#### 7.3.1-RISCO DE MERCADO

É o risco de oscilações de preços dos ativos conforme o cenário macroeconômico. Este risco é voltado para a volatilidade dos papéis, sobretudo de Renda Fixa (Títulos Públicos e fundos atrelados à inflação) e Renda Variável (ações, dólar e etc..)."

Conforme a tabela abaixo, o ARRAIAS-PREV aplica em alguns Fundos de Investimentos sensíveis às oscilações de mercado, conforme a classificação de Risco de Mercado, disponibilizado nas Lâminas de Informações Essenciais dos Fundos de Investimentos.

Nº	FUNDOS DE INVESTIMENTO	RISCO DE MERCADO*
1	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	2 - Baixo
2	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2 - Baixo
3	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	2 - Baixo
4	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	1 - Muito baixo
5	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	4 - Alto
6	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TP FI	4 - Alto
7	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3 - Médio
8	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	4 - Alto
9	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B 5 + FI	5 - Muito Alto
10	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	5 - Muito Alto
11	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	3 - Médio
12	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5 - Muito Alto
13	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	5 - Muito Alto
14	BB AÇÕES AGRO FIC FI	4 - Alto
15	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	4 - Alto
16	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	3 - Médio
17	BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI	1 - Muito baixo

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.



### 7.3.2-RISCO DE CRÉDITO

É a possibilidade do devedor não honrar seus compromissos. Nesse caso, investimentos que possuem risco de insolvência financeira são obrigados à se submeter a classificação de risco por Agências de Rating.

#### 7.3.2.1-FUNDO DE INVESTIMENTO

A maioria dos Fundos de Investimentos em Renda Fixa e Renda Variável que o ARRAIAS-PREV aplica, não necessitam de Análise de Rating. Entretanto, alguns fundos de Renda Variável possuem certa concentração de papéis privados em sua carteira de investimento que, por possuir risco de insolvência financeira são obrigados à se submeter a classificação de risco por Agências de Rating. Abaixo segue a Classificação de Rating destes Fundos de Investimentos.

Nº	FUNDO DE INVESTIMENTO	CLASSIFICAÇÃO DE RATING	
		AGÊNCIA	RATING
1	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
2	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
3	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
4	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	Não Precisa	Não Precisa
5	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
6	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TP FI	Não Precisa	Não Precisa
7	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
8	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	Não Precisa	Não Precisa
9	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B 5 + FI	Não Precisa	Não Precisa
10	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	Não Precisa	Não Precisa
11	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	Não Há	Não Há
12	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Não Precisa	Não Precisa
13	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
14	BB AÇÕES AGRO FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
15	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	Não Há	Não Há
16	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	Não Precisa	Não Precisa
17	BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI	Não Há	Não Há

### 7.3.2.2-*INSTITUIÇÃO FINANCEIRA*

Todos os envolvidos na gestão do Fundo de Investimento, incluindo as Instituições Financeiras, o Administrador, o Gestor e o Distribuidor necessitam de Análise de Rating. Abaixo segue a Classificação de Rating dos envolvidos na gestão e distribuição dos Fundos de Investimentos.

Nº	INSTITUIÇÃO FINANCEIRA / ADMINISTRADOR / GESTOR / DISTRIBUIDOR	CLASSIFICAÇÃO DE RATING	
		AGÊNCIA	RATING
1	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	Fitch Ratings	AA

### 7.3.3-*RISCO DE LIQUIDEZ*

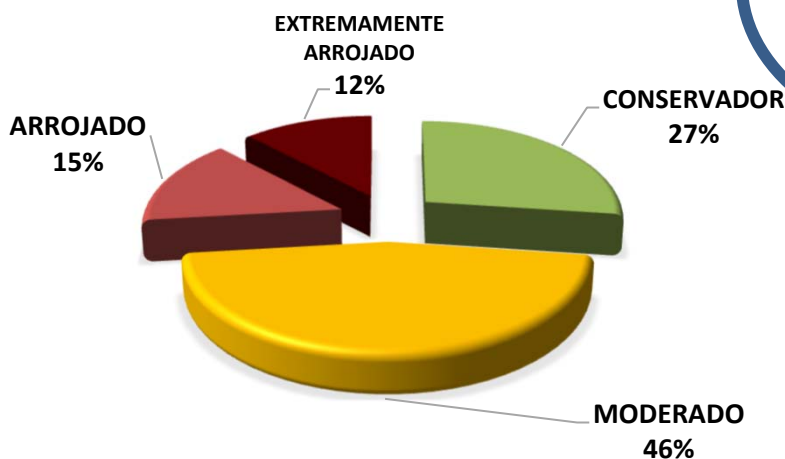
É o risco de o investidor não conseguir dar liquidez ao ativo financeiro (vender) ou conseguir liquidez abaixo do preço de mercado ou abaixo do preço de aquisição (compra).

O ARRAIAS-PREV possui Fundos de Investimento Aberto com Carência. Nesse caso, só poderá resgatar as cotas, após o termino do prazo de carência. Investimentos que possuem prazo para resgate, necessitam estar aderentes as obrigações financeiras do investidor.

## 7.4-ADERÊNCIA AO PAI

### 7.4.1-PERFIL DE RISCO (MERCADO)

#### PERFIL DOS INVESTIMENTOS



**PERFIL 6  
 MODERADO COM  
 TENDÊNCIA  
 ARROJADA**

#### Descrição do Perfil de Investidor

##### Objetivo do perfil

Perfil que tem o objetivo de buscar ganhos acima da inflação. A carteira possui uma grande concentração de ativos moderados, mas busca investir um pouco em ativos arrojados. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo (como Planos de Previdência) é o perfil mais indicado.

##### Comportamento da carteira

A carteira com perfil MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA, busca investimentos que rentabilizam acima da inflação, mas que podem apresentar rentabilidades negativas no curto prazo. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo é o perfil mais indicado, pois os investimentos podem oferecer ganhos mais vultuosos no médio e longo prazo. Esse tipo de perfil é o mais equilibrado, entre cumprir a Meta Atuarial e se proteger um pouco das oscilações de mercado.

#### Classificação de Perfil de Investidor - Metodologia Atuarial Consultoria

CONSERVADOR	1	EXTREMAMENTE CONSERVADOR
	2	CONSERVADOR
	3	CONSERVADOR COM TENDÊNCIA MODERADA
MODERADO	4	MODERADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	5	MODERADO
	6	MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA
ARROJADO	7	ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	8	ARROJADO COM TENDÊNCIA MODERADA
	9	ARROJADO
	10	EXTREMAMENTE ARROJADO

O atual perfil de risco do ARRAIAS-PREV (PERFIL 6 - MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA), se encontra aderente ao Perfil de Risco proposto na Política Anual de Investimentos/2022.

#### *7.4.2-RISCO DE CRÉDITO*

A Política Anual de Investimentos/2022 do ARRAIAS-PREV, determina que fundos de investimentos e Instituições Financeiras que necessitem de Análise de Rating, só receberão recursos do ARRAIAS-PREV, caso sejam classificados, no mínimo, como BAIXO RISCO DE CRÉDITO (BBB).

As Análises de Ratings encontradas dos Fundos de Investimentos, assim como das Instituições Financeiras, dos Administradores, dos Gestores e dos Distribuidores dos fundos, se encontram aderentes à Política Anual de Investimentos/2022 do ARRAIAS-PREV.

#### *7.4.3-RISCO DE LIQUIDEZ*

##### *7.4.3.1-OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS - CURTO PRAZO*

Para resguardar o ARRAIAS-PREV e minimizar o risco de liquidez no Curto Prazo foi definido na Política de Investimentos/2022, uma Separação de Recursos Financeiros, no intuito de formalizar uma Provisão de Caixa.

Na Política Anual de Investimentos/2022 do ARRAIAS-PREV foi definido um valor de Provisão de Caixa de R\$ 472.252,75 Milhões de reais. Atualmente, a necessidade de Provisão de Caixa do ARRAIAS-PREV é de R\$ 145.308,54 e o Saldo financeiro da Provisão de Caixa do ARRAIAS-PREV está em R\$ 1.986.348,87 Milhões de reais.

As Obrigações Previdenciárias no Curto Prazo, ou seja, a necessidade financeira do ARRAIAS-PREV estão aderentes a Política Anual de Investimentos/2022 e a sua capacidade financeira no Curto Prazo.

#### 7.4.3.2-OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS - MÉDIO e LONGO PRAZO

O investimento com prazo de duração mais longo que o ARRAIAS-PREV possui na sua carteira de investimento, tem liquidez à partir de 2024, representando 8,16% de seus recursos financeiros.

De acordo com o Estudo de Duration do Fluxo de Caixa do Plano Previdenciário, informado na Política Anual de Investimentos/2022, o RPPS irá começar a consumir os seus recursos, à partir do ano de 2031.

As Obrigações Previdenciárias a Médio e Longo Prazo do ARRAIAS-PREV estão aderentes a Política Anual de Investimentos/2022 e a sua capacidade e necessidade financeira a Médio e Longo prazo.

As análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 4.963/2021**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

É o Relatório.



---

Igor França Garcia  
Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA  
Consultor de Investimentos credenciado pela CVM