

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2022

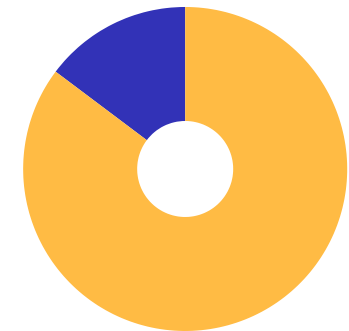


Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	1.181.518,71	0,72%	33.893	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.976.095,56	4,25%	2.100	0,71%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÃO...	D+24	Não há	400.159,58	0,24%	17	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.239.913,33	4,42%	9.808	0,29%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	8.378.324,12	5,11%	9.294	0,90%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			163.976.516,17				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Junho / 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%	16,23%	59,24%	97.139.688,18
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	66.062.303,08	40,29%	12,55%	16,23%	59,24%	31.077.385,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	73.738.201,79	44,97%	15,77%	21,03%	50,00%	8.250.056,30
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,00%	20,00%	32.795.303,23
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,78%	5,00%	8.198.825,81
Total Renda Fixa	100,00%	139.800.504,87	85,26%	28,32%	76,27%	193,48%	

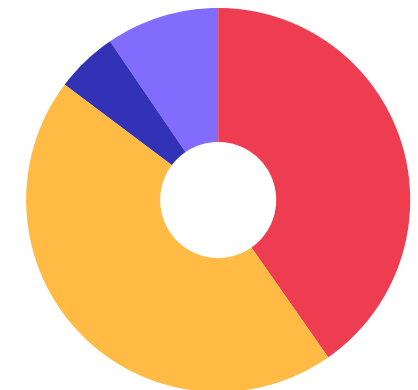


■ RENDA FIXA 139.800.504,87
■ RENDA VARIÁVEL 24.176.011,30

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	8.557.773,85	5,22%	11,21%	12,70%	20,00%	24.237.529,38
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,24%	20,00%	32.795.303,23
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	15.618.237,45	9,52%	2,09%	2,78%	10,00%	779.414,17
Total Renda Variável	30,00%	24.176.011,30	14,74%	13,30%	17,72%	50,00%	

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%	3,75%	5,00%	10,00%	16.397.651,62
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	3,75%	5,00%	10,00%	



■ 7º I b
 ■ 7º III a
 ■ 8º I
 ■ 10º I

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	81.425.368,70	49,66	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	71.202.530,30	43,42	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	8.737.746,07	5,33	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.659.705,93	1,01	0,00
ITAÚ DTVM	951.165,17	0,58	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 %		

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	0,28%	1,84%	0,71%	1,84%	0,48%	0,24%	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,15%	1,39%	0,54%	1,39%	-0,01%	-0,59%	2,51%	0,05%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,47%	6,85%	2,86%	6,85%	10,11%	17,88%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,27%	6,46%	2,54%	6,46%	9,85%	16,85%	1,38%	0,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,22%	6,41%	2,50%	6,41%	9,66%	16,68%	1,39%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,10%	2,03%	0,12%	2,03%	-2,16%	6,18%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,10%	1,85%	0,04%	1,85%	-2,48%	5,42%	3,18%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	4,86%	2,58%	4,86%	6,94%	8,89%	0,17%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,22%	-	2,37%	-	-	-	1,44%	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,22%	3,51%	2,37%	3,51%	3,61%	3,61%	1,44%	0,06%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	0,32%	6,50%	2,62%	6,50%	9,29%	15,36%	1,25%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,41%	4,26%	1,37%	4,26%	3,58%	10,95%	2,09%	0,06%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,38%	4,25%	1,39%	4,25%	3,52%	10,96%	2,05%	0,06%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,36%	4,21%	1,40%	4,21%	3,50%	10,92%	2,06%	0,06%

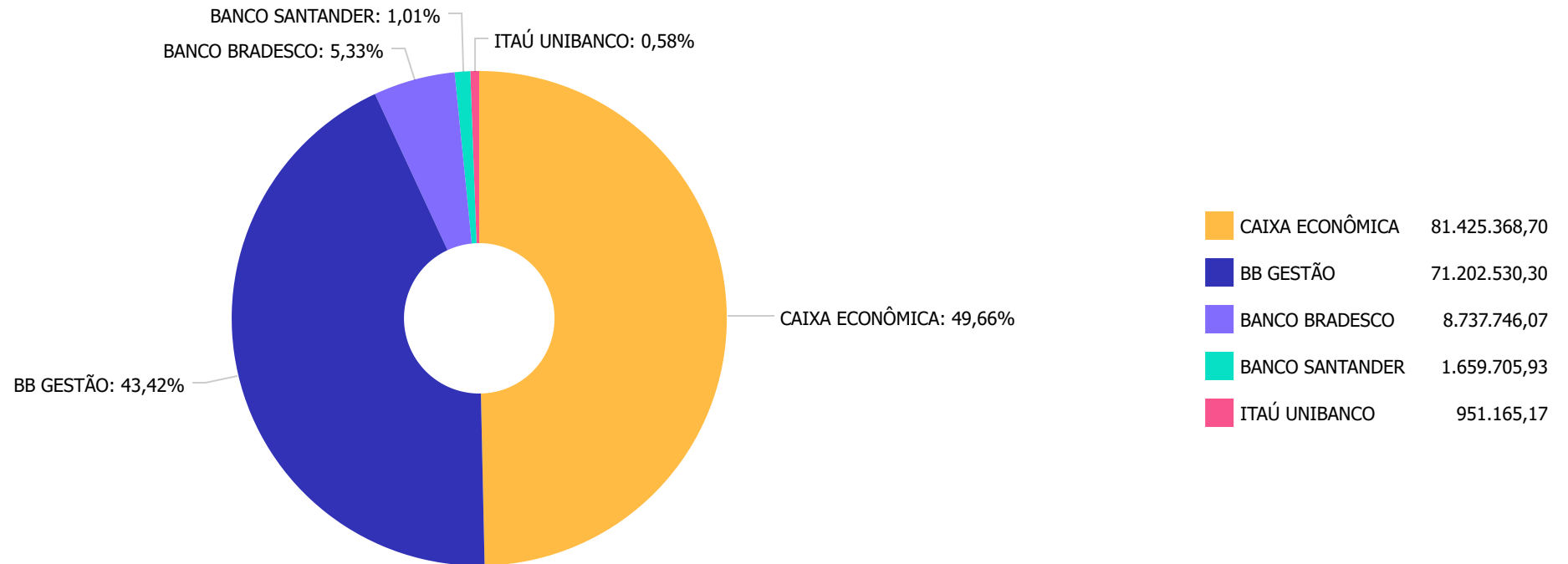
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	3,71%	1,67%	3,71%	4,01%	6,69%	1,11%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,93%	4,87%	2,63%	4,87%	7,48%	8,72%	0,01%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,03%	5,54%	2,90%	5,54%	8,98%	11,54%	0,01%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	5,52%	2,87%	5,52%	8,84%	10,78%	0,01%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,32%	4,08%	1,69%	4,08%	4,75%	6,86%	1,08%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	4,30%	2,02%	4,30%	5,27%	8,66%	0,81%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,23%	4,59%	2,22%	4,59%	3,73%	6,51%	1,57%	0,03%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,72%	4,32%	2,32%	4,32%	6,83%	8,46%	0,52%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,79%	5,28%	2,57%	5,28%	8,95%	10,68%	0,42%	0,02%

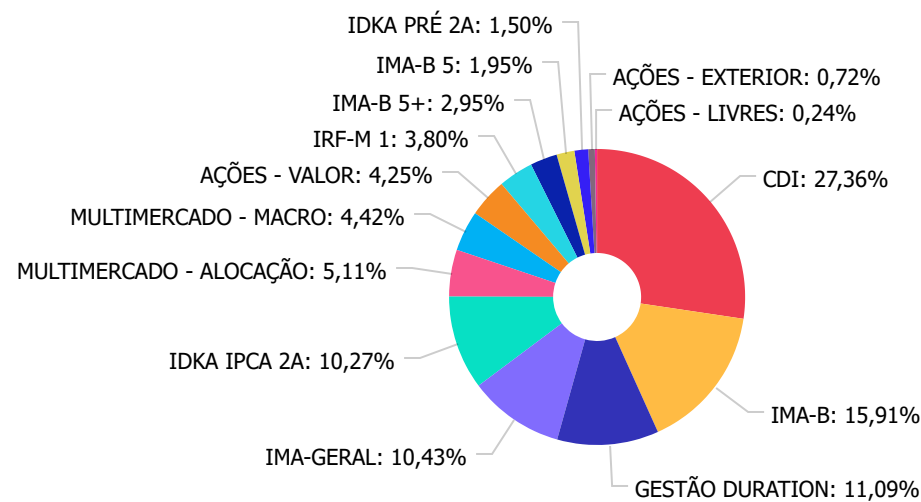
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	-8,39%	-20,58%	-16,45%	-20,58%	-11,92%	22,10%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-7,44%	-17,82%	-14,85%	-17,82%	-7,14%	28,23%	14,21%	0,18%
Ibovespa (Benchmark)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-11,61%	-8,53%	-15,87%	-8,53%	-16,66%	12,69%	9,62%	0,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-10,28%	-10,39%	-19,12%	-10,39%	-33,09%	-13,44%	8,35%	0,20%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-2,31%	3,37%	-2,88%	3,37%	0,22%	8,47%	2,56%	0,06%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,80%	4,02%	-0,05%	4,02%	2,32%	10,36%	1,52%	0,04%

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



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

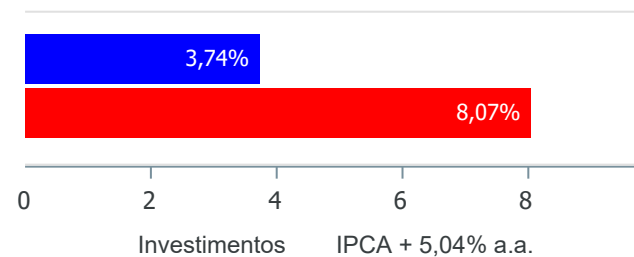


CDI	44.858.611,36	IMA-B	26.081.181,09	GESTÃO DURATION	18.181.110,29	IMA-GERAL	17.100.383,52
IDKA IPCA 2A	16.839.883,52	MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	8.378.324,12	MULTIMERCADO - MACRO	7.239.913,33	AÇÕES - VALOR	6.976.095,56
IRF-M 1	6.238.326,22	IMA-B 5+	4.835.531,66	IMA-B 5	3.203.394,34	IDKA PRÉ 2A	2.462.082,87
AÇÕES - EXTERIOR	1.181.518,71	AÇÕES - LIVRES	400.159,58				

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	159.089.616,73	3.509.439,58	3.457.199,95	159.812.204,10	670.347,74	670.347,74	0,42%	0,42%	0,95%	0,95%	44,21%	1,45%
Fevereiro	159.812.204,10	13.221.711,17	13.275.527,99	160.807.546,01	1.049.158,73	1.719.506,47	0,66%	1,08%	1,39%	2,35%	45,95%	1,25%
Março	160.807.546,01	1.377.220,61	1.456.111,09	163.896.942,51	3.168.286,98	4.887.793,45	1,97%	3,07%	2,06%	4,46%	68,93%	1,81%
Abril	163.896.942,51	1.294.149,95	1.292.202,44	163.918.937,18	20.047,16	4.907.840,61	0,01%	3,08%	1,44%	5,96%	51,79%	1,53%
Mai	163.918.937,18	1.565.487,75	1.630.700,24	165.687.074,20	1.833.349,51	6.741.190,12	1,12%	4,24%	0,90%	6,91%	61,31%	1,60%
Junho	165.687.074,20	6.072.261,84	6.999.500,48	163.976.516,17	-783.319,39	5.957.870,73	-0,47%	3,74%	1,08%	8,07%	46,40%	1,63%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





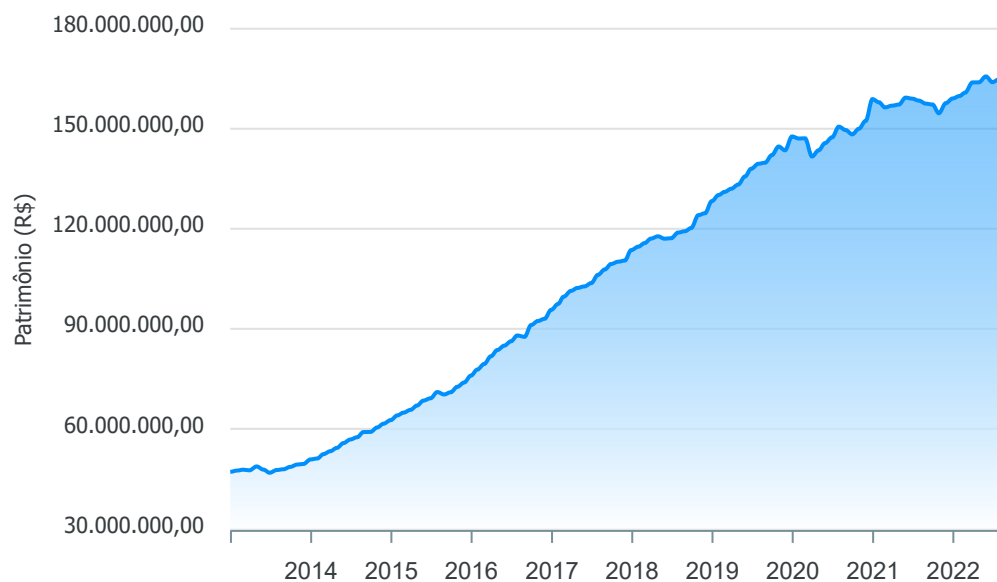
CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

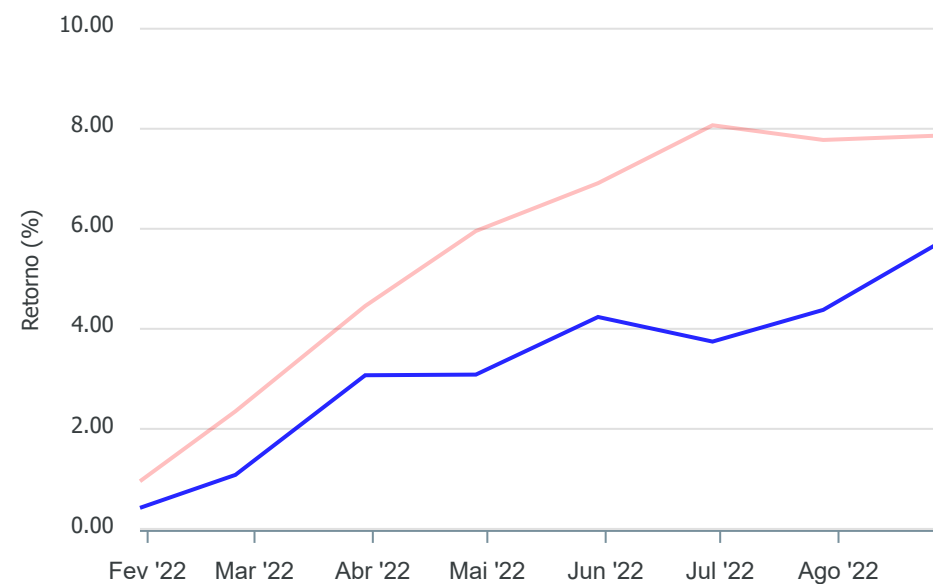
ANO

36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos

Meta de Rentabilidade

☐ CDI

☐ IMA-B

☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 5+

☐ IMA Geral

☐ IRF-M

☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+

☐ Ibovespa

☐ IBX

☐ SMLL

☐ IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	19.026.435,66	0,00	0,00	19.221.160,03	194.724,37	1,02%	1,02%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.182.070,82	0,00	0,00	6.238.326,22	56.255,40	0,91%	0,91%	0,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	21.582.174,07	4.523.647,60	1.997.706,21	24.344.893,85	236.778,39	0,91%	1,03%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	546.712,33	0,00	0,00	551.005,59	4.293,26	0,79%	0,79%	0,42%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	537.683,31	0,00	0,00	541.538,88	3.855,57	0,72%	0,72%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.639.190,61	0,00	4.665.441,88	0,00	26.251,27	0,57%	0,92%	0,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.206.974,18	0,00	0,00	1.212.557,96	5.583,78	0,46%	0,46%	0,81%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.044.226,35	0,00	0,00	17.100.383,52	56.157,17	0,33%	0,33%	1,11%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.255.457,03	0,00	0,00	6.275.663,20	20.206,17	0,32%	0,32%	1,08%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	1.114.661,10	0,00	0,00	1.118.167,05	3.505,95	0,31%	0,31%	1,25%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.978.208,01	0,00	0,00	9.002.099,56	23.891,55	0,27%	0,27%	1,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.578.275,11	0,00	0,00	9.600.344,66	22.069,55	0,23%	0,23%	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.820.240,21	0,00	0,00	7.837.783,96	17.543,75	0,22%	0,22%	1,39%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.051.923,54	0,00	0,00	1.054.252,67	2.329,13	0,22%	0,22%	1,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.028.729,97	0,00	0,00	1.030.974,62	2.244,65	0,22%	0,22%	1,44%
BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.458.386,32	0,00	0,00	2.462.082,87	3.696,55	0,15%	0,15%	2,51%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	78.444,56	1.548.614,24	336.352,39	1.292.557,48	1.851,07	0,11%	0,93%	0,01%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	15.008.323,32	0,00	0,00	14.954.740,37	-53.582,95	-0,36%	-0,36%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.926.734,09	0,00	0,00	6.900.523,34	-26.210,75	-0,38%	-0,38%	2,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.243.155,02	0,00	0,00	4.225.917,38	-17.237,64	-0,41%	-0,41%	2,09%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	4.889.523,09	0,00	0,00	4.835.531,66	-53.991,43	-1,10%	-1,10%	3,18%
Total Renda Fixa	140.197.528,70	6.072.261,84	6.999.500,48	139.800.504,87	530.214,81	0,38%		1,05%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.298.157,12	0,00	0,00	7.239.913,33	-58.243,79	-0,80%	-0,80%	1,52%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	8.576.609,29	0,00	0,00	8.378.324,12	-198.285,17	-2,31%	-2,31%	2,56%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.276.538,84	0,00	0,00	1.181.518,71	-95.020,13	-7,44%	-7,44%	14,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	445.982,15	0,00	0,00	400.159,58	-45.822,57	-10,27%	-10,27%	8,35%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	7.892.258,10	0,00	0,00	6.976.095,56	-916.162,54	-11,61%	-11,61%	9,62%
Total Renda Variável	25.489.545,50	0,00	0,00	24.176.011,30	-1.313.534,20	-5,15%		4,95%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	22.339.054,98	4.523.647,60	3.156.471,30	24.344.893,85	638.662,57	2,38%	2,90%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.684.762,76	0,00	0,00	19.221.160,03	536.397,27	2,87%	2,87%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.818.850,16	0,00	0,00	17.100.383,52	281.533,36	1,67%	1,67%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.778.893,54	0,00	0,00	9.002.099,56	223.206,02	2,54%	2,54%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.391.779,13	0,00	0,00	9.600.344,66	208.565,53	2,22%	2,22%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	14.748.774,87	0,00	0,00	14.954.740,37	205.965,50	1,40%	1,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.646.989,89	0,00	0,00	7.837.783,96	190.794,07	2,50%	2,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.081.225,70	0,00	0,00	6.238.326,22	157.100,52	2,58%	2,58%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.761.684,19	0,00	4.865.441,88	0,00	103.757,69	2,18%	2,56%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.805.921,54	0,00	0,00	6.900.523,34	94.601,80	1,39%	1,39%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.816.035,68	1.373.663,63	0,00	6.275.663,20	85.963,89	1,39%	1,69%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.169.028,14	0,00	0,00	4.225.917,38	56.889,24	1,36%	1,36%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	1.089.642,64	0,00	0,00	1.118.167,05	28.524,41	2,62%	2,62%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.029.819,65	0,00	0,00	1.054.252,67	24.433,02	2,37%	2,37%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.188.546,92	0,00	0,00	1.212.557,96	24.011,04	2,02%	2,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.007.118,73	0,00	0,00	1.030.974,62	23.855,89	2,37%	2,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	537.192,28	0,00	0,00	551.005,59	13.813,31	2,57%	2,57%
BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.448.871,72	0,00	0,00	2.462.082,87	13.211,15	0,54%	0,54%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	145.493,91	3.034.588,31	1.900.489,98	1.292.557,48	12.965,24	0,41%	2,63%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	529.243,05	0,00	0,00	541.538,88	12.295,83	2,32%	2,32%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	4.833.759,66	0,00	0,00	4.835.531,66	1.772,00	0,04%	0,04%
Total Renda Fixa	137.852.689,14	8.931.899,54	9.922.403,16	139.800.504,87	2.938.319,35	2,00%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.243.784,51	0,00	0,00	7.239.913,33	-3.871,18	-0,05%	-0,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	494.729,11	0,00	0,00	400.159,58	-94.569,53	-19,12%	-19,12%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.387.638,32	0,00	0,00	1.181.518,71	-206.119,61	-14,85%	-14,85%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	8.626.324,11	0,00	0,00	8.378.324,12	-247.999,99	-2,87%	-2,87%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8.291.777,32	0,00	0,00	6.976.095,56	-1.315.681,76	-15,87%	-15,87%
Total Renda Variável	26.044.253,37	0,00	0,00	24.176.011,30	-1.868.242,07	-7,17%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	22.809.325,48	4.523.647,60	4.196.471,30	24.344.893,85	1.208.392,07	4,42%	5,54%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.581.104,44	10.787.060,25	0,00	19.221.160,03	852.995,34	4,64%	5,52%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.488.195,79	0,00	0,00	17.100.383,52	612.187,73	3,71%	3,71%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	14.351.013,64	0,00	0,00	14.954.740,37	603.726,73	4,21%	4,21%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.456.111,03	0,00	0,00	9.002.099,56	545.988,53	6,46%	6,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.365.456,29	0,00	0,00	7.837.783,96	472.327,67	6,41%	6,41%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.179.269,32	0,00	0,00	9.600.344,66	421.075,34	4,59%	4,59%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.949.411,85	0,00	0,00	6.238.326,22	288.914,37	4,86%	4,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.619.138,13	0,00	0,00	6.900.523,34	281.385,21	4,25%	4,25%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	5.652.143,50	0,00	5.865.441,88	0,00	213.298,38	3,77%	4,85%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.053.280,76	0,00	0,00	4.225.917,38	172.636,62	4,26%	4,26%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.403.003,86	2.706.744,51	0,00	6.275.663,20	165.914,83	2,72%	4,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	4.747.562,16	0,00	0,00	4.835.531,66	87.969,50	1,85%	1,85%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	1.049.942,60	0,00	0,00	1.118.167,05	68.224,45	6,50%	6,50%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	11.724.996,86	0,00	11.787.060,25	0,00	62.063,39	0,53%	4,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	1.000.000,00	28.302,32	1.030.974,62	59.276,94	5,93%	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.054.252,67	54.252,67	5,43%	3,51%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.162.577,82	0,00	0,00	1.212.557,96	49.980,14	4,30%	4,30%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	718.242,49	6.772.818,54	6.233.966,44	1.292.557,48	35.462,89	0,47%	4,87%
BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.428.227,76	0,00	0,00	2.462.082,87	33.855,11	1,39%	1,39%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	523.395,91	0,00	0,00	551.005,59	27.609,68	5,28%	5,28%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	519.108,70	0,00	0,00	541.538,88	22.430,18	4,32%	4,32%
Total Renda Fixa	134.781.508,39	26.790.270,90	28.111.242,19	139.800.504,87	6.339.967,77	3,92%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.960.450,41	0,00	0,00	7.239.913,33	279.462,92	4,02%	4,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	8.105.355,23	0,00	0,00	8.378.324,12	272.968,89	3,37%	3,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	446.559,36	0,00	0,00	400.159,58	-46.399,78	-10,39%	-10,39%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.169.194,99	250.000,00	0,00	1.181.518,71	-237.676,28	-16,75%	-17,82%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	7.626.548,35	0,00	0,00	6.976.095,56	-650.452,79	-8,53%	-8,53%
Total Renda Variável	24.308.108,34	250.000,00	0,00	24.176.011,30	-382.097,04	-1,56%	

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 nº 519, de 24 de agosto de 2011 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.