

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 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	4.451.174,07	2,07%	1.077	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.163.483,48	1,47%	821	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.837.976,84	1,32%	585	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	3.423.799,78	1,59%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	463 dias	25.107.210,49	11,65%	245	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	14.961.612,11	6,95%	209	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	2027-05-16	20.172.097,07	9,36%	44	10,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	258.362,95	0,12%	321	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	9.536.070,62	4,43%	837	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	9.290.214,68	4,31%	1.066	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	8.827.537,43	4,10%	1.015	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.043.921,94	2,34%	246	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	597.254,29	0,28%	869	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.565.781,09	4,44%	172	1,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	12.423.338,85	5,77%	246	0,49%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	5.866.286,14	2,72%	183	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BBIF MASTER FIDC LP	Não se ...	27 meses	259.168,33	0,12%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	4.016.539,76	1,86%	33	2,85%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.794.400,15	1,30%	2.014	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.186.003,12	1,94%	3.845	1,39%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.261.437,46	1,05%	25.182	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.912.663,87	1,35%	672	1,47%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	6.126.171,73	2,84%	3.658	0,43%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	3.579.484,41	1,66%	128	0,55%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.880.874,83	1,80%	4.173	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	2.826.417,68	1,31%	262	1,51%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.484.016,96	1,15%	25.470	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.256.014,76	1,05%	1.598	1,09%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	D+32	Não há	4.771.466,64	2,21%	50.505	1,44%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	4.068.788,43	1,89%	31	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕ...	D+6 du	Não há	2.819.426,96	1,31%	8	1,36%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+5 du	Não há	2.584.170,15	1,20%	139	0,47%	Artigo 9º, Inciso II
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	2.037.713,43	0,95%	22.121	0,44%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.814.225,43	0,84%	701	0,13%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.040.315,72	3,27%	9.037	0,31%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	3.010.681,14	1,40%	582	1,88%	Artigo 10º, Inciso I
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.713.233,87	2,65%	562	5,86%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	2.174.429,81	1,01%	134	0,25%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	3.152.793,12	1,46%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	3.131.141,97	1,45%	28	2,32%	Artigo 10º, Inciso II



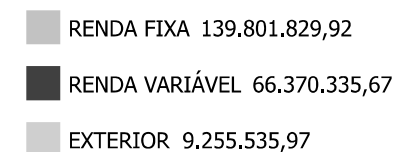
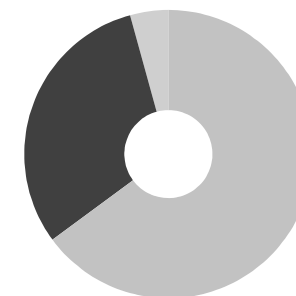
CRÉDITO
& MERCADO

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			215.427.701,56				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	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%	16,58%	62,20%	133.996.030,37
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	107.073.461,46	49,70%	12,44%	16,58%	62,20%	26.922.568,91
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	28.452.660,37	13,21%	5,70%	12,60%	50,00%	79.261.190,41
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	10,00%	4.275.708,09	1,98%	0,00%	2,34%	5,00%	6.495.676,99
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,60%	15,00%	32.314.155,23
Total Renda Fixa	100,00%	139.801.829,92	64,90%	18,14%	52,70%	194,40%	



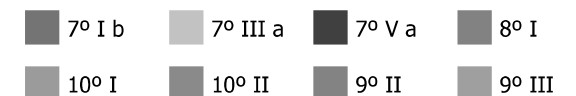
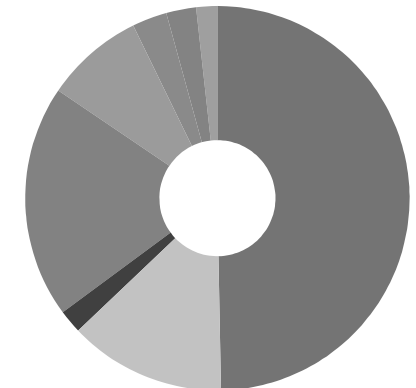
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	42.147.740,04	19,56%	19,65%	26,18%	30,00%	22.480.570,43
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	17.938.660,54	8,33%	5,00%	8,00%	10,00%	3.604.109,62
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	6.283.935,09	2,92%	0,00%	3,12%	5,00%	4.487.449,99
Total Renda Variável	40,00%	66.370.335,67	30,81%	24,65%	37,30%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	5.403.597,11	2,51%	2,00%	5,00%	10,00%	16.139.173,05
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.851.938,86	1,79%	2,00%	5,00%	10,00%	17.690.831,30
Total Exterior	10,00%	9.255.535,97	4,30%	4,00%	10,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	106.827.508,56	49,59	0,36
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	28.572.669,58	13,26	-
ITAÚ DTVM	14.907.355,81	6,92	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	9.565.781,09	4,44	0,00
TRÍGONO CAPITAL	8.840.255,07	4,10	0,21
ITAÚ UNIBANCO	8.450.456,29	3,92	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	6.126.171,73	2,84	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	5.713.233,87	2,65	0,06
GRAPHEN INVESTIMENTOS	4.016.539,76	1,86	1,06
BANCO J. SAFRA S/A	3.988.655,24	1,85	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.880.874,83	1,80	0,24
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	3.152.793,12	1,46	0,00
KPTL	3.131.141,97	1,45	0,91
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	2.912.663,87	1,35	0,00
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	2.826.417,68	1,31	-
PERFIN INVESTIMENTOS	2.256.014,76	1,05	0,02
PLURAL	259.168,33	0,12	0,00

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	62,20
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	107.073.461,46	49,70	14,19	62,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	28.452.660,37	13,21	24,89	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	4.275.708,09	1,98	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 8º, Inciso I	42.147.740,04	19,56	9,10	30,00
Artigo 9º, Inciso III	3.851.938,86	1,79	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso I	17.938.660,54	8,33	2,40	10,00
Artigo 10º, Inciso II	6.283.935,09	2,92	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,17%	6,66%	1,15%	6,61%	10,11%	16,59%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,22%	6,22%	0,82%	6,21%	9,51%	15,66%	1,40%	0,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29%	6,10%	0,78%	6,08%	9,41%	15,38%	1,48%	0,04%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	-0,12%	8,93%	2,20%	7,73%	17,74%	37,24%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-2,48%	-4,99%	-1,38%	-0,87%	-10,20%	-11,78%	-	0,05%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,01%	6,62%	1,13%	6,50%	10,04%	15,61%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00%	6,47%	1,09%	6,39%	9,71%	14,96%	1,22%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	7,32%	1,46%	6,92%	10,97%	17,11%	0,82%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	6,53%	1,12%	6,44%	9,84%	15,08%	1,21%	0,04%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,32%	3,18%	0,79%	3,21%	3,47%	1,48%	1,51%	0,06%
IMA-B (Benchmark)	-0,88%	3,43%	-0,28%	4,20%	3,25%	5,86%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,89%	3,29%	-0,29%	4,09%	2,96%	5,30%	2,40%	0,06%
IRF-M (Benchmark)	1,15%	3,36%	2,11%	3,45%	3,42%	1,97%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,12%	3,29%	2,07%	3,37%	3,25%	1,57%	1,47%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,03%	6,49%	3,11%	5,72%	9,39%	12,05%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,95%	5,87%	2,86%	5,18%	8,24%	9,65%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,90%	5,54%	2,69%	4,90%	7,81%	9,49%	0,00%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,84%	6,81%	2,92%	6,32%	11,29%	14,13%	0,21%	0,01%
BBIF MASTER FIDC LP	-1,81%	-4,68%	-3,25%	-4,44%	-6,31%	18,65%	2,39%	0,01%

IPCA (Benchmark)	-0,68%	4,77%	0,46%	4,21%	10,07%	19,97%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,79%	5,41%	2,09%	4,71%	5,36%	6,31%	0,99%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,34%	4,43%	1,51%	4,19%	5,32%	5,43%	1,08%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,80%	6,12%	2,60%	5,57%	9,65%	10,96%	0,36%	0,02%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,50%	-	-	-	-	-	2,47%	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,08%	-	-2,36%	-	-	-	0,76%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,15%	10,96%	3,04%	9,45%	21,58%	46,31%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,06%	-1,16%	-0,32%	-1,04%	-1,75%	-	-	0,00%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	-0,04%	9,51%	2,44%	8,23%	18,84%	39,80%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	3,30%	9,46%	4,50%	9,65%	3,95%	-	-	-
IDIV (Benchmark)	1,98%	6,66%	-2,58%	-0,76%	-0,49%	13,65%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	6,19%	2,33%	-1,71%	4,45%	-1,54%	103,83%	8,96%	0,25%
Ibovespa (Benchmark)	4,69%	-1,58%	-4,37%	-8,01%	-15,30%	0,25%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4,05%	-3,49%	-5,90%	-9,37%	-12,06%	8,74%	7,97%	0,20%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3,73%	-1,00%	-7,27%	-6,81%	-12,91%	9,10%	6,30%	0,20%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,17%	-4,72%	-4,39%	-8,10%	-11,12%	10,34%	6,78%	0,19%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	4,88%	2,54%	-3,68%	-6,34%	-14,01%	-2,76%	7,69%	0,22%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4,67%	2,12%	-4,11%	-1,69%	-10,02%	2,35%	6,45%	0,19%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,37%	-2,93%	-3,72%	0,20%	-12,87%	63,37%	9,44%	0,25%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6,01%	-3,20%	-2,21%	-4,48%	-18,57%	0,76%	7,73%	0,19%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4,89%	2,01%	-6,17%	-6,55%	-14,81%	-3,12%	7,86%	0,23%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,94%	-3,66%	-3,40%	-5,92%	-26,77%	-27,09%	7,72%	0,17%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,51%	-5,83%	-3,75%	-10,32%	-35,56%	-30,25%	8,55%	0,25%

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

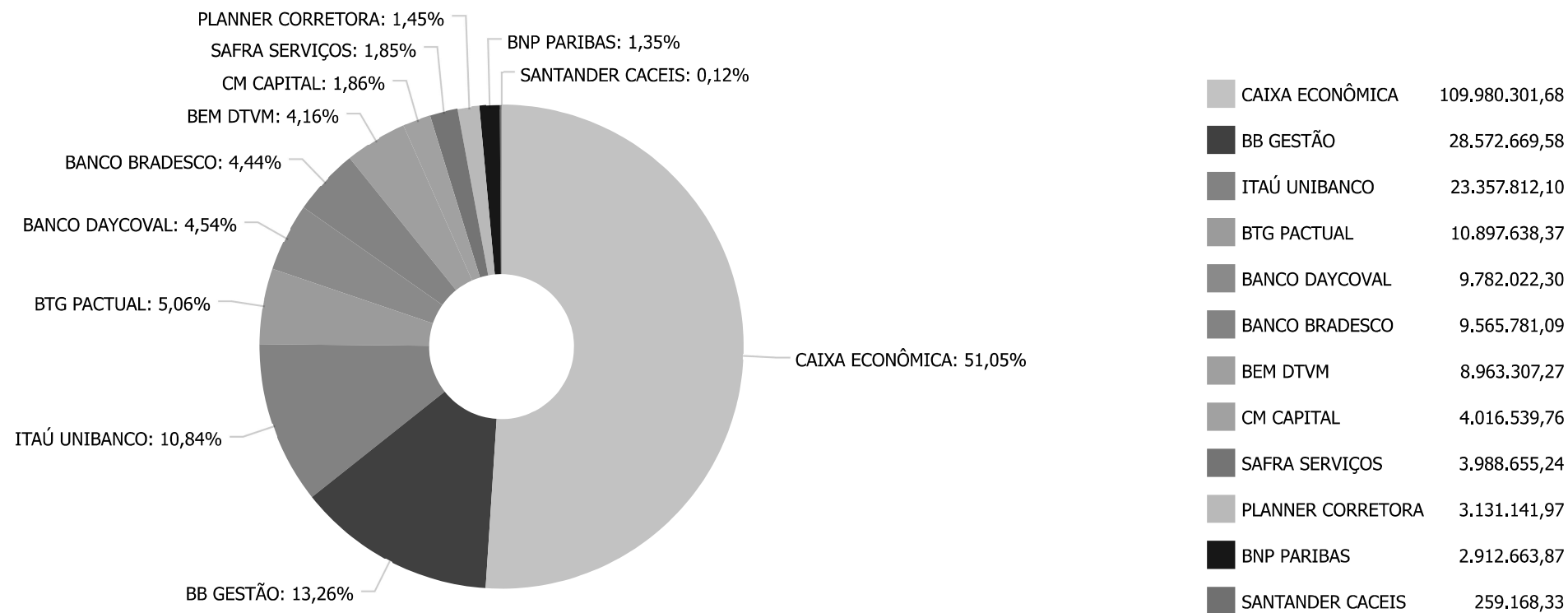
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	4,34%	-1,48%	-4,69%	-7,69%	-7,87%	12,59%	7,57%	0,20%

CDI (Benchmark)	1,03%	6,49%	3,11%	5,72%	9,39%	12,05%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,20%	5,26%	1,31%	3,94%	3,93%	10,14%	1,71%	0,04%
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	0,84%	5,82%	3,13%	6,00%	6,97%	8,05%	0,40%	0,02%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	10,02%	-9,17%	2,51%	-4,20%	1,03%	35,96%	8,87%	0,21%

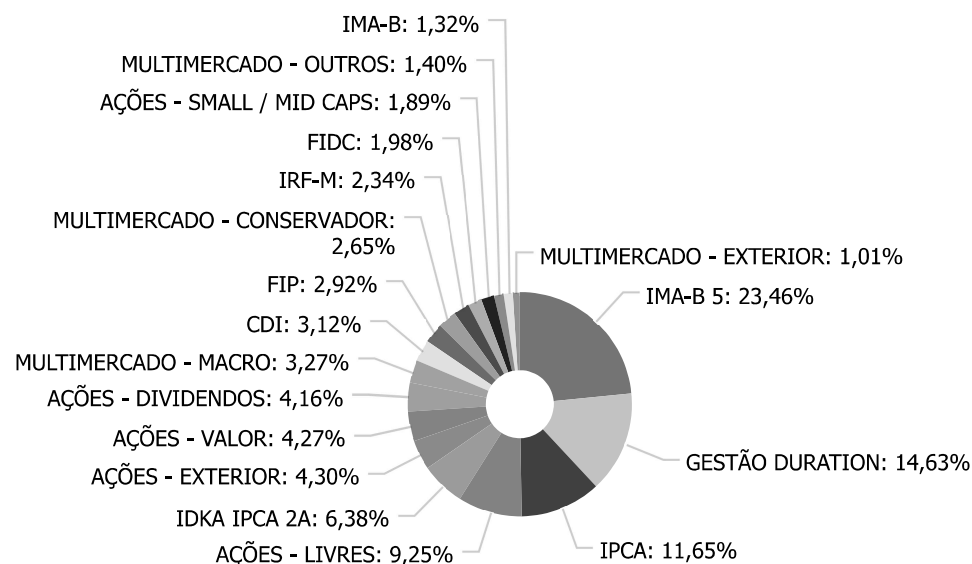
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	7,65%	-22,08%	3,82%	-13,58%	-10,66%	19,00%	-	-
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12,38%	-22,83%	-3,06%	-16,51%	-35,91%	-16,58%	12,96%	0,22%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,23%	-24,76%	4,08%	-14,77%	-14,16%	15,43%	9,87%	0,21%
MSCI WORLD (Benchmark)	6,84%	-20,99%	3,62%	-13,05%	-9,35%	18,81%	-	-
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	6,86%	-20,58%	1,17%	-11,28%	-9,86%	21,43%	9,86%	0,19%
MSCI ACWI (Benchmark)	5,85%	-21,45%	2,90%	-13,91%	-10,79%	15,22%	-	-
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	2,44%	-12,32%	-3,79%	-5,66%	-7,00%	17,22%	5,39%	0,16%

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



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

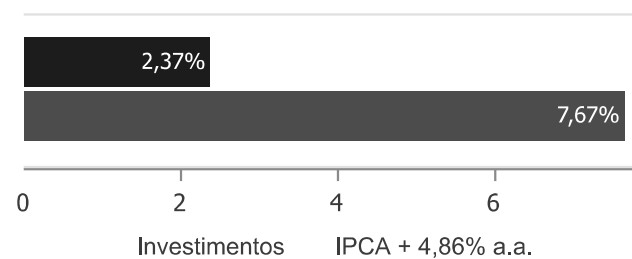


■ IMA-B 5	50.548.529,87	■ GESTÃO DURATION	31.525.190,56	■ IPCA	25.107.210,49
■ AÇÕES - LIVRES	19.921.179,61	■ IDKA IPCA 2A	13.741.388,75	■ AÇÕES - EXTERIOR	9.255.535,97
■ AÇÕES - VALOR	9.200.302,24	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	8.957.469,76	■ MULTIMERCADO - MACRO	7.040.315,72
■ CDI	6.721.903,38	■ FIP	6.283.935,09	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	5.713.233,87
■ IRF-M	5.043.921,94	■ FIDC	4.275.708,09	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	4.068.788,43
■ MULTIMERCADO - OUTROS	3.010.681,14	■ IMA-B	2.837.976,84	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.174.429,81

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	204.149.239,18	3.851.981,68	5.036.893,69	203.642.133,30	677.806,13	677.806,13	0,33%	0,33%	0,94%	0,94%	35,38%	3,67%
Fevereiro	203.642.133,30	8.195.616,67	5.781.128,98	206.435.138,47	378.517,48	1.056.323,61	0,18%	0,52%	1,37%	2,32%	22,22%	2,70%
Março	206.435.138,47	3.571.148,94	2.486.216,43	212.970.189,46	5.450.118,48	6.506.442,09	2,63%	3,16%	2,04%	4,41%	71,53%	3,78%
Abril	212.970.189,46	5.444.259,71	2.892.117,79	213.641.856,10	-1.880.475,28	4.625.966,81	-0,87%	2,26%	1,42%	5,90%	38,25%	2,84%
Mai	213.641.856,10	43.771.417,44	43.327.821,97	216.430.187,14	2.344.735,57	6.970.702,38	1,10%	3,38%	0,89%	6,84%	49,38%	3,95%
Junho	216.430.187,14	45.723.471,96	44.695.787,41	212.078.787,43	-5.379.084,26	1.591.618,12	-2,47%	0,82%	1,07%	7,98%	10,26%	3,21%
Julho	212.078.787,43	42.500.003,85	42.406.328,92	215.427.701,56	3.255.239,20	4.846.857,32	1,53%	2,37%	-0,29%	7,67%	30,85%	3,06%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





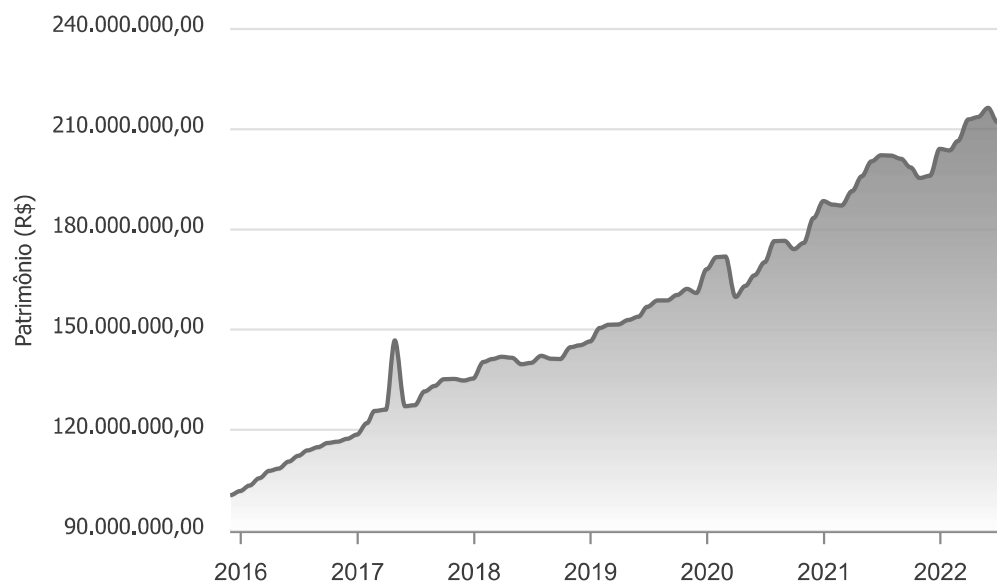
CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

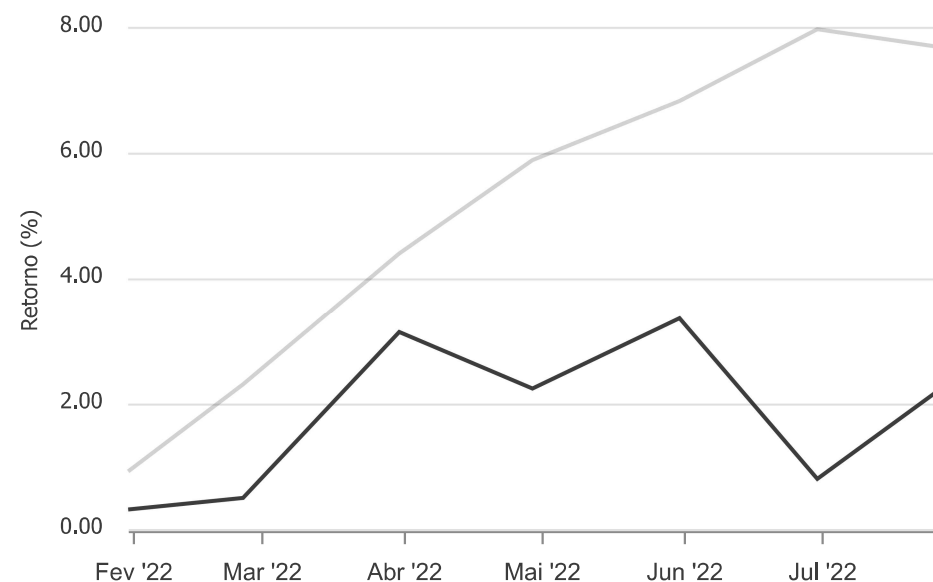
ANO

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 Julho/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	576.930,08	28.172,36	13.258,40	597.254,29	5.410,25	0,89%	0,95%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	5.000.000,00	0,00	5.043.921,94	43.921,94	0,88%	1,12%	1,47%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	20.000.000,00	0,00	20.172.097,07	172.097,07	0,86%	-0,50%	2,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	5.817.204,73	0,00	0,00	5.866.286,14	49.081,41	0,84%	0,84%	0,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	12.324.487,86	0,00	0,00	12.423.338,85	98.850,99	0,80%	0,80%	0,36%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.461.691,72	0,00	0,00	9.536.070,62	74.378,90	0,79%	0,79%	0,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	3.408.709,14	0,00	0,00	3.423.799,78	15.090,64	0,44%	0,44%	0,82%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.533.168,12	0,00	0,00	9.565.781,09	32.612,97	0,34%	0,34%	1,08%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	25.088.502,37	0,00	0,00	25.107.210,49	18.708,12	0,07%	0,07%	0,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.312.872,92	589.579,01	80.000,00	8.827.537,43	5.085,50	0,06%	0,02%	1,21%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	308.992,82	12.369.418,01	12.424.197,44	258.362,95	4.149,56	0,03%	0,90%	0,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.461.028,18	0,00	0,00	4.451.174,07	-9.854,11	-0,22%	-0,22%	1,40%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.009.772,92	0,00	0,00	14.961.612,11	-48.160,81	-0,32%	-0,32%	1,51%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	18.263.486,80	0,00	15.000.000,00	3.163.483,48	-100.003,32	-0,55%	0,00%	1,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	22.835.267,65	1.512.834,47	14.888.873,08	9.290.214,68	-169.014,36	-0,69%	-0,29%	1,48%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.863.332,83	0,00	0,00	2.837.976,84	-25.355,99	-0,89%	-0,89%	2,40%
BBIF MASTER FIDC LP	263.933,34	0,00	0,00	259.168,33	-4.765,01	-1,81%	-1,81%	2,39%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.118.664,66	0,00	0,00	4.016.539,76	-102.124,90	-2,48%	-	-
Total Renda Fixa	142.648.046,14	39.500.003,85	42.406.328,92	139.801.829,92	60.108,85	0,04%		1,25%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.976.366,04	0,00	0,00	2.174.429,81	198.063,77	10,02%	10,02%	8,87%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.645.778,50	0,00	0,00	6.126.171,73	480.393,23	8,51%	8,51%	8,55%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	4.493.285,84	0,00	0,00	4.771.466,64	278.180,80	6,19%	6,19%	8,96%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.343.300,12	0,00	0,00	2.484.016,96	140.716,84	6,01%	6,01%	7,73%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.129.455,97	0,00	0,00	2.256.014,76	126.558,79	5,94%	5,94%	7,72%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	3.861.351,43	0,00	0,00	4.068.788,43	207.437,00	5,37%	5,37%	9,44%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.776.929,47	0,00	0,00	2.912.663,87	135.734,40	4,89%	4,89%	7,86%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.412.873,56	0,00	0,00	3.579.484,41	166.610,85	4,88%	4,88%	7,69%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.707.565,75	0,00	0,00	3.880.874,83	173.309,08	4,67%	4,67%	6,45%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.708.940,90	0,00	0,00	2.826.417,68	117.476,78	4,34%	4,34%	7,57%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.682.631,48	0,00	0,00	2.794.400,15	111.768,67	4,17%	4,17%	6,78%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.173.515,10	0,00	0,00	2.261.437,46	87.922,36	4,05%	4,05%	7,97%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	4.035.516,54	0,00	0,00	4.186.003,12	150.486,58	3,73%	3,73%	6,30%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	3.052.166,79	0,00	0,00	3.152.793,12	100.626,33	3,30%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.956.989,17	0,00	0,00	7.040.315,72	83.326,55	1,20%	1,20%	1,71%
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	5.665.631,35	0,00	0,00	5.713.233,87	47.602,52	0,84%	0,84%	0,40%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	0,00	3.000.000,00	0,00	3.010.681,14	10.681,14	0,36%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	3.132.964,09	0,00	0,00	3.131.141,97	-1.822,12	-0,06%	-	-
Total Renda Variável	60.755.262,10	3.000.000,00	0,00	66.370.335,67	2.615.073,57	4,10%		6,38%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.813.173,54	0,00	0,00	2.037.713,43	224.539,89	12,38%	12,38%	12,96%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.691.874,51	0,00	0,00	1.814.225,43	122.350,92	7,23%	7,23%	9,87%
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	2.418.245,91	0,00	0,00	2.584.170,15	165.924,24	6,86%	6,86%	9,86%
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	2.752.185,23	0,00	0,00	2.819.426,96	67.241,73	2,44%	2,44%	5,39%
Total Exterior	8.675.479,19	0,00	0,00	9.255.535,97	580.056,78	6,69%		9,18%

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.