

Relatório Analítico dos Investimentos

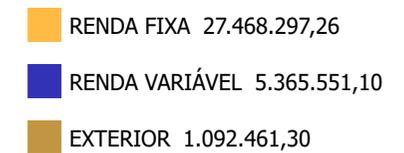
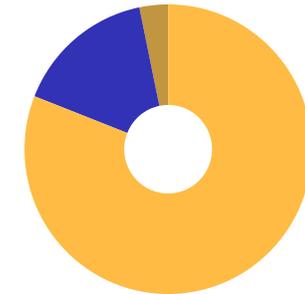
em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	D+4	Não há	258.786,25	0,76%	5.820	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	522.603,95	1,54%	25.804	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	211.213,25	0,62%	40.998	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	241.211,77	0,71%	177	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	411.389,40	1,21%	8.170	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	166.252,30	0,49%	3.270	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	233.655,65	0,69%	17	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	496.491,08	1,46%	17.020	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	268.987,76	0,79%	34.606	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	457.321,51	1,35%	152	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	366.152,03	1,08%	522	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	406.775,97	1,20%	222.952	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	747.133,14	2,20%	136	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	135.415,61	0,40%	1.093	0,19%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	372.660,25	1,10%	1.008	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		4.870,33	0,01%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			33.926.309,66				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			4.870,33				Artigo 6º
PL Total			33.931.179,99				

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

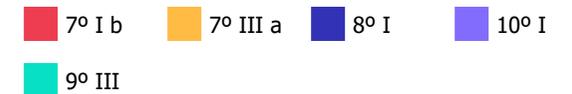
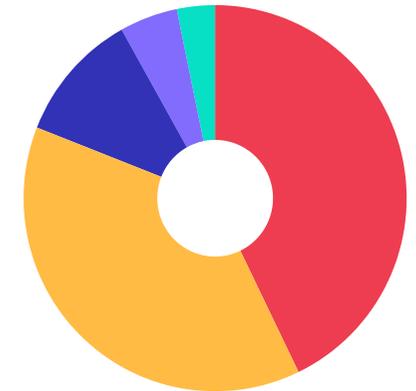
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	3.392.630,97
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	14.530.073,55	42,83%	0,00%	36,00%	100,00%	19.396.236,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	12.938.223,71	38,14%	0,00%	24,00%	60,00%	7.417.562,09
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	3.392.630,97
Total Renda Fixa	100,00%	27.468.297,26	80,96%	0,00%	65,00%	180,00%	



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%	3.703.566,13	10,92%	0,00%	15,00%	20,00%	3.081.695,80
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	3.392.630,97
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.661.984,97	4,90%	0,00%	9,00%	10,00%	1.730.646,00
Total Renda Variável	30,00%	5.365.551,10	15,82%	0,00%	25,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.092.461,30	3,22%	0,00%	10,00%	10,00%	2.300.169,67
Total Exterior	10,00%	1.092.461,30	3,22%	0,00%	10,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.743.769,86	49,35	0,00
CAIXA DTVM	9.982.334,16	29,42	-
ITAÚ UNIBANCO	6.966.549,99	20,53	0,00
ITAÚ DTVM	233.655,65	0,69	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 %		

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%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,10%	2,03%	0,12%	2,03%	-2,16%	6,18%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,10%	1,95%	0,07%	1,95%	-2,61%	5,51%	3,18%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	4,86%	2,58%	4,86%	6,94%	8,89%	0,17%	0,01%
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%
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%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,93%	4,87%	2,63%	4,87%	7,48%	8,72%	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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,03%	5,54%	2,90%	5,54%	8,98%	11,54%	0,01%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1,31%	5,52%	2,97%	5,52%	11,26%	14,02%	1,18%	0,02%

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%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,95%	5,91%	2,99%	5,91%	11,12%	13,61%	0,36%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,98%	6,38%	3,24%	6,38%	13,70%	-	0,22%	0,01%
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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,23%	4,59%	2,22%	4,59%	3,73%	6,51%	1,57%	0,03%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,33%	-	-0,26%	-	-	-	1,37%	-

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%
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%
IDIV (Benchmark)	-8,38%	4,58%	-9,43%	4,58%	-4,10%	18,72%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-8,31%	4,05%	-9,45%	4,05%	-7,36%	11,21%	7,00%	0,19%
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 AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	-14,42%	-19,00%	-19,28%	-19,00%	-25,47%	22,35%	11,92%	0,20%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-12,08%	-15,07%	-21,57%	-15,07%	-37,46%	-38,24%	9,78%	0,27%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-10,83%	-4,56%	-15,26%	-4,56%	-18,64%	12,46%	6,71%	0,19%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	-12,89%	-10,30%	-17,28%	-10,30%	-21,51%	14,46%	10,14%	0,22%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-12,77%	-7,24%	-16,81%	-7,24%	-17,83%	14,76%	9,44%	0,20%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-11,84%	-13,02%	-16,34%	-13,02%	-33,06%	-10,23%	9,60%	0,18%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-10,52%	-3,62%	-10,56%	-3,62%	-15,12%	21,27%	8,01%	0,17%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-14,29%	-25,31%	-28,75%	-25,31%	-46,89%	-38,86%	10,10%	0,21%

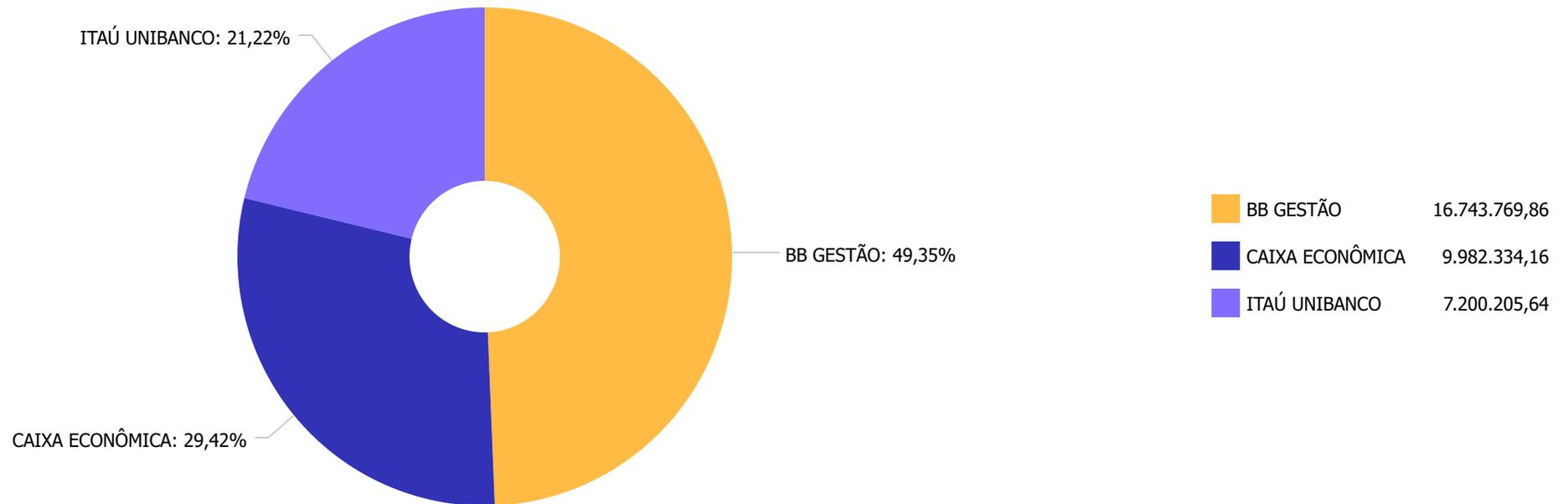
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-10,28%	-10,39%	-19,12%	-10,39%	-33,09%	-13,44%	8,35%	0,20%
SMLL (Benchmark)	-16,33%	-19,69%	-24,72%	-19,69%	-39,59%	-15,65%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-14,37%	-14,37%	-20,60%	-14,37%	-32,71%	-4,09%	9,01%	0,21%
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%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,82%	4,59%	-0,02%	4,59%	3,57%	12,16%	1,93%	0,04%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	2,55%	2,20%	4,07%	2,20%	10,90%	-	1,19%	0,05%

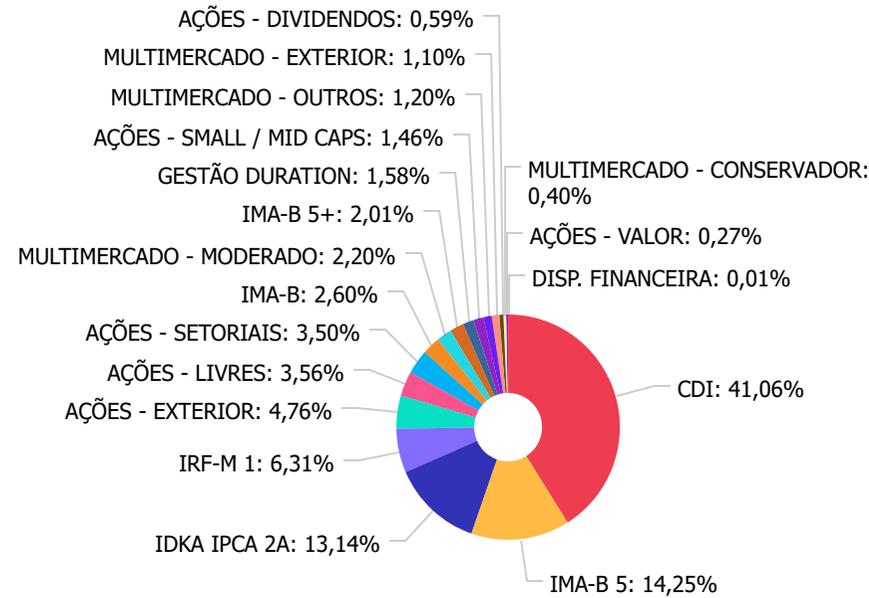
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,71%	-15,61%	-12,77%	-15,61%	-9,37%	-	11,83%	0,15%
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)

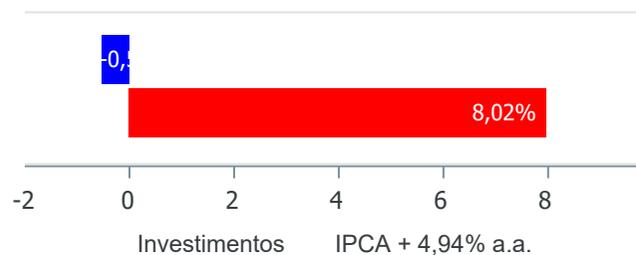


■ CDI	13.933.419,48	■ IMA-B 5	4.835.684,55	■ IDKA IPCA 2A	4.458.926,08
■ IRF-M 1	2.141.271,50	■ AÇÕES - EXTERIOR	1.614.084,73	■ AÇÕES - LIVRES	1.208.684,62
■ AÇÕES - SETORIAIS	1.186.773,33	■ IMA-B	881.252,88	■ MULTIMERCADO - MODERADO	747.133,14
■ IMA-B 5+	681.217,04	■ GESTÃO DURATION	536.525,73	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	496.491,08
■ MULTIMERCADO - OUTROS	406.775,97	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	372.660,25	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	198.574,08
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	135.415,61	■ AÇÕES - VALOR	91.419,59	■ DISP. FINANCEIRA	4.870,33

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	30.898.189,95	857.173,16	170.236,29	31.434.748,43	-150.378,39	-150.378,39	-0,48%	-0,48%	0,94%	0,94%	-50,39%	3,42%
Fevereiro	31.434.748,43	2.900.344,67	3.070.447,00	31.129.823,97	-134.822,13	-285.200,52	-0,43%	-0,90%	1,38%	2,34%	-38,66%	3,03%
Março	31.129.823,97	6.257.996,97	5.309.562,28	32.760.338,53	682.079,87	396.879,35	2,13%	1,20%	2,05%	4,43%	27,17%	3,51%
Abril	32.760.338,53	1.264.206,52	909.622,97	32.745.683,37	-369.238,71	27.640,64	-1,12%	0,08%	1,43%	5,92%	1,28%	2,86%
Mai	32.745.683,37	2.110.800,89	1.757.945,50	33.307.827,60	209.288,84	236.929,48	0,63%	0,71%	0,89%	6,87%	10,31%	2,78%
Junho	33.307.827,60	2.804.120,03	1.765.016,23	33.926.309,66	-420.621,74	-183.692,26	-1,22%	-0,52%	1,08%	8,02%	-6,54%	2,32%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



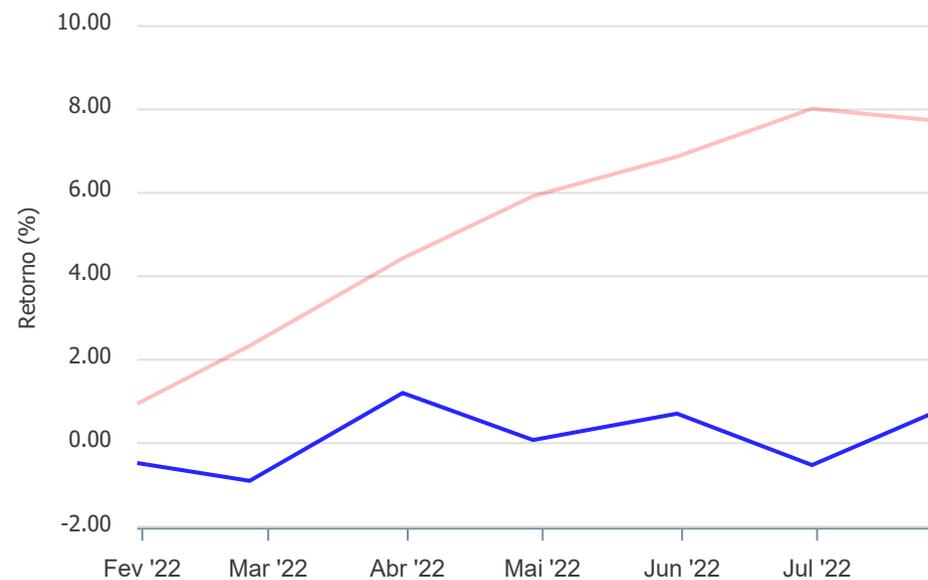
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- 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
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1.281.671,27	0,00	0,00	1.298.490,39	16.819,12	1,31%	1,31%	1,18%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.985.413,72	0,00	0,00	5.036.559,65	51.145,93	1,03%	1,03%	0,01%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.001.954,23	0,00	0,00	1.012.162,91	10.208,68	1,02%	1,02%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.576.708,70	0,00	0,00	1.592.216,15	15.507,45	0,98%	0,98%	0,22%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.121.962,15	0,00	0,00	2.141.271,50	19.309,35	0,91%	0,91%	0,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	993.713,64	500.000,00	0,00	1.505.938,40	12.224,76	0,82%	1,10%	0,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.136.712,52	552.462,76	0,00	1.700.753,72	11.578,44	0,69%	0,95%	0,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.548.732,04	0,00	0,00	3.560.569,87	11.837,83	0,33%	0,33%	1,23%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	991.971,92	0,00	0,00	995.195,77	3.223,85	0,32%	0,32%	1,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	1.103.370,06	167.970,05	0,00	1.275.114,68	3.774,57	0,30%	0,33%	1,37%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.447.092,10	0,00	0,00	4.458.926,08	11.833,98	0,27%	0,27%	1,38%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	363.261,87	1.449.063,62	1.025.016,23	792.102,49	4.793,23	0,26%	0,93%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.039.268,03	0,00	500.000,00	536.525,73	-2.742,30	-0,26%	0,23%	1,57%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	884.372,37	0,00	0,00	881.252,88	-3.119,49	-0,35%	-0,35%	2,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	688.792,66	0,00	0,00	681.217,04	-7.575,62	-1,10%	-1,10%	3,18%
Total Renda Fixa	26.164.997,28	2.669.496,43	1.525.016,23	27.468.297,26	158.819,78	0,58%		0,78%

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 HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	132.046,41	0,00	0,00	135.415,61	3.369,20	2,55%	2,55%	1,19%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	268.081,04	134.623,60	0,00	406.775,97	4.071,33	1,01%	1,05%	0,21%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	753.332,05	0,00	0,00	747.133,14	-6.198,91	-0,82%	-0,82%	1,93%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	563.573,45	0,00	0,00	521.623,43	-41.950,02	-7,44%	-7,44%	14,21%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	404.133,74	0,00	0,00	372.660,25	-31.473,49	-7,79%	-7,79%	13,65%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	181.319,12	0,00	0,00	166.252,30	-15.066,82	-8,31%	-8,31%	7,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	260.075,24	0,00	0,00	233.655,65	-26.419,59	-10,16%	-10,27%	8,35%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	269.583,86	0,00	0,00	241.211,77	-28.372,09	-10,52%	-10,52%	8,01%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	36.248,31	0,00	0,00	32.321,78	-3.926,53	-10,83%	-10,83%	6,71%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	372.298,99	0,00	240.000,00	91.419,59	-40.879,40	-10,98%	-11,61%	9,62%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	239.568,39	0,00	0,00	211.213,25	-28.355,14	-11,84%	-11,84%	9,60%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	310.345,67	0,00	0,00	272.856,32	-37.489,35	-12,08%	-12,08%	9,78%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	599.073,07	0,00	0,00	522.603,95	-76.469,12	-12,76%	-12,76%	9,44%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	297.086,23	0,00	0,00	258.786,25	-38.299,98	-12,89%	-12,89%	10,14%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	479.972,74	0,00	0,00	411.389,40	-68.583,34	-14,29%	-14,29%	10,10%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	579.840,13	0,00	0,00	496.491,08	-83.349,05	-14,37%	-14,37%	9,01%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	284.799,09	0,00	0,00	243.741,36	-41.057,73	-14,42%	-14,42%	11,92%
Total Renda Variável	6.031.377,53	134.623,60	240.000,00	5.365.551,10	-560.450,03	-9,09%		8,22%

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	363.147,06	0,00	0,00	366.152,03	3.004,97	0,83%	0,83%	12,50%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	456.861,37	0,00	0,00	457.321,51	460,14	0,10%	0,10%	11,56%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	291.444,36	0,00	0,00	268.987,76	-22.456,60	-7,71%	-7,71%	11,83%
Total Exterior	1.111.452,79	0,00	0,00	1.092.461,30	-18.991,49	-1,71%		11,94%

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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.894.540,04	0,00	0,00	5.036.559,65	142.019,61	2,90%	2,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.348.367,52	0,00	0,00	4.458.926,08	110.558,56	2,54%	2,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.468.533,13	0,00	0,00	3.560.569,87	92.036,74	2,65%	2,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.087.347,61	0,00	0,00	2.141.271,50	53.923,89	2,58%	2,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.146.030,47	400.000,00	0,00	1.592.216,15	46.185,68	2,99%	3,24%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1.261.034,92	0,00	0,00	1.298.490,39	37.455,47	2,97%	2,97%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.114.180,23	552.462,76	0,00	1.700.753,72	34.110,73	2,05%	2,99%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	974.761,23	500.000,00	0,00	1.505.938,40	31.177,17	2,11%	3,06%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	997.833,67	0,00	33.346,45	995.195,77	30.708,55	3,08%	-0,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	514.132,86	762.740,69	23.433,70	1.275.114,68	21.674,83	1,70%	3,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.019.032,73	0,00	500.000,00	536.525,73	17.493,00	1,72%	2,22%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	868.984,14	0,00	0,00	881.252,88	12.268,74	1,41%	1,41%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.012.162,91	12.162,91	1,22%	2,93%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	43.014,59	2.829.300,39	2.091.804,55	792.102,49	11.592,06	0,40%	2,63%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	680.742,00	0,00	0,00	681.217,04	475,04	0,07%	0,07%
Total Renda Fixa	23.418.535,14	6.044.503,84	2.648.584,70	27.468.297,26	653.842,98	2,44%	

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	263.494,49	134.623,60	0,00	406.775,97	8.657,88	2,17%	2,81%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	130.119,11	0,00	0,00	135.415,61	5.296,50	4,07%	4,07%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	747.274,78	0,00	0,00	747.133,14	-141,64	-0,02%	-0,02%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	38.143,22	0,00	0,00	32.321,78	-5.821,44	-15,26%	-15,26%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	183.593,67	0,00	0,00	166.252,30	-17.341,37	-9,45%	-9,45%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	269.697,02	0,00	0,00	241.211,77	-28.485,25	-10,56%	-10,56%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	252.476,76	0,00	0,00	211.213,25	-41.263,51	-16,34%	-16,34%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	312.838,76	0,00	0,00	258.786,25	-54.052,51	-17,28%	-17,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	288.875,39	0,00	0,00	233.655,65	-55.219,74	-19,12%	-19,12%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	301.965,99	0,00	0,00	243.741,36	-58.224,63	-19,28%	-19,28%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	800.975,14	0,00	640.000,00	91.419,59	-69.555,55	-8,68%	-15,87%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	347.889,61	0,00	0,00	272.856,32	-75.033,29	-21,57%	-21,57%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	628.214,57	0,00	0,00	522.603,95	-105.610,62	-16,81%	-16,81%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	938.932,67	0,00	290.000,00	521.623,43	-127.309,24	-13,56%	-14,85%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	625.325,13	0,00	0,00	496.491,08	-128.834,05	-20,60%	-20,60%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	577.410,71	0,00	0,00	411.389,40	-166.021,31	-28,75%	-28,75%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1.319.686,21	0,00	774.000,00	372.660,25	-173.025,96	-13,11%	-14,94%
Total Renda Variável	8.026.913,23	134.623,60	1.704.000,00	5.365.551,10	-1.091.985,73	-13,38%	

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 BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	308.367,50	0,00	0,00	268.987,76	-39.379,74	-12,77%	-12,77%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	505.842,03	0,00	0,00	457.321,51	-48.520,52	-9,59%	-9,59%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	500.680,63	0,00	80.000,00	366.152,03	-54.528,60	-10,89%	-10,22%
Total Exterior	1.314.890,16	0,00	80.000,00	1.092.461,30	-142.428,86	-10,83%	

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...	4.365.452,15	458.761,64	640.000,00	4.458.926,08	274.712,29	5,69%	6,46%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.942.246,91	488.761,64	662.513,23	5.036.559,65	268.064,33	4,94%	5,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.342.902,44	0,00	0,00	3.560.569,87	217.667,43	6,51%	6,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.977.728,09	65.210,08	0,00	2.141.271,50	98.333,33	4,81%	4,86%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1.230.547,21	0,00	0,00	1.298.490,39	67.943,18	5,52%	5,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.975.891,55	0,00	1.500.000,00	536.525,73	60.634,18	3,07%	4,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,00	1.537.665,09	0,00	1.592.216,15	54.551,06	3,55%	6,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	301.381,01	1.352.462,76	0,00	1.700.753,72	46.909,95	2,84%	5,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.467.912,29	0,00	1.505.938,40	38.026,11	2,59%	5,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	1.262.740,69	23.433,70	1.275.114,68	35.807,69	2,84%	7,12%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	845.609,50	0,00	0,00	881.252,88	35.643,38	4,22%	4,22%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	33.346,45	995.195,77	28.542,22	2,85%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	249.861,13	6.876.504,45	6.359.526,86	792.102,49	25.263,77	0,35%	4,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	668.205,92	0,00	0,00	681.217,04	13.011,12	1,95%	1,95%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.012.162,91	12.162,91	1,22%	5,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	857.399,13	0,00	864.799,95	0,00	7.400,82	0,86%	4,30%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	65.296,99	0,00	65.210,08	0,00	-86,91	-0,13%	0,62%
Total Renda Fixa	20.822.522,03	15.510.018,64	10.148.830,27	27.468.297,26	1.284.586,86	4,91%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	714.356,08	0,00	0,00	747.133,14	32.777,06	4,59%	4,59%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	257.351,96	134.623,60	0,00	406.775,97	14.800,41	3,78%	5,26%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	159.783,11	0,00	0,00	166.252,30	6.469,19	4,05%	4,05%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	132.499,62	0,00	0,00	135.415,61	2.915,99	2,20%	2,20%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	33.865,13	0,00	0,00	32.321,78	-1.543,35	-4,56%	-4,56%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	736.714,87	0,00	640.000,00	91.419,59	-5.295,28	-0,72%	-8,53%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	250.283,14	0,00	0,00	241.211,77	-9.071,37	-3,62%	-3,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	260.761,40	0,00	0,00	233.655,65	-27.105,75	-10,39%	-10,39%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	288.511,78	0,00	0,00	258.786,25	-29.725,53	-10,30%	-10,30%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	242.835,09	0,00	0,00	211.213,25	-31.621,84	-13,02%	-13,02%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	321.271,87	0,00	0,00	272.856,32	-48.415,55	-15,07%	-15,07%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	324.941,72	250.000,00	0,00	522.603,95	-52.337,77	-9,10%	-7,24%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	300.899,07	0,00	0,00	243.741,36	-57.157,71	-19,00%	-19,00%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	579.840,13	0,00	0,00	496.491,08	-83.349,05	-14,37%	-14,37%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	550.789,38	0,00	0,00	411.389,40	-139.399,98	-25,31%	-25,31%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	972.765,74	0,00	290.000,00	521.623,43	-161.142,31	-16,57%	-17,82%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1.362.051,12	0,00	774.000,00	372.660,25	-215.390,87	-15,81%	-17,59%
Total Renda Variável	7.489.521,21	384.623,60	1.704.000,00	5.365.551,10	-804.593,71	-10,22%	

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 BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	0,00	300.000,00	0,00	268.987,76	-31.012,24	-10,34%	-15,61%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	626.532,24	0,00	0,00	457.321,51	-169.210,73	-27,01%	-27,01%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.959.614,47	0,00	1.130.000,00	366.152,03	-463.462,44	-23,65%	-27,83%
Total Exterior	2.586.146,71	300.000,00	1.130.000,00	1.092.461,30	-663.685,41	-23,00%	

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.