

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

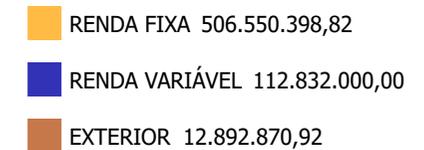
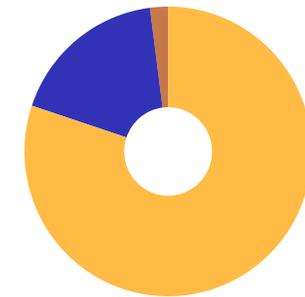
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	83.636.245,11	13,23%	1.077	0,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	85.634.385,87	13,54%	820	1,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	27.587.177,51	4,36%	1.068	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	803.280,29	0,13%	453	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	D+0	Não há	103.430.825,39	16,36%	100	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	14.722.645,77	2,33%	115	2,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	1.489.581,39	0,24%	165	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	188.053,99	0,03%	1.175	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	103.890.046,81	16,43%	547	2,77%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	28.081.424,34	4,44%	228	3,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	44.286.711,93	7,00%	974	0,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	12.800.020,42	2,02%	69	2,03%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	5.014.077,49	0,79%	33.893	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	6.195.671,95	0,98%	1.797	0,73%	Artigo 8º, Inciso I
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.491.336,46	1,82%	6.652	7,37%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.502.684,68	0,55%	40.998	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	13.405.551,73	2,12%	1.588	2,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	23.673.800,05	3,74%	177	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	6.292.810,98	1,00%	170	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	22.683.768,89	3,59%	128	0,00%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	4.532.273,45	0,72%	17.281	0,58%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	4.544.229,84	0,72%	152	0,33%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.816.367,63	0,60%	522	0,17%	Artigo 9º, Inciso III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	10.293.980,14	1,63%	222.952	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	5.334.253,32	0,84%	50.585	0,22%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.459.283,03	0,55%	9.294	0,37%	Artigo 10º, Inciso I
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	1.484.781,28	0,23%		0,06%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		240,90	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			632.275.269,74				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			240,90				Artigo 6º
PL Total			632.275.510,64				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	59,24%	374.559.869,79
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	317.492.195,32	50,21%	11,38%	28,34%	59,24%	57.067.674,47
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	176.258.183,08	27,88%	11,41%	30,42%	55,00%	171.493.215,28
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	126.455.053,95
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	12.800.020,42	2,02%	0,00%	2,78%	5,00%	18.813.743,07
Total Renda Fixa	100,00%	506.550.398,82	80,12%	22,79%	61,54%	198,48%	



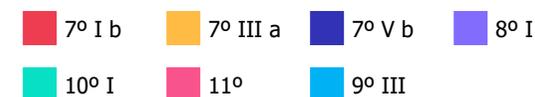
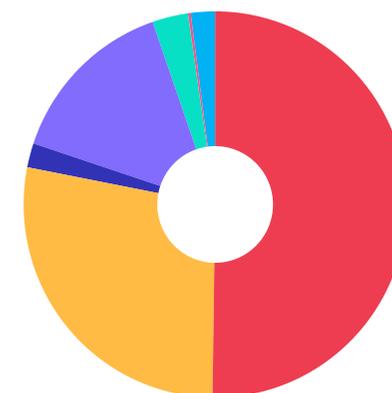
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	92.259.702,23	14,59%	11,21%	24,15%	25,00%	65.809.115,21
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,26%	25,00%	158.068.817,44
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	19.087.516,49	3,02%	2,09%	4,79%	10,00%	44.140.010,48
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,50%	15.806.881,74
Artigo 11º	5,00%	1.484.781,28	0,23%	0,00%	0,26%	0,26%	159.134,42
Total Renda Variável	35,00%	112.832.000,00	17,85%	13,30%	33,46%	62,76%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	1,88%	2,50%	10,00%	63.227.526,97
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	12.892.870,92	2,04%	1,88%	2,50%	10,00%	50.334.656,05
Total Exterior	10,00%	12.892.870,92	2,04%	3,76%	5,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	557.270.852,16	88,14	0,03
CAIXA DTVM	73.519.636,30	11,63	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	1.484.781,28	0,23	0,15

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	59,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	317.492.195,32	50,21	11,38	59,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	176.258.183,08	27,88	11,41	55,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	12.800.020,42	2,02	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	92.259.702,23	14,59	11,21	25,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	25,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	1,88	10,00
Artigo 9º, Inciso III	12.892.870,92	2,04	1,88	10,00
Artigo 10º, Inciso I	19.087.516,49	3,02	2,09	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	2,50
Artigo 11º	1.484.781,28	0,23	0,00	0,26
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%	-	-
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%	-	-
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%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,41%	4,26%	1,37%	4,26%	3,58%	10,95%	2,09%	0,06%
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%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,02%	5,42%	2,85%	5,42%	8,75%	11,00%	0,01%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,03%	5,54%	2,90%	5,54%	8,98%	11,54%	0,01%	0,01%

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 IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	7,18%	3,03%	7,18%	11,79%	19,50%	1,43%	0,03%
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 VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	7,18%	3,03%	7,18%	11,77%	18,68%	1,42%	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
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%	-	-
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%
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%	-	-
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-11,32%	-6,98%	-18,05%	-6,98%	-23,58%	1,31%	8,86%	0,21%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-11,84%	-13,02%	-16,34%	-13,02%	-33,06%	-10,23%	9,60%	0,18%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-11,79%	-6,80%	-18,32%	-6,80%	-24,50%	2,17%	9,10%	0,22%
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%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-10,81%	-2,24%	-16,40%	-2,24%	-21,51%	0,93%	8,22%	0,22%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,06%	5,55%	1,91%	5,55%	6,73%	10,54%	0,84%	0,02%

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

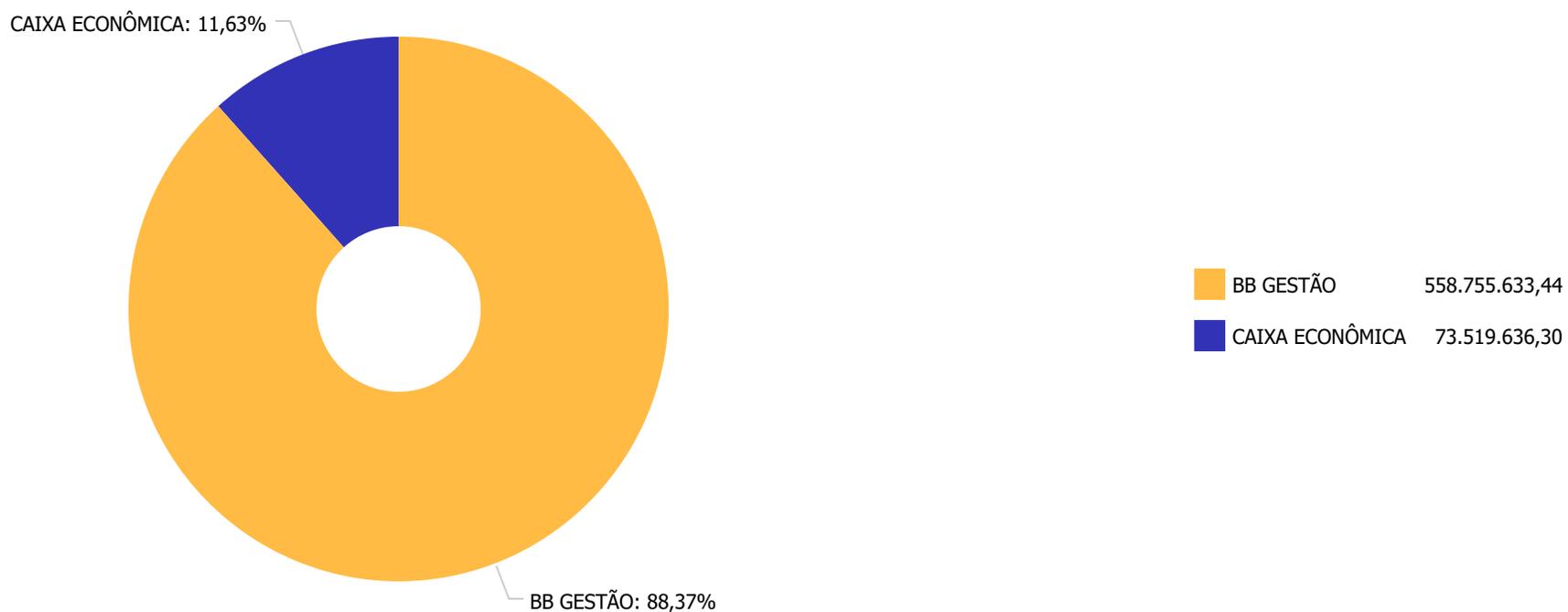
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,05%	5,26%	2,81%	5,26%	8,48%	12,36%	0,21%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-2,31%	3,37%	-2,88%	3,37%	0,22%	8,47%	2,56%	0,06%
IFIX (Benchmark)	-0,88%	-0,33%	0,56%	-0,33%	1,48%	-0,38%	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-0,08%	-	-

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

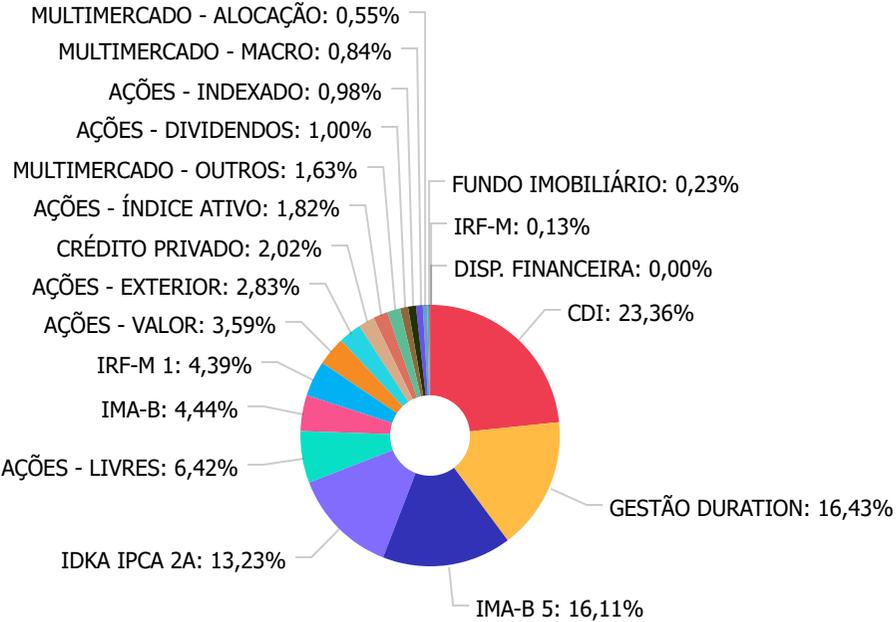
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,79%	-27,61%	-10,27%	-27,61%	-12,10%	12,50%	-	-
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,10%	-27,01%	-9,59%	-27,01%	-10,20%	11,63%	11,56%	0,20%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,02%	-27,37%	-9,82%	-27,37%	-11,10%	9,17%	11,56%	0,20%
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)

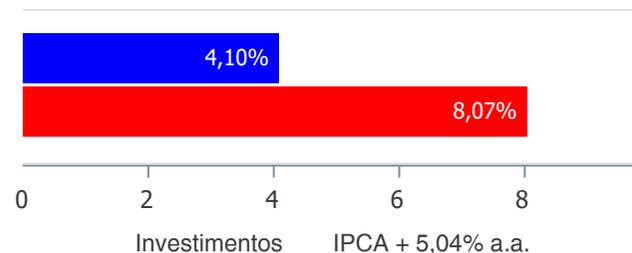


■ CDI	147.717.537,32	■ GESTÃO DURATION	103.890.046,81	■ IMA-B 5	101.846.613,03	■ IDKA IPCA 2A	83.636.245,11
■ AÇÕES - LIVRES	40.582.036,46	■ IMA-B	28.081.424,34	■ IRF-M 1	27.775.231,50	■ AÇÕES - VALOR	22.683.768,89
■ AÇÕES - EXTERIOR	17.906.948,41	■ CRÉDITO PRIVADO	12.800.020,42	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	11.491.336,46	■ MULTIMERCADO - OUTROS	10.293.980,14
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	6.292.810,98	■ AÇÕES - INDEXADO	6.195.671,95	■ MULTIMERCADO - MACRO	5.334.253,32	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	3.459.283,03
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.484.781,28	■ IRF-M	803.280,29	■ DISP. FINANCEIRA	240,90		

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	587.462.729,96	204.869.759,79	208.049.574,26	595.245.091,72	10.962.176,23	10.962.176,23	1,87%	1,87%	0,95%	0,95%	195,84%	3,38%
Fevereiro	595.245.091,72	103.904.945,09	99.713.144,83	602.419.852,19	2.982.960,21	13.945.136,44	0,50%	2,37%	1,39%	2,35%	100,92%	1,66%
Março	602.419.852,19	115.057.227,74	106.599.030,96	623.647.576,22	12.769.527,25	26.714.663,69	2,09%	4,51%	2,06%	4,46%	101,26%	2,45%
Abril	623.647.576,22	4.139.002,63	3.748.500,00	622.096.532,69	-1.941.546,16	24.773.117,53	-0,31%	4,19%	1,44%	5,96%	70,31%	1,93%
Mai	622.096.532,69	10.243.056,66	7.778.190,65	631.273.775,70	6.712.377,00	31.485.494,53	1,07%	5,31%	0,90%	6,91%	76,79%	2,17%
Junho	631.273.775,70	23.444.645,71	15.136.340,00	632.275.269,74	-7.306.811,67	24.178.682,86	-1,14%	4,10%	1,08%	8,07%	50,86%	2,18%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



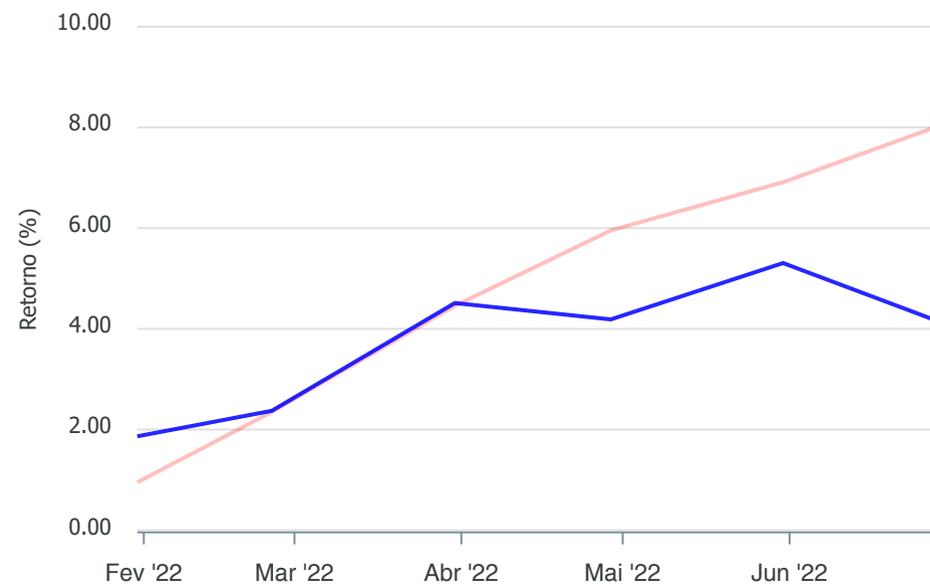
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	102.382.805,63	0,00	0,00	103.430.825,39	1.048.019,76	1,02%	1,02%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	41.245.908,79	7.725.178,88	5.136.340,00	44.286.711,93	451.964,26	0,92%	1,03%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	186.358,17	0,00	0,00	188.053,99	1.695,82	0,91%	0,91%	0,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	32.407.399,23	4.903.012,34	10.000.000,00	27.587.177,51	276.765,94	0,74%	0,92%	0,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	103.411.637,88	0,00	0,00	103.890.046,81	478.408,93	0,46%	0,46%	0,81%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	12.756.369,99	0,00	0,00	12.800.020,42	43.650,43	0,34%	0,34%	1,40%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	85.363.195,99	0,00	0,00	85.634.385,87	271.189,88	0,32%	0,32%	1,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	14.676.774,84	0,00	0,00	14.722.645,77	45.870,93	0,31%	0,31%	1,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.484.959,31	0,00	0,00	1.489.581,39	4.622,08	0,31%	0,31%	1,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	83.414.274,72	0,00	0,00	83.636.245,11	221.970,39	0,27%	0,27%	1,38%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	803.536,01	0,00	803.280,29	-255,72	-0,03%	0,34%	1,76%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.195.969,27	0,00	0,00	28.081.424,34	-114.544,93	-0,41%	-0,41%	2,09%
Total Renda Fixa	505.525.653,82	13.431.727,23	15.136.340,00	506.550.398,82	2.729.357,77	0,54%		0,82%

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	10.186.873,33	0,00	0,00	10.293.980,14	107.106,81	1,05%	1,05%	0,21%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	1.469.756,48	0,00	0,00	1.484.781,28	15.024,80	1,02%	0,00%	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.337.230,65	0,00	0,00	5.334.253,32	-2.977,33	-0,06%	-0,06%	0,84%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.541.151,97	0,00	0,00	3.459.283,03	-81.868,94	-2,31%	-2,31%	2,56%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.158.418,08	10.012.918,48	0,00	11.491.336,46	-680.000,10	-5,59%	-11,32%	8,86%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	5.417.319,78	0,00	0,00	5.014.077,49	-403.242,29	-7,44%	-7,44%	14,21%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	6.918.028,72	0,00	0,00	6.292.810,98	-625.217,74	-9,04%	-9,04%	7,07%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	14.976.033,28	0,00	0,00	13.405.551,73	-1.570.481,55	-10,49%	-10,49%	7,94%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	26.458.386,47	0,00	0,00	23.673.800,05	-2.784.586,42	-10,52%	-10,52%	8,01%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	25.432.340,81	0,00	0,00	22.683.768,89	-2.748.571,92	-10,81%	-10,81%	8,22%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	7.023.517,24	0,00	0,00	6.195.671,95	-827.845,29	-11,79%	-11,79%	9,10%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	3.972.916,15	0,00	0,00	3.502.684,68	-470.231,47	-11,84%	-11,84%	9,60%
Total Renda Variável	112.891.972,96	10.012.918,48	0,00	112.832.000,00	-10.072.891,44	-8,20%		7,23%

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	3.785.047,36	0,00	0,00	3.816.367,63	31.320,27	0,83%	0,83%	12,50%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.539.657,58	0,00	0,00	4.544.229,84	4.572,26	0,10%	0,10%	11,56%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.531.443,98	0,00	0,00	4.532.273,45	829,47	0,02%	0,02%	11,56%
Total Exterior	12.856.148,92	0,00	0,00	12.892.870,92	36.722,00	0,29%		11,83%

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	100.560.812,78	0,00	0,00	103.430.825,39	2.870.012,61	2,85%	2,85%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	83.436.539,00	0,00	0,00	85.634.385,87	2.197.846,87	2,63%	2,63%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	81.562.494,08	0,00	0,00	83.636.245,11	2.073.751,03	2,54%	2,54%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	101.832.819,53	0,01	0,00	103.890.046,81	2.057.227,27	2,02%	2,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	35.974.850,59	16.053.251,82	8.877.340,00	44.286.711,93	1.135.949,52	2,18%	2,90%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	39.554.306,13	4.909.716,53	17.778.190,65	27.587.177,51	901.345,50	2,03%	2,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	14.289.589,79	0,00	0,00	14.722.645,77	433.055,98	3,03%	3,03%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.483.776,34	1.241.301,49	0,00	28.081.424,34	356.346,51	1,29%	1,36%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	12.486.845,73	0,00	0,00	12.800.020,42	313.174,69	2,51%	2,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.445.818,94	0,00	0,00	1.489.581,39	43.762,45	3,03%	3,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	17.201,42	167.627,65	0,00	188.053,99	3.224,92	1,74%	2,58%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	803.536,01	0,00	803.280,29	-255,72	-0,03%	0,81%
Total Renda Fixa	497.645.054,33	23.175.433,51	26.655.530,65	506.550.398,82	12.385.441,63	2,38%	

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	10.012.587,91	0,00	0,00	10.293.980,14	281.392,23	2,81%	2,81%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.234.119,64	0,00	0,00	5.334.253,32	100.133,68	1,91%	1,91%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	1.453.075,04	0,00	7.500,00	1.484.781,28	39.206,24	2,70%	0,00%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.561.678,48	0,00	0,00	3.459.283,03	-102.395,45	-2,87%	-2,87%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,00	12.018.391,46	0,00	11.491.336,46	-527.055,00	-4,39%	-18,05%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	4.186.983,77	0,00	0,00	3.502.684,68	-684.299,09	-16,34%	-16,34%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	5.888.798,91	0,00	0,00	5.014.077,49	-874.721,42	-14,85%	-14,85%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	7.184.422,35	0,00	0,00	6.292.810,98	-891.611,37	-12,41%	-12,41%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	4.585.073,37	2.632.880,03	0,00	6.195.671,95	-1.022.281,45	-14,16%	-18,32%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	15.990.551,85	0,00	0,00	13.405.551,73	-2.585.000,12	-16,17%	-16,17%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	26.469.493,27	0,00	0,00	23.673.800,05	-2.795.693,22	-10,56%	-10,56%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	27.133.159,90	0,00	0,00	22.683.768,89	-4.449.391,01	-16,40%	-16,40%
Total Renda Variável	111.699.944,49	14.651.271,49	7.500,00	112.832.000,00	-13.511.715,98	-10,69%	



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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.250.668,27	0,00	0,00	3.816.367,63	-434.300,64	-10,22%	-10,22%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.026.359,73	0,00	0,00	4.544.229,84	-482.129,89	-9,59%	-9,59%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5.025.549,40	0,00	0,00	4.532.273,45	-493.275,95	-9,82%	-9,82%
Total Exterior	14.302.577,40	0,00	0,00	12.892.870,92	-1.409.706,48	-9,86%	

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 IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	25.383.149,29	55.000.000,00	0,00	85.634.385,87	5.251.236,58	6,53%	6,47%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.527.222,26	65.003.641,17	0,00	83.636.245,11	5.105.381,68	6,50%	6,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	23.606.362,71	75.755.813,42	0,00	103.890.046,81	4.527.870,68	4,56%	4,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI ...	38.392.876,79	94.241.515,46	33.540.000,00	103.430.825,39	4.336.433,14	3,27%	5,42%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	51.710.057,10	8.877.340,00	44.286.711,93	1.453.994,83	2,81%	5,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	629.731,39	47.668.265,99	21.980.190,65	27.587.177,51	1.269.370,78	2,63%	4,85%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	55.780.519,83	168.040,68	56.956.812,77	0,00	1.008.252,26	1,80%	4,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	14.126.382,78	0,00	394.972,39	14.722.645,77	991.235,38	7,02%	7,18%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	12.034.142,74	0,00	0,00	12.800.020,42	765.877,68	6,36%	6,36%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	27.368.340,70	0,00	28.081.424,34	713.083,64	2,61%	4,26%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	56.652.875,40	0,00	56.819.066,52	0,00	166.191,12	0,29%	6,41%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	99.396.302,12	0,00	99.498.403,22	0,00	102.101,10	0,10%	4,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.430.424,99	0,00	41.047,75	1.489.581,39	100.204,15	7,01%	7,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	38.310.457,41	0,00	38.401.476,63	0,00	91.019,22	0,24%	6,51%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	5.022.122,29	0,00	5.091.399,60	0,00	69.277,31	1,38%	6,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	184.829,07	0,00	188.053,99	3.224,92	1,74%	4,86%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	803.536,01	0,00	803.280,29	-255,72	-0,03%	2,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	11.908.884,69	9.103.326,53	20.958.159,02	0,00	-54.052,20	-0,26%	4,25%
				Total Renda Fixa	25.900.446,55	5,39%	

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 INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	38.436.503,07	0,00	41.356.240,95	0,00	2.919.737,88	7,60%	-5,82%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	30.435.785,57	0,00	33.076.516,92	0,00	2.640.731,35	8,68%	-6,95%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	10.000.000,00	0,00	10.293.980,14	293.980,14	2,94%	5,26%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.053.702,27	0,00	0,00	5.334.253,32	280.551,05	5,55%	5,55%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.280.263,08	0,00	9.438.835,69	0,00	158.572,61	1,71%	4,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.346.578,31	0,00	0,00	3.459.283,03	112.704,72	3,37%	3,37%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	1.436.017,28	0,00	53.100,00	1.484.781,28	101.864,00	7,09%	0,00%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	6.210.411,53	0,00	0,00	6.292.810,98	82.399,45	1,33%	1,33%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.208.136,66	0,00	3.283.739,84	0,00	75.603,18	2,36%	4,59%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	4.018.180,95	2.632.880,03	0,00	6.195.671,95	-455.389,03	-6,85%	-6,80%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	23.202.998,81	0,00	0,00	22.683.768,89	-519.229,92	-2,24%	-2,24%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	4.027.089,89	0,00	0,00	3.502.684,68	-524.405,21	-13,02%	-13,02%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,00	12.018.391,46	0,00	11.491.336,46	-527.055,00	-4,39%	-6,98%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	12.068.699,26	0,00	11.257.478,75	0,00	-811.220,51	-6,72%	-19,47%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	24.564.111,97	0,00	0,00	23.673.800,05	-890.311,92	-3,62%	-3,62%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	6.100.993,15	0,00	0,00	5.014.077,49	-1.086.915,66	-17,82%	-17,82%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	14.583.837,20	0,00	0,00	13.405.551,73	-1.178.285,47	-8,08%	-8,08%
				Total Renda Variável	673.331,66	0,32%	

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 AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	5.000.000,00	0,00	4.544.229,84	-455.770,16	-9,12%	-27,01%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	5.000.000,00	0,00	4.532.273,45	-467.726,55	-9,35%	-27,37%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.287.966,27	0,00	0,00	3.816.367,63	-1.471.598,64	-27,83%	-27,83%
				Total Exterior	-2.395.095,35	-15,67%	

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.