

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
TÍTULOS PÚBLICOS			53.378.712,21	14,72%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.795.083,14	3,53%	32	7,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	20.634.403,65	5,69%	21	6,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.887.375,59	1,62%	453	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	5.394.598,18	1,49%	95	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	7.384.297,64	2,04%	140	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	573.640,54	0,16%	165	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.892.210,00	2,45%	105	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	10.059.843,75	2,77%	179	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	9.195.075,00	2,54%	67	2,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	34.858.041,03	9,61%	868	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	28.034,24	0,01%	1.024	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.709.099,94	2,13%	1.175	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	9.894.988,88	2,73%	249	1,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	20.644.501,60	5,69%	177	12,81%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	633.844,12	0,17%	14.999	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	10.769.159,77	2,97%	248	0,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	37.781.543,76	10,42%	547	1,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	10.908.331,75	3,01%	974	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.733.138,13	0,48%	262	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

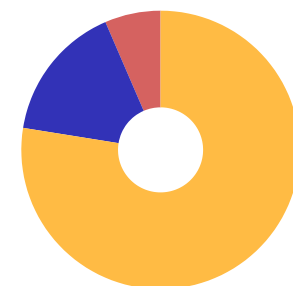
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	12.037.795,48	3,32%	69	1,91%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.008.259,31	0,28%	4.519	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	9.724.393,75	2,68%	204	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+5 du	Não há	1.600.312,81	0,44%	65	13,21%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	6.617.344,88	1,82%	743	1,67%	Artigo 8º, Inciso I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.403.408,08	0,94%	25.804	0,26%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.563.794,55	0,43%	40.998	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	7.347.629,37	2,03%	177	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÃO...	D+33	Não há	1.530.159,32	0,42%	170	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.521.871,98	0,70%	128	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.621.103,30	0,72%	2.256	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	4.695.636,34	1,29%	63	0,70%	Artigo 9º, Inciso II
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	D+5 du	Não há	917.921,10	0,25%	49	0,14%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	1.553.431,19	0,43%	76	1,27%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+6 du	Não há	1.271.675,72	0,35%	187	0,71%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	1.325.826,27	0,37%	371	0,49%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	13.752.725,86	3,79%	522	0,62%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	9.105.360,50	2,51%	136	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	9.358.243,12	2,58%	12.074	0,45%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.582.000,00	0,44%		1,59%	Artigo 11º

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			362.694.815,85				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.762.946,99	Artigo 6º			
PL Total			366.457.762,84				

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

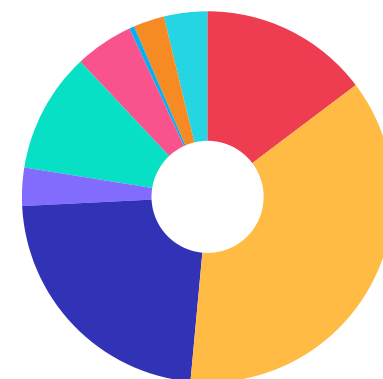
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a '	100,00%	53.378.712,21	14,72%	1,00%	15,00%	30,00%	55.429.732,55
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	133.306.691,58	36,75%	20,00%	36,00%	85,00%	174.983.901,89
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.134.740,79
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.134.740,79
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	60,00%	82.470.519,13	22,74%	0,00%	0,50%	65,00%	153.281.111,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.134.740,79
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	10,00%	22,00%	55,00%	199.482.148,72
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.134.740,79
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	5,00%	12.037.795,48	3,32%	0,00%	3,50%	10,00%	24.231.686,11
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.134.740,79
Total Renda Fixa	100,00%	281.193.718,40	77,53%	31,00%	77,00%	270,00%	



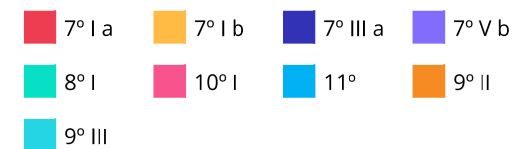
■ RENDA FIXA 281.193.718,40
■ RENDA VARIÁVEL 57.983.880,97
■ EXTERIOR 23.517.216,48

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	37.938.277,35	10,46%	0,00%	8,00%	20,00%	34.600.685,82
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.134.740,79
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	18.463.603,62	5,09%	1,00%	4,00%	10,00%	17.805.877,97
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.134.740,79
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.134.740,79
Artigo 11º	5,00%	1.582.000,00	0,44%	0,00%	1,00%	5,00%	16.552.740,79
Total Renda Variável	30,00%	57.983.880,97	15,99%	1,00%	13,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	36.269.481,59
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	9.764.490,62	2,69%	0,00%	4,00%	10,00%	26.504.990,97
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	13.752.725,86	3,79%	0,00%	6,00%	10,00%	22.516.755,73
Total Exterior	10,00%	23.517.216,48	6,48%	0,00%	10,00%	30,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	125.046.549,14	34,48	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	97.165.687,89	26,79	0,00
BANESTES DTVM	76.801.698,84	21,18	0,82
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	53.378.712,21	14,72	-
GENIAL INVESTIMENTOS	2.825.106,91	0,78	0,04
OCCAM BRASIL	2.621.103,30	0,72	0,01
VINCI PARTNERS	2.521.871,98	0,70	0,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.325.826,27	0,37	0,02
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.008.259,31	0,28	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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)

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
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	4,86%	2,58%	4,86%	6,94%	8,89%	0,17%	0,01%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	5,03%	2,70%	5,03%	7,36%	8,38%	0,13%	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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	7,21%	3,04%	7,21%	11,84%	19,81%	1,43%	0,03%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,22%	3,27%	2,37%	3,27%	3,37%	3,37%	1,44%	0,06%
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%

IMA-B (Benchmark)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%	-	-
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%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,33%	3,59%	1,23%	3,59%	0,03%	4,98%	2,19%	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%

IRF-M (Benchmark)	0,37%	2,19%	0,83%	2,19%	1,76%	1,90%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,34%	2,11%	0,81%	2,11%	1,51%	1,42%	1,76%	0,04%
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%	-	-
------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---

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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,03%	5,54%	2,90%	5,54%	8,98%	11,54%	0,01%	0,01%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,04%	5,70%	3,02%	5,70%	9,48%	13,50%	0,03%	0,01%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,77%	3,96%	2,18%	3,96%	5,92%	6,49%	0,01%	0,01%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,82%	5,23%	2,68%	5,23%	6,93%	9,41%	0,29%	0,02%

IPCA (Benchmark)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%	-	-
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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	6,88%	2,83%	6,88%	10,99%	17,56%	1,27%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	7,18%	3,03%	7,18%	11,77%	18,68%	1,42%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,23%	4,59%	2,22%	4,59%	3,73%	6,51%	1,57%	0,03%
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%

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
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%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-9,04%	1,33%	-12,41%	1,33%	-12,62%	12,31%	7,07%	0,19%

Ibovespa (Benchmark)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-10,81%	-2,24%	-16,40%	-2,24%	-21,51%	0,93%	8,22%	0,22%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-11,05%	-5,03%	-15,73%	-5,03%	-22,86%	2,62%	9,03%	0,20%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-10,66%	-13,14%	-20,86%	-13,14%	-43,16%	-30,19%	9,02%	0,22%
OCCAM FIC AÇÕES	-8,92%	-4,02%	-14,14%	-4,02%	-19,95%	4,19%	9,17%	0,18%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-12,77%	-7,24%	-16,81%	-7,24%	-17,83%	14,76%	9,44%	0,20%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-11,84%	-13,02%	-16,34%	-13,02%	-33,06%	-10,23%	9,60%	0,18%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-10,52%	-3,62%	-10,56%	-3,62%	-15,12%	21,27%	8,01%	0,17%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-9,07%	-1,74%	-12,39%	-1,74%	-22,33%	-	7,98%	0,18%

SMLL (Benchmark)	-16,33%	-19,69%	-24,72%	-19,69%	-39,59%	-15,65%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-11,16%	-11,97%	-17,17%	-11,97%	-29,80%	-3,42%	7,76%	0,16%

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 BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,82%	4,59%	-0,02%	4,59%	3,57%	12,16%	1,93%	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%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,49%	-7,27%	-2,15%	-7,27%	-24,46%	-59,44%	3,61%	0,12%

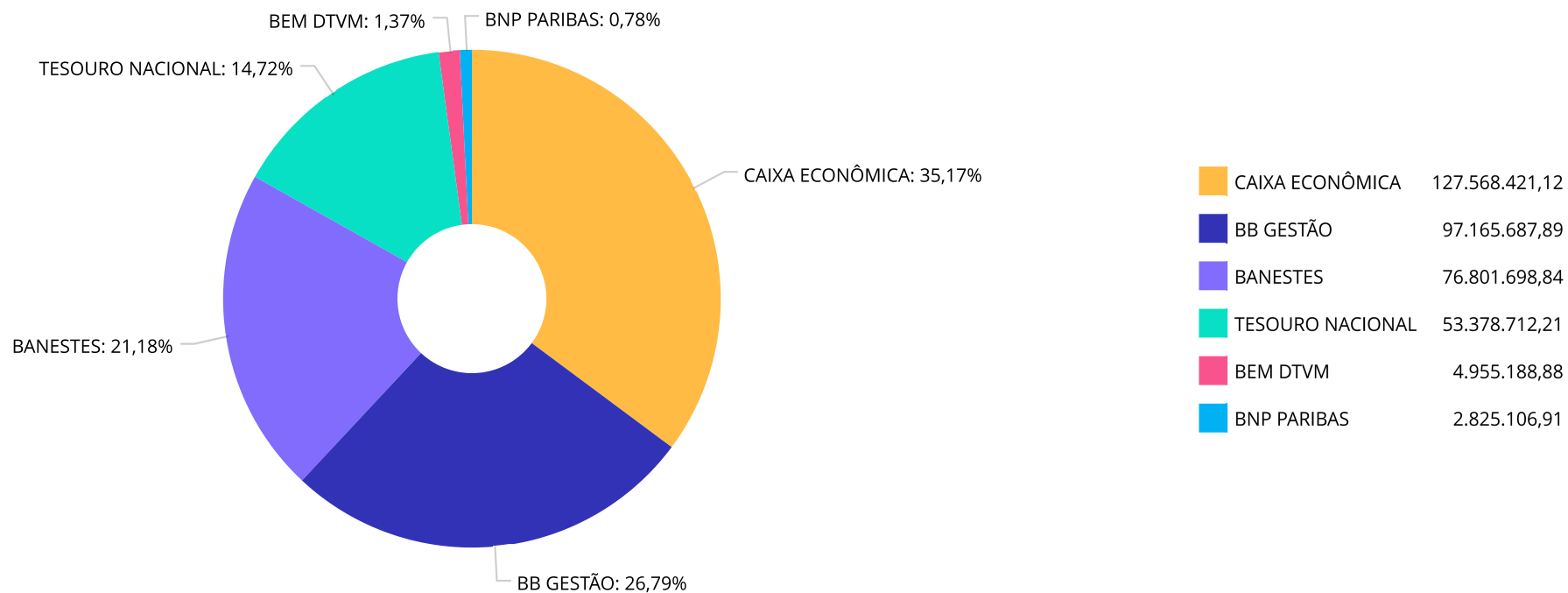
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%

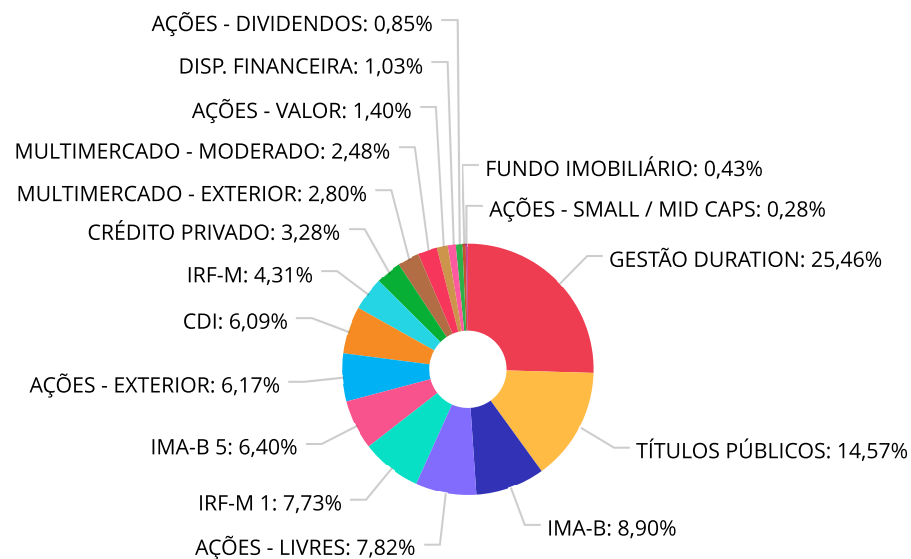
MSCI WORLD (Benchmark)	1,05%	-26,05%	-7,80%	-26,05%	-11,63%	10,62%	-	-
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-0,05%	-60,02%	-36,07%	-60,02%	-60,24%	-	29,15%	0,40%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	0,42%	-24,43%	-6,67%	-24,43%	-10,89%	18,84%	10,29%	0,17%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-2,23%	-28,67%	-7,85%	-28,67%	-11,83%	20,06%	11,58%	0,22%

MSCI ACWI (Benchmark)	1,26%	-25,79%	-7,28%	-25,79%	-13,20%	8,75%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	0,33%	-27,32%	-8,82%	-27,32%	-14,58%	-	10,12%	0,19%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2,38%	-23,87%	-2,64%	-23,87%	-6,54%	-	11,88%	0,20%

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



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



■ GESTÃO DURATION	93.284.086,39	■ TÍTULOS PÚBLICOS	53.378.712,21	■ IMA-B	32.615.506,27	■ AÇÕES - LIVRES	28.656.570,63
■ IRF-M 1	28.343.503,59	■ IMA-B 5	23.440.414,35	■ AÇÕES - EXTERIOR	22.599.295,38	■ CDI	22.311.335,64
■ IRF-M	15.782.364,47	■ CRÉDITO PRIVADO	12.037.795,48	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	10.276.164,22	■ MULTIMERCADO - MODERADO	9.105.360,50
■ AÇÕES - VALOR	5.142.975,28	■ DISP. FINANCEIRA	3.762.946,99	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	3.130.472,13	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.582.000,00
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.008.259,31						

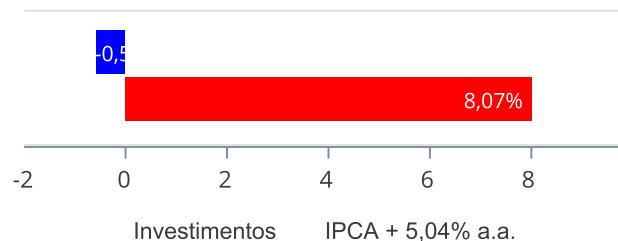
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2022)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	08/02/2022	2.430	4117,023852	4.201,239668	10.004.367,96	10.209.012,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/02/2022	2.475	4041,475328	4.201,239668	10.002.651,44	10.398.068,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	09/03/2022	730	3957,411381	4.063,427723	2.888.910,31	2.966.302,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/04/2022	1.560	4217,247417	4.239,907361	6.578.905,97	6.614.255,48	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	29/12/2021	665	4.198,229405	4.429,116809	2.791.822,55	2.945.362,68	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/02/2022	617	3968,953944	4.220,410108	2.448.844,58	2.603.993,04	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/02/2022	202	3968,953944	4.220,410108	801.728,70	852.522,84	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	602	4175,438692	4.316,027158	2.513.614,09	2.598.248,35	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	878	4175,438692	4.316,027158	3.666.035,17	3.789.471,84	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	100	4175,438692	4.316,027158	417.543,87	431.602,72	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	140	4164,883793	4.215,930363	583.083,73	590.230,25	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	35	4164,883793	4.215,930363	145.770,93	147.557,56	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	15/12/2021	707	4.267,647108	4.523,350878	3.017.226,51	3.198.009,07	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	06/05/2022	611	4076,821575	4.157,127730	2.490.937,98	2.540.005,04	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	03/06/2022	830	4087,350009	4.121,975282	3.392.500,51	3.421.239,48	Curva

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	352.002.609,19	5.605.389,69	7.761.443,36	347.406.335,02	-2.440.220,50	-2.440.220,50	-0,69%	-0,69%	0,95%	0,95%	-72,76%	3,27%
Fevereiro	347.406.335,02	26.051.407,10	22.275.826,48	350.653.934,91	-527.980,73	-2.968.201,23	-0,15%	-0,84%	1,39%	2,35%	-35,83%	3,23%
Março	350.653.934,91	8.009.351,50	5.209.806,65	359.504.349,25	6.050.869,49	3.082.668,26	1,71%	0,85%	2,06%	4,46%	19,18%	3,72%
Abril	359.504.349,25	16.995.562,95	14.467.694,37	358.601.103,24	-3.431.114,59	-348.446,33	-0,95%	-0,10%	1,44%	5,96%	-1,69%	3,16%
Mai	358.601.103,24	9.050.868,19	6.392.299,99	363.477.704,95	2.218.033,51	1.869.587,18	0,61%	0,51%	0,90%	6,91%	7,41%	3,60%
Junho	363.477.704,95	28.487.999,05	25.419.120,78	362.635.041,38	-3.911.541,84	-2.041.954,66	-1,07%	-0,56%	1,08%	8,07%	-6,94%	3,33%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

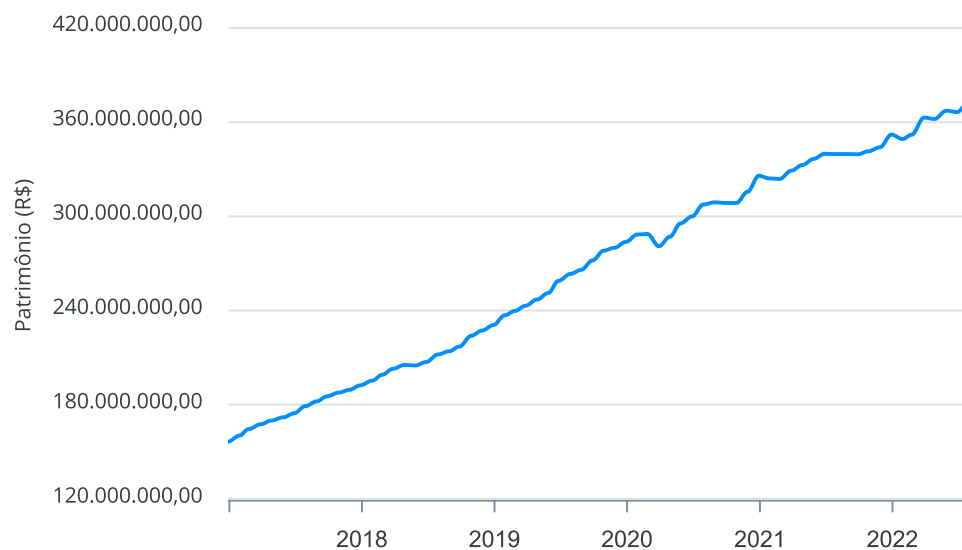


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

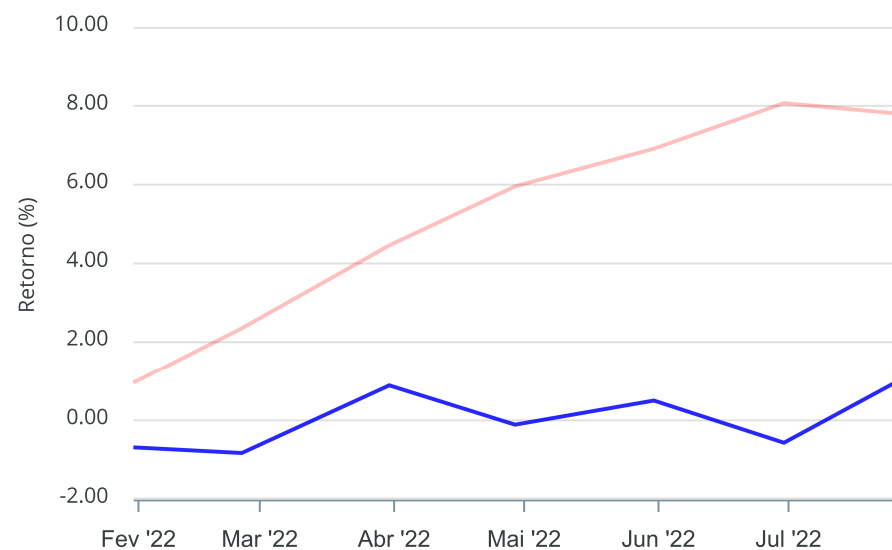
ANO

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
TÍTULOS PÚBLICOS	49.476.723,43	3.392.500,50	0,00	53.378.712,21	509.488,28	0,96%	-	-
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.442.345,14	0,00	0,00	20.634.403,65	192.058,51	0,94%	0,94%	0,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.639.581,55	0,00	0,00	7.709.099,94	69.518,39	0,91%	0,91%	0,17%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	20.476.848,30	0,00	0,00	20.644.501,60	167.653,30	0,82%	0,82%	0,29%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.092.751,21	10.151.098,74	565.012,02	10.769.159,77	90.321,84	0,80%	1,04%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	821.413,93	10.000.000,00	0,00	10.908.331,75	86.917,82	0,80%	1,03%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	37.607.561,47	0,00	0,00	37.781.543,76	173.982,29	0,46%	0,46%	0,81%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	11.996.744,38	0,00	0,00	12.037.795,48	41.051,10	0,34%	0,34%	1,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	27.941,03	0,00	0,00	28.034,24	93,21	0,33%	0,33%	1,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.377.597,56	0,00	0,00	5.394.598,18	17.000,62	0,32%	0,32%	1,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	571.860,57	0,00	0,00	573.640,54	1.779,97	0,31%	0,31%	1,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	7.363.335,50	0,00	0,00	7.384.297,64	20.962,14	0,28%	0,28%	1,27%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	34.777.908,31	0,00	0,00	34.858.041,03	80.132,72	0,23%	0,23%	1,57%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.037.618,75	0,00	0,00	10.059.843,75	22.225,00	0,22%	0,22%	1,44%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.872.625,00	0,00	0,00	8.892.210,00	19.585,00	0,22%	0,22%	1,44%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.869.386,06	0,00	10.000.000,00	9.894.988,88	25.602,82	0,13%	0,34%	1,76%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	523.277,84	4.944.399,81	4.840.358,76	633.844,12	6.525,23	0,12%	0,77%	0,01%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.199.010,00	0,00	0,00	9.195.075,00	-3.935,00	-0,04%	-0,04%	2,85%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.894.887,09	0,00	10.000.000,00	5.887.375,59	-7.511,50	-0,05%	0,34%	1,76%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.837.408,19	0,00	0,00	12.795.083,14	-42.325,05	-0,33%	-0,33%	2,19%

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 NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.739.347,98	0,00	0,00	1.733.138,13	-6.209,85	-0,36%	-0,36%	2,06%
Total Renda Fixa	276.646.173,29	28.487.999,05	25.405.370,78	281.193.718,40	1.464.916,84	0,52%		1,07%

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.574.250,00	0,00	13.750,00	1.582.000,00	21.500,00	1,37%	0,49%	3,61%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	9.180.906,95	0,00	0,00	9.105.360,50	-75.546,45	-0,82%	-0,82%	1,93%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10.147.756,83	0,00	0,00	9.358.243,12	-789.513,71	-7,78%	-7,78%	13,68%
OCCAM FIC AÇÕES	2.877.817,98	0,00	0,00	2.621.103,30	-256.714,68	-8,92%	-8,92%	9,17%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.682.187,21	0,00	0,00	1.530.159,32	-152.027,89	-9,04%	-9,04%	7,07%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.759.849,14	0,00	0,00	1.600.312,81	-159.536,33	-9,07%	-9,07%	7,98%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	8.211.880,52	0,00	0,00	7.347.629,37	-864.251,15	-10,52%	-10,52%	8,01%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	10.884.365,65	0,00	0,00	9.724.393,75	-1.159.971,90	-10,66%	-10,66%	9,02%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.827.444,94	0,00	0,00	2.521.871,98	-305.572,96	-10,81%	-10,81%	8,22%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	7.439.608,46	0,00	0,00	6.617.344,88	-822.263,58	-11,05%	-11,05%	9,03%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.134.900,29	0,00	0,00	1.008.259,31	-126.640,98	-11,16%	-11,16%	7,76%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.773.732,20	0,00	0,00	1.563.794,55	-209.937,65	-11,84%	-11,84%	9,60%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.901.405,93	0,00	0,00	3.403.408,08	-497.997,85	-12,76%	-12,76%	9,44%
Total Renda Variável	63.396.106,10	0,00	13.750,00	57.983.880,97	-5.398.475,13	-8,52%		8,29%

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
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.517.353,07	0,00	0,00	1.553.431,19	36.078,12	2,38%	2,38%	11,88%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.639.859,63	0,00	0,00	13.752.725,86	112.866,23	0,83%	0,83%	12,50%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	914.053,78	0,00	0,00	917.921,10	3.867,32	0,42%	0,42%	10,29%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	1.321.473,12	0,00	0,00	1.325.826,27	4.353,15	0,33%	0,33%	10,12%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	1.272.281,95	0,00	0,00	1.271.675,72	-606,23	-0,05%	-0,05%	29,15%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	4.802.513,15	0,00	0,00	4.695.636,34	-106.876,81	-2,23%	-2,23%	11,58%
Total Exterior	23.467.534,70	0,00	0,00	23.517.216,48	49.681,78	0,21%		12,95%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TÍTULOS PÚBLICOS	31.640.529,91	20.597.756,74	731.592,64	53.378.712,21	1.872.018,20	3,58%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	39.094.452,61	0,00	5.000.000,00	34.858.041,03	763.588,42	1,95%	2,22%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	42.020.055,65	0,00	5.000.000,00	37.781.543,76	761.488,11	1,81%	2,02%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.078.768,07	13.590,22	0,00	20.634.403,65	542.045,36	2,70%	2,70%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	20.106.307,24	0,00	0,00	20.644.501,60	538.194,36	2,68%	2,68%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	11.743.269,94	0,00	0,00	12.037.795,48	294.525,54	2,51%	2,51%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.826.700,00	0,00	0,00	10.059.843,75	233.143,75	2,37%	2,37%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.686.100,00	0,00	0,00	8.892.210,00	206.110,00	2,37%	2,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	7.180.924,93	0,00	0,00	7.384.297,64	203.372,71	2,83%	2,83%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.514.960,77	0,00	0,00	7.709.099,94	194.139,17	2,58%	2,58%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.021.910,00	0,00	0,00	9.195.075,00	173.165,00	1,92%	1,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.235.332,82	0,00	0,00	5.394.598,18	159.265,36	3,04%	3,04%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.639.733,10	0,00	0,00	12.795.083,14	155.350,04	1,23%	1,23%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.139.415,12	10.151.098,74	1.644.996,63	10.769.159,77	123.642,54	1,01%	3,02%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.787.159,49	0,00	10.000.000,00	9.894.988,88	107.829,39	0,54%	0,76%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	911.827,70	10.000.000,00	106.447,99	10.908.331,75	102.952,04	0,94%	2,90%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.820.222,78	0,00	10.000.000,00	5.887.375,59	67.152,81	0,42%	0,81%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.709.268,33	0,00	0,00	1.733.138,13	23.869,80	1,40%	1,40%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	600.574,48	13.771.984,49	13.756.327,88	633.844,12	17.613,03	0,12%	2,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	556.787,54	0,00	0,00	573.640,54	16.853,00	3,03%	3,03%

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	27.309,58	0,00	0,00	28.034,24	724,66	2,65%	2,65%
Total Renda Fixa	266.341.610,06	54.534.430,19	46.239.365,14	281.193.718,40	6.557.043,29	2,39%	

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.616.750,00	0,00	39.750,00	1.582.000,00	5.000,00	0,31%	-2,15%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	9.107.086,66	0,00	0,00	9.105.360,50	-1.726,16	-0,02%	-0,02%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.217.200,50	0,00	0,00	1.008.259,31	-208.941,19	-17,17%	-17,17%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.746.963,46	0,00	0,00	1.530.159,32	-216.804,14	-12,41%	-12,41%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.826.582,46	0,00	0,00	1.600.312,81	-226.269,65	-12,39%	-12,39%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.869.303,97	0,00	0,00	1.563.794,55	-305.509,42	-16,34%	-16,34%
OCCAM FIC AÇÕES	3.052.749,39	0,00	0,00	2.621.103,30	-431.646,09	-14,14%	-14,14%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.016.533,80	0,00	0,00	2.521.871,98	-494.661,82	-16,40%	-16,40%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.091.187,14	0,00	0,00	3.403.408,08	-687.779,06	-16,81%	-16,81%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	8.215.327,74	0,00	0,00	7.347.629,37	-867.698,37	-10,56%	-10,56%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	7.852.781,45	0,00	0,00	6.617.344,88	-1.235.436,57	-15,73%	-15,73%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11.006.920,87	0,00	0,00	9.358.243,12	-1.648.677,75	-14,98%	-14,98%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	12.287.490,54	0,00	0,00	9.724.393,75	-2.563.096,79	-20,86%	-20,86%
Total Renda Variável	66.906.877,98	0,00	39.750,00	57.983.880,97	-8.883.247,01	-13,28%	

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
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.595.582,45	0,00	0,00	1.553.431,19	-42.151,26	-2,64%	-2,64%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	983.499,82	0,00	0,00	917.921,10	-65.578,72	-6,67%	-6,67%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	1.454.102,59	0,00	0,00	1.325.826,27	-128.276,32	-8,82%	-8,82%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	5.095.466,15	0,00	0,00	4.695.636,34	-399.829,81	-7,85%	-7,85%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	1.989.244,49	0,00	0,00	1.271.675,72	-717.568,77	-36,07%	-36,07%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	15.317.778,91	0,00	0,00	13.752.725,86	-1.565.053,05	-10,22%	-10,22%
Total Exterior	26.435.674,41	0,00	0,00	23.517.216,48	-2.918.457,93	-11,04%	

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
TÍTULOS PÚBLICOS	5.828.535,46	45.942.531,02	1.080.276,82	53.378.712,21	2.687.922,55	5,19%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	48.113.243,58	0,00	15.000.000,00	34.858.041,03	1.744.797,45	3,63%	4,59%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	51.048.889,44	0,00	15.000.000,00	37.781.543,76	1.732.654,32	3,39%	4,30%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	19.617.800,12	0,00	0,00	20.644.501,60	1.026.701,48	5,23%	5,23%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.676.529,44	13.590,22	43.742,54	20.634.403,65	988.026,53	5,02%	5,03%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	11.317.524,84	0,00	0,00	12.037.795,48	720.270,64	6,36%	6,36%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.718.356,25	0,00	245.029,77	10.059.843,75	586.517,27	6,04%	3,51%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.610.515,00	0,00	237.044,32	8.892.210,00	518.739,32	6,02%	3,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	7.104.683,66	0,00	197.563,23	7.384.297,64	477.177,21	6,72%	6,88%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.352.129,84	0,00	0,00	12.795.083,14	442.953,30	3,59%	3,59%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.971.480,00	0,00	169.124,01	9.195.075,00	392.719,01	4,38%	2,49%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.518.442,57	0,00	10.000.000,00	9.894.988,88	376.546,31	1,93%	2,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.176.190,47	0,00	145.958,16	5.394.598,18	364.365,87	7,04%	7,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.352.069,95	0,00	0,00	7.709.099,94	357.029,99	4,86%	4,86%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.619.055,79	0,00	10.000.000,00	5.887.375,59	268.319,80	1,72%	2,11%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.157.927,13	11.610.409,07	3.185.859,20	10.769.159,77	186.682,77	1,36%	5,70%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	535.595,94	10.359.328,95	106.447,99	10.908.331,75	119.854,85	1,10%	5,54%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.663.170,90	0,00	0,00	1.733.138,13	69.967,23	4,21%	4,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	550.859,29	0,00	15.807,56	573.640,54	38.588,81	7,01%	7,18%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	353.407,08	24.574.719,22	24.320.338,03	633.844,12	26.055,85	0,10%	3,96%

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	26.320,42	0,00	0,00	28.034,24	1.713,82	6,51%	6,51%
Total Renda Fixa	255.312.727,17	92.500.578,48	79.747.191,63	281.193.718,40	13.127.604,38	4,90%	

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 BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	8.705.904,27	0,00	0,00	9.105.360,50	399.456,23	4,59%	4,59%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.510.123,08	0,00	0,00	1.530.159,32	20.036,24	1,33%	1,33%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.628.571,03	0,00	0,00	1.600.312,81	-28.258,22	-1,74%	-1,74%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.706.000,00	0,00	79.000,00	1.582.000,00	-45.000,00	-2,64%	-7,27%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.579.597,45	0,00	0,00	2.521.871,98	-57.725,47	-2,24%	-2,24%
OCCAM FIC AÇÕES	2.730.829,83	0,00	0,00	2.621.103,30	-109.726,53	-4,02%	-4,02%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.145.345,55	0,00	0,00	1.008.259,31	-137.086,24	-11,97%	-11,97%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.797.918,39	0,00	0,00	1.563.794,55	-234.123,84	-13,02%	-13,02%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.669.215,98	0,00	0,00	3.403.408,08	-265.807,90	-7,24%	-7,24%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.933.732,71	1.700.000,00	0,00	7.347.629,37	-286.103,34	-3,75%	-3,62%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	6.967.568,17	0,00	0,00	6.617.344,88	-350.223,29	-5,03%	-5,03%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	11.194.859,29	0,00	0,00	9.724.393,75	-1.470.465,54	-13,14%	-13,14%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11.353.170,79	0,00	0,00	9.358.243,12	-1.994.927,67	-17,57%	-17,57%
Total Renda Variável	60.922.836,54	1.700.000,00	79.000,00	57.983.880,97	-4.559.955,57	-7,29%	

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 SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	1.214.576,21	0,00	0,00	917.921,10	-296.655,11	-24,42%	-24,42%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.040.422,82	0,00	0,00	1.553.431,19	-486.991,63	-23,87%	-23,87%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	1.824.211,38	0,00	0,00	1.325.826,27	-498.385,11	-27,32%	-27,32%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	6.582.500,44	0,00	0,00	4.695.636,34	-1.886.864,10	-28,66%	-28,66%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	3.180.930,68	0,00	0,00	1.271.675,72	-1.909.254,96	-60,02%	-60,02%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	21.000.357,90	0,00	1.700.000,00	13.752.725,86	-5.547.632,04	-26,42%	-27,83%
Total Exterior	35.842.999,43	0,00	1.700.000,00	23.517.216,48	-10.625.782,95	-29,65%	

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.