

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	5.483.100,42	4,32%	439	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	25.492.074,85	20,08%	1.077	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	6.240.282,69	4,92%	820	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	846.046,52	0,67%	597	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	523.309,59	0,41%	165	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	16.914,90	0,01%	317	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	16.443.718,03	12,96%	868	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.672.934,68	4,47%	1.073	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.838.080,24	1,45%	1.024	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	6.766.609,60	5,33%	3.831	4,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	9.311.783,38	7,34%	547	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.816.144,94	1,43%	859	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.556.484,98	9,89%	110	0,91%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.432.591,31	1,92%	2.100	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	312.922,52	0,25%	4.019	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.349.980,36	1,85%	36	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	4.092.981,33	3,22%	199	1,75%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.789.924,85	1,41%	19	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.406.220,50	5,05%	34	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.484.026,36	1,96%	53	3,22%	Artigo 8º, Inciso II

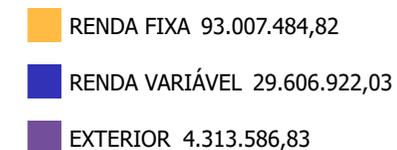
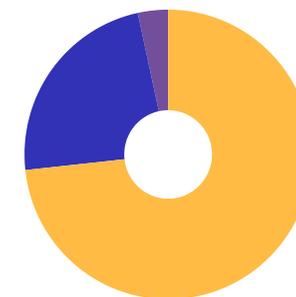


Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	4.313.586,83	3,40%	522	0,19%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.865.833,27	3,83%	9.808	0,20%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.647.392,55	2,09%	136	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	278.035,87	0,22%	1.008	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	283.017,27	0,22%	5.324	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	1.663.995,84	1,31%		1,12%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		1.775,14	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			126.927.993,68				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.775,14				Artigo 6º
PL Total			126.929.768,82				

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

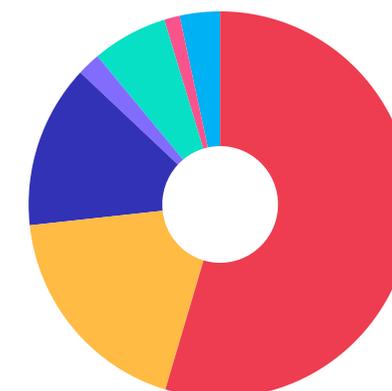
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	18,87%	59,24%	75.192.143,46
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	69.323.071,52	54,62%	14,53%	18,87%	59,24%	5.869.071,94
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	23.684.413,30	18,66%	12,98%	17,31%	50,00%	39.779.583,54
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,31%	20,00%	25.385.598,74
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,78%	5,00%	6.346.399,68
Total Renda Fixa	100,00%	93.007.484,82	73,28%	27,51%	75,14%	193,48%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	17.384.620,87	13,70%	11,21%	13,70%	20,00%	8.000.977,87
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	2.484.026,36	1,96%	0,00%	2,24%	20,00%	22.901.572,38
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	8.074.278,96	6,36%	2,09%	2,78%	10,00%	4.618.520,41
Artigo 11º	5,00%	1.663.995,84	1,31%	0,00%	1,14%	1,14%	-217.016,71
Total Renda Variável	30,00%	29.606.922,03	23,33%	13,30%	19,86%	51,14%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.313.586,83	3,40%	3,75%	5,00%	10,00%	8.379.212,54
Total Exterior	10,00%	4.313.586,83	3,40%	3,75%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	65.014.741,20	51,22	0,00
CAIXA DTVM	38.282.486,86	30,16	-
TRÍGONO CAPITAL	8.196.145,35	6,46	0,20
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	6.766.609,60	5,33	0,07
META ASSET MANAGEMENT	4.092.981,33	3,22	1,72
ITAÚ UNIBANCO	2.628.016,23	2,07	0,00
ZION INVEST	1.663.995,84	1,31	1,83
SICREDI	283.017,27	0,22	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 '	69.323.071,52	54,62	14,53	59,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	23.684.413,30	18,66	12,98	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	17.384.620,87	13,70	11,21	20,00
Artigo 8º, Inciso II	2.484.026,36	1,96	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	4.313.586,83	3,40	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso I	8.074.278,96	6,36	2,09	10,00
Artigo 11º	1.663.995,84	1,31	0,00	1,14
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,47%	6,85%	2,86%	6,85%	10,11%	17,88%	-	-
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%
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%
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%
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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	4,22%	1,41%	4,22%	3,48%	10,88%	2,02%	0,06%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,88%	4,59%	2,50%	4,59%	7,12%	8,63%	0,01%	0,01%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,02%	5,55%	2,93%	5,55%	9,08%	11,95%	0,04%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,93%	4,87%	2,63%	4,87%	7,48%	8,72%	0,01%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	3,71%	1,67%	3,71%	4,01%	6,69%	1,11%	0,03%
IPCA (Benchmark)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,23%	4,59%	2,22%	4,59%	3,73%	6,51%	1,57%	0,03%



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 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%	-	-
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-7,82%	-17,54%	-14,99%	-17,54%	-5,64%	-	13,70%	0,19%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	-7,79%	-17,59%	-14,94%	-17,59%	-5,80%	31,34%	13,65%	0,19%
Global BDRX (Benchmark)	0,79%	-27,61%	-10,27%	-27,61%	-12,10%	12,50%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,83%	-27,83%	-10,22%	-27,83%	-13,08%	9,72%	12,50%	0,20%
IBX (Benchmark)	-11,56%	-5,72%	-17,94%	-5,72%	-23,04%	4,91%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-14,32%	-10,59%	-22,53%	-10,59%	-31,48%	-18,31%	10,81%	0,26%
Ibovespa (Benchmark)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-	-
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-10,46%	-14,31%	-17,89%	-14,31%	-37,09%	-13,41%	8,65%	0,21%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-15,33%	-3,17%	-3,63%	-3,17%	-6,87%	-	10,92%	0,25%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	-11,18%	-5,66%	-17,44%	-5,66%	-21,76%	3,70%	9,74%	0,21%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-14,19%	-7,88%	-7,74%	-7,88%	-15,15%	60,91%	10,54%	0,24%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-10,83%	-4,56%	-15,26%	-4,56%	-18,64%	12,46%	6,71%	0,19%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-11,61%	-8,53%	-15,87%	-8,53%	-16,66%	12,69%	9,62%	0,18%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,80%	4,02%	-0,05%	4,02%	2,32%	10,36%	1,52%	0,04%

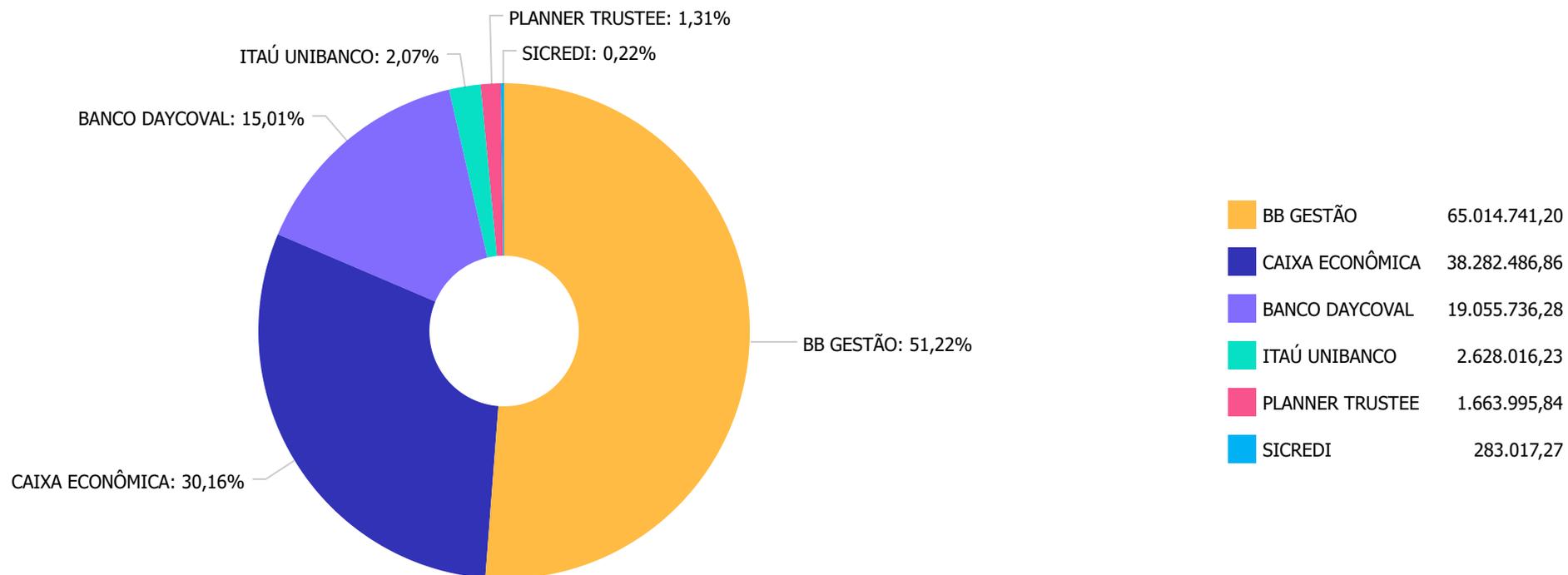
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - RENDA VARIÁVEL

	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%
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%

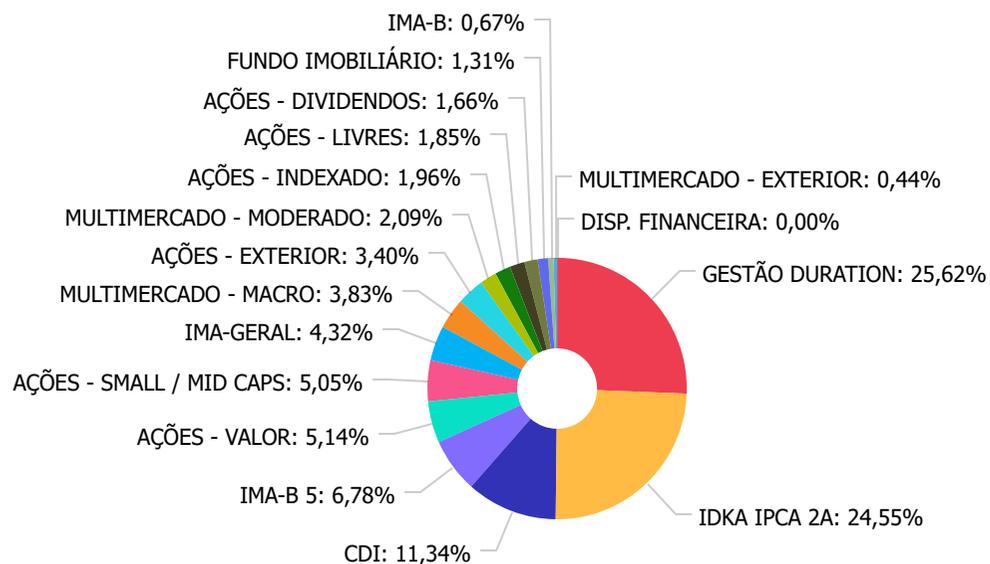
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%

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



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

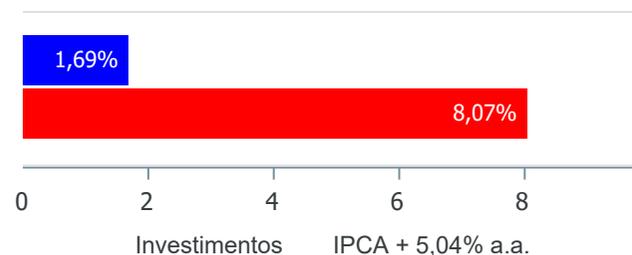


■ GESTÃO DURATION	32.522.111,01	■ IDKA IPCA 2A	31.165.009,53	■ CDI	14.389.544,82	■ IMA-B 5	8.601.672,52
■ AÇÕES - VALOR	6.525.572,64	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	6.406.220,50	■ IMA-GERAL	5.483.100,42	■ MULTIMERCADO - MACRO	4.865.833,27
■ AÇÕES - EXTERIOR	4.313.586,83	■ MULTIMERCADO - MODERADO	2.647.392,55	■ AÇÕES - INDEXADO	2.484.026,36	■ AÇÕES - LIVRES	2.349.980,36
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	2.102.847,37	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.663.995,84	■ IMA-B	846.046,52	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	561.053,14
■ DISP. FINANCEIRA	1.775,14						

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	125.610.767,11	1.837.427,88	1.932.390,04	125.512.704,50	-3.100,45	-3.100,45	0,00%	0,00%	0,95%	0,95%	-0,26%	3,41%
Fevereiro	125.512.704,50	1.701.509,38	1.968.853,18	125.658.550,51	413.189,81	410.089,36	0,33%	0,33%	1,39%	2,35%	13,90%	2,81%
Março	125.658.550,51	2.145.728,92	2.317.354,27	128.804.588,03	3.317.662,87	3.727.752,23	2,64%	2,98%	2,06%	4,46%	66,77%	3,81%
Abril	128.804.588,03	3.149.097,13	3.486.674,71	127.785.831,67	-681.178,78	3.046.573,45	-0,53%	2,43%	1,44%	5,96%	40,82%	2,95%
Mai	127.785.831,67	2.667.532,65	2.582.031,25	129.863.122,21	1.991.789,14	5.038.362,59	1,56%	4,03%	0,90%	6,91%	58,25%	3,23%
Junho	129.863.122,21	1.927.544,98	1.951.802,20	126.927.993,68	-2.910.871,31	2.127.491,28	-2,24%	1,69%	1,08%	8,07%	21,00%	3,19%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





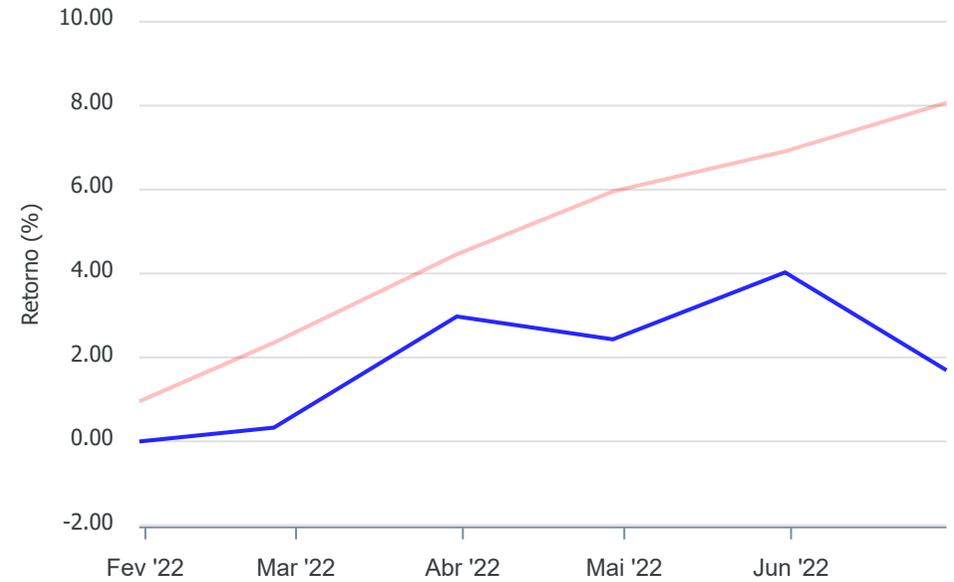
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	12.528.975,14	0,00	100.000,00	12.556.484,98	127.509,84	1,02%	1,02%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.712.408,98	1.911.579,46	1.833.225,38	1.816.144,94	25.381,88	0,70%	0,93%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	9.268.903,05	0,00	0,00	9.311.783,38	42.880,33	0,46%	0,46%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.843.852,54	0,00	11.896,78	1.838.080,24	6.124,48	0,33%	0,33%	1,23%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.465.094,07	0,00	0,00	5.483.100,42	18.006,35	0,33%	0,33%	1,11%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	6.744.656,01	0,00	0,00	6.766.609,60	21.953,59	0,33%	0,33%	1,24%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.220.520,75	0,00	0,00	6.240.282,69	19.761,94	0,32%	0,32%	1,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	521.685,79	0,00	0,00	523.309,59	1.623,80	0,31%	0,31%	1,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	25.424.418,94	0,00	0,00	25.492.074,85	67.655,91	0,27%	0,27%	1,38%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	7.571,21	15.965,52	6.680,04	16.914,90	58,21	0,25%	0,88%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.405.916,71	0,00	0,00	16.443.718,03	37.801,32	0,23%	0,23%	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.660.236,64	0,00	0,00	5.672.934,68	12.698,04	0,22%	0,22%	1,39%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	849.041,38	0,00	0,00	846.046,52	-2.994,86	-0,35%	-0,35%	2,02%
Total Renda Fixa	92.653.281,21	1.927.544,98	1.951.802,20	93.007.484,82	378.460,83	0,41%		1,12%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.904.978,02	0,00	0,00	4.865.833,27	-39.144,75	-0,80%	-0,80%	1,52%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.669.357,76	0,00	0,00	2.647.392,55	-21.965,21	-0,82%	-0,82%	1,93%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	301.517,73	0,00	0,00	278.035,87	-23.481,86	-7,79%	-7,79%	13,65%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	307.012,80	0,00	0,00	283.017,27	-23.995,53	-7,82%	-7,82%	13,70%
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.624.532,51	0,00	0,00	2.349.980,36	-274.552,15	-10,46%	-10,46%	8,65%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	350.937,11	0,00	0,00	312.922,52	-38.014,59	-10,83%	-10,83%	6,71%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.867.995,33	0,00	0,00	1.663.995,84	-203.999,49	-10,92%	-10,92%	15,00%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	2.796.627,04	0,00	0,00	2.484.026,36	-312.600,68	-11,18%	-11,18%	9,74%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.752.060,71	0,00	0,00	2.432.591,31	-319.469,40	-11,61%	-11,61%	9,62%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.465.708,21	0,00	0,00	6.406.220,50	-1.059.487,71	-14,19%	-14,19%	10,54%
META VALOR FI AÇÕES	4.776.876,41	0,00	0,00	4.092.981,33	-683.895,08	-14,32%	-14,32%	10,81%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.114.051,40	0,00	0,00	1.789.924,85	-324.126,55	-15,33%	-15,33%	10,92%
Total Renda Variável	32.931.655,03	0,00	0,00	29.606.922,03	-3.324.733,00	-10,10%		8,33%



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	4.278.185,97	0,00	0,00	4.313.586,83	35.400,86	0,83%	0,83%	12,50%
Total Exterior	4.278.185,97	0,00	0,00	4.313.586,83	35.400,86	0,83%		12,50%

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...	24.860.001,80	0,00	0,00	25.492.074,85	632.073,05	2,54%	2,54%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	12.798.906,82	583.003,18	1.200.000,00	12.556.484,98	374.574,98	2,80%	2,93%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.086.481,55	0,00	0,00	16.443.718,03	357.236,48	2,22%	2,22%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	10.024.012,96	0,00	900.000,00	9.311.783,38	187.770,42	1,87%	2,02%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	6.601.292,64	0,00	0,00	6.766.609,60	165.316,96	2,50%	2,50%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.080.122,89	0,00	0,00	6.240.282,69	160.159,80	2,63%	2,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.534.839,23	0,00	0,00	5.672.934,68	138.095,45	2,50%	2,50%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.392.829,01	0,00	0,00	5.483.100,42	90.271,41	1,67%	1,67%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.825.729,20	0,00	35.690,34	1.838.080,24	48.041,38	2,63%	2,65%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	504.207,41	7.125.192,52	5.860.200,60	1.816.144,94	46.945,61	0,62%	2,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	507.935,26	0,00	0,00	523.309,59	15.374,33	3,03%	3,03%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	834.267,92	0,00	0,00	846.046,52	11.778,60	1,41%	1,41%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	5.390,75	35.979,06	24.617,22	16.914,90	162,31	0,39%	2,50%
Total Renda Fixa	91.056.017,44	7.744.174,76	8.020.508,16	93.007.484,82	2.227.800,78	2,25%	

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 - ...	1.551.996,12	0,00	0,00	1.663.995,84	111.999,72	7,22%	7,22%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.647.894,44	0,00	0,00	2.647.392,55	-501,89	-0,02%	-0,02%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.868.435,03	0,00	0,00	4.865.833,27	-2.601,76	-0,05%	-0,05%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	326.881,76	0,00	0,00	278.035,87	-48.845,89	-14,94%	-14,94%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	332.912,51	0,00	0,00	283.017,27	-49.895,24	-14,99%	-14,99%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	369.282,60	0,00	0,00	312.922,52	-56.360,08	-15,26%	-15,26%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.857.341,82	0,00	0,00	1.789.924,85	-67.416,97	-3,63%	-3,63%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.891.374,59	0,00	0,00	2.432.591,31	-458.783,28	-15,87%	-15,87%
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.862.082,36	0,00	0,00	2.349.980,36	-512.102,00	-17,89%	-17,89%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	3.008.890,94	0,00	0,00	2.484.026,36	-524.864,58	-17,44%	-17,44%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.943.409,73	0,00	0,00	6.406.220,50	-537.189,23	-7,74%	-7,74%
META VALOR FI AÇÕES	5.283.597,92	0,00	0,00	4.092.981,33	-1.190.616,59	-22,53%	-22,53%
Total Renda Variável	32.944.099,82	0,00	0,00	29.606.922,03	-3.337.177,79	-10,13%	



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	4.804.470,77	0,00	0,00	4.313.586,83	-490.883,94	-10,22%	-10,22%
Total Exterior	4.804.470,77	0,00	0,00	4.313.586,83	-490.883,94	-10,22%	

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...	23.945.948,82	0,00	0,00	25.492.074,85	1.546.126,03	6,46%	6,46%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.175.062,92	0,00	453.171,70	16.443.718,03	721.826,81	4,46%	4,59%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	12.313.810,01	1.532.417,28	1.974.575,05	12.556.484,98	684.832,74	4,95%	5,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	10.464.094,51	0,00	1.574.000,00	9.311.783,38	421.688,87	4,03%	4,30%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	6.379.510,56	0,00	0,00	6.766.609,60	387.099,04	6,07%	6,07%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.860.931,85	0,00	0,00	6.240.282,69	379.350,84	6,47%	6,47%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.331.067,13	0,00	0,00	5.672.934,68	341.867,55	6,41%	6,41%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.286.807,35	0,00	0,00	5.483.100,42	196.293,07	3,71%	3,71%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.795.853,81	0,00	72.070,21	1.838.080,24	114.296,64	6,36%	6,51%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	24.359,31	11.674.906,80	9.944.664,44	1.816.144,94	61.543,27	0,53%	4,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	502.527,17	0,00	14.420,62	523.309,59	35.203,04	7,01%	7,18%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	811.827,10	0,00	0,00	846.046,52	34.219,42	4,22%	4,22%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1.274,30	221.516,86	206.203,63	16.914,90	327,37	0,15%	4,59%
				Total Renda Fixa	4.924.674,69	4,81%	

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 - ...	1.107.997,23	0,00	0,00	1.663.995,84	555.998,61	50,18%	50,18%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.678.010,58	0,00	0,00	4.865.833,27	187.822,69	4,02%	4,02%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.531.250,26	0,00	0,00	2.647.392,55	116.142,29	4,59%	4,59%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	327.864,37	0,00	0,00	312.922,52	-14.941,85	-4,56%	-4,56%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.848.527,59	0,00	0,00	1.789.924,85	-58.602,74	-3,17%	-3,17%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	337.375,41	0,00	0,00	278.035,87	-59.339,54	-17,59%	-17,59%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	343.222,31	0,00	0,00	283.017,27	-60.205,04	-17,54%	-17,54%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	2.633.048,51	0,00	0,00	2.484.026,36	-149.022,15	-5,66%	-5,66%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.659.406,69	0,00	0,00	2.432.591,31	-226.815,38	-8,53%	-8,53%
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.742.442,36	0,00	0,00	2.349.980,36	-392.462,00	-14,31%	-14,31%
META VALOR FI AÇÕES	4.577.591,22	0,00	0,00	4.092.981,33	-484.609,89	-10,59%	-10,59%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.954.041,59	0,00	0,00	6.406.220,50	-547.821,09	-7,88%	-7,88%
				Total Renda Variável	-1.133.856,09	-3,69%	

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.