

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

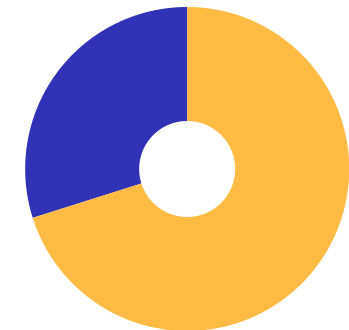
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	365.044,35	0,84%	1.077	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.559.436,05	3,60%	1.068	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.539.140,68	3,56%	317	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.134.485,17	11,87%	868	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.135.445,97	9,56%	1.073	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.524.817,59	8,15%	1.024	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	71.395,17	0,16%	798	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	997.859,00	2,31%	3.831	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.493.527,20	5,76%	176	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.054.555,93	2,44%	253	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	875.466,54	2,02%	214	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.415.170,30	10,20%	248	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.055.011,41	2,44%	282	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.121.704,37	7,21%	33	2,25%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	883.733,14	2,04%	33	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	714.688,31	1,65%	2.100	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	418.542,81	0,97%	4.019	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.924.478,88	4,45%	158	0,45%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	514.037,38	1,19%	177	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.975.612,87	4,57%	99	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
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	948.875,53	2,19%	85	0,37%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	486.632,39	1,12%	19	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	482.520,86	1,12%	34	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.301.105,01	3,01%	204	0,41%	Artigo 10º, Inciso I
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.294.074,10	2,99%	27	0,66%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.033.016,69	2,39%	136	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	950.855,36	2,20%		0,64%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		21,36	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			43.271.233,06				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			21,36	Artigo 6º			
PL Total			43.271.254,42				

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%	5,00%	59,24%	25.633.878,46
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	17.327.623,98	40,04%	12,37%	28,82%	59,24%	8.306.254,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	65,00%	9.893.731,38	22,86%	11,91%	25,07%	52,31%	12.741.450,63
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	8.654.246,61
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a '	5,00%	3.121.704,37	7,21%	0,00%	7,69%	7,69%	205.853,45
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,78%	5,00%	2.163.561,65
Total Renda Fixa	100,00%	30.343.059,73	70,12%	24,28%	74,36%	203,48%	



RENDA FIXA 30.343.059,73

RENDA VARIÁVEL 12.928.173,33

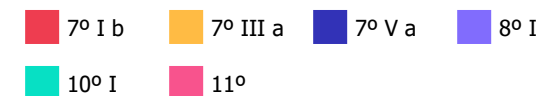
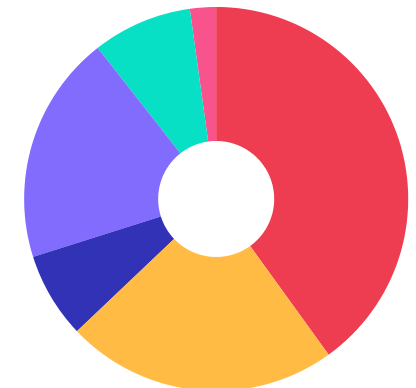
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	8.349.122,17	19,29%	11,21%	14,93%	25,00%	2.468.686,10
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	25,00%	10.817.808,27
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	3.628.195,80	8,38%	2,09%	2,78%	10,00%	698.927,51
Artigo 11º	5,00%	950.855,36	2,20%	0,00%	1,93%	1,93%	-115.720,56
Total Renda Variável	35,00%	12.928.173,33	29,88%	13,30%	20,64%	61,93%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	4.327.123,31
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	4.327.123,31
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	16.827.805,19	38,89	-
ITAÚ UNIBANCO	8.394.670,11	19,40	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	6.766.636,11	15,64	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.358.816,53	10,07	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.121.704,37	7,21	0,60
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	997.859,00	2,31	0,01
TRÍGONO CAPITAL	969.153,25	2,24	0,02
ZION INVEST	950.855,36	2,20	1,05
AZ QUEST INVESTIMENTOS	883.733,14	2,04	0,00

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'	17.327.623,98	40,04	12,37	59,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	9.893.731,38	22,86	11,91	52,31
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	3.121.704,37	7,21	0,00	7,69
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	8.349.122,17	19,29	11,21	25,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	25,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	3.628.195,80	8,38	2,09	10,00
Artigo 11º	950.855,36	2,20	0,00	1,93

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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,24%	9,06%	3,93%	9,06%	19,72%	38,75%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,15%	-2,57%	1,96%	-2,57%	-9,09%	-17,45%	0,47%	0,05%
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%
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%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,33%	6,07%	2,50%	6,07%	8,94%	14,54%	1,24%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,38%	4,25%	1,39%	4,25%	3,52%	10,96%	2,05%	0,06%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08%	5,71%	3,07%	5,71%	9,36%	12,01%	0,02%	0,01%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	5,28%	2,85%	5,28%	8,43%	10,54%	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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,10%	5,89%	3,06%	5,89%	9,64%	12,36%	0,07%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,88%	4,59%	2,50%	4,59%	7,12%	8,63%	0,01%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,32%	4,08%	1,69%	4,08%	4,75%	6,86%	1,08%	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%

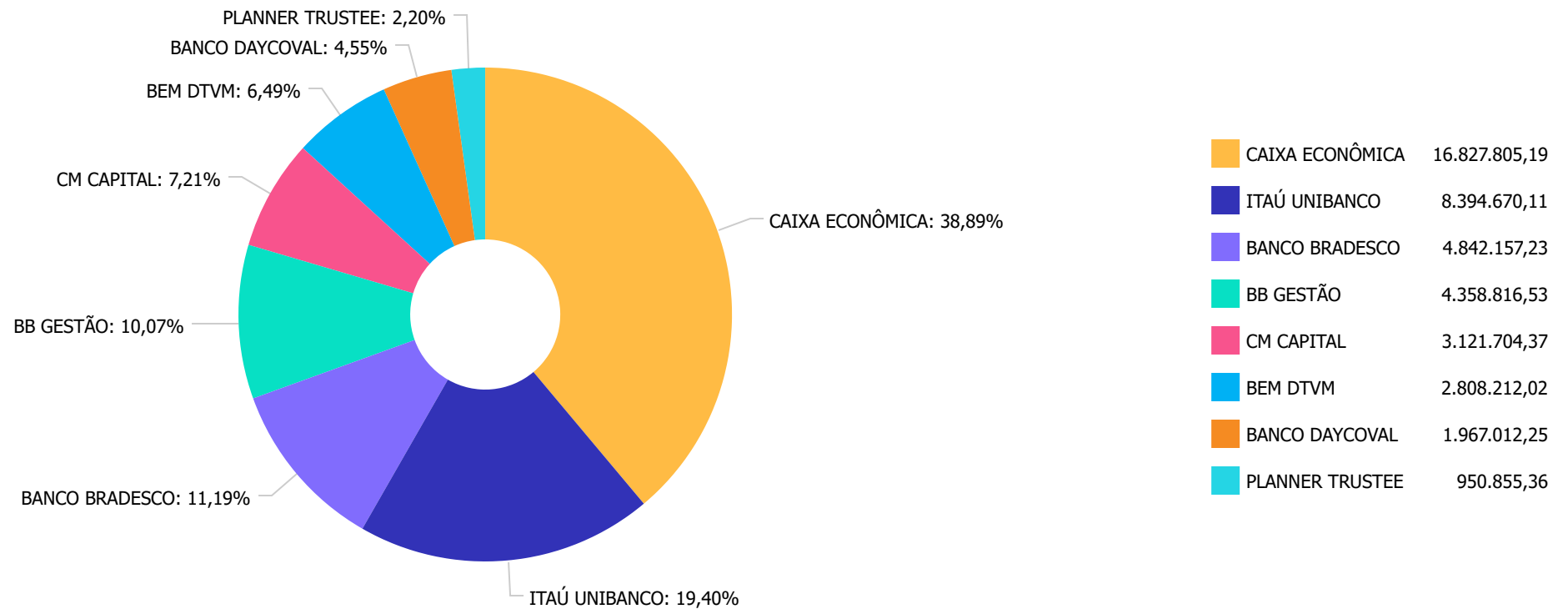
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-11,61%	-8,53%	-15,87%	-8,53%	-16,66%	12,69%	9,62%	0,18%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-10,83%	-4,56%	-15,26%	-4,56%	-18,64%	12,46%	6,71%	0,19%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-11,17%	-5,01%	-15,12%	-5,01%	-25,98%	-0,10%	8,29%	0,21%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-10,52%	-3,62%	-10,56%	-3,62%	-15,12%	21,27%	8,01%	0,17%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-10,66%	-8,38%	-18,33%	-8,38%	-	-	8,54%	0,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-10,46%	-10,71%	-19,62%	-10,71%	-32,68%	-18,43%	8,99%	0,21%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-15,33%	-3,17%	-3,63%	-3,17%	-6,87%	-	10,92%	0,25%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-14,19%	-7,88%	-7,74%	-7,88%	-15,15%	60,91%	10,54%	0,24%
SMLL (Benchmark)	-16,33%	-19,69%	-24,72%	-19,69%	-39,59%	-15,65%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-10,73%	-11,30%	-16,44%	-11,30%	-29,34%	-2,88%	7,53%	0,15%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,22%	4,93%	2,03%	4,93%	7,29%	9,81%	0,48%	0,02%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,78%	5,07%	2,68%	5,07%	5,85%	8,21%	0,24%	0,02%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,82%	4,59%	-0,02%	4,59%	3,57%	12,16%	1,93%	0,04%
IFIX (Benchmark)	-0,88%	-0,33%	0,56%	-0,33%	1,48%	-0,38%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-10,92%	50,18%	7,22%	50,18%	413,58%	485,92%	15,00%	0,99%

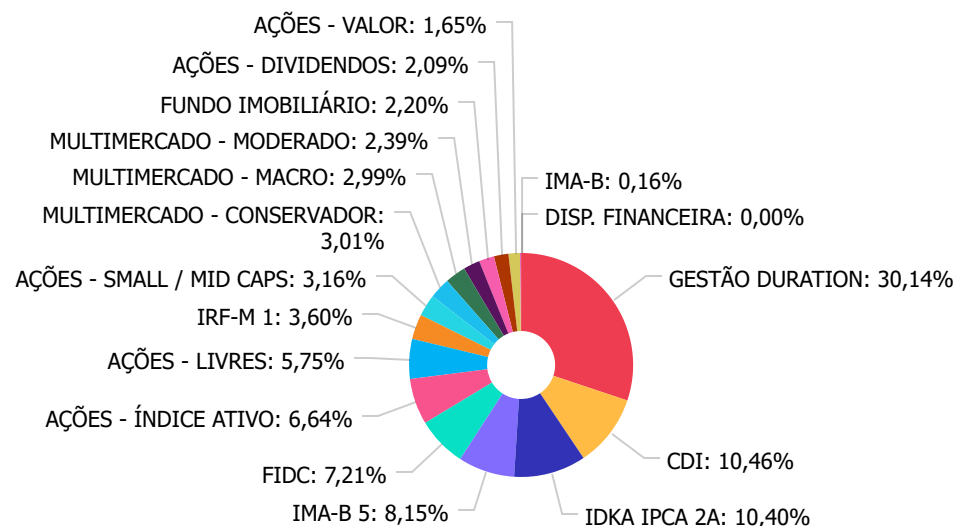
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - RENDA VARIÁVEL

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

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



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

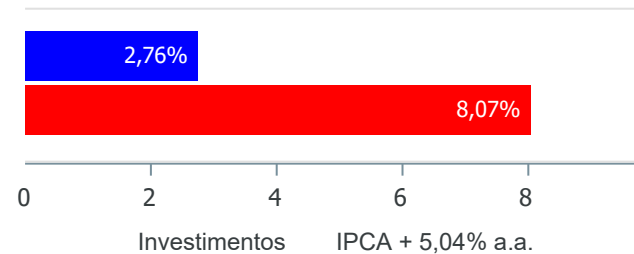


■ GESTÃO DURATION	13.041.041,67	■ CDI	4.524.174,56	■ IDKA IPCA 2A	4.500.490,32
■ IMA-B 5	3.524.817,59	■ FIDC	3.121.704,37	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.873.354,41
■ AÇÕES - LIVRES	2.489.650,25	■ IRF-M 1	1.559.436,05	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.366.254,00
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.301.105,01	■ MULTIMERCADO - MACRO	1.294.074,10	■ MULTIMERCADO - MODERADO	1.033.016,69
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	950.855,36	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	905.175,20	■ AÇÕES - VALOR	714.688,31
■ IMA-B	71.395,17	■ DISP. FINANCEIRA	21,36		

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	41.791.077,51	633.693,68	29.789,52	42.610.684,53	215.702,86	215.702,86	0,51%	0,51%	0,95%	0,95%	53,40%	3,23%
Fevereiro	42.610.684,53	1.197.771,01	1.237.690,40	42.902.946,76	332.181,62	547.884,48	0,78%	1,29%	1,39%	2,35%	54,97%	2,35%
Março	42.902.946,76	1.206.159,88	1.240.719,50	44.165.139,98	1.296.752,84	1.844.637,32	3,02%	4,35%	2,06%	4,46%	97,69%	3,57%
Abril	44.165.139,98	1.312.590,82	1.337.099,52	43.770.233,07	-370.398,21	1.474.239,11	-0,84%	3,48%	1,44%	5,96%	58,41%	2,82%
Maio	43.770.233,07	1.306.984,22	1.389.301,15	44.264.358,42	576.442,28	2.050.681,39	1,32%	4,84%	0,90%	6,91%	70,05%	2,67%
Junho	44.264.358,42	8.808.557,99	8.921.546,65	43.271.233,06	-880.136,70	1.170.544,69	-1,99%	2,76%	1,08%	8,07%	34,16%	2,69%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



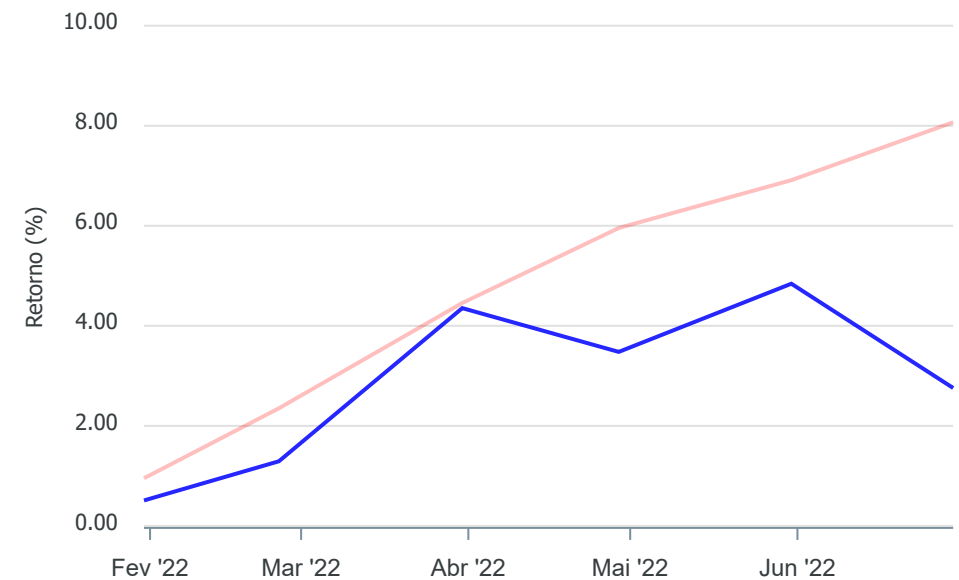
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.086.266,14	0,00	0,00	3.121.704,37	35.438,23	1,15%	-0,50%	0,47%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	866.850,70	0,00	0,00	875.466,54	8.615,84	0,99%	0,99%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.545.248,94	0,00	0,00	1.559.436,05	14.187,11	0,92%	0,92%	0,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.883.227,71	500.000,00	0,00	4.415.170,30	31.942,59	0,73%	0,79%	0,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.050.000,00	0,00	1.055.011,41	5.011,41	0,48%	1,10%	0,07%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.050.000,00	0,00	1.054.555,93	4.555,93	0,43%	1,08%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.360.302,39	0,00	1.000.000,00	365.044,35	4.741,96	0,35%	0,27%	1,38%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.661.877,96	0,00	1.596.200,00	71.395,17	5.717,21	0,34%	-0,38%	2,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.799.503,26	0,00	287.450,05	3.524.817,59	12.764,38	0,34%	0,33%	1,23%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.485.498,63	0,00	0,00	2.493.527,20	8.028,57	0,32%	0,32%	1,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.122.681,85	0,00	0,00	5.134.485,17	11.803,32	0,23%	0,23%	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.723.849,38	500.000,00	1.100.000,00	4.135.445,97	11.596,59	0,22%	0,22%	1,39%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1.547.305,76	2.496.514,78	2.513.282,54	1.539.140,68	8.602,68	0,21%	0,88%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.212.043,21	1.212.570,85	0,00	527,64	0,04%	0,93%	0,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.212.785,56	0,00	1.212.043,21	0,00	-742,35	-0,06%	0,32%	1,26%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	997.859,00	-2.141,00	-0,21%	0,33%	1,24%
Total Renda Fixa	31.295.398,28	7.808.557,99	8.921.546,65	30.343.059,73	160.650,11	0,51%		0,87%

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
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.284.118,88	0,00	0,00	1.294.074,10	9.955,22	0,78%	0,78%	0,24%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.298.316,71	0,00	0,00	1.301.105,01	2.788,30	0,21%	0,21%	0,48%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.041.587,55	0,00	0,00	1.033.016,69	-8.570,86	-0,82%	-0,82%	1,93%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	486.632,39	-13.367,61	-2,67%	-15,33%	10,92%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	482.520,86	-17.479,14	-3,50%	-14,19%	10,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.206.487,28	0,00	0,00	1.975.612,87	-230.874,41	-10,46%	-10,46%	8,99%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	574.500,07	0,00	0,00	514.037,38	-60.462,69	-10,52%	-10,52%	8,01%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	1.062.133,76	0,00	0,00	948.875,53	-113.258,23	-10,66%	-10,66%	8,54%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	989.902,12	0,00	0,00	883.733,14	-106.168,98	-10,73%	-10,73%	7,53%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	469.388,42	0,00	0,00	418.542,81	-50.845,61	-10,83%	-10,83%	6,71%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.067.426,57	0,00	0,00	950.855,36	-116.571,21	-10,92%	-10,92%	15,00%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.166.551,28	0,00	0,00	1.924.478,88	-242.072,40	-11,17%	-11,17%	8,29%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	808.547,50	0,00	0,00	714.688,31	-93.859,19	-11,61%	-11,61%	9,62%
Total Renda Variável	12.968.960,14	1.000.000,00	0,00	12.928.173,33	-1.040.786,81	-7,45%		6,95%

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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.619.196,79	500.000,00	1.100.000,00	4.135.445,97	116.249,18	2,27%	2,50%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.147.831,61	0,00	125.000,00	5.134.485,17	111.653,56	2,17%	2,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.815.607,99	500.000,00	0,00	4.415.170,30	99.562,31	2,31%	2,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.713.637,10	0,00	287.450,05	3.524.817,59	98.630,54	2,66%	2,65%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.061.803,97	0,00	0,00	3.121.704,37	59.900,40	1,96%	1,96%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.452.031,66	0,00	0,00	2.493.527,20	41.495,54	1,69%	1,69%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.520.499,61	0,00	0,00	1.559.436,05	38.936,44	2,56%	2,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.330.103,94	0,00	1.000.000,00	365.044,35	34.940,41	2,63%	2,54%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.632.892,34	0,00	1.596.200,00	71.395,17	34.702,83	2,13%	1,39%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.185.412,85	0,00	1.212.043,21	0,00	26.630,36	2,25%	2,63%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	925.589,67	0,00	75.000,00	875.466,54	24.876,87	2,69%	2,85%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1.442.100,36	5.116.089,82	5.039.683,21	1.539.140,68	20.633,71	0,31%	2,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.050.000,00	0,00	1.055.011,41	5.011,41	0,48%	3,06%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.050.000,00	0,00	1.054.555,93	4.555,93	0,43%	3,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.212.043,21	1.212.570,85	0,00	527,64	0,04%	2,63%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	997.859,00	-2.141,00	-0,21%	2,50%
Total Renda Fixa	30.846.707,89	10.428.133,03	11.647.947,32	30.343.059,73	716.166,13	1,74%	

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
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	886.855,48	0,00	0,00	950.855,36	63.999,88	7,22%	7,22%
BRASESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.260.364,71	0,00	0,00	1.294.074,10	33.709,39	2,67%	2,67%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.275.211,84	0,00	0,00	1.301.105,01	25.893,17	2,03%	2,03%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.033.212,53	0,00	0,00	1.033.016,69	-195,84	-0,02%	-0,02%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	486.632,39	-13.367,61	-2,67%	-3,63%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	482.520,86	-17.479,14	-3,50%	-7,74%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	574.741,23	0,00	0,00	514.037,38	-60.703,85	-10,56%	-10,56%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	493.926,04	0,00	0,00	418.542,81	-75.383,23	-15,26%	-15,26%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	849.477,52	0,00	0,00	714.688,31	-134.789,21	-15,87%	-15,87%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.057.624,50	0,00	0,00	883.733,14	-173.891,36	-16,44%	-16,44%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	1.161.881,48	0,00	0,00	948.875,53	-213.005,95	-18,33%	-18,33%
BRASESCO SELECTION FI AÇÕES	2.267.296,49	0,00	0,00	1.924.478,88	-342.817,61	-15,12%	-15,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.457.840,27	0,00	0,00	1.975.612,87	-482.227,40	-19,62%	-19,62%
Total Renda Variável	13.318.432,09	1.000.000,00	0,00	12.928.173,33	-1.390.258,76	-9,71%	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.449.135,22	500.000,00	1.100.000,00	4.135.445,97	286.310,75	5,79%	6,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.579.128,73	0,00	287.450,05	3.524.817,59	233.138,91	6,51%	6,51%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.031.350,53	0,00	125.000,00	5.134.485,17	228.134,64	4,53%	4,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.717.614,17	500.000,00	0,00	4.415.170,30	197.556,13	4,68%	5,28%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.395.816,21	0,00	0,00	2.493.527,20	97.710,99	4,08%	4,08%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.281.198,65	0,00	1.000.000,00	365.044,35	83.845,70	6,54%	6,46%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.588.078,83	0,00	1.596.200,00	71.395,17	79.516,34	5,01%	4,25%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.487.263,90	0,00	0,00	1.559.436,05	72.172,15	4,85%	4,85%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.142.678,21	0,00	1.212.043,21	0,00	69.365,00	6,07%	6,47%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.494.355,22	0,00	670.000,00	875.466,54	51.111,32	3,42%	5,28%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	304.069,14	8.153.714,39	6.952.882,63	1.539.140,68	34.239,78	0,40%	4,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.050.000,00	0,00	1.055.011,41	5.011,41	0,48%	5,89%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.050.000,00	0,00	1.054.555,93	4.555,93	0,43%	5,71%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.212.043,21	1.212.570,85	0,00	527,64	0,04%	4,87%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	997.859,00	-2.141,00	-0,21%	6,07%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.204.186,72	0,00	0,00	3.121.704,37	-82.482,35	-2,57%	-2,57%
			Total Renda Fixa		1.358.573,34	3,15%	

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
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	633.141,67	0,00	0,00	950.855,36	317.713,69	50,18%	50,18%
BRASESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.231.636,61	0,00	0,00	1.294.074,10	62.437,49	5,07%	5,07%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.239.973,29	0,00	0,00	1.301.105,01	61.131,72	4,93%	4,93%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	987.697,79	0,00	0,00	1.033.016,69	45.318,90	4,59%	4,59%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	486.632,39	-13.367,61	-2,67%	-3,17%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	482.520,86	-17.479,14	-3,50%	-7,88%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	533.369,03	0,00	0,00	514.037,38	-19.331,65	-3,62%	-3,62%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	438.527,97	0,00	0,00	418.542,81	-19.985,16	-4,56%	-4,56%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	781.326,02	0,00	0,00	714.688,31	-66.637,71	-8,53%	-8,53%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	1.035.682,88	0,00	0,00	948.875,53	-86.807,35	-8,38%	-8,38%
BRASESCO SELECTION FI AÇÕES	2.025.925,07	0,00	0,00	1.924.478,88	-101.446,19	-5,01%	-5,01%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	996.351,74	0,00	0,00	883.733,14	-112.618,60	-11,30%	-11,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.212.569,91	0,00	0,00	1.975.612,87	-236.957,04	-10,71%	-10,71%
				Total Renda Variável	-188.028,65	-1,43%	

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.