

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

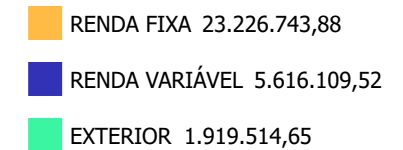
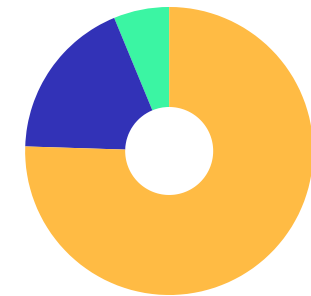
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	908.280,38	2,95%	439	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	3.870.496,11	12,58%	1.077	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.509.730,56	4,91%	820	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	412.456,73	1,34%	241	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	492.774,67	1,60%	179	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.291.746,41	10,70%	868	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.553.561,72	8,30%	1.073	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.165.842,72	10,29%	1.024	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	497.178,04	1,62%	50	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.511.372,24	4,91%	547	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.383.505,18	4,50%	974	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	304.389,74	0,99%	948	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.318.208,77	4,29%	204	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	510.891,91	1,66%	588	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	854.966,09	2,78%	92	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	132.484,49	0,43%	248	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	508.858,12	1,65%	171	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	112.109,04	0,36%	743	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	796.846,15	2,59%	33.893	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	284.056,40	0,92%	7.477	0,21%	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
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.439.119,72	4,68%	1.797	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	538.274,89	1,75%	100	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	130.445,14	0,42%	8.170	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	358.427,95	1,17%	3.850	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	D+3	Não há	404.070,04	1,31%	12.032	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	286.222,05	0,93%	17.281	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.633.292,60	5,31%	522	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	431.629,22	1,40%	222.952	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.121.130,97	3,64%	12.074	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			30.762.368,05				

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

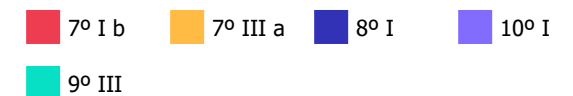
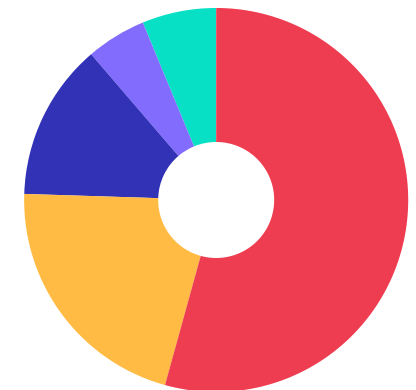
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,86%	59,24%	18.223.626,83
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	16.702.067,34	54,29%	0,00%	15,86%	59,24%	1.521.559,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	6.524.676,54	21,21%	0,00%	15,81%	50,00%	8.856.507,49
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,81%	20,00%	6.152.473,61
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,78%	5,00%	1.538.118,40
Total Renda Fixa	100,00%	23.226.743,88	75,50%	0,00%	66,12%	193,48%	



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%	4.063.349,33	13,21%	0,00%	20,00%	20,00%	2.089.124,28
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,09%	20,00%	6.152.473,61
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.552.760,19	5,05%	0,00%	2,78%	10,00%	1.523.476,62
Total Renda Variável	30,00%	5.616.109,52	18,26%	0,00%	27,87%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.919.514,65	6,24%	0,00%	5,00%	10,00%	1.156.722,16
Total Exterior	10,00%	1.919.514,65	6,24%	0,00%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	15.418.987,49	50,12	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.945.823,78	42,08	0,00
ITAÚ UNIBANCO	2.265.072,29	7,36	0,00
ITAÚ DTVM	132.484,49	0,43	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
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%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	0,22%	6,39%	2,47%	6,39%	9,61%	16,46%	1,44%	0,04%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%	-	-
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%
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%
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%

IMA-B (Benchmark)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,65%	4,18%	1,00%	4,18%	3,54%	10,75%	2,23%	0,07%

CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
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%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	3,71%	1,67%	3,71%	4,01%	6,69%	1,11%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,06%	5,60%	2,97%	5,60%	9,19%	11,59%	0,04%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,04%	5,69%	2,94%	5,69%	9,23%	11,71%	0,03%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	5,52%	2,87%	5,52%	8,84%	10,78%	0,01%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,95%	5,91%	2,99%	5,91%	11,12%	13,61%	0,36%	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
IPCA (Benchmark)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	7,13%	3,08%	7,13%	10,31%	16,86%	1,37%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	4,30%	2,02%	4,30%	5,27%	8,66%	0,81%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,23%	4,59%	2,22%	4,59%	3,73%	6,51%	1,57%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,79%	5,28%	2,57%	5,28%	8,95%	10,68%	0,42%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,34%	-27,01%	-8,36%	-27,01%	-10,80%	14,52%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,02%	-27,37%	-9,82%	-27,37%	-11,10%	9,17%	11,56%	0,20%
S&P 500 (Benchmark)	-8,39%	-20,58%	-16,45%	-20,58%	-11,92%	22,10%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-7,44%	-17,82%	-14,85%	-17,82%	-7,14%	28,23%	14,21%	0,18%
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%
Ibovespa (Benchmark)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-14,47%	-25,32%	-28,92%	-25,32%	-47,15%	-39,19%	10,10%	0,21%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-11,79%	-6,80%	-18,32%	-6,80%	-24,50%	2,17%	9,10%	0,22%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-11,05%	-5,03%	-15,73%	-5,03%	-22,86%	2,62%	9,03%	0,20%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-11,26%	-5,82%	-17,60%	-5,82%	-22,15%	3,40%	8,71%	0,21%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-10,34%	-1,37%	-12,54%	-1,37%	-11,64%	8,62%	8,25%	0,20%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-14,29%	-25,31%	-28,75%	-25,31%	-46,89%	-38,86%	10,10%	0,21%
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%	-	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,05%	5,26%	2,81%	5,26%	8,48%	12,36%	0,21%	0,01%

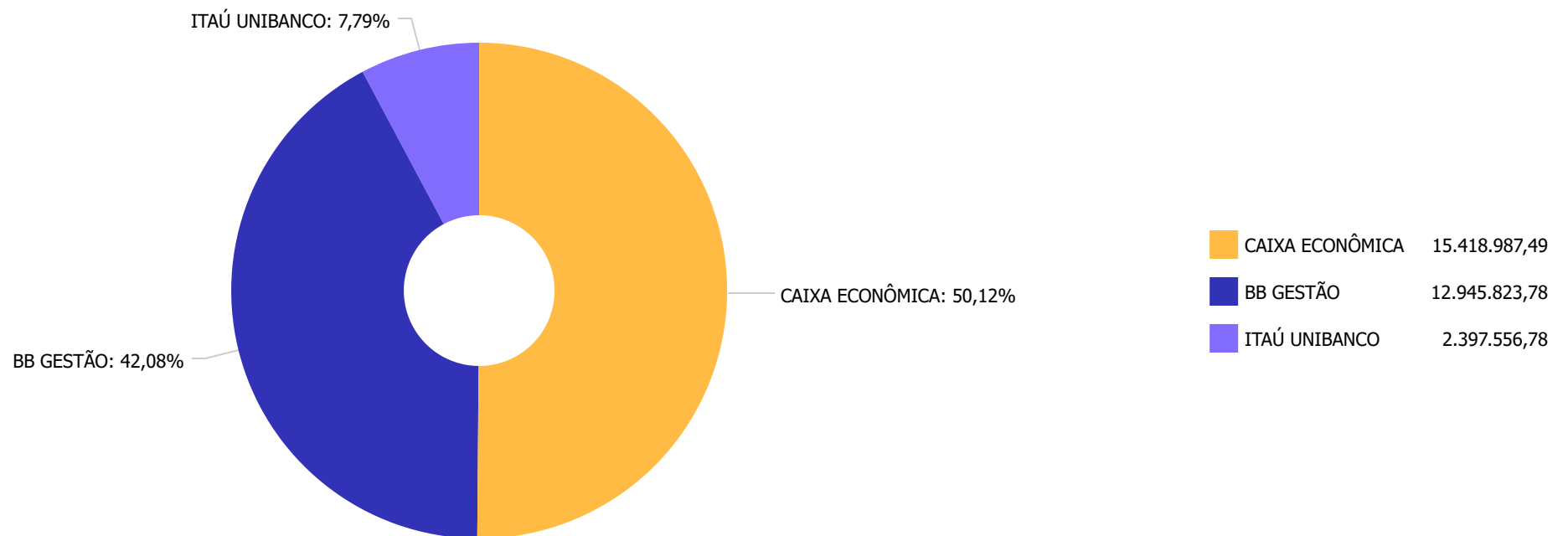
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%

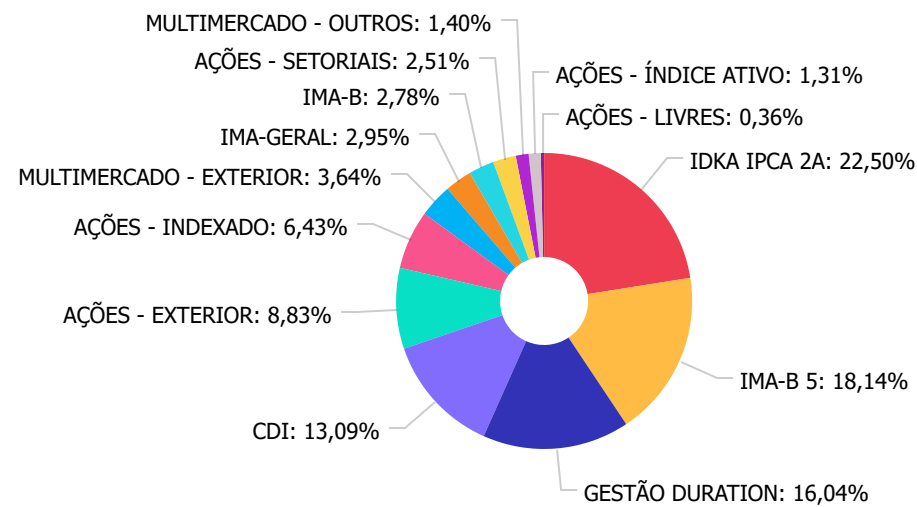
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,34%	-27,01%	-8,36%	-27,01%	-10,80%	14,52%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,02%	-27,37%	-9,82%	-27,37%	-11,10%	9,17%	11,56%	0,20%
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%

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



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

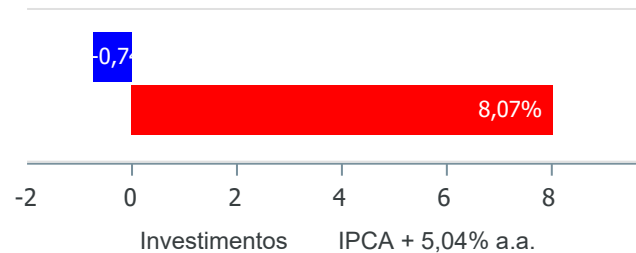


IDKA IPCA 2A	6.921.235,87	IMA-B 5	5.580.804,68	GESTÃO DURATION	4.935.603,14	CDI	4.025.853,72
AÇÕES - EXTERIOR	2.716.360,80	AÇÕES - INDEXADO	1.977.394,61	MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.121.130,97	IMA-GERAL	908.280,38
IMA-B	854.966,09	AÇÕES - SETORIAIS	772.929,49	MULTIMERCADO - OUTROS	431.629,22	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	404.070,04
AÇÕES - LIVRES	112.109,04						

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	28.531.635,46	0,00	0,00	28.414.641,10	-116.994,36	-116.994,36	-0,41%	-0,41%	0,95%	0,95%	-43,04%	3,62%
Fevereiro	28.414.641,10	875.295,99	400.674,27	28.885.872,25	-3.390,57	-120.384,93	-0,01%	-0,42%	1,39%	2,35%	-17,94%	3,26%
Março	28.885.872,25	498.780,08	0,00	30.037.722,87	653.070,54	532.685,61	2,22%	1,79%	2,06%	4,46%	40,19%	3,86%
Abril	30.037.722,87	498.140,04	0,00	30.052.990,05	-482.872,86	49.812,75	-1,58%	0,18%	1,44%	5,96%	3,05%	3,24%
Mai	30.052.990,05	1.002.607,04	11.844,11	31.246.708,40	202.955,42	252.768,17	0,65%	0,84%	0,90%	6,91%	12,10%	3,58%
Junho	31.246.708,40	2.866,22	0,00	30.762.368,05	-487.206,57	-234.438,40	-1,56%	-0,74%	1,08%	8,07%	-9,11%	3,45%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



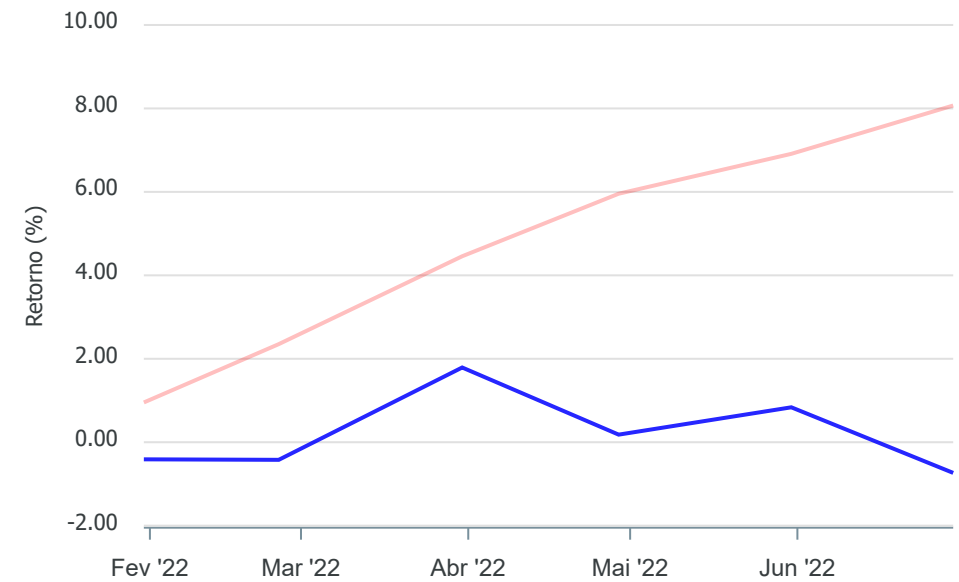
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B
☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1
☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	301.195,23	0,00	0,00	304.389,74	3.194,51	1,06%	1,06%	0,04%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1.304.671,08	0,00	0,00	1.318.208,77	13.537,69	1,04%	1,04%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.366.618,66	2.866,22	0,00	1.383.505,18	14.020,30	1,02%	1,03%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	505.716,20	0,00	0,00	510.891,91	5.175,71	1,02%	1,02%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	504.085,75	0,00	0,00	508.858,12	4.772,37	0,95%	0,95%	0,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	131.452,21	0,00	0,00	132.484,49	1.032,28	0,79%	0,79%	0,42%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.504.412,44	0,00	0,00	1.511.372,24	6.959,80	0,46%	0,46%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.155.317,23	0,00	0,00	3.165.842,72	10.525,49	0,33%	0,33%	1,23%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	905.297,61	0,00	0,00	908.280,38	2.982,77	0,33%	0,33%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	411.110,27	0,00	0,00	412.456,73	1.346,46	0,33%	0,33%	1,37%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.504.949,49	0,00	0,00	1.509.730,56	4.781,07	0,32%	0,32%	1,26%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.860.223,82	0,00	0,00	3.870.496,11	10.272,29	0,27%	0,27%	1,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.284.179,23	0,00	0,00	3.291.746,41	7.567,18	0,23%	0,23%	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.547.845,94	0,00	0,00	2.553.561,72	5.715,78	0,22%	0,22%	1,39%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	496.078,85	0,00	0,00	497.178,04	1.099,19	0,22%	0,22%	1,44%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	491.685,99	0,00	0,00	492.774,67	1.088,68	0,22%	0,22%	1,44%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	860.572,20	0,00	0,00	854.966,09	-5.606,11	-0,65%	-0,65%	2,23%
Total Renda Fixa	23.135.412,20	2.866,22	0,00	23.226.743,88	88.465,46	0,38%		1,13%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	427.138,21	0,00	0,00	431.629,22	4.491,01	1,05%	1,05%	0,21%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	860.930,13	0,00	0,00	796.846,15	-64.083,98	-7,44%	-7,44%	14,21%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.215.715,84	0,00	0,00	1.121.130,97	-94.584,87	-7,78%	-7,78%	13,68%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	399.748,56	0,00	0,00	358.427,95	-41.320,61	-10,34%	-10,34%	8,25%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	453.376,67	0,00	0,00	404.070,04	-49.306,63	-10,88%	-10,88%	8,39%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	126.039,58	0,00	0,00	112.109,04	-13.930,54	-11,05%	-11,05%	9,03%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	606.566,25	0,00	0,00	538.274,89	-68.291,36	-11,26%	-11,26%	8,71%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.631.410,16	0,00	0,00	1.439.119,72	-192.290,44	-11,79%	-11,79%	9,10%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	152.191,84	0,00	0,00	130.445,14	-21.746,70	-14,29%	-14,29%	10,10%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	332.120,84	0,00	0,00	284.056,40	-48.064,44	-14,47%	-14,47%	10,10%
Total Renda Variável	6.205.238,08	0,00	0,00	5.616.109,52	-589.128,56	-9,49%		9,99%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.619.888,45	0,00	0,00	1.633.292,60	13.404,15	0,83%	0,83%	12,50%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	286.169,67	0,00	0,00	286.222,05	52,38	0,02%	0,02%	11,56%
Total Exterior	1.906.058,12	0,00	0,00	1.919.514,65	13.456,53	0,71%		12,36%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.774.527,61	0,00	0,00	3.870.496,11	95.968,50	2,54%	2,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.084.009,24	0,00	0,00	3.165.842,72	81.833,48	2,65%	2,65%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.220.233,87	0,00	0,00	3.291.746,41	71.512,54	2,22%	2,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.491.400,71	0,00	0,00	2.553.561,72	62.161,01	2,50%	2,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.340.400,09	4.175,34	0,00	1.383.505,18	38.929,75	2,90%	2,90%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.459.433,66	11.833,11	0,00	1.509.730,56	38.463,79	2,61%	2,63%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1.280.516,81	0,00	0,00	1.318.208,77	37.691,96	2,94%	2,94%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.481.444,09	0,00	0,00	1.511.372,24	29.928,15	2,02%	2,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	893.326,84	0,00	0,00	908.280,38	14.953,54	1,67%	1,67%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	496.830,92	0,00	510.891,91	14.060,99	2,83%	2,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	411.577,28	0,00	11.844,11	412.456,73	12.723,56	3,09%	3,08%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	485.191,18	0,00	0,00	497.178,04	11.986,86	2,47%	2,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	0,00	499.087,94	0,00	508.858,12	9.770,18	1,96%	2,99%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	295.622,14	0,00	0,00	304.389,74	8.767,60	2,97%	2,97%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	846.468,29	0,00	0,00	854.966,09	8.497,80	1,00%	1,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	129.163,20	0,00	0,00	132.484,49	3.321,29	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	491.685,99	0,00	492.774,67	1.088,68	0,22%	2,37%
Total Renda Fixa	21.193.315,01	1.503.613,30	11.844,11	23.226.743,88	541.659,68	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
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	419.830,38	0,00	0,00	431.629,22	11.798,84	2,81%	2,81%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	133.039,43	0,00	0,00	112.109,04	-20.930,39	-15,73%	-15,73%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	409.822,18	0,00	0,00	358.427,95	-51.394,23	-12,54%	-12,54%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	183.087,89	0,00	0,00	130.445,14	-52.642,75	-28,75%	-28,75%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	492.853,24	0,00	0,00	404.070,04	-88.783,20	-18,01%	-18,01%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	653.206,25	0,00	0,00	538.274,89	-114.931,36	-17,59%	-17,59%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	399.632,01	0,00	0,00	284.056,40	-115.575,61	-28,92%	-28,92%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	935.858,44	0,00	0,00	796.846,15	-139.012,29	-14,85%	-14,85%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.318.644,93	0,00	0,00	1.121.130,97	-197.513,96	-14,98%	-14,98%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.761.899,25	0,00	0,00	1.439.119,72	-322.779,53	-18,32%	-18,32%
Total Renda Variável	6.707.874,00	0,00	0,00	5.616.109,52	-1.091.764,48	-16,28%	

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
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	317.373,41	0,00	0,00	286.222,05	-31.151,36	-9,82%	-9,82%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.819.160,45	0,00	0,00	1.633.292,60	-185.867,85	-10,22%	-10,22%
Total Exterior	2.136.533,86	0,00	0,00	1.919.514,65	-217.019,21	-10,16%	

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.635.745,71	0,00	0,00	3.870.496,11	234.750,40	6,46%	6,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.972.306,06	0,00	0,00	3.165.842,72	193.536,66	6,51%	6,51%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.399.676,66	0,00	0,00	2.553.561,72	153.885,06	6,41%	6,41%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.147.368,95	0,00	0,00	3.291.746,41	144.377,46	4,59%	4,59%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.161.076,18	260.572,73	0,00	1.509.730,56	88.081,65	6,20%	6,47%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.070.718,34	243.124,17	674,27	1.383.505,18	70.336,94	5,35%	5,54%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	767.254,86	486.387,62	0,00	1.318.208,77	64.566,29	5,15%	5,69%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.449.075,35	0,00	0,00	1.511.372,24	62.296,89	4,30%	4,30%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	820.675,81	0,00	0,00	854.966,09	34.290,28	4,18%	4,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	875.764,26	0,00	0,00	908.280,38	32.516,12	3,71%	3,71%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	467.340,08	0,00	0,00	497.178,04	29.837,96	6,38%	6,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	400.000,00	11.844,11	412.456,73	24.300,84	6,08%	7,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	288.257,26	0,00	0,00	304.389,74	16.132,48	5,60%	5,60%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	496.830,92	0,00	510.891,91	14.060,99	2,83%	5,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	0,00	499.087,94	0,00	508.858,12	9.770,18	1,96%	5,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	125.845,98	0,00	0,00	132.484,49	6.638,51	5,28%	5,28%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	491.685,99	0,00	492.774,67	1.088,68	0,22%	3,51%
Total Renda Fixa	19.181.105,50	2.877.689,37	12.518,38	23.226.743,88	1.180.467,39	5,35%	

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
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	410.043,38	0,00	0,00	431.629,22	21.585,84	5,26%	5,26%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	363.400,39	0,00	0,00	358.427,95	-4.972,44	-1,37%	-1,37%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	118.042,41	0,00	0,00	112.109,04	-5.933,37	-5,03%	-5,03%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	436.369,45	0,00	0,00	404.070,04	-32.299,41	-7,40%	-7,40%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	571.522,83	0,00	0,00	538.274,89	-33.247,94	-5,82%	-5,82%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	174.646,69	0,00	0,00	130.445,14	-44.201,55	-25,31%	-25,31%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.909.258,34	0,00	400.000,00	1.439.119,72	-70.138,62	-3,67%	-6,80%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	380.363,23	0,00	0,00	284.056,40	-96.306,83	-25,32%	-25,32%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	969.580,73	0,00	0,00	796.846,15	-172.734,58	-17,82%	-17,82%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.360.126,17	0,00	0,00	1.121.130,97	-238.995,20	-17,57%	-17,57%
Total Renda Variável	6.693.353,62	0,00	400.000,00	5.616.109,52	-677.244,10	-10,12%	

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.