

Relatório Analítico dos Investimentos

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

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



Carteira consolidada de investimentos - base (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	932.938,84	4,40%	1.077	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.097.121,94	5,17%	820	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	6.411,90	0,03%	1.068	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	171.621,30	0,81%	317	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.257.750,95	10,64%	868	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.161.577,83	5,48%	1.073	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	822.334,66	3,88%	1.024	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.666.340,71	7,85%	798	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	879.118,56	4,14%	1.175	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.102,51	0,01%	59	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	99.032,68	0,47%	859	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.169.401,99	5,51%	176	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	247.867,07	1,17%	147	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	158.145,37	0,75%	214	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.987.512,71	9,37%	134	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA...	D+3	Não há	820.498,74	3,87%	468	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	920.315,73	4,34%	248	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	1.544.234,58	7,28%	171	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	50.346,12	0,24%	1.209	0,03%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	359.066,75	1,69%	25.804	0,03%	Artigo 8º, Inciso I



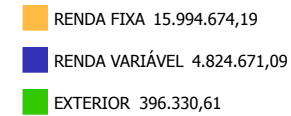
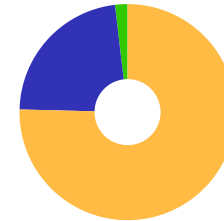
Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.203.748,35	5,67%	1.588	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	621.693,32	2,93%	177	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	332.959,78	1,57%	3.270	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	267.813,43	1,26%	4.289	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	294.644,40	1,39%	26.685	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	D+3	Não há	149.266,08	0,70%	12.032	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	131.162,72	0,62%	17.281	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BRADERCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	66.964,35	0,32%	75	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	198.203,54	0,93%	522	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
BRADERCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	293.348,71	1,38%	37.358	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
BRADERCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	D+4	Não há	45.475,42	0,21%	776	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	214.758,00	1,01%	9.808	0,01%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	341.790,04	1,61%	12.074	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	446.062,54	2,10%	9.294	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	254.044,27	1,20%	1.008	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			21.215.675,89				



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA 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%	20,76%	63,78%	13.531.358,08
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	8.997.319,20	42,41%	15,94%	21,75%	63,78%	4.534.038,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	6.947.008,87	32,74%	13,13%	17,50%	50,00%	3.660.829,08
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,50%	20,00%	4.243.135,18
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	50.346,12	0,24%	0,00%	3,42%	5,00%	1.010.437,67
Total Renda Fixa	100,00%	15.994.674,19	75,39%	29,07%	80,93%	202,56%	

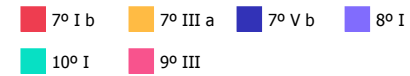
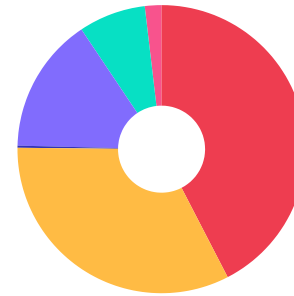




Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3.229.192,11	15,22%	7,98%	9,05%	20,00%	1.013.943,07
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,60%	20,00%	4.243.135,18
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.595.478,98	7,52%	2,56%	3,42%	10,00%	526.088,61
Total Renda Variável	30,00%	4.824.671,09	22,74%	10,54%	14,07%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	396.330,61	1,87%	3,75%	5,00%	10,00%	1.725.236,98
Total Exterior	10,00%	396.330,61	1,87%	3,75%	5,00%	10,00%	





Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	13.284.116,40	62,61	-
ITAÚ UNIBANCO	3.164.607,57	14,92	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.625.734,83	12,38	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.823.057,54	8,59	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	267.813,43	1,26	0,02
SOMMA INVESTIMENTOS	50.346,12	0,24	-

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	63,78
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	8.997.319,20	42,41	15,94	63,78
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	6.947.008,87	32,74	13,13	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	50.346,12	0,24	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	3.229.192,11	15,22	7,98	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	396.330,61	1,87	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.595.478,98	7,52	2,56	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00



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%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,93%	4,93%	2,61%	4,93%	7,03%	8,93%	0,17%	0,02%
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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,32%	6,47%	2,63%	6,47%	9,74%	16,08%	1,26%	0,04%

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%

CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	5,28%	2,85%	5,28%	8,43%	10,54%	0,01%	0,01%
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,97%	5,16%	2,69%	5,16%	8,33%	10,19%	0,02%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,88%	4,59%	2,50%	4,59%	7,12%	8,63%	0,01%	0,01%



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
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,95%	5,91%	2,99%	5,91%	11,12%	13,61%	0,36%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,93%	4,87%	2,63%	4,87%	7,48%	8,72%	0,01%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,34%	6,51%	2,66%	6,51%	7,75%	13,88%	1,24%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,79%	5,28%	2,57%	5,28%	8,95%	10,68%	0,42%	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%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,32%	4,08%	1,69%	4,08%	4,75%	6,86%	1,08%	0,02%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,09%	4,95%	2,32%	4,95%	4,93%	7,33%	1,55%	0,03%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,17%	5,91%	3,15%	5,91%	10,11%	16,73%	0,04%	0,01%



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%	-	-
BRASESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	-7,88%	-17,97%	-15,16%	-17,97%	-6,68%	29,32%	13,69%	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%
BRASESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,04%	-26,63%	-9,11%	-26,63%	-9,09%	13,90%	11,62%	0,20%
IDIV (Benchmark)	-8,38%	4,58%	-9,43%	4,58%	-4,10%	18,72%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-8,31%	4,05%	-9,45%	4,05%	-7,36%	11,21%	7,00%	0,19%
Ibovespa (Benchmark)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-12,77%	-7,24%	-16,81%	-7,24%	-17,83%	14,76%	9,44%	0,20%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-10,77%	-2,44%	-11,90%	-2,44%	-17,59%	6,05%	7,26%	0,18%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-11,11%	-8,68%	-13,57%	-8,68%	-25,55%	2,22%	8,32%	0,17%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-10,49%	-8,08%	-16,17%	-8,08%	-27,94%	-7,88%	7,94%	0,19%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-10,52%	-3,62%	-10,56%	-3,62%	-15,12%	21,27%	8,01%	0,17%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	-10,88%	-7,40%	-18,01%	-7,40%	-29,39%	-8,78%	8,39%	0,19%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-



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 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%
BRADESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	-7,86%	-17,86%	-15,11%	-17,86%	-6,37%	30,10%	13,69%	0,19%
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%

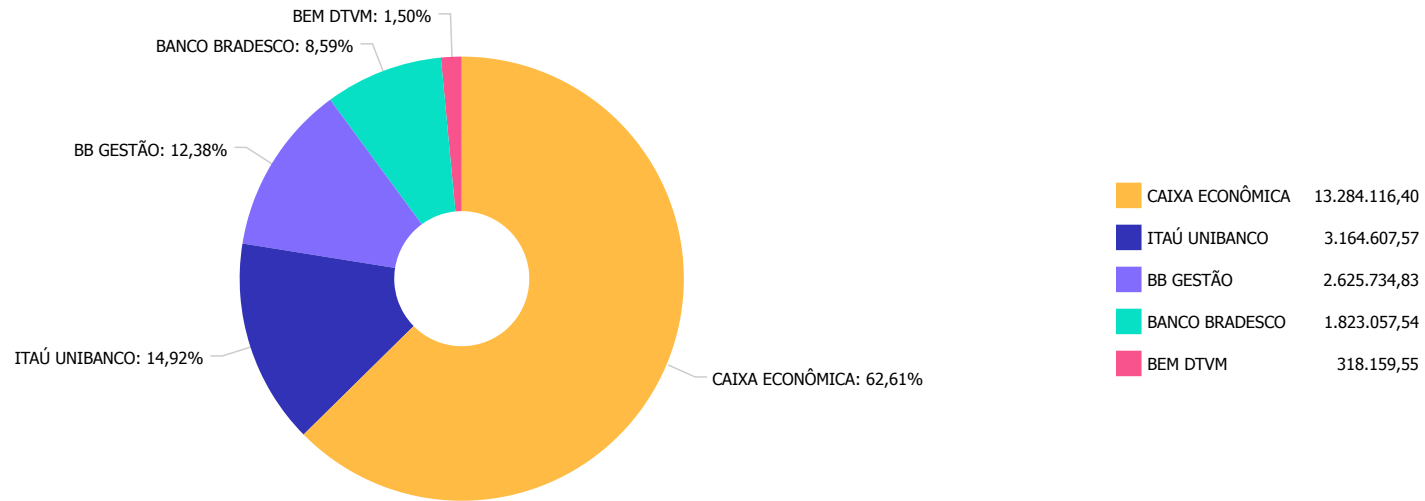


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,04%	-26,63%	-9,11%	-26,63%	-9,09%	13,90%	11,62%	0,20%

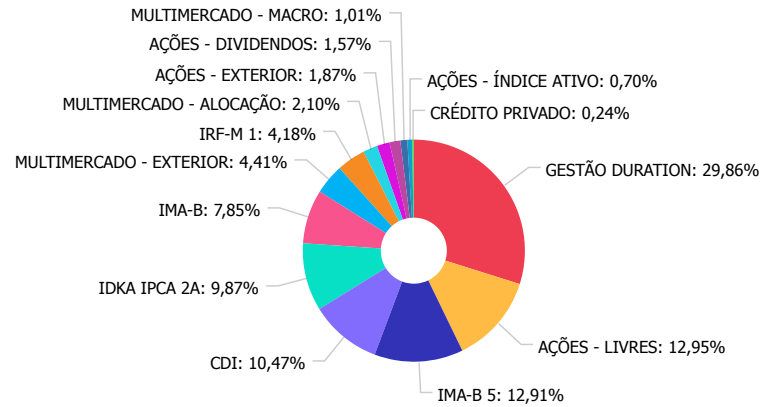


Distribuição dos ativos por Administradores - base (Junho / 2022)





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



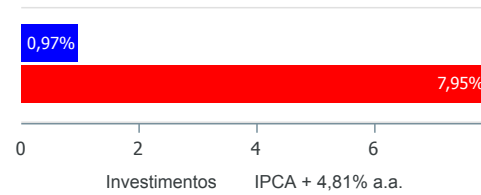
■ GESTÃO DURATION	6.334.981,38	■ AÇÕES - LIVRES	2.746.966,25	■ IMA-B 5	2.739.955,34	■ CDI	2.220.901,00
■ IDKA IPCA 2A	2.094.516,67	■ IMA-B	1.666.340,71	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	934.658,44	■ IRF-M 1	887.632,97
■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	446.062,54	■ AÇÕES - EXTERIOR	396.330,61	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	332.959,78	■ MULTIMERCADO - MACRO	214.758,00
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	149.266,08	■ CRÉDITO PRIVADO	50.346,12				



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	19.968.429,30	184.013,14	90.169,65	20.113.449,05	51.176,26	51.176,26	0,26%	0,26%	0,93%	0,93%	27,30%	3,13%
Fevereiro	20.113.449,05	380.775,41	61.727,48	20.495.022,07	62.525,09	113.701,35	0,31%	0,56%	1,37%	2,32%	24,26%	2,55%
Março	20.495.022,07	927.893,30	428.606,36	21.443.537,10	449.228,09	562.929,44	2,14%	2,71%	2,04%	4,40%	61,67%	3,23%
Abril	21.443.537,10	149.363,07	22.871,39	21.372.735,42	-197.293,36	365.636,08	-0,91%	1,77%	1,42%	5,88%	30,17%	2,56%
Mai	21.372.735,42	1.014.990,37	553.334,38	22.077.038,30	242.646,89	608.282,97	1,11%	2,91%	0,88%	6,82%	42,62%	3,05%
Junho	22.077.038,30	466.922,40	913.672,80	21.215.675,89	-414.612,01	193.670,96	-1,88%	0,97%	1,06%	7,95%	12,23%	3,00%

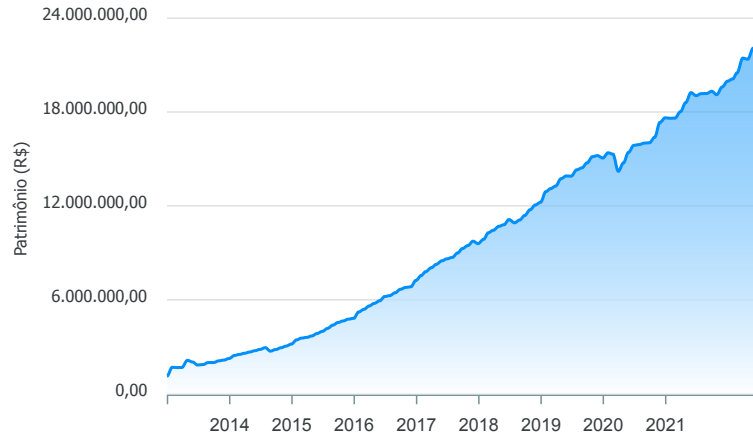
Investimentos x Meta de Rentabilidade



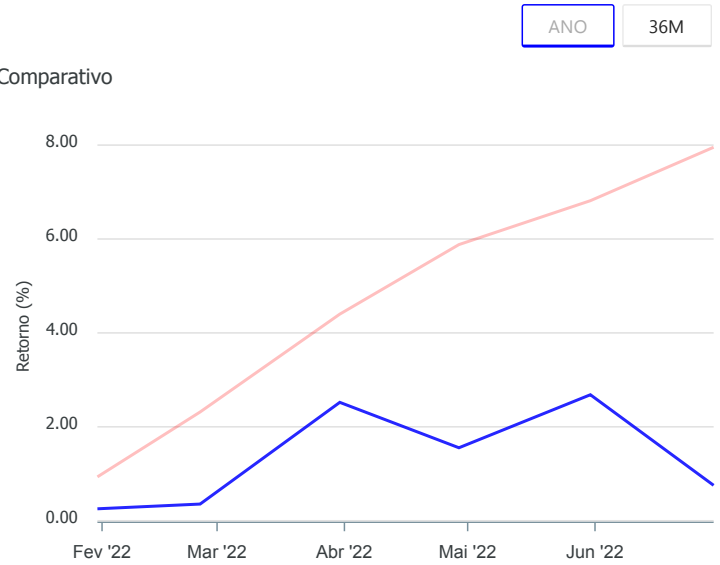


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	156.589,00	0,00	0,00	158.145,37	1.556,37	0,99%	0,99%	0,01%
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	245.477,21	0,00	0,00	247.867,07	2.389,86	0,97%	0,97%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.529.751,84	0,00	0,00	1.544.234,58	14.482,74	0,95%	0,95%	0,36%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.353,57	0,00	0,00	6.411,90	58,33	0,92%	0,92%	0,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	871.190,92	0,00	0,00	879.118,56	7.927,64	0,91%	0,91%	0,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	913.144,93	0,00	0,00	920.315,73	7.170,80	0,79%	0,79%	0,42%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	98.331,87	0,00	99.032,68	700,81	0,71%	0,93%	0,01%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,00	50.000,00	0,00	50.346,12	346,12	0,69%	1,17%	0,04%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	817.705,53	0,00	0,00	820.498,74	2.793,21	0,34%	0,34%	1,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	819.600,65	0,00	0,00	822.334,66	2.734,01	0,33%	0,33%	1,23%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.165.636,79	0,00	0,00	1.169.401,99	3.765,20	0,32%	0,32%	1,08%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.093.647,53	0,00	0,00	1.097.121,94	3.474,41	0,32%	0,32%	1,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	769.679,56	0,00	770.000,00	2.102,51	2.422,95	0,31%	0,93%	0,17%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	930.462,82	0,00	0,00	932.938,84	2.476,02	0,27%	0,27%	1,38%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	162.945,22	151.590,53	143.672,80	171.621,30	758,35	0,24%	0,88%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.252.560,78	0,00	0,00	2.257.750,95	5.190,17	0,23%	0,23%	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.158.977,80	0,00	0,00	1.161.577,83	2.600,03	0,22%	0,22%	1,39%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1.985.812,66	0,00	0,00	1.987.512,71	1.700,05	0,09%	0,09%	1,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.672.670,10	0,00	0,00	1.666.340,71	-6.329,39	-0,38%	-0,38%	2,05%
Total Renda Fixa	16.552.206,91	299.922,40	913.672,80	15.994.674,19	56.217,68	0,34%		1,17%



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	216.485,69	0,00	0,00	214.758,00	-1.727,69	-0,80%	-0,80%	1,52%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	456.619,26	0,00	0,00	446.062,54	-10.556,72	-2,31%	-2,31%	2,56%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	193.589,26	167.000,00	0,00	332.959,78	-27.629,48	-7,66%	-8,31%	7,00%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	370.625,36	0,00	0,00	341.790,04	-28.835,32	-7,78%	-7,78%	13,68%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	275.499,90	0,00	0,00	254.044,27	-21.455,63	-7,79%	-7,79%	13,65%
BRADESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	318.384,81	0,00	0,00	293.348,71	-25.036,10	-7,86%	-7,86%	13,69%
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	49.363,41	0,00	0,00	45.475,42	-3.887,99	-7,88%	-7,88%	13,69%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.344.769,39	0,00	0,00	1.203.748,35	-141.021,04	-10,49%	-10,49%	7,94%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	694.818,84	0,00	0,00	621.693,32	-73.125,52	-10,52%	-10,52%	8,01%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	300.137,33	0,00	0,00	267.813,43	-32.323,90	-10,77%	-10,77%	7,26%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	167.480,27	0,00	0,00	149.266,08	-18.214,19	-10,88%	-10,88%	8,39%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	331.458,05	0,00	0,00	294.644,40	-36.813,65	-11,11%	-11,11%	8,32%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	411.606,58	0,00	0,00	359.066,75	-52.539,83	-12,76%	-12,76%	9,44%
Total Renda Variável	5.130.838,15	167.000,00	0,00	4.824.671,09	-473.167,06	-8,93%		8,32%



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
BRANCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	66.277,61	0,00	0,00	66.964,35	686,74	1,04%	1,04%	11,62%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	196.576,92	0,00	0,00	198.203,54	1.626,62	0,83%	0,83%	12,50%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	131.138,71	0,00	0,00	131.162,72	24,01	0,02%	0,02%	11,56%
Total Exterior	393.993,24	0,00	0,00	396.330,61	2.337,37	0,59%		12,04%



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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.208.701,77	0,00	0,00	2.257.750,95	49.049,18	2,22%	2,22%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1.942.523,09	0,00	0,00	1.987.512,71	44.989,62	2,32%	2,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.332.962,93	169.000,00	0,00	1.544.234,58	42.271,65	2,81%	2,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.133.301,69	0,00	0,00	1.161.577,83	28.276,14	2,50%	2,50%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.068.963,78	0,00	0,00	1.097.121,94	28.158,16	2,63%	2,63%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	909.806,73	0,00	0,00	932.938,84	23.132,11	2,54%	2,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	897.244,08	0,00	0,00	920.315,73	23.071,65	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.643.496,25	0,00	0,00	1.666.340,71	22.844,46	1,39%	1,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	856.979,62	0,00	0,00	879.118,56	22.138,94	2,58%	2,58%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	799.210,47	0,00	0,00	820.498,74	21.288,27	2,66%	2,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	801.078,23	0,00	0,00	822.334,66	21.256,43	2,65%	2,65%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.149.941,62	0,00	0,00	1.169.401,99	19.460,37	1,69%	1,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	246.954,46	525.000,00	780.000,00	2.102,51	10.148,05	1,31%	2,61%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	189.618,71	52.000,00	0,00	247.867,07	6.248,36	2,59%	2,69%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	153.767,08	0,00	0,00	158.145,37	4.378,29	2,85%	2,85%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	277.742,10	293.058,01	475.990,80	99.032,68	4.223,37	0,74%	2,63%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	78.339,42	325.217,83	233.887,77	171.621,30	1.951,82	0,48%	2,50%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,00	50.000,00	0,00	50.346,12	346,12	0,69%	3,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.251,81	0,00	0,00	6.411,90	160,09	2,56%	2,56%
Total Renda Fixa	15.696.883,84	1.414.275,84	1.489.878,57	15.994.674,19	373.393,08	2,18%	



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	214.872,83	0,00	0,00	214.758,00	-114,83	-0,05%	-0,05%
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	53.600,09	0,00	0,00	45.475,42	-8.124,67	-15,16%	-15,16%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	459.266,08	0,00	0,00	446.062,54	-13.203,54	-2,87%	-2,87%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	196.017,74	167.000,00	0,00	332.959,78	-30.057,96	-8,28%	-9,45%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	182.063,17	0,00	0,00	149.266,08	-32.797,09	-18,01%	-18,01%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	251.172,27	50.000,00	0,00	267.813,43	-33.358,84	-11,08%	-11,90%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	298.675,27	0,00	0,00	254.044,27	-44.631,00	-14,94%	-14,94%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	340.921,75	0,00	0,00	294.644,40	-46.277,35	-13,57%	-13,57%
BRADESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	345.580,80	0,00	0,00	293.348,71	-52.232,09	-15,11%	-15,11%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	402.004,51	0,00	0,00	341.790,04	-60.214,47	-14,98%	-14,98%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	431.628,90	0,00	0,00	359.066,75	-72.562,15	-16,81%	-16,81%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	695.110,51	0,00	0,00	621.693,32	-73.417,19	-10,56%	-10,56%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.435.867,84	0,00	0,00	1.203.748,35	-232.119,49	-16,17%	-16,17%
Total Renda Variável	5.306.781,76	217.000,00	0,00	4.824.671,09	-699.110,67	-12,66%	



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
BRABESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	73.674,53	0,00	0,00	66.964,35	-6.710,18	-9,11%	-9,11%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	145.437,98	0,00	0,00	131.162,72	-14.275,26	-9,82%	-9,82%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	220.758,99	0,00	0,00	198.203,54	-22.555,45	-10,22%	-10,22%
Total Exterior	439.871,50	0,00	0,00	396.330,61	-43.540,89	-9,90%	



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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.158.724,99	0,00	0,00	2.257.750,95	99.025,96	4,59%	4,59%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1.310.473,41	593.811,44	0,00	1.987.512,71	83.227,86	4,37%	4,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.050.126,31	421.115,28	0,00	1.544.234,58	72.992,99	4,96%	5,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.091.577,77	0,00	0,00	1.161.577,83	70.000,06	6,41%	6,41%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.598.391,72	0,00	0,00	1.666.340,71	67.948,99	4,25%	4,25%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.030.427,18	0,00	0,00	1.097.121,94	66.694,76	6,47%	6,47%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	876.354,94	0,00	0,00	932.938,84	56.583,90	6,46%	6,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	772.063,09	0,00	0,00	822.334,66	50.271,57	6,51%	6,51%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	770.322,12	0,00	0,00	820.498,74	50.176,62	6,51%	6,51%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.123.577,97	0,00	0,00	1.169.401,99	45.824,02	4,08%	4,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	729.703,41	147.087,84	0,00	920.315,73	43.524,48	4,96%	5,28%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	838.404,11	0,00	0,00	879.118,56	40.714,45	4,86%	4,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	277.308,55	525.000,00	816.000,00	2.102,51	15.793,96	1,97%	4,93%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	185.158,31	52.000,00	0,00	247.867,07	10.708,76	4,52%	5,16%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	150.214,71	0,00	0,00	158.145,37	7.930,66	5,28%	5,28%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	567.189,92	475.990,80	99.032,68	7.833,56	1,38%	4,87%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	68.650,25	550.753,21	451.141,26	171.621,30	3.359,10	0,54%	4,59%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	33.216,43	0,00	27.250,00	6.411,90	445,47	1,34%	4,85%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,00	50.000,00	0,00	50.346,12	346,12	0,69%	5,91%
				Total Renda Fixa	793.403,29	5,22%	



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 RV 30 FI MULTIMERCADO LP	431.529,66	0,00	0,00	446.062,54	14.532,88	3,37%	3,37%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	206.468,28	0,00	0,00	214.758,00	8.289,72	4,02%	4,02%
CAIXA ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	4,60%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	170.595,87	167.000,00	0,00	332.959,78	-4.636,09	-1,37%	4,05%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	226.816,46	50.000,00	0,00	267.813,43	-9.003,03	-3,25%	-2,44%
BRAPESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	55.436,44	0,00	0,00	45.475,42	-9.961,02	-17,97%	-17,97%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	161.197,69	0,00	0,00	149.266,08	-11.931,61	-7,40%	-7,40%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	639.929,92	0,00	0,00	621.693,32	-18.236,60	-2,85%	-3,62%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	322.651,54	0,00	0,00	294.644,40	-28.007,14	-8,68%	-8,68%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	387.110,05	0,00	0,00	359.066,75	-28.043,30	-7,24%	-7,24%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	308.263,43	0,00	0,00	254.044,27	-54.219,16	-17,59%	-17,59%
BRAPESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	357.127,09	0,00	0,00	293.348,71	-63.778,38	-17,86%	-17,86%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	414.650,56	0,00	0,00	341.790,04	-72.860,52	-17,57%	-17,57%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.309.552,26	0,00	0,00	1.203.748,35	-105.803,91	-8,08%	-8,08%
				Total Renda Variável	-383.658,16	-7,37%	

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.

