Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2022

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

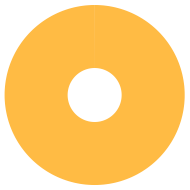
Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.192.479,97	17,23%	1.050	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.051.613,20	15,19%	575	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.594.196,18	37,48%	868	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	588.490,50	8,50%	222	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	904.772,47	13,07%	1.028	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANPARÁ FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+0	Não há	589.877,63	8,52%	14	19,61%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		325,53	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			**6.921.429,95**				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			**325,53**				Artigo 6º
PL Total			**6.921.755,48**				

Mosaico Consultoria
Otto Weiss, 10, sala A - Rio Negrinho - SC
CEP: 89295-000 - Telefone: (47) 9135 4237

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	6.921.429,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	2.244.093,17	32,42%	10,00%	35,00%	100,00%	4.677.336,78
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	4.087.459,15	59,06%	10,00%	60,00%	60,00%	65.398,82
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	4.152.857,97
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	346.071,50
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	346.071,50
Desenquadrado - RF	0,00%	589.877,63	8,52%	0,00%	0,00%	0,00%	-589.877,63
Total Renda Fixa	100,00%	6.921.429,95	100,00%	20,00%	95,00%	330,00%	



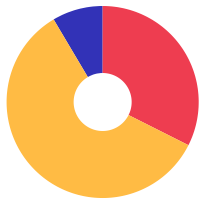
RENDA FIXA 6.921.429,95

Mosaico Consultoria
Otto Weiss, 10, sala A - Rio Negrinho - SC
CEP: 89295-000 - Telefone: (47) 9135 4237

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	2.076.428,99
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	692.143,00
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	346.071,50
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	692.143,00
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	



7º I b
7º III a
Desenquadrado

Mosaico Consultoria
Otto Weiss, 10, sala A - Rio Negrinho - SC
CEP: 89295-000 - Telefone: (47) 9135 4237

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.331.552,32	91,48	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT	589.877,63	8,52	0,00

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira $	Carteira %		

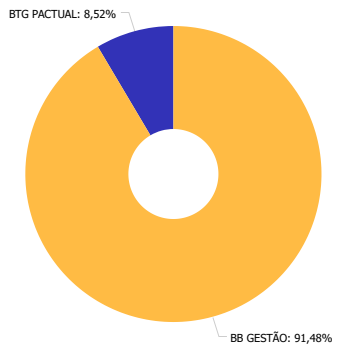
Mosaico Consultoria
Otto Weiss, 10, sala A - Rio Negrinho - SC
CEP: 89295-000 - Telefone: (47) 9135 4237

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,62%	6,94%	0,09%	2,94%	8,91%	15,68%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	6,74%	0,26%	2,81%	8,72%	15,30%	1,42%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	1,48%	6,12%	1,70%	3,16%	7,25%	12,30%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45%	5,87%	1,55%	2,93%	6,92%	11,66%	2,45%	0,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45%	5,92%	1,63%	3,07%	6,95%	11,76%	2,43%	0,06%
CDI (Benchmark)	1,07%	8,89%	3,31%	6,31%	10,90%	14,21%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,99%	8,08%	3,06%	5,77%	9,78%	11,85%	0,00%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,09%	9,08%	3,35%	6,35%	11,18%	14,77%	0,02%	0,01%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

Mosaico Consultoria
Otto Weiss, 10, sala A - Rio Negrinho - SC
CEP: 89295-000 - Telefone: (47) 9135 4237

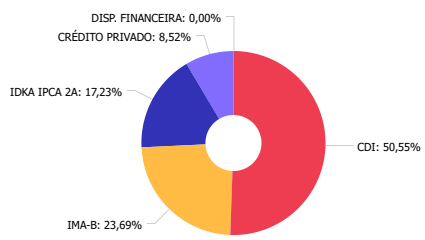
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2022)



BB GESTÃO	6.331.552,32
BTG PACTUAL	589.877,63

Mosaico Consultoria
Otto Weiss, 10, sala A - Rio Negrinho - SC
CEP: 89295-000 - Telefone: (47) 9135 4237

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

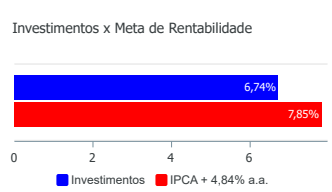


CDI	3.498.968,65	IMA-B	1.640.103,70	IDKA IPCA 2A	1.192.479,97	CRÉDITO PRIVADO	589.877,63
DISP. FINANCEIRA	325,53						

Mosaico Consultoria
Otto Weiss, 10, sala A - Rio Negrinho - SC
CEP: 89295-000 - Telefone: (47) 9135 4237

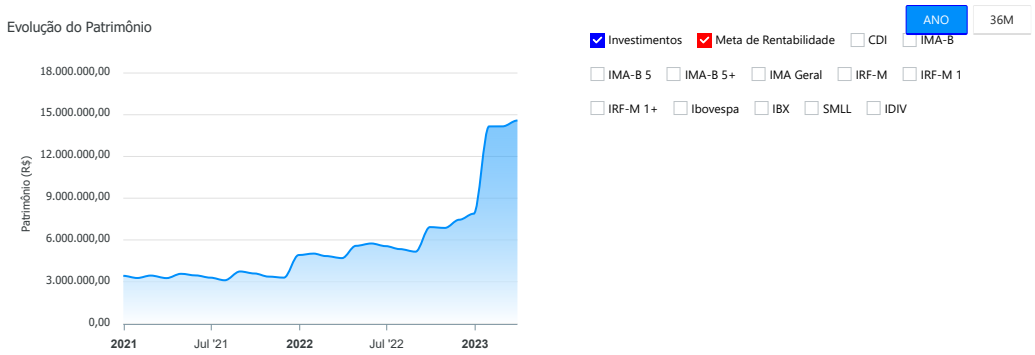
Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	3.024.568,56	0,00	0,00	3.015.314,10	-9.254,46	-9.254,46	-0,31%	-0,31%	0,94%	0,94%	-32,55%	1,43%
Fevereiro	3.015.314,10	0,00	0,00	3.039.389,78	24.075,68	14.821,22	0,80%	0,49%	1,37%	2,32%	21,09%	1,34%
Março	3.039.389,78	1.778.600,88	242.794,45	4.666.350,29	91.154,08	105.975,30	1,99%	2,49%	2,04%	4,41%	56,50%	1,29%
Abril	4.666.350,29	0,00	171.952,57	4.540.786,06	46.388,34	152.363,64	0,99%	3,51%	1,42%	5,89%	59,56%	1,12%
Maio	4.540.786,06	0,00	15.000,00	4.568.585,50	42.799,44	195.163,08	0,94%	4,49%	0,89%	6,83%	65,67%	1,07%
Junho	4.568.585,50	606.490,95	109.168,02	5.081.828,45	15.920,02	211.083,10	0,31%	4,82%	1,07%	7,97%	60,40%	0,98%
Julho	5.081.828,45	0,00	72.399,77	5.015.761,94	6.333,26	217.416,36	0,12%	4,95%	-0,29%	7,66%	64,55%	1,12%
Agosto	5.015.761,94	0,00	87.334,50	4.970.366,06	41.938,62	259.354,98	0,84%	5,82%	0,07%	7,74%	75,26%	1,38%
Setembro	4.970.366,06	3.242.236,48	1.350.714,77	6.921.429,95	59.542,18	318.897,16	0,87%	6,74%	0,10%	7,85%	85,89%	0,83%



Mosaico Consultoria
Otto Weiss, 10, sala A - Rio Negrinho - SC
CEP: 89295-000 - Telefone: (47) 9135 4237

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores



Mosaico Consultoria
Otto Weiss, 10, sala A - Rio Negrinho - SC
CEP: 89295-000 - Telefone: (47) 9135 4237

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2022 — **FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	580.070,91	0,00	0,00	588.490,50	8.419,59	1,45%	1,45%	2,45%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.036.578,17	0,00	0,00	1.051.613,20	15.035,03	1,45%	1,45%	2,43%
BANPARÁ FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	1.820.466,42	0,00	1.244.312,84	589.877,63	13.724,05	0,75%	1,08%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	900.000,00	0,00	904.772,47	4.772,47	0,53%	1,09%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.186.198,67	0,00	0,00	1.192.479,97	6.281,30	0,53%	0,53%	1,42%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	347.051,89	2.342.236,48	106.401,93	2.594.196,18	11.309,74	0,42%	0,99%	0,00%
Total Renda Fixa	**4.970.366,06**	**3.242.236,48**	**1.350.714,77**	**6.921.429,95**	**59.542,18**	**0,87%**		**0,83%**

Mosaico Consultoria
Otto Weiss, 10, sala A - Rio Negrinho - SC
CEP: 89295-000 - Telefone: (47) 9135 4237

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2022 — **FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Variável	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00%**		**0,00%**

Mosaico Consultoria
Otto Weiss, 10, sala A - Rio Negrinho - SC
CEP: 89295-000 - Telefone: (47) 9135 4237

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2022 **FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
BANPARÁ FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	1.780.332,88	0,00	1.244.312,84	589.877,63	53.857,59	3,03%	3,36%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	497.916,52	2.342.236,48	266.136,20	2.594.196,18	20.179,38	0,71%	3,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.034.705,55	0,00	0,00	1.051.613,20	16.907,65	1,63%	1,63%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	579.518,82	0,00	0,00	588.490,50	8.971,68	1,55%	1,55%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	900.000,00	0,00	904.772,47	4.772,47	0,53%	3,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.189.354,68	0,00	0,00	1.192.479,97	3.125,29	0,26%	0,26%
Total Renda Fixa	**5.081.828,45**	**3.242.236,48**	**1.510.449,04**	**6.921.429,95**	**107.814,06**	**1,58%**	

Mosaico Consultoria
Otto Weiss, 10, sala A - Rio Negrinho - SC
CEP: 89295-000 - Telefone: (47) 9135 4237

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria 1.467, de 02 de junho de 2022. e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Mosaico Consultoria
Otto Weiss, 10, sala A - Rio Negrinho - SC
CEP: 89295-000 - Telefone: (47) 9135 4237