

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

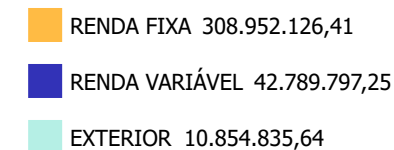
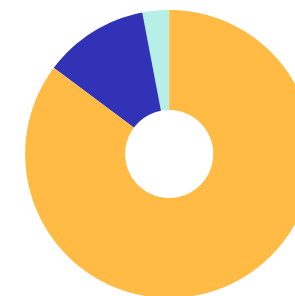
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	33.190.256,72	9,15%	1.077	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	23.014.558,57	6,35%	820	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	7.108.306,76	1,96%	597	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	240.942,83	0,07%	101	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.785.782,48	0,77%	1.068	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	48.142.242,48	13,28%	868	0,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	44.723.952,73	12,33%	1.073	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	21.920.163,17	6,05%	1.024	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	909.965,41	0,25%	272	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	10.048.033,19	2,77%	798	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	6.567.248,08	1,81%	166	1,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	18.106.353,09	4,99%	1.175	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	28.304.583,28	7,81%	547	0,75%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	25.970.854,03	7,16%	974	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.084.665,25	2,51%	134	1,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	27.598.730,99	7,61%	948	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.235.487,35	0,34%	262	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	7.168.135,67	1,98%	33.893	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	10.603.335,15	2,92%	2.100	1,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	241.557,68	0,07%	25.804	0,02%	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 RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.521.381,92	0,42%	40.998	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.517.165,56	0,97%	177	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	7.440.971,04	2,05%	128	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	7.510.237,31	2,07%	152	0,54%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.344.598,33	0,92%	522	0,15%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	328.703,56	0,09%	50.585	0,01%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.232.368,11	1,99%	9.808	0,29%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	4.736.178,56	1,31%	12.074	0,23%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		45.174,04	0,01%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			362.596.759,30				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			45.174,04	Artigo 6º			
PL Total			362.641.933,34				

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

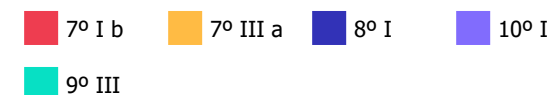
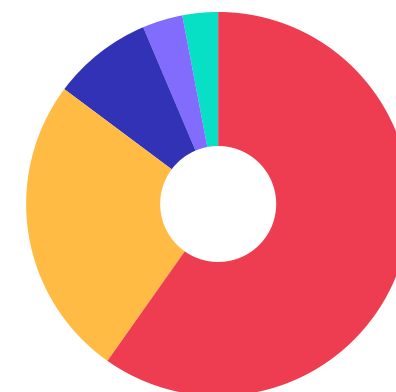
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	108.779.027,79
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	216.757.805,51	59,78%	40,00%	52,00%	80,00%	73.319.601,93
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	92.194.320,90	25,43%	15,00%	20,00%	60,00%	125.363.734,68
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	72.519.351,86
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	18.129.837,97
Total Renda Fixa	100,00%	308.952.126,41	85,21%	55,00%	80,00%	195,00%	



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%	30.492.547,02	8,41%	7,00%	12,00%	30,00%	78.286.480,77
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	12.297.250,23	3,39%	1,00%	4,00%	10,00%	23.962.425,70
Total Renda Variável	30,00%	42.789.797,25	11,80%	8,00%	16,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.129.837,97
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	10.854.835,64	2,99%	1,00%	4,00%	10,00%	25.404.840,29
Total Exterior	10,00%	10.854.835,64	2,99%	1,00%	4,00%	15,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	207.167.152,30	57,13	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	147.988.635,96	40,81	0,01
VINCI PARTNERS	7.440.971,04	2,05	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	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	216.757.805,51	59,78	40,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	63.889.737,62	17,62	15,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	30.492.547,02	8,41	7,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	10.854.835,64	2,99	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	12.297.250,23	3,39	1,00	10,00
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%	-	-
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%

IMA Geral (Benchmark)	0,43%	4,49%	1,90%	4,49%	5,34%	9,08%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,40%	4,20%	1,83%	4,20%	5,03%	7,86%	1,08%	0,03%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	4,14%	1,78%	4,14%	4,96%	7,49%	1,03%	0,03%

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%	-	-
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%	-	-
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%
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%	-	-
--------------------------	--------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	4,22%	1,41%	4,22%	3,48%	10,88%	2,02%	0,06%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,36%	4,21%	1,40%	4,21%	3,50%	10,92%	2,06%	0,06%
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%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,06%	5,60%	2,97%	5,60%	9,19%	11,59%	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%

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%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	4,30%	2,02%	4,30%	5,27%	8,66%	0,81%	0,02%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,09%	4,95%	2,32%	4,95%	4,93%	7,33%	1,55%	0,03%

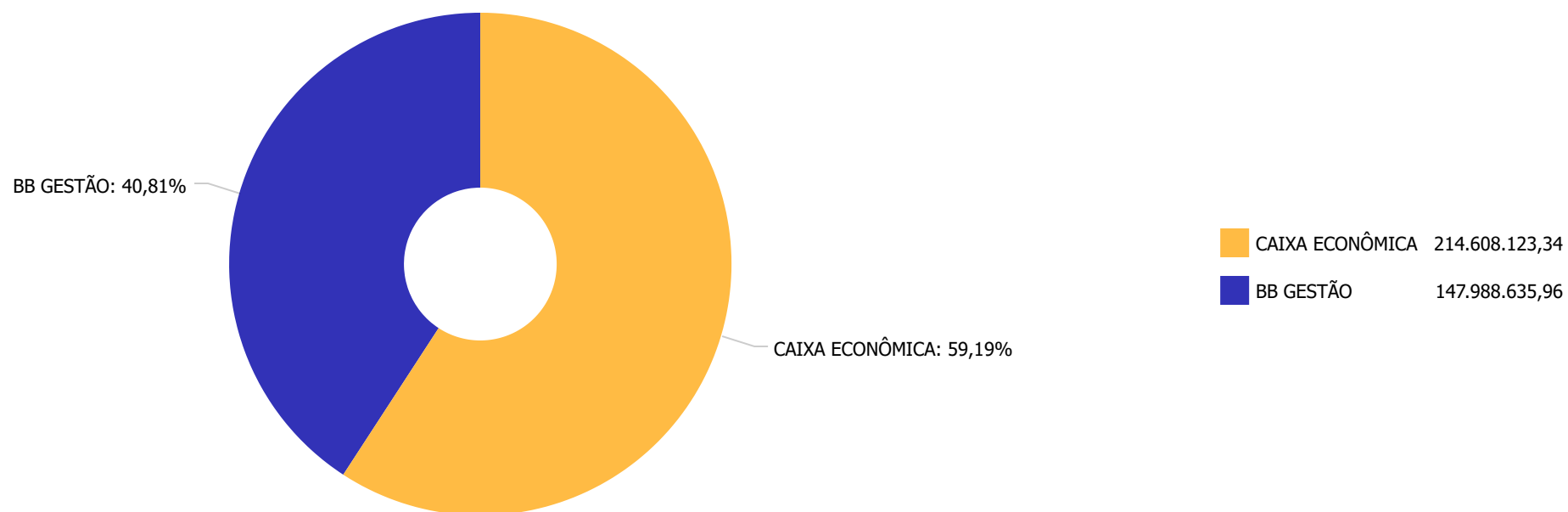
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - RENDA VARIÁVEL

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,83%	-27,83%	-10,22%	-27,83%	-13,08%	9,72%	12,50%	0,20%
Ibovespa (Benchmark)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-10,81%	-2,24%	-16,40%	-2,24%	-21,51%	0,93%	8,22%	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%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-11,61%	-8,53%	-15,87%	-8,53%	-16,66%	12,69%	9,62%	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%
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%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,06%	5,55%	1,91%	5,55%	6,73%	10,54%	0,84%	0,02%
MSCI ACWI (Benchmark)	1,26%	-25,79%	-7,28%	-25,79%	-13,20%	8,75%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-7,78%	-17,57%	-14,98%	-17,57%	-5,74%	30,65%	13,68%	0,19%

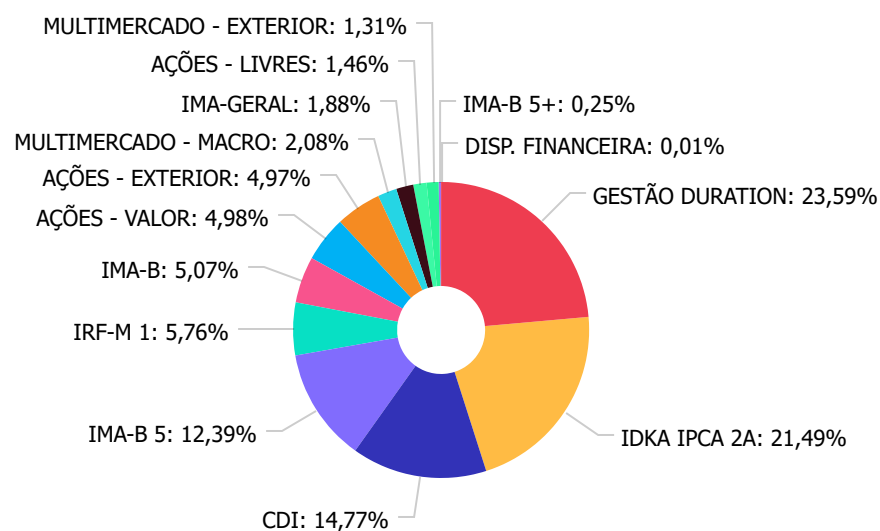
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

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

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



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

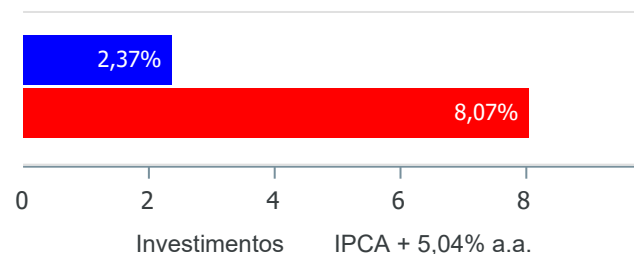


■ GESTÃO DURATION	85.531.491,01	■ IDKA IPCA 2A	77.914.209,45	■ CDI	53.569.585,02	■ IMA-B 5	44.934.721,74
■ IRF-M 1	20.892.135,57	■ IMA-B	18.391.827,30	■ AÇÕES - VALOR	18.044.306,19	■ AÇÕES - EXTERIOR	18.022.971,31
■ MULTIMERCADO - MACRO	7.561.071,67	■ IMA-GERAL	6.808.190,91	■ AÇÕES - LIVRES	5.280.105,16	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	4.736.178,56
■ IMA-B 5+	909.965,41	■ DISP. FINANCEIRA	45.174,04				

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	307.630.138,83	17.324.185,72	1.711.094,44	323.807.902,43	564.672,32	564.672,32	0,17%	0,17%	0,95%	0,95%	18,33%	2,11%
Fevereiro	323.807.902,43	5.168.183,50	1.588.828,10	328.633.959,32	1.246.701,49	1.811.373,81	0,38%	0,56%	1,39%	2,35%	23,65%	2,03%
Março	328.633.959,32	7.078.679,10	1.843.163,25	340.450.628,10	6.581.152,93	8.392.526,74	1,97%	2,54%	2,06%	4,46%	56,95%	2,42%
Abril	340.450.628,10	6.909.788,19	1.906.063,95	344.290.671,30	-1.163.681,04	7.228.845,70	-0,34%	2,19%	1,44%	5,96%	36,82%	2,10%
Maio	344.290.671,30	8.207.993,46	1.632.135,36	354.165.264,76	3.298.735,36	10.527.581,06	0,94%	3,15%	0,90%	6,91%	45,63%	2,28%
Junho	354.165.264,76	8.105.084,11	1.806.999,98	357.725.687,59	-2.737.661,30	7.789.919,76	-0,76%	2,37%	1,08%	8,07%	29,37%	2,33%

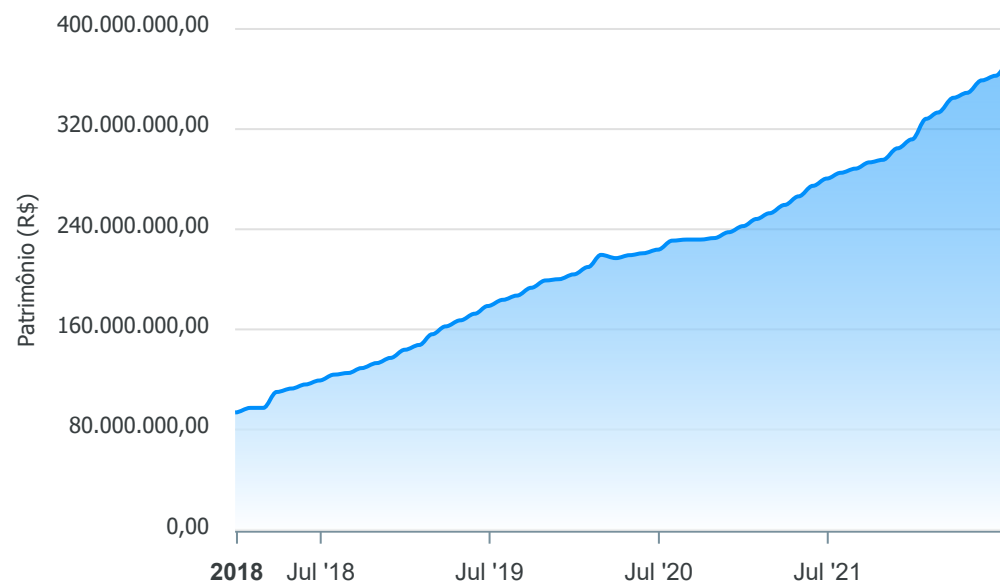
Investimentos x Meta de Rentabilidade



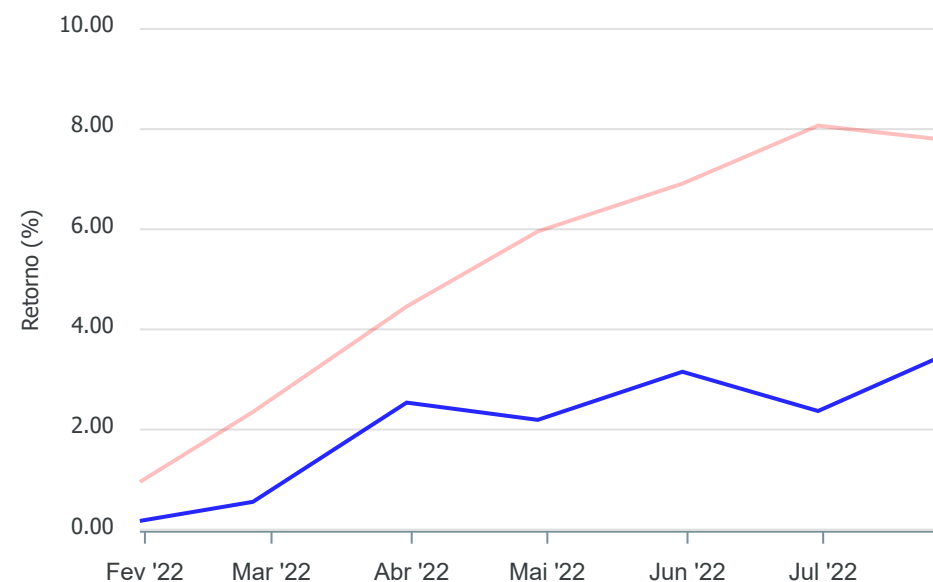
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	27.309.087,76	0,00	0,00	27.598.730,99	289.643,23	1,06%	1,06%	0,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	25.707.121,72	0,00	0,00	25.970.854,03	263.732,31	1,03%	1,03%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	17.977.455,00	0,00	34.513,29	18.106.353,09	163.411,38	0,91%	0,91%	0,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.455.931,96	75.000,00	1.772.486,69	2.785.782,48	27.337,21	0,60%	0,92%	0,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	28.174.241,97	0,00	0,00	28.304.583,28	130.341,31	0,46%	0,46%	0,81%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	239.968,84	0,00	0,00	240.942,83	973,99	0,41%	0,41%	1,03%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	6.541.296,15	0,00	0,00	6.567.248,08	25.951,93	0,40%	0,40%	1,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.847.285,17	0,00	0,00	21.920.163,17	72.878,00	0,33%	0,33%	1,23%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	33.102.169,86	0,00	0,00	33.190.256,72	88.086,86	0,27%	0,27%	1,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	48.031.571,66	0,00	0,00	48.142.242,48	110.670,82	0,23%	0,23%	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	44.623.844,64	0,00	0,00	44.723.952,73	100.108,09	0,22%	0,22%	1,39%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.859.885,60	8.105.084,11	0,00	23.014.558,57	49.588,86	0,22%	0,32%	1,26%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	9.076.894,42	0,00	0,00	9.084.665,25	7.770,83	0,09%	0,09%	1,55%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.133.469,00	0,00	0,00	7.108.306,76	-25.162,24	-0,35%	-0,35%	2,02%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.239.914,12	0,00	0,00	1.235.487,35	-4.426,77	-0,36%	-0,36%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.086.199,35	0,00	0,00	10.048.033,19	-38.166,16	-0,38%	-0,38%	2,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	920.084,88	0,00	0,00	909.965,41	-10.119,47	-1,10%	-1,10%	3,18%
Total Renda Fixa	301.326.422,10	8.180.084,11	1.806.999,98	308.952.126,41	1.252.620,18	0,41%		1,07%

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 MACRO FIC MULTIMERCADO LP	328.887,03	0,00	0,00	328.703,56	-183,47	-0,06%	-0,06%	0,84%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.290.551,20	0,00	0,00	7.232.368,11	-58.183,09	-0,80%	-0,80%	1,52%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	7.744.611,69	0,00	0,00	7.168.135,67	-576.476,02	-7,44%	-7,44%	14,21%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.135.749,06	0,00	0,00	4.736.178,56	-399.570,50	-7,78%	-7,78%	13,68%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.930.865,58	0,00	0,00	3.517.165,56	-413.700,02	-10,52%	-10,52%	8,01%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	8.342.586,81	0,00	0,00	7.440.971,04	-901.615,77	-10,81%	-10,81%	8,22%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	11.995.858,85	0,00	0,00	10.603.335,15	-1.392.523,70	-11,61%	-11,61%	9,62%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.725.625,73	0,00	0,00	1.521.381,92	-204.243,81	-11,84%	-11,84%	9,60%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	276.903,20	0,00	0,00	241.557,68	-35.345,52	-12,76%	-12,76%	9,44%
Total Renda Variável	46.771.639,15	0,00	0,00	42.789.797,25	-3.981.841,90	-8,51%		9,03%

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	3.317.149,80	0,00	0,00	3.344.598,33	27.448,53	0,83%	0,83%	12,50%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.502.680,76	0,00	0,00	7.510.237,31	7.556,55	0,10%	0,10%	11,56%
Total Exterior	10.819.830,56	0,00	0,00	10.854.835,64	35.005,08	0,32%		11,85%

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...	43.635.243,90	0,00	0,00	44.723.952,73	1.088.708,83	2,50%	2,50%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	47.096.361,95	0,00	0,00	48.142.242,48	1.045.880,53	2,22%	2,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	32.367.308,14	0,00	0,00	33.190.256,72	822.948,58	2,54%	2,54%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	26.803.780,83	0,00	0,00	27.598.730,99	794.950,16	2,97%	2,97%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	11.187.989,37	14.207.993,46	0,00	25.970.854,03	574.871,20	2,26%	2,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.353.551,58	0,00	0,00	21.920.163,17	566.611,59	2,65%	2,65%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	27.744.096,86	0,00	0,00	28.304.583,28	560.486,42	2,02%	2,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	17.687.353,14	0,00	40.913,29	18.106.353,09	459.913,24	2,60%	2,58%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.524.496,30	8.105.084,11	0,00	23.014.558,57	384.978,16	1,70%	2,63%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	8.879.023,42	0,00	0,00	9.084.665,25	205.641,83	2,32%	2,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	11.524.833,73	0,00	1.623.589,20	10.048.033,19	146.788,66	1,27%	1,39%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	8.065.438,36	0,00	1.628.935,36	6.567.248,08	130.745,08	1,62%	1,83%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.289.567,38	0,00	282.474,75	7.108.306,76	101.214,13	1,39%	1,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.262.758,85	1.204.788,19	1.772.486,69	2.785.782,48	90.722,13	2,03%	2,56%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.218.471,50	0,00	0,00	1.235.487,35	17.015,85	1,40%	1,40%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	236.725,10	0,00	0,00	240.942,83	4.217,73	1,78%	1,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	909.330,86	0,00	0,00	909.965,41	634,55	0,07%	0,07%
Total Renda Fixa	283.786.331,27	23.517.865,76	5.348.399,29	308.952.126,41	6.996.328,67	2,32%	

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 MACRO FIC MULTIMERCADO LP	322.533,20	0,00	0,00	328.703,56	6.170,36	1,91%	1,91%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.236.235,25	0,00	0,00	7.232.368,11	-3.867,14	-0,05%	-0,05%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	290.372,96	0,00	0,00	241.557,68	-48.815,28	-16,81%	-16,81%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.818.605,44	0,00	0,00	1.521.381,92	-297.223,52	-16,34%	-16,34%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.932.515,69	0,00	0,00	3.517.165,56	-415.350,13	-10,56%	-10,56%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.570.569,37	0,00	0,00	4.736.178,56	-834.390,81	-14,98%	-14,98%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	8.418.639,23	0,00	0,00	7.168.135,67	-1.250.503,56	-14,85%	-14,85%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	8.900.507,57	0,00	0,00	7.440.971,04	-1.459.536,53	-16,40%	-16,40%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	12.603.109,15	0,00	0,00	10.603.335,15	-1.999.774,00	-15,87%	-15,87%
Total Renda Variável	49.093.087,86	0,00	0,00	42.789.797,25	-6.303.290,61	-12,84%	

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	3.725.211,87	0,00	0,00	3.344.598,33	-380.613,54	-10,22%	-10,22%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.307.052,19	0,00	0,00	7.510.237,31	-796.814,88	-9,59%	-9,59%
Total Exterior	12.032.264,06	0,00	0,00	10.854.835,64	-1.177.428,42	-9,79%	

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...	42.028.757,20	0,00	0,00	44.723.952,73	2.695.195,53	6,41%	6,41%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	46.030.702,48	0,00	0,00	48.142.242,48	2.111.540,00	4,59%	4,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	31.177.226,39	0,00	0,00	33.190.256,72	2.013.030,33	6,46%	6,46%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.469.144,27	4.734.203,20	0,00	27.598.730,99	1.395.383,52	5,33%	5,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	20.580.123,40	0,00	0,00	21.920.163,17	1.340.039,77	6,51%	6,51%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	27.137.903,54	0,00	0,00	28.304.583,28	1.166.679,74	4,30%	4,30%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	8.828.629,83	13.286.174,82	0,00	23.014.558,57	899.753,92	4,07%	6,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	17.590.767,56	0,00	328.014,90	18.106.353,09	843.600,43	4,80%	4,86%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	5.736.586,83	20.922.842,14	1.404.057,40	25.970.854,03	715.482,46	2,68%	5,54%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.379.206,46	0,00	4.793.278,08	10.048.033,19	462.104,81	3,21%	4,25%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	7.877.959,45	797.810,72	0,00	9.084.665,25	408.895,08	4,71%	4,95%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	7.882.340,65	0,00	1.628.935,36	6.567.248,08	313.842,79	3,98%	4,20%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.093.486,60	0,00	282.474,75	7.108.306,76	297.294,91	4,19%	4,22%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.061.332,85	2.638.706,30	2.070.724,59	2.785.782,48	156.467,92	3,33%	4,85%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.185.610,43	0,00	0,00	1.235.487,35	49.876,92	4,21%	4,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	892.585,23	0,00	0,00	909.965,41	17.380,18	1,95%	1,95%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	231.364,56	0,00	0,00	240.942,83	9.578,27	4,14%	4,14%
Total Renda Fixa	262.183.727,73	42.379.737,18	10.507.485,08	308.952.126,41	14.896.146,58	5,07%	

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 ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.953.196,45	0,00	0,00	7.232.368,11	279.171,66	4,02%	4,02%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	311.415,65	0,00	0,00	328.703,56	17.287,91	5,55%	5,55%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	260.423,46	0,00	0,00	241.557,68	-18.865,78	-7,24%	-7,24%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.649.437,30	0,00	0,00	3.517.165,56	-132.271,74	-3,62%	-3,62%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	7.611.294,34	0,00	0,00	7.440.971,04	-170.323,30	-2,24%	-2,24%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.749.155,95	0,00	0,00	1.521.381,92	-227.774,03	-13,02%	-13,02%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	332.762,63	5.000.000,00	0,00	4.736.178,56	-596.584,07	-11,19%	-17,57%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	11.591.992,61	0,00	0,00	10.603.335,15	-988.657,46	-8,53%	-8,53%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	6.555.127,45	2.000.000,00	0,00	7.168.135,67	-1.386.991,78	-16,21%	-17,82%
Total Renda Variável	39.014.805,84	7.000.000,00	0,00	42.789.797,25	-3.225.008,59	-7,01%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	234.831,90	4.000.000,00	0,00	3.344.598,33	-890.233,57	-21,02%	-27,83%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.289.054,14	0,00	0,00	7.510.237,31	-2.778.816,83	-27,01%	-27,01%
Total Exterior	10.523.886,04	4.000.000,00	0,00	10.854.835,64	-3.669.050,40	-25,26%	

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.