

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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	101.950,26	0,09%	1.077	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	894.463,91	0,78%	597	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	115.472,16	0,10%	1.068	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	2.010.977,22	1,76%	241	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	900.515,58	0,79%	95	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	1.472.264,60	1,29%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	2.010.428,60	1,76%	161	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	463 dias	4.982.142,83	4,37%	218	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	2.911.743,79	2,55%	179	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.732.546,00	1,52%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	1.530.684,18	1,34%	67	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	11.899.738,26	10,43%	868	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	10.426.814,18	9,14%	1.073	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.214.845,08	3,69%	1.024	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.580.671,14	2,26%	798	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	501.804,11	0,44%	1.175	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	40.970,24	0,04%	249	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.058.005,57	0,93%	547	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	471.427,39	0,41%	974	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.723.065,89	4,14%	176	0,55%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

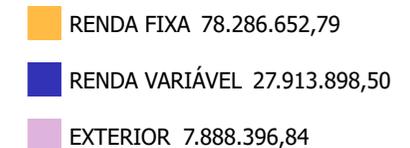
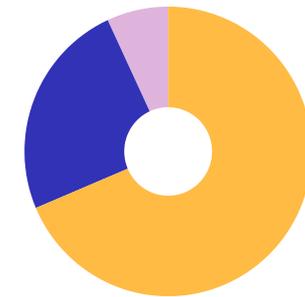
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.051.874,12	0,92%	134	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.434.568,59	1,26%	948	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	10.611.214,78	9,30%	204	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.096.257,37	0,96%	262	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.914.933,34	4,31%	248	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	940.312,50	0,82%	71	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	D+1	Não há	2.210.682,41	1,94%	270	0,63%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	1.446.278,69	1,27%	69	0,23%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.630.276,50	3,18%	2.100	0,37%	Artigo 8º, Inciso I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	51.260,76	0,04%	25.804	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.661.028,19	2,33%	996	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.215.801,93	1,07%	844	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.678.688,96	2,35%	1.588	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.573.037,01	2,26%	100	0,55%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	304.803,95	0,27%	8.170	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.826.910,57	1,60%	128	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.529.902,14	1,34%	3.850	0,66%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	525.485,39	0,46%	26.685	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.066.074,61	0,93%	7	2,80%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.036.084,25	0,91%	99	0,00%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	297.592,04	0,26%	3.300	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	2.566.378,39	2,25%	69	0,20%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	1.242.047,57	1,09%	63	0,18%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	4.079.970,88	3,58%	522	0,18%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.310.896,31	2,90%	9.808	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.686.147,24	1,48%	12.074	0,08%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.685.575,80	1,48%	1.008	0,12%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	1.685.854,71	1,48%	5.324	0,76%	Artigo 10º, Inciso I
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	148.478,14	0,13%		0,01%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			114.088.948,13				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	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%	5,00%	35,00%	39.931.131,85
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	48.328.032,14	42,36%	15,00%	37,00%	70,00%	31.534.231,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	28.512.341,96	24,99%	10,00%	15,80%	65,00%	45.645.474,32
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.704.447,41
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	1.446.278,69	1,27%	0,00%	4,00%	5,00%	4.258.168,72
Total Renda Fixa	100,00%	78.286.652,79	68,62%	25,00%	62,80%	180,00%	



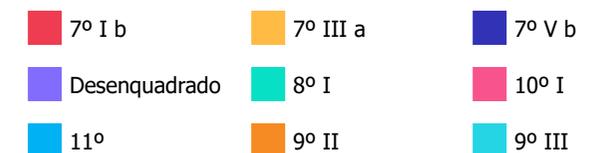
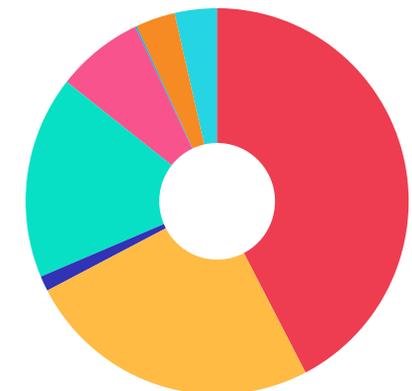
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	19.396.946,30	17,00%	10,00%	22,00%	30,00%	14.829.738,14
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	11.408.894,81
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	8.368.474,06	7,34%	2,00%	5,00%	10,00%	3.040.420,75
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,10%	0,50%	570.444,74
Artigo 11º	5,00%	148.478,14	0,13%	0,00%	0,10%	1,00%	992.411,34
Total Renda Variável	35,00%	27.913.898,50	24,47%	12,00%	27,20%	51,50%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	3.808.425,96	3,34%	1,00%	5,00%	10,00%	7.600.468,85
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.079.970,88	3,58%	1,00%	5,00%	10,00%	7.328.923,93
Total Exterior	10,00%	7.888.396,84	6,91%	2,00%	10,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	73.006.231,73	63,99	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.971.747,20	15,75	0,00
ITAÚ UNIBANCO	9.228.153,39	8,09	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	8.599.896,01	7,54	0,00
SICREDI	3.896.537,12	3,42	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.237.904,54	1,09	0,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	148.478,14	0,13	0,01

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 %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	48.328.032,14	42,36	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	28.512.341,96	24,99	10,00	65,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	1.446.278,69	1,27	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	19.396.946,30	17,00	10,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	3.808.425,96	3,34	1,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	4.079.970,88	3,58	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	8.368.474,06	7,34	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	0,50
Artigo 11º	148.478,14	0,13	0,00	1,00

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 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%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,16%	8,56%	3,69%	8,56%	18,60%	36,18%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	5,66%	4,39%	5,66%	12,08%	21,65%	0,18%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,94%	5,11%	2,59%	5,11%	7,63%	9,32%	0,19%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	4,85%	2,56%	4,85%	6,92%	8,69%	0,17%	0,01%
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%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,33%	6,51%	2,65%	6,51%	9,84%	16,18%	1,23%	0,04%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	7,21%	3,04%	7,21%	11,84%	19,81%	1,43%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,22%	-	2,37%	-	-	-	1,44%	-
IMA-B (Benchmark)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%	-	-
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%

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 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%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,04%	2,49%	1,92%	2,49%	0,08%	0,76%	2,85%	0,08%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	4,22%	1,41%	4,22%	3,48%	10,88%	2,02%	0,06%
IRF-M (Benchmark)	0,37%	2,19%	0,83%	2,19%	1,76%	1,90%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,34%	2,15%	0,76%	2,15%	1,63%	1,54%	1,76%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,06%	5,60%	2,97%	5,60%	9,19%	11,59%	0,04%	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 MATRIZ FI RENDA FIXA	1,04%	5,69%	2,94%	5,69%	9,23%	11,71%	0,03%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%	-	-
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,72%	4,32%	2,32%	4,32%	6,83%	8,46%	0,52%	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%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,09%	4,95%	2,32%	4,95%	4,93%	7,33%	1,55%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,79%	5,28%	2,57%	5,28%	8,95%	10,68%	0,42%	0,02%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,32%	4,08%	1,69%	4,08%	4,75%	6,86%	1,08%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	7,13%	3,08%	7,13%	10,31%	16,86%	1,37%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	7,18%	3,03%	7,18%	11,79%	19,50%	1,43%	0,03%

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
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,34%	6,36%	2,51%	6,36%	9,98%	16,39%	1,40%	0,04%
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%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,33%	-	-0,26%	-	-	-	1,37%	-

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%	-	-
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-7,82%	-17,54%	-14,99%	-17,54%	-5,64%	-	13,70%	0,19%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-7,79%	-17,59%	-14,94%	-17,59%	-5,80%	31,34%	13,65%	0,19%
Global BDRX (Benchmark)	0,79%	-27,61%	-10,27%	-27,61%	-12,10%	12,50%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,83%	-27,83%	-10,22%	-27,83%	-13,08%	9,72%	12,50%	0,20%
IDIV (Benchmark)	-8,38%	4,58%	-9,43%	4,58%	-4,10%	18,72%	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-9,19%	-0,29%	-13,28%	-0,29%	-12,84%	10,61%	7,94%	0,19%
Ibovespa (Benchmark)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-	-
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-8,42%	3,84%	-9,57%	3,84%	-5,08%	15,12%	7,28%	0,18%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-10,49%	-8,08%	-16,17%	-8,08%	-27,94%	-7,88%	7,94%	0,19%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-10,81%	-2,24%	-16,40%	-2,24%	-21,51%	0,93%	8,22%	0,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-10,46%	-10,71%	-19,62%	-10,71%	-32,68%	-18,43%	8,99%	0,21%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-11,11%	-8,68%	-13,57%	-8,68%	-25,55%	2,22%	8,32%	0,17%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	-11,86%	-6,51%	-18,31%	-6,51%	-24,15%	3,06%	9,16%	0,22%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-12,77%	-7,24%	-16,81%	-7,24%	-17,83%	14,76%	9,44%	0,20%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-11,61%	-8,53%	-15,87%	-8,53%	-16,66%	12,69%	9,62%	0,18%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-10,34%	-1,37%	-12,54%	-1,37%	-11,64%	8,62%	8,25%	0,20%

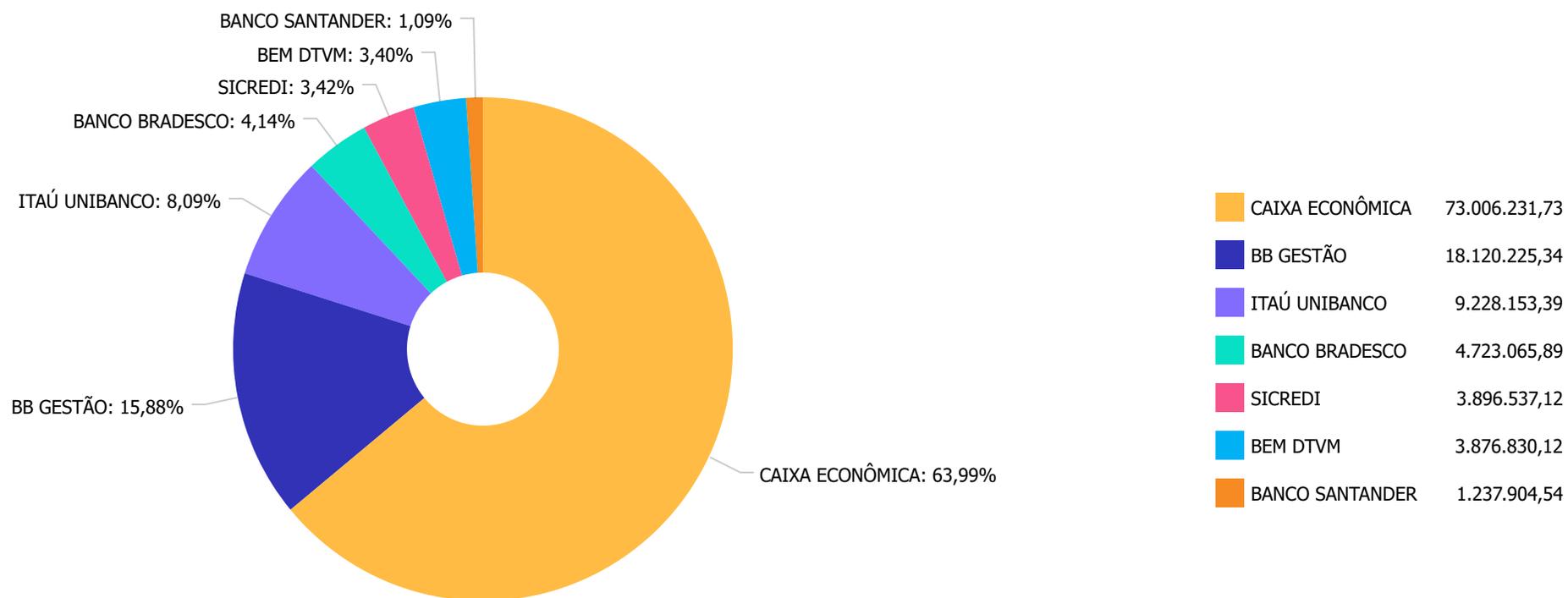
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-11,26%	-5,82%	-17,60%	-5,82%	-22,15%	3,40%	8,71%	0,21%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-14,29%	-25,31%	-28,75%	-25,31%	-46,89%	-38,86%	10,10%	0,21%
SMLL (Benchmark)	-16,33%	-19,69%	-24,72%	-19,69%	-39,59%	-15,65%	-	-
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-15,24%	-12,85%	-22,04%	-12,85%	-30,80%	-8,69%	10,25%	0,24%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,80%	4,02%	-0,05%	4,02%	2,32%	10,36%	1,52%	0,04%
MSCI ACWI (Benchmark)	1,26%	-25,79%	-7,28%	-25,79%	-13,20%	8,75%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-7,78%	-17,57%	-14,98%	-17,57%	-5,74%	30,65%	13,68%	0,19%
IFIX (Benchmark)	-0,88%	-0,33%	0,56%	-0,33%	1,48%	-0,38%	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-0,08%	-	-

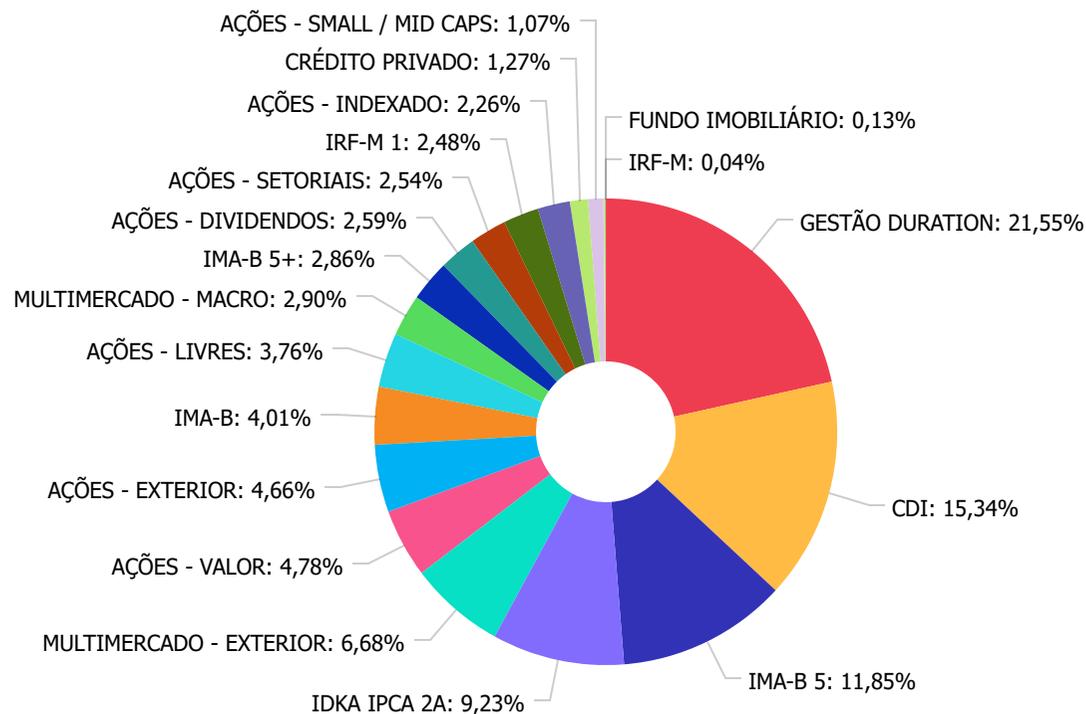
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,79%	-27,61%	-10,27%	-27,61%	-12,10%	12,50%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,83%	-27,83%	-10,22%	-27,83%	-13,08%	9,72%	12,50%	0,20%
MSCI WORLD (Benchmark)	1,05%	-26,05%	-7,80%	-26,05%	-11,63%	10,62%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-1,08%	-25,52%	-9,84%	-25,52%	-9,70%	19,74%	11,67%	0,17%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-2,23%	-28,67%	-7,85%	-28,67%	-11,83%	20,06%	11,58%	0,22%

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



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

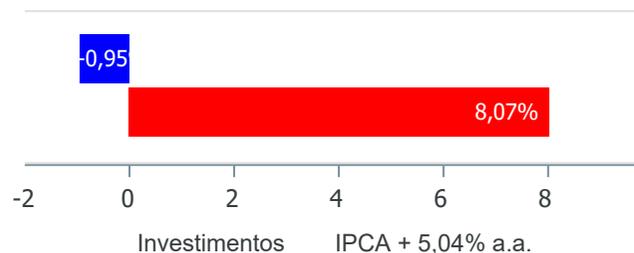


GESTÃO DURATION	24.587.929,68
CDI	17.499.353,59
IMA-B 5	13.520.774,87
IDKA IPCA 2A	10.528.764,44
MULTIMERCADO - EXTERIOR	7.623.956,14
AÇÕES - VALOR	5.457.187,07
AÇÕES - EXTERIOR	5.322.018,45
IMA-B	4.571.392,42
AÇÕES - LIVRES	4.291.519,36
MULTIMERCADO - MACRO	3.310.896,31
IMA-B 5+	3.263.230,18
AÇÕES - DIVIDENDOS	2.958.620,23
AÇÕES - SETORIAIS	2.900.780,70
IRF-M 1	2.827.958,68
AÇÕES - INDEXADO	2.573.037,01
CRÉDITO PRIVADO	1.446.278,69
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.215.801,93
FUNDO IMOBILIÁRIO	148.478,14
IRF-M	40.970,24

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	113.912.327,34	2.048.684,98	4.387.905,31	111.520.545,44	-52.561,57	-52.561,57	-0,05%	-0,05%	0,95%	0,95%	-4,84%	3,75%
Fevereiro	111.520.545,44	6.132.996,49	3.382.032,52	114.230.567,26	-40.942,15	-93.503,72	-0,04%	-0,08%	1,39%	2,35%	-3,49%	3,26%
Março	114.230.567,26	10.180.550,50	9.838.659,84	117.223.191,13	2.650.733,21	2.557.229,49	2,31%	2,23%	2,06%	4,46%	50,03%	4,14%
Abril	117.223.191,13	6.823.539,14	7.037.475,50	114.963.800,12	-2.045.454,65	511.774,84	-1,74%	0,45%	1,44%	5,96%	7,49%	3,46%
Mai	114.963.800,12	12.914.800,59	12.539.931,14	116.305.344,11	966.674,54	1.478.449,38	0,84%	1,29%	0,90%	6,91%	18,63%	4,09%
Junho	116.305.344,11	3.758.878,80	3.398.388,43	114.088.948,13	-2.576.886,35	-1.098.436,97	-2,21%	-0,95%	1,08%	8,07%	-11,76%	3,72%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



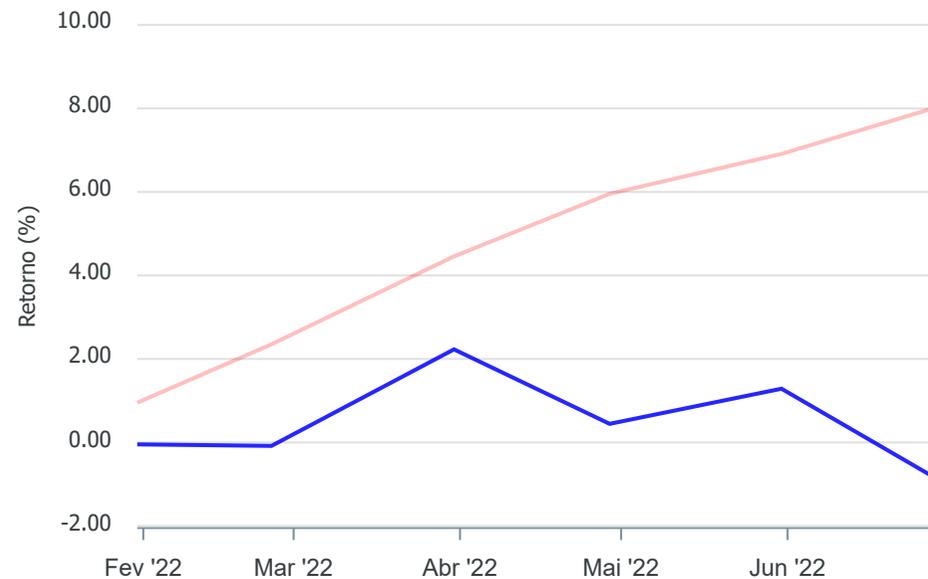
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.419.513,06	0,00	0,00	1.434.568,59	15.055,53	1,06%	1,06%	0,04%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.714.912,00	0,00	0,00	1.732.546,00	17.634,00	1,03%	1,03%	0,18%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	465.319,01	1.328,00	0,00	471.427,39	4.780,38	1,02%	1,03%	0,01%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	2.178.705,13	11.503,99	0,00	2.210.682,41	20.473,29	0,93%	0,94%	0,19%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	114.421,65	0,00	0,00	115.472,16	1.050,51	0,92%	0,92%	0,17%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	9.275.089,76	2.096.201,15	855.078,91	10.611.214,78	95.002,78	0,84%	1,04%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	545.029,16	30.000,00	77.975,17	501.804,11	4.750,12	0,83%	0,91%	0,17%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.876.637,77	0,00	0,00	4.914.933,34	38.295,57	0,79%	0,79%	0,42%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	933.617,80	0,00	0,00	940.312,50	6.694,70	0,72%	0,72%	0,52%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.053.133,51	0,00	0,00	1.058.005,57	4.872,06	0,46%	0,46%	0,81%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	40.829,71	0,00	0,00	40.970,24	140,53	0,34%	0,34%	1,76%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	1.441.346,61	0,00	0,00	1.446.278,69	4.932,08	0,34%	0,34%	1,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.200.831,98	0,00	0,00	4.214.845,08	14.013,10	0,33%	0,33%	1,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.004.412,39	0,00	0,00	2.010.977,22	6.564,83	0,33%	0,33%	1,37%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.966.003,62	0,00	0,00	4.982.142,83	16.139,21	0,32%	0,32%	1,37%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.707.858,73	0,00	0,00	4.723.065,89	15.207,16	0,32%	0,32%	1,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	897.677,68	0,00	0,00	900.515,58	2.837,90	0,32%	0,32%	1,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.467.677,51	0,00	0,00	1.472.264,60	4.587,09	0,31%	0,31%	1,43%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	101.679,68	0,00	0,00	101.950,26	270,58	0,27%	0,27%	1,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	11.872.382,78	0,00	0,00	11.899.738,26	27.355,48	0,23%	0,23%	1,57%

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 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.905.310,94	0,00	0,00	2.911.743,79	6.432,85	0,22%	0,22%	1,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	2.006.051,47	0,00	0,00	2.010.428,60	4.377,13	0,22%	0,22%	1,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	11.238.774,00	1.619.845,66	2.453.080,36	10.426.814,18	21.274,88	0,17%	0,22%	1,39%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1.050.974,37	0,00	0,00	1.051.874,12	899,75	0,09%	0,09%	1,55%
SICREDI BAIXO RISCO FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO...	11.498,42	0,00	11.503,99	0,00	5,57	0,05%	1,04%	0,02%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.531.339,23	0,00	0,00	1.530.684,18	-655,05	-0,04%	-0,04%	2,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	897.630,16	0,00	0,00	894.463,91	-3.166,25	-0,35%	-0,35%	2,02%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.100.185,26	0,00	0,00	1.096.257,37	-3.927,89	-0,36%	-0,36%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.590.473,48	0,00	0,00	2.580.671,14	-9.802,34	-0,38%	-0,38%	2,05%
Total Renda Fixa	77.609.316,87	3.758.878,80	3.397.638,43	78.286.652,79	316.095,55	0,41%		1,09%

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
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	146.975,65	0,00	750,00	148.478,14	2.252,49	1,53%	0,00%	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.337.531,88	0,00	0,00	3.310.896,31	-26.635,57	-0,80%	-0,80%	1,52%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.828.400,04	0,00	0,00	1.686.147,24	-142.252,80	-7,78%	-7,78%	13,68%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	1.827.933,20	0,00	0,00	1.685.575,80	-142.357,40	-7,79%	-7,79%	13,65%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.828.789,37	0,00	0,00	1.685.854,71	-142.934,66	-7,82%	-7,82%	13,70%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	324.934,91	0,00	0,00	297.592,04	-27.342,87	-8,41%	-8,41%	7,28%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.930.161,61	0,00	0,00	2.661.028,19	-269.133,42	-9,18%	-9,18%	7,94%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.706.273,69	0,00	0,00	1.529.902,14	-176.371,55	-10,34%	-10,34%	8,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.157.163,30	0,00	0,00	1.036.084,25	-121.079,05	-10,46%	-10,46%	8,99%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.992.501,60	0,00	0,00	2.678.688,96	-313.812,64	-10,49%	-10,49%	7,94%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.048.275,69	0,00	0,00	1.826.910,57	-221.365,12	-10,81%	-10,81%	8,22%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	591.140,90	0,00	0,00	525.485,39	-65.655,51	-11,11%	-11,11%	8,32%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	2.899.480,24	0,00	0,00	2.573.037,01	-326.443,23	-11,26%	-11,26%	8,71%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.107.036,50	0,00	0,00	3.630.276,50	-476.760,00	-11,61%	-11,61%	9,62%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.209.479,57	0,00	0,00	1.066.074,61	-143.404,96	-11,86%	-11,86%	9,16%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	58.761,41	0,00	0,00	51.260,76	-7.500,65	-12,76%	-12,76%	9,44%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	355.618,27	0,00	0,00	304.803,95	-50.814,32	-14,29%	-14,29%	10,10%
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.434.456,83	0,00	0,00	1.215.801,93	-218.654,90	-15,24%	-15,24%	10,25%
Total Renda Variável	30.784.914,66	0,00	750,00	27.913.898,50	-2.870.266,16	-9,32%		8,76%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.046.487,26	0,00	0,00	4.079.970,88	33.483,62	0,83%	0,83%	12,50%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.594.307,66	0,00	0,00	2.566.378,39	-27.929,27	-1,08%	-1,08%	11,67%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	1.270.317,66	0,00	0,00	1.242.047,57	-28.270,09	-2,23%	-2,23%	11,58%
Total Exterior	7.911.112,58	0,00	0,00	7.888.396,84	-22.715,74	-0,29%		12,08%

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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.044.163,44	3.731.234,89	9.714.095,29	10.426.814,18	365.511,14	1,85%	2,50%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	12.620.133,20	0,00	1.000.000,00	11.899.738,26	279.605,06	2,22%	2,22%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	6.588.062,32	10.144.969,03	6.352.066,88	10.611.214,78	230.250,31	1,38%	2,94%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.995.348,66	0,00	166.938,78	4.982.142,83	153.732,95	3,08%	-0,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.791.719,53	0,00	0,00	4.914.933,34	123.213,81	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.105.896,07	0,00	0,00	4.214.845,08	108.949,01	2,65%	2,65%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.644.467,93	0,00	0,00	4.723.065,89	78.597,96	1,69%	1,69%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.659.758,00	0,00	0,00	1.732.546,00	72.788,00	4,39%	4,39%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.351.115,94	1.500.000,00	0,00	2.911.743,79	60.627,85	2,13%	2,37%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	2.132.124,93	23.102,62	0,00	2.210.682,41	55.454,86	2,57%	2,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.428.959,00	0,00	0,00	1.472.264,60	43.305,60	3,03%	3,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.341.186,46	52.420,34	0,00	1.434.568,59	40.961,79	2,94%	2,97%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	1.410.892,98	0,00	0,00	1.446.278,69	35.385,71	2,51%	2,51%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.545.291,78	0,00	0,00	2.580.671,14	35.379,36	1,39%	1,39%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.501.857,78	0,00	0,00	1.530.684,18	28.826,40	1,92%	1,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	873.929,55	0,00	0,00	900.515,58	26.586,03	3,04%	3,04%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	2.571.791,92	0,00	1.500.000,00	1.096.257,37	24.465,45	0,95%	1,40%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1.028.063,74	0,00	0,00	1.051.874,12	23.810,38	2,32%	2,32%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	918.962,37	0,00	0,00	940.312,50	21.350,13	2,32%	2,32%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.037.054,98	0,00	0,00	1.058.005,57	20.950,59	2,02%	2,02%

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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	685.288,29	30.000,00	228.940,13	501.804,11	15.455,95	2,16%	2,58%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	452.332,44	4.004.004,35	4.000.000,00	471.427,39	15.090,60	0,34%	2,90%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	882.011,25	0,00	0,00	894.463,91	12.452,66	1,41%	1,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.010.977,22	10.977,22	0,55%	3,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.010.428,60	10.428,60	0,52%	2,37%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	112.589,02	0,00	0,00	115.472,16	2.883,14	2,56%	2,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	99.422,41	0,00	0,00	101.950,26	2.527,85	2,54%	2,54%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	40.660,74	0,00	0,00	40.970,24	309,50	0,76%	0,76%
SICREDI BAIXO RISCO FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO...	0,00	11.487,30	11.503,99	0,00	16,69	0,15%	2,97%
Total Renda Fixa	75.863.084,73	23.497.218,53	22.973.545,07	78.286.652,79	1.899.894,60	2,49%	

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
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	145.307,50	0,00	2.250,00	148.478,14	5.420,64	3,73%	0,00%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.312.666,65	0,00	0,00	3.310.896,31	-1.770,34	-0,05%	-0,05%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	61.619,81	0,00	0,00	51.260,76	-10.359,05	-16,81%	-16,81%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	329.095,22	0,00	0,00	297.592,04	-31.503,18	-9,57%	-9,57%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	608.018,98	0,00	0,00	525.485,39	-82.533,59	-13,57%	-13,57%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	427.811,37	0,00	0,00	304.803,95	-123.007,42	-28,75%	-28,75%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.749.271,56	0,00	0,00	1.529.902,14	-219.369,42	-12,54%	-12,54%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.305.004,91	0,00	0,00	1.066.074,61	-238.930,30	-18,31%	-18,31%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.288.982,09	0,00	0,00	1.036.084,25	-252.897,84	-19,62%	-19,62%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1.981.701,09	0,00	0,00	1.685.575,80	-296.125,29	-14,94%	-14,94%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.983.202,29	0,00	0,00	1.686.147,24	-297.055,05	-14,98%	-14,98%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.983.066,73	0,00	0,00	1.685.854,71	-297.212,02	-14,99%	-14,99%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.559.493,15	0,00	0,00	1.215.801,93	-343.691,22	-22,04%	-22,04%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.185.256,64	0,00	0,00	1.826.910,57	-358.346,07	-16,40%	-16,40%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.068.404,07	0,00	0,00	2.661.028,19	-407.375,88	-13,28%	-13,28%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.195.222,07	0,00	0,00	2.678.688,96	-516.533,11	-16,17%	-16,17%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	3.122.426,64	0,00	0,00	2.573.037,01	-549.389,63	-17,59%	-17,59%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.314.941,51	0,00	0,00	3.630.276,50	-684.665,01	-15,87%	-15,87%
Total Renda Variável	32.621.492,28	0,00	2.250,00	27.913.898,50	-4.705.343,78	-14,42%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	1.347.806,96	0,00	0,00	1.242.047,57	-105.759,39	-7,85%	-7,85%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.846.537,74	0,00	0,00	2.566.378,39	-280.159,35	-9,84%	-9,84%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.544.269,42	0,00	0,00	4.079.970,88	-464.298,54	-10,22%	-10,22%
Total Exterior	8.738.614,12	0,00	0,00	7.888.396,84	-850.217,28	-9,73%	

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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	15.823.225,83	6.569.850,50	12.915.635,32	10.426.814,18	949.373,17	4,24%	6,41%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	12.334.574,72	0,00	1.000.000,00	11.899.738,26	565.163,54	4,58%	4,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.774.043,61	0,00	5.000.000,00	4.214.845,08	440.801,47	5,02%	6,51%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	4.217.201,83	17.608.628,12	11.560.850,87	10.611.214,78	346.235,70	1,59%	5,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.668.656,85	0,00	0,00	4.914.933,34	246.276,49	5,28%	5,28%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.537.988,53	0,00	0,00	4.723.065,89	185.077,36	4,08%	4,08%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	166.938,78	4.982.142,83	149.081,61	2,98%	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.639.747,00	0,00	47.326,07	1.732.546,00	140.125,07	8,55%	5,66%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	3.962.714,20	0,00	3.000.000,00	1.096.257,37	133.543,17	3,37%	4,21%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.336.219,28	1.500.000,00	33.690,21	2.911.743,79	109.214,72	3,85%	3,51%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	2.054.944,17	49.637,59	0,00	2.210.682,41	106.100,65	5,04%	5,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.475.438,15	0,00	0,00	2.580.671,14	105.232,99	4,25%	4,25%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.088.115,04	1.378.052,41	2.134.960,88	1.434.568,59	103.362,02	2,98%	5,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.412.638,30	0,00	39.497,24	1.472.264,60	99.123,54	7,02%	7,18%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	1.359.741,91	0,00	0,00	1.446.278,69	86.536,78	6,36%	6,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	864.056,97	0,00	24.364,67	900.515,58	60.823,28	7,04%	7,21%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1.002.287,52	0,00	0,00	1.051.874,12	49.586,60	4,95%	4,95%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.014.395,90	0,00	0,00	1.058.005,57	43.609,67	4,30%	4,30%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	901.365,38	0,00	0,00	940.312,50	38.947,12	4,32%	4,32%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	858.286,19	0,00	0,00	894.463,91	36.177,72	4,22%	4,22%

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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	685.282,33	110.194,71	324.602,86	501.804,11	30.929,93	3,89%	4,86%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	1.500.000,00	0,00	1.530.684,18	30.684,18	2,05%	2,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	628.408,95	4.131.599,87	4.318.211,85	471.427,39	29.630,42	0,62%	5,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.010.977,22	10.977,22	0,55%	7,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.010.428,60	10.428,60	0,52%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	95.766,85	0,00	0,00	101.950,26	6.183,41	6,46%	6,46%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	110.128,01	0,00	0,00	115.472,16	5.344,15	4,85%	4,85%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	40.108,55	0,00	0,00	40.970,24	861,69	2,15%	2,15%
SICREDI BAIXO RISCO FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO...	0,00	11.487,30	11.503,99	0,00	16,69	0,15%	5,62%
				Total Renda Fixa	4.119.448,96	5,55%	

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	3.183.094,68	0,00	0,00	3.310.896,31	127.801,63	4,02%	4,02%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	143.601,73	0,00	6.810,00	148.478,14	11.686,41	8,14%	0,00%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	286.594,23	0,00	0,00	297.592,04	10.997,81	3,84%	3,84%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	55.264,25	0,00	0,00	51.260,76	-4.003,49	-7,24%	-7,24%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.668.875,10	0,00	0,00	2.661.028,19	-7.846,91	-0,29%	-0,29%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.551.126,31	0,00	0,00	1.529.902,14	-21.224,17	-1,37%	-1,37%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.868.728,43	0,00	0,00	1.826.910,57	-41.817,86	-2,24%	-2,24%
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	575.434,87	0,00	0,00	525.485,39	-49.949,48	-8,68%	-8,68%
ITAU GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.140.287,12	0,00	0,00	1.066.074,61	-74.212,51	-6,51%	-6,51%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	408.087,27	0,00	0,00	304.803,95	-103.283,32	-25,31%	-25,31%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.160.353,26	0,00	0,00	1.036.084,25	-124.269,01	-10,71%	-10,71%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	2.731.967,25	0,00	0,00	2.573.037,01	-158.930,24	-5,82%	-5,82%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.395.106,24	0,00	0,00	1.215.801,93	-179.304,31	-12,85%	-12,85%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.914.133,23	0,00	0,00	2.678.688,96	-235.444,27	-8,08%	-8,08%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.968.764,34	0,00	0,00	3.630.276,50	-338.487,84	-8,53%	-8,53%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.044.479,31	0,00	0,00	1.685.854,71	-358.624,60	-17,54%	-17,54%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.045.588,82	0,00	0,00	1.686.147,24	-359.441,58	-17,57%	-17,57%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.045.318,20	0,00	0,00	1.685.575,80	-359.742,40	-17,59%	-17,59%
Total Renda Variável					-2.266.096,14	-7,51%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	1.741.143,92	0,00	0,00	1.242.047,57	-499.096,35	-28,66%	-28,66%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	3.445.827,27	0,00	0,00	2.566.378,39	-879.448,88	-25,52%	-25,52%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.653.215,44	0,00	0,00	4.079.970,88	-1.573.244,56	-27,83%	-27,83%
			Total Exterior		-2.951.789,79	-27,23%	

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.