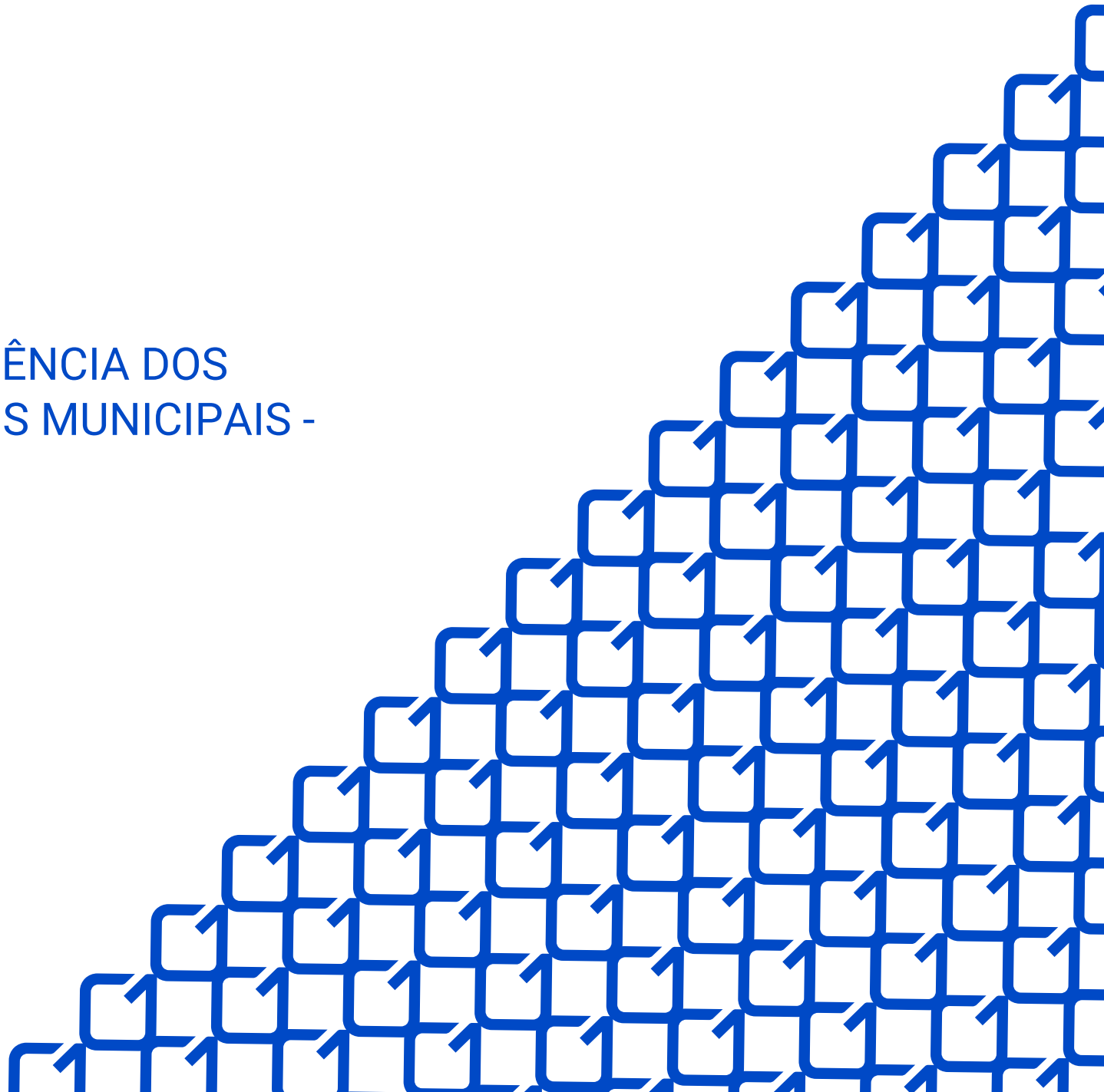




# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS - CAPREV

 Setembro/2022



Patrimônio

R\$ 26.520.177,50

Rentabilidade

| Mês   | Acum. |
|-------|-------|
| 1,33% | 7,38% |

Meta

| Mês   | Acum.  |
|-------|--------|
| 0,10% | 12,61% |

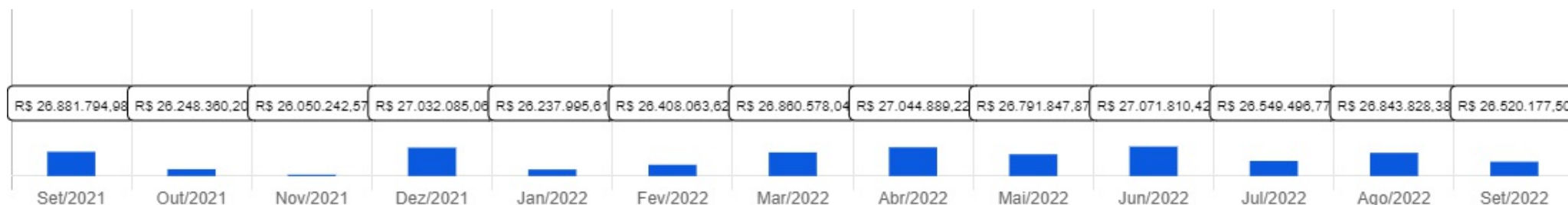
Gap

| Mês   | Acum.  |
|-------|--------|
| 1,23% | -5,23% |

VaR

0,54%

## Evolução do Patrimônio (Últimos 12 meses)

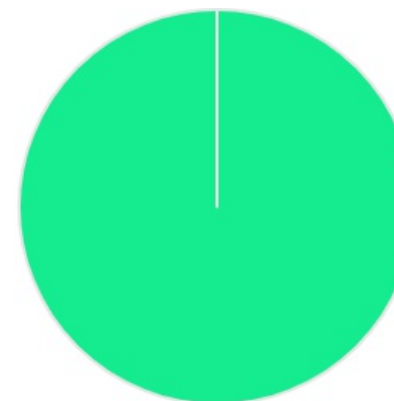


## Comparativo (Rentabilidades | Metas) (Últimos 12 meses)

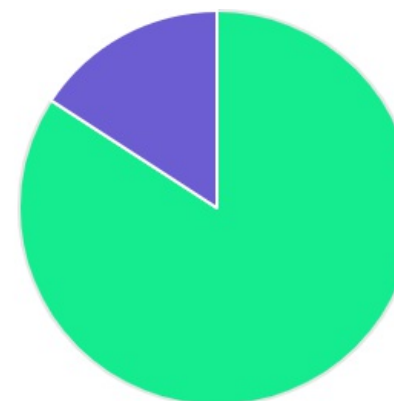


| ATIVO                           | SALDO             | CARTEIRA(%) | RESG. | 4.963      | RETORNO (R\$)  | (%)   |
|---------------------------------|-------------------|-------------|-------|------------|----------------|-------|
| CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF     | R\$ 5.008.722,65  | 18.90%      | D+0   | 7, I "b"   | R\$ 73.847,55  | 1,50% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...   | R\$ 4.649.448,93  | 17.54%      | D+0   | 7, I "b"   | R\$ 19.775,08  | 0,43% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...   | R\$ 642.736,76    | 2.43%       | D+0   | 7, I "b"   | R\$ 3.506,81   | 0,13% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...  | R\$ 4.202.634,69  | 15.86%      | D+0   | 7, I "b"   | R\$ 97.471,70  | 2,37% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP... | R\$ 1.772.948,65  | 6.69%       | D+0   | 7, I "b"   | R\$ 9.035,41   | 0,51% |
| BNB RPPS IMA-B FI RF            | R\$ 6.030.160,91  | 22.75%      | D+1   | 7, I "b"   | R\$ 78.211,85  | 1,31% |
| CAIXA FIC FI NOVO BRASIL RF...  | R\$ 4.161.613,00  | 15.70%      | D+0   | 7, III "a" | R\$ 73.215,38  | 1,52% |
| CAIXA BRASIL FI RF REF DI...    | R\$ 32.829,55     | 0.12%       | D+0   | 7, III "a" | R\$ 358,85     | 1,11% |
| Total investimentos             | R\$ 26.501.095,14 | 100.00%     |       |            | R\$ 355.422,63 | 1,33% |
| Disponibilidade                 | R\$ 19.082,36     | -           |       |            | -              | -     |
| Total patrimônio                | R\$ 26.520.177,50 | 100.00%     |       |            | -              | -     |

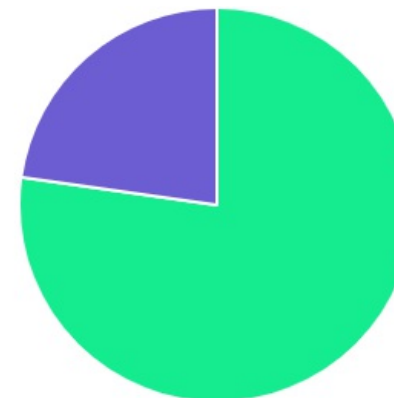
| CLASSE     | PERCENTUAL | VALOR             | LEG.                                                                                |
|------------|------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| Renda Fixa | 100,00%    | R\$ 26.501.095,14 |  |
| Total      | 100,00%    | R\$ 26.501.095,14 |                                                                                     |



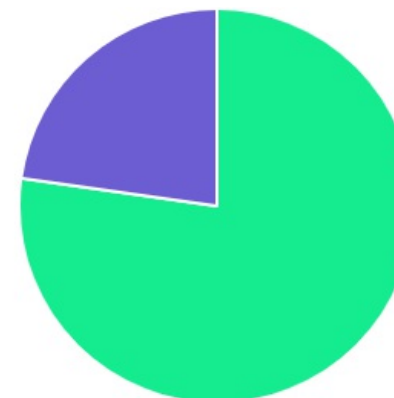
| ENQUADRAMENTO                       | PERCENTUAL | VALOR             | LEG.                                                                                |
|-------------------------------------|------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   | 84,17%     | R\$ 22.306.652,59 |  |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 15,83%     | R\$ 4.194.442,55  |  |
| Total                               | 100,00%    | R\$ 26.501.095,14 |                                                                                     |



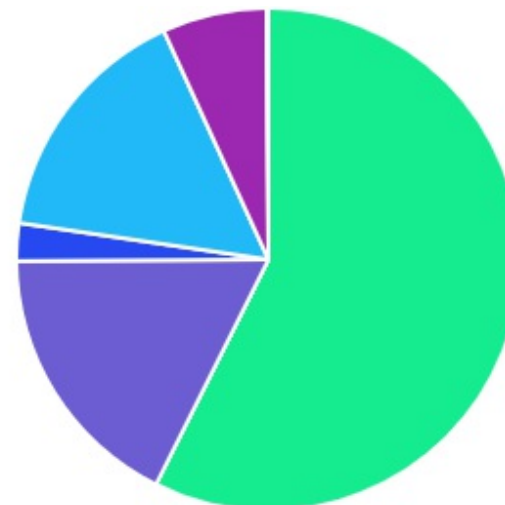
| GESTOR              | PERCENTUAL | VALOR             | LEG.                                                                                |
|---------------------|------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| CAIXA DISTRIBUIDORA | 77,25%     | R\$ 20.470.934,23 |  |
| BANCO DO NORDESTE   | 22,75%     | R\$ 6.030.160,91  |  |
| Total               | 100,00%    | R\$ 26.501.095,14 |                                                                                     |



| ADMINISTRADOR    | PERCENTUAL | VALOR             | LEG.                                                                                |
|------------------|------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| CAIXA ECONOMICA  | 77,25%     | R\$ 20.470.934,23 |  |
| SANTANDER CACEIS | 22,75%     | R\$ 6.030.160,91  |  |
| Total            | 100,00%    | R\$ 26.501.095,14 |                                                                                     |



| BENCHMARK    | PERCENTUAL | VALOR             | LEG. |
|--------------|------------|-------------------|------|
| IMA-B        | 57,36%     | R\$ 15.200.496,56 |      |
| IMA-B 5      | 17,54%     | R\$ 4.649.448,93  |      |
| IMA-B 5+     | 15,86%     | R\$ 4.202.634,69  |      |
| IDKA IPCA 2A | 6,69%      | R\$ 1.772.948,65  |      |
| IRF-M 1      | 2,43%      | R\$ 642.736,76    |      |
| CDI          | 0,12%      | R\$ 32.829,55     |      |
| Total        | 100,00%    | R\$ 26.501.095,14 |      |



| RENDA FIXA                                             | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$)    | (%)     | POLÍTICA DE INVESTIMENTO |         |             |
|--------------------------------------------------------|--------------|-------------------|---------|--------------------------|---------|-------------|
|                                                        |              |                   |         | Inferior(%)              | Alvo(%) | Superior(%) |
| Títulos Tesouro Nacional – SELIC - 7, I "a"            | 100%         | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 100,00%     |
| FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"  | 100%         | R\$ 22.306.652,59 | 84.17%  | 50,00%                   | 55,00%  | 100,00%     |
| FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c" | 100%         | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 100,00%     |
| Operações Compromissadas - 7, II                       | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 5,00%       |
| FI Renda Fixa - 7, III "a"                             | 60%          | R\$ 4.194.442,55  | 15.83%  | 0,00%                    | 10,00%  | 60,00%      |
| FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"                  | 60%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 60,00%      |
| Ativos Bancários - 7, IV                               | 20%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 20,00%      |
| FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"     | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 10,00%  | 5,00%       |
| FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"             | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 5,00%   | 5,00%       |
| FI Debêntures - 7, V "c"                               | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 5,00%       |
| Total Renda Fixa                                       |              | R\$ 26.501.095,14 | 100,00% |                          |         |             |
| RENDA VARIÁVEL                                         | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$)    | (%)     | POLÍTICA DE INVESTIMENTO |         |             |
|                                                        |              |                   |         | Inferior(%)              | Alvo(%) | Superior(%) |
| FI Ações - 8, I                                        | 30%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 7,50%   | 30,00%      |
| FI de Índices Ações - 8, II                            | 30%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 7,50%   | 30,00%      |
| Total Renda Variável                                   |              | R\$ 0,00          | 0,00%   |                          |         |             |
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR                              | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$)    | (%)     | POLÍTICA DE INVESTIMENTO |         |             |
|                                                        |              |                   |         | Inferior(%)              | Alvo(%) | Superior(%) |
| FI Renda Fixa - Dívida Externa - 9, I                  | 10%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 10,00%      |
| FI Investimento no Exterior - 9, II                    | 10%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 10,00%      |

|                                 |     |          |       |       |       |        |
|---------------------------------|-----|----------|-------|-------|-------|--------|
| FI Ações – BDR Nível I - 9, III | 10% | R\$ 0,00 | 0.00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% |
| Total Investimentos no Exterior |     | R\$ 0,00 | 0,00% |       |       |        |

| FUNDOS ESTRUTURADOS                      | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$)    | (%)     | POLÍTICA DE INVESTIMENTO |         |             |
|------------------------------------------|--------------|-------------------|---------|--------------------------|---------|-------------|
|                                          |              |                   |         | Inferior(%)              | Alvo(%) | Superior(%) |
| FI Multimercado - aberto - 10, I         | 10%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 10,00%      |
| FI em Participações - 10, II             | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 5,00%       |
| FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 5,00%       |
| Total Fundos Estruturados                |              | R\$ 0,00          | 0,00%   |                          |         |             |
| FUNDOS IMOBILIÁRIOS                      | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$)    | (%)     | POLÍTICA DE INVESTIMENTO |         |             |
|                                          |              |                   |         | Inferior(%)              | Alvo(%) | Superior(%) |
| FI Imobiliário - 11                      | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 5,00%   | 5,00%       |
| Total Fundos Imobiliários                |              | R\$ 0,00          | 0,00%   |                          |         |             |
| EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS                  | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$)    | (%)     | Inferior(%)              | Alvo(%) | Superior(%) |
|                                          |              |                   |         |                          |         |             |
| Empréstimos Consignados - 12             | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 5,00%   | 5,00%       |
| Total Empréstimos Consignados            |              | R\$ 0,00          | 0,00%   |                          |         |             |
| Total Global                             |              | R\$ 26.501.095,14 | 100,00% |                          |         |             |

| PERÍODO   | SALDO ANTERIOR    | SALDO FINAL       | META              | RENT.(R\$)       | RENT.(%) | GAP    |
|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|----------|--------|
| 2022      |                   |                   | IPCA + 4.81% a.a. |                  |          |        |
| Janeiro   | R\$ 27.031.480,72 | R\$ 26.228.226,92 | 0,93%             | R\$ -163.253,80  | -0,60%   | -1,53% |
| Fevereiro | R\$ 26.228.226,92 | R\$ 26.316.123,00 | 1,40%             | R\$ 158.363,21   | 0,60%    | -0,80% |
| Março     | R\$ 26.316.123,00 | R\$ 26.837.754,83 | 2,01%             | R\$ 777.707,10   | 2,95%    | 0,94%  |
| Abril     | R\$ 26.837.754,83 | R\$ 26.892.797,14 | 1,45%             | R\$ 232.664,59   | 0,86%    | -0,59% |
| Maio      | R\$ 26.892.797,14 | R\$ 26.782.753,42 | 0,86%             | R\$ 254.578,56   | 0,95%    | 0,08%  |
| Junho     | R\$ 26.782.753,42 | R\$ 27.059.917,13 | 1,06%             | R\$ -81.214,01   | -0,30%   | -1,36% |
| Julho     | R\$ 27.059.917,13 | R\$ 26.540.495,39 | -0,29%            | R\$ -212.799,46  | -0,78%   | -0,49% |
| Agosto    | R\$ 26.540.495,39 | R\$ 26.835.294,91 | 0,03%             | R\$ 285.421,80   | 1,09%    | 1,06%  |
| Setembro  | R\$ 26.835.294,91 | R\$ 26.501.095,14 | 0,10%             | R\$ 355.422,63   | 1,33%    | 1,23%  |
| Total     | R\$ 26.835.294,91 | R\$ 26.501.095,14 | 7,82%             | R\$ 1.606.890,62 | 6,22%    | -1,60% |
| 2021      |                   |                   | IPCA + 5.87% a.a. |                  |          |        |
| Janeiro   | R\$ 26.483.918,17 | R\$ 25.951.057,75 | 0,73%             | R\$ -198.860,42  | -0,74%   | -1,47% |
| Fevereiro | R\$ 25.951.057,75 | R\$ 26.295.202,99 | 1,34%             | R\$ -364.253,98  | -1,39%   | -2,72% |
| Março     | R\$ 26.295.202,99 | R\$ 26.312.768,31 | 1,41%             | R\$ -98.434,68   | -0,36%   | -1,77% |
| Abril     | R\$ 26.312.768,31 | R\$ 26.640.586,27 | 0,79%             | R\$ 173.579,71   | 0,66%    | -0,13% |
| Maio      | R\$ 26.640.586,27 | R\$ 26.821.801,14 | 1,31%             | R\$ 262.394,00   | 0,98%    | -0,32% |
| Junho     | R\$ 26.821.801,14 | R\$ 26.849.707,98 | 1,01%             | R\$ 80.906,84    | 0,30%    | -0,70% |
| Julho     | R\$ 26.849.707,98 | R\$ 26.844.958,41 | 1,44%             | R\$ -87.192,46   | -0,32%   | -1,76% |
| Agosto    | R\$ 26.844.958,41 | R\$ 27.006.128,64 | 1,35%             | R\$ -248.474,31  | -0,93%   | -2,28% |
| Setembro  | R\$ 27.006.128,64 | R\$ 26.881.794,98 | 1,64%             | R\$ 10.797,72    | 0,04%    | -1,60% |

|          |                   |                   |        |                 |        |         |
|----------|-------------------|-------------------|--------|-----------------|--------|---------|
| Outubro  | R\$ 26.881.794,98 | R\$ 26.241.259,48 | 1,73%  | R\$ -633.629,92 | -2,34% | -4,07%  |
| Novembro | R\$ 26.241.259,48 | R\$ 26.039.269,75 | 1,43%  | R\$ 846.010,27  | 3,23%  | 1,80%   |
| Dezembro | R\$ 26.039.269,75 | R\$ 27.031.480,72 | 1,21%  | R\$ 70.210,97   | 0,28%  | -0,93%  |
| Total    | R\$ 26.039.269,75 | R\$ 27.031.480,72 | 16,52% | R\$ -186.946,26 | -0,69% | -17,21% |

| ATIVO                           | CNPJ               | RENTABILIDADE |         |              |              |            |
|---------------------------------|--------------------|---------------|---------|--------------|--------------|------------|
|                                 |                    | Mês (%)       | Ano (%) | 12 meses (%) | 24 meses (%) | Início (%) |
| CAIXA BRASIL FI RF REF DI...    | 03.737.206/0001-97 | 1,11%         | 9,12%   | 4,60%        | -            | 14,13%     |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...   | 10.740.670/0001-06 | 0,13%         | 5,95%   | 1,62%        | -            | 0,22%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...   | 11.060.913/0001-10 | 0,43%         | 7,04%   | 4,31%        | -            | 11,66%     |
| CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF     | 10.740.658/0001-93 | 1,50%         | 6,09%   | -1,53%       | -            | 4,46%      |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP... | 14.386.926/0001-71 | 0,51%         | 6,48%   | 4,76%        | -            | 8,20%      |
| BNB RPPS IMA-B FI RF            | 08.266.261/0001-60 | 1,31%         | 6,03%   | -0,98%       | -            | 4,98%      |
| CAIXA FIC FI NOVO BRASIL RF...  | 10.646.895/0001-90 | 1,52%         | 6,08%   | -1,50%       | -            | 4,49%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...  | 10.577.503/0001-88 | 2,37%         | 4,93%   | -7,00%       | -            | -2,41%     |