

# 2022

## Relatório

### Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2022

## Junho

## Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MPS nº 519 de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V, e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.2, ítem 3.2.6, aprovado pela Portaria SPREV nº 3030, de 15 de Março de 2021.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.099.733,25	2,73%	5.102.683.195,98	0,16%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.849.692,71	1,63%	9.717.321.383,29	0,05%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	728.540,86	0,25%	5.700.982.768,47	0,01%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.991.954,46	3,70%	5.103.254.867,87	0,22%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	724.086,68	0,24%	3.520.668.596,00	0,02%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.062.914,02	6,76%	2.872.769.394,76	0,70%	7º I b
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.711.043,60	3,27%	591.945.993,72	1,64%	7º I b
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.047.007,18	3,38%	3.451.516.253,51	0,29%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.046.441,65	3,38%	6.957.180.815,09	0,14%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	26.706.555,60	9,00%	11.226.926.091,22	0,24%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	43.710.550,64	14,72%	11.084.704.335,99	0,39%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.802.579,14	12,73%	1.212.673.784,01	3,12%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	441.950,77	0,15%	4.111.516.095,57	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.641.457,22	0,89%	571.753.898,32	0,46%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.124.497,56	4,42%	5.096.804.349,76	0,26%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	47.877,65	0,02%	1.835.852.466,18	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	400.653,13	0,13%	142.319.131,43	0,28%	7º I b
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	662.339,48	0,22%	786.311.506,32	0,08%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	18.250.939,25	6,15%	9.838.414.136,64	0,19%	7º III a
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.993.924,74	1,35%	857.365.563,33	0,47%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	426.449,20	0,14%	1.352.871.181,17	0,03%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	21.038.273,13	7,09%	4.894.755.710,10	0,43%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	608.241,27	0,20%	2.202.359.178,53	0,03%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	19.147.731,77	6,45%	2.668.371.249,57	0,72%	7º III a
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1.432.272,88	0,48%	784.041.551,98	0,18%	7º III a
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.559.920,00	2,21%	219.095.498,14	2,99%	7º V b
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	458.288,29	0,15%	231.443.985,24	0,20%	8º I

**Investimentos**

\$ 296.894.307,47

**Disponibilidades Financeiras**

\$ 0,00

**Total Carteira**

\$ 296.894.307,47

**Governança (Pró Gestão)**
 Não possui

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	193.549,24	0,07%	658.062.057,54	0,03%	8º I
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	178.647,76	0,06%	424.182.243,03	0,04%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.403.761,17	1,15%	2.383.481.665,49	0,14%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.968.801,56	0,66%	537.669.914,17	0,37%	8º I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	468.507,31	0,16%	251.804.459,59	0,19%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.606.217,89	0,88%	420.593.709,32	0,62%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.749.113,06	2,27%	2.225.410.384,30	0,30%	9º III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	364.330,37	0,12%	48.184.890,26	0,76%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	7.500.216,53	2,53%	1.374.157.964,02	0,55%	10º I
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	256.987,67	0,09%	252.159.138,73	0,10%	10º I
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	488.258,78	0,16%	212.316.465,17	0,23%	NE

**Investimentos**

\$ 296.894.307,47

**Disponibilidades Financeiras**

\$ 0,00

**Total Carteira**

\$ 296.894.307,47

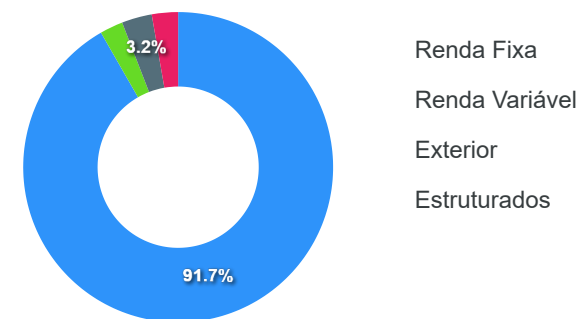
**Governança (Pró Gestão)**
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	67,41%	200.137.536,12 32,59% 96.756.771,35
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	22,08%	65.560.171,72 37,92% 112.576.412,76
7° V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	2,21%	6.559.920,00 2,79% 8.284.795,37
8° I - Fundos de Ações	30,00%	2,25%	6.671.555,33 27,75% 82.396.736,91
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,15%	9.355.330,95 6,85% 20.334.099,80
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	2,74%	8.121.534,57 7,26% 21.567.896,18
Não Enquadrado	0,00%	0,16%	488.258,78 -0,16% -488.258,78

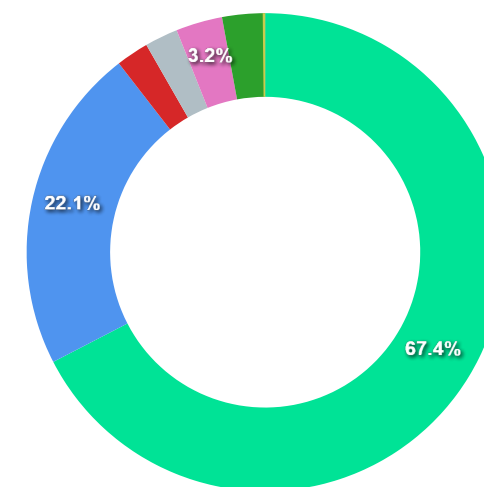
#### Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

#### Segmentos



#### Artigos



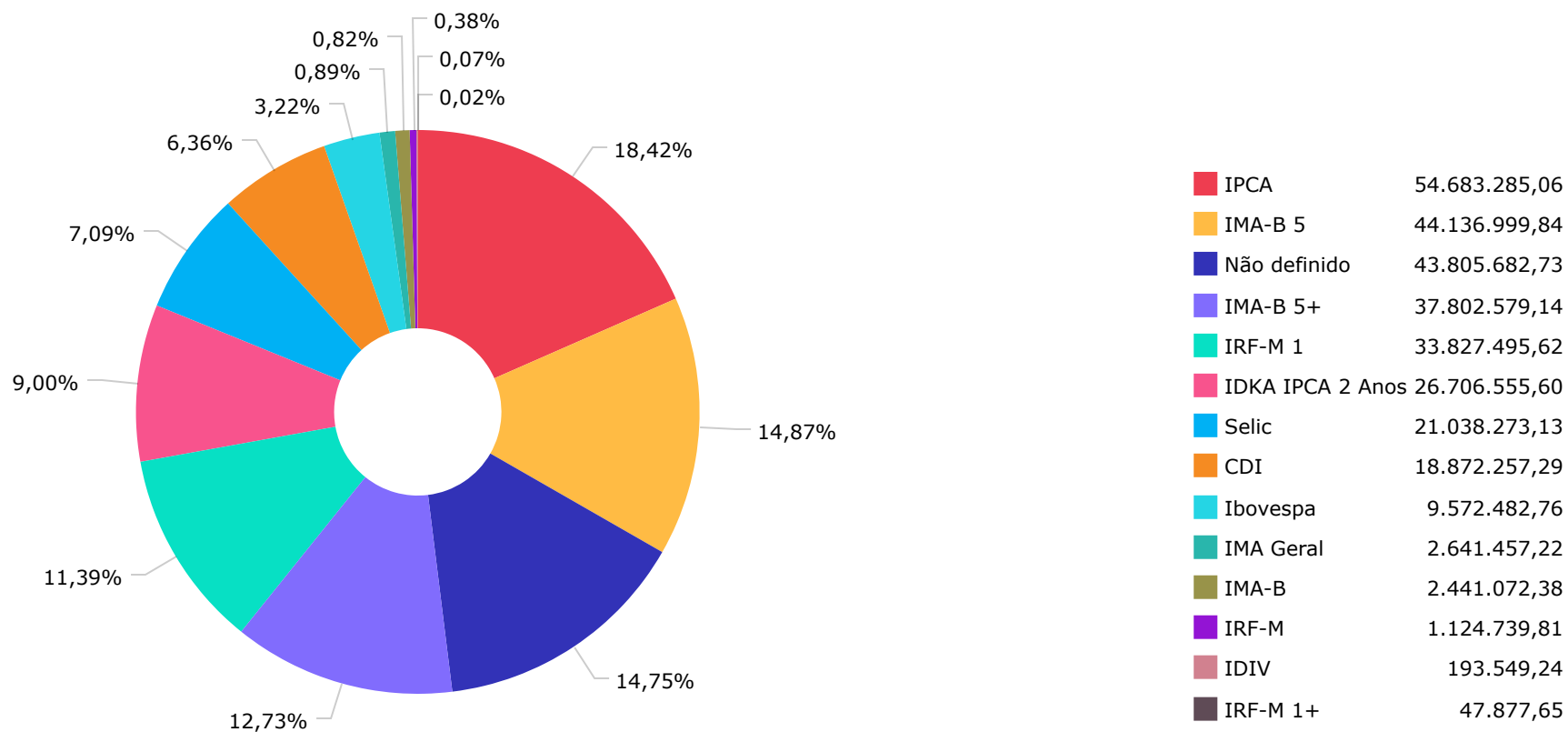
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	20,00%	100,00%	296.894.307,47	8° I - Fundos de Ações	2,25%	0,00%	10,00%	30,00%	82.396.736,91
7° I b - FI 100% Títulos TN	67,41%	0,00%	34,00%	100,00%	96.756.771,35	9° III - Ações - BDR Nível I	3,15%	0,00%	8,00%	10,00%	20.334.099,80
7° III a - FI Referenciados RF	22,08%	0,00%	20,00%	60,00%	112.576.412,76	10° I - Fundos Multimercados	2,74%	0,00%	5,00%	10,00%	21.567.896,18
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	2,21%	0,00%	3,00%	5,00%	8.284.795,37	Não Enquadrado	0,16%	0,00%	0,00%	0,00%	-488.258,78

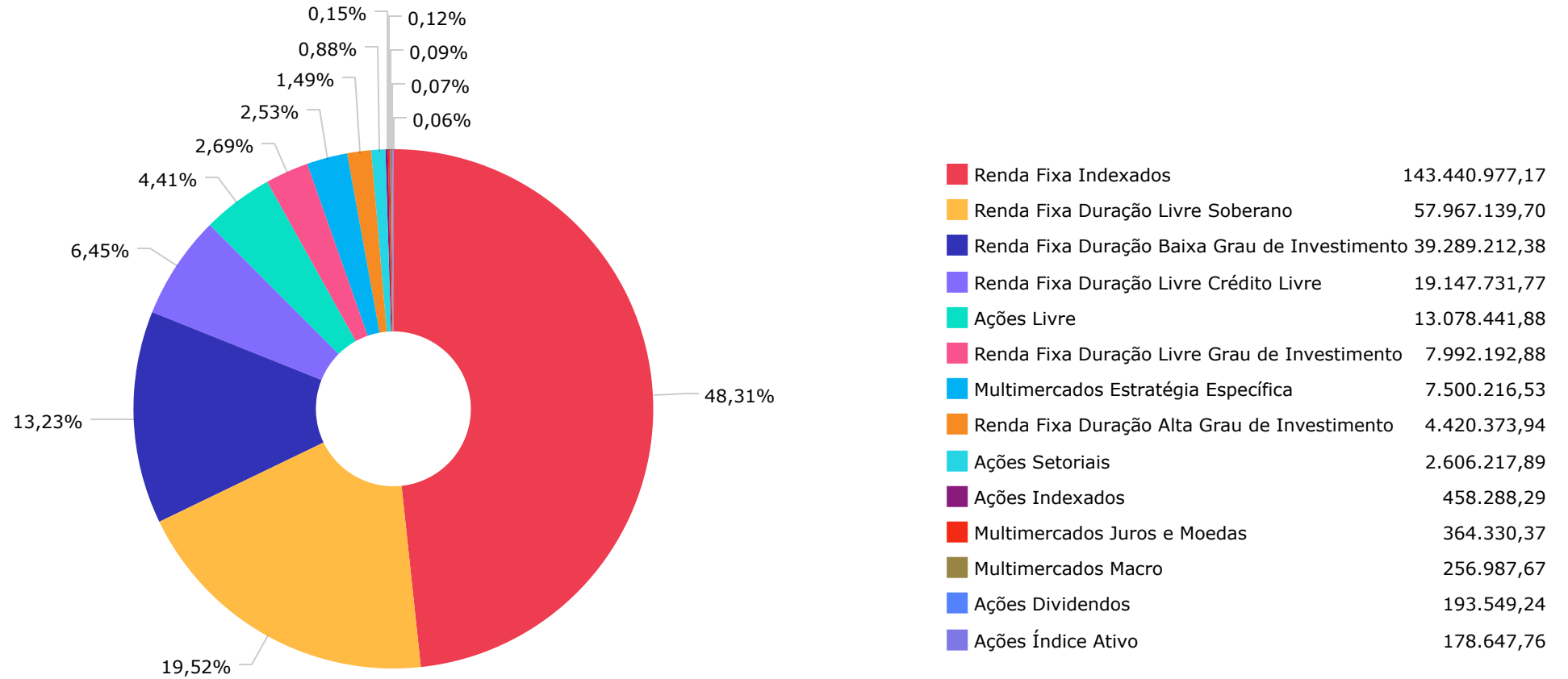
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>NÃO DEFINIDO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,27	6,46	2,54	6,46	9,84	16,85	1,38	2,90
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,42	6,81	2,79	6,81	7,85	13,60	1,14	2,40
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33	3,71	1,67	3,71	4,01	6,69	1,11	2,33
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-7,79	-17,59	-14,94	-17,59	-5,80	31,34	13,65	28,75
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,83	-27,83	-10,22	-27,83	-13,08	9,72	12,50	26,32
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,32		-0,26				1,37	2,89
<b>CDI - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,95	5,77	2,86	5,77	9,16	11,76	0,08	0,18
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,03	5,54	2,90	5,54	8,98	11,54	0,01	0,02
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,94	5,13	2,67	5,13	8,17	13,57	0,20	0,43
<b>IBOVESPA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	-5,61	7,83	-6,75	7,83	-8,37	1,77	7,97	16,78
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	-7,18	4,03	-7,38	4,03	-18,60	2,80	8,32	17,52
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	-11,56	-6,71	-18,11	-6,71	-23,39	0,63	8,86	18,66
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-11,11	-8,68	-13,57	-8,68	-25,55	2,22	8,32	17,52
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	-11,17	-5,01	-15,12	-5,01	-25,98	-0,10	8,29	17,46
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-10,46	-10,71	-19,62	-10,71	-32,68	-18,43	8,99	18,92
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-8,65	-31,34	-23,55	-31,34	-41,86	-19,23	13,65	28,75
<b>IDIV - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-9,18	-0,29	-13,28	-0,29	-12,84	10,61	7,94	16,73
<b>IDKA IPCA 2 ANOS - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
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	2,93

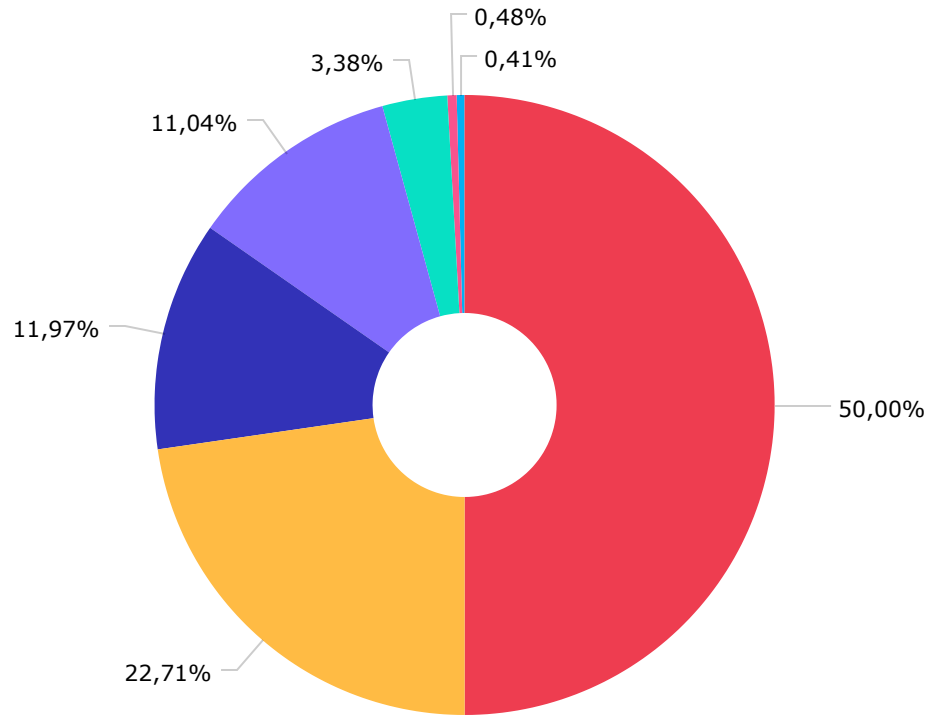
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>IMA GERAL - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>0,43</b>	<b>4,49</b>	<b>1,90</b>	<b>4,49</b>	<b>5,34</b>	<b>9,08</b>		
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,40	4,20	1,83	4,20	5,03	7,86	1,08	2,28
<b>IMA-B - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>-0,36</b>	<b>4,35</b>	<b>1,43</b>	<b>4,35</b>	<b>3,78</b>	<b>11,48</b>		
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,41	4,26	1,36	4,26	3,58	10,95	2,09	4,39
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,38	4,25	1,39	4,25	3,52	10,96	2,05	4,32
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,36	4,21	1,40	4,21	3,50	10,92	2,06	4,34
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,35	4,22	1,41	4,22	3,48	10,88	2,02	4,26
<b>IMA-B 5 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>0,33</b>	<b>6,61</b>	<b>2,69</b>	<b>6,61</b>	<b>10,06</b>	<b>16,74</b>		
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	2,59
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,28	6,31	2,55	6,31	9,47	15,15	1,27	2,67
<b>IMA-B 5+ - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>-1,10</b>	<b>2,03</b>	<b>0,12</b>	<b>2,03</b>	<b>-2,16</b>	<b>6,18</b>		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,10	1,95	0,07	1,95	-2,61	5,50	3,18	6,70
<b>IPCA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>0,67</b>	<b>5,49</b>	<b>2,22</b>	<b>5,49</b>	<b>11,89</b>	<b>21,23</b>		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33	7,12	3,08	7,12	10,31	16,86	1,37	2,89
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,79	5,28	2,57	5,28	8,95	10,68	0,42	0,89
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,18	5,81	2,24	5,81	8,68	16,71	1,65	3,48
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,32	4,08	1,69	4,08	4,75	6,86	1,08	2,28
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,23	4,59	2,22	4,59	3,73	6,51	1,57	3,30
<b>IRF-M - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>0,37</b>	<b>2,19</b>	<b>0,83</b>	<b>2,19</b>	<b>1,76</b>	<b>1,90</b>		
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,93	4,93	2,61	4,93	7,03	8,93	0,17	0,35
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,34	2,11	0,81	2,11	1,51	1,42	1,76	3,71

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>IRF-M 1 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>0,93</b>	<b>4,99</b>	<b>2,65</b>	<b>4,99</b>	<b>7,19</b>	<b>9,37</b>		
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92	4,87	2,56	4,87	7,00	8,75	0,17	0,35
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91	4,86	2,58	4,86	6,94	8,89	0,17	0,35
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92	4,85	2,56	4,85	6,92	8,69	0,17	0,36
<b>IRF-M 1+ - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>0,09</b>	<b>0,73</b>	<b>-0,06</b>	<b>0,73</b>	<b>-1,02</b>	<b>-2,10</b>		
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04	0,62	-0,11	0,62	-1,34	-2,63	2,55	5,38
<b>SELIC - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>1,01</b>	<b>5,40</b>	<b>2,91</b>	<b>5,40</b>	<b>8,66</b>	<b>11,12</b>		
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08	5,71	3,07	5,71	9,36	12,01	0,02	0,04

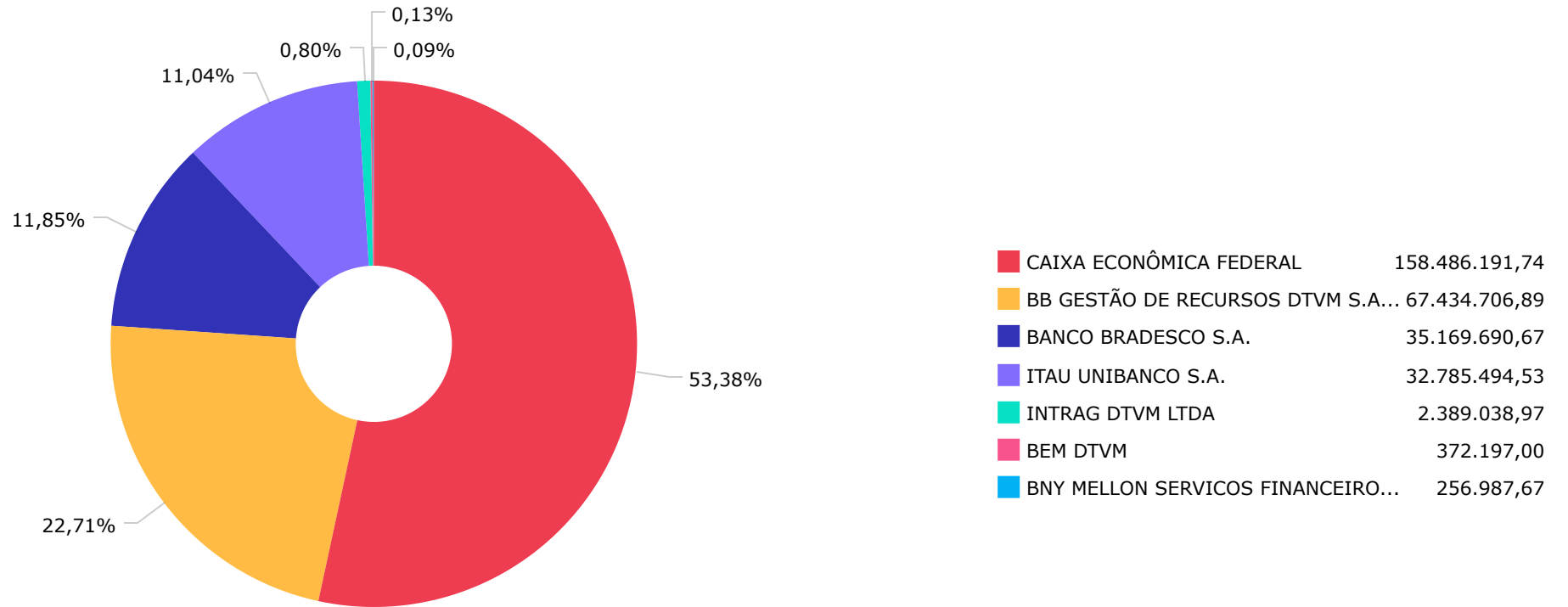








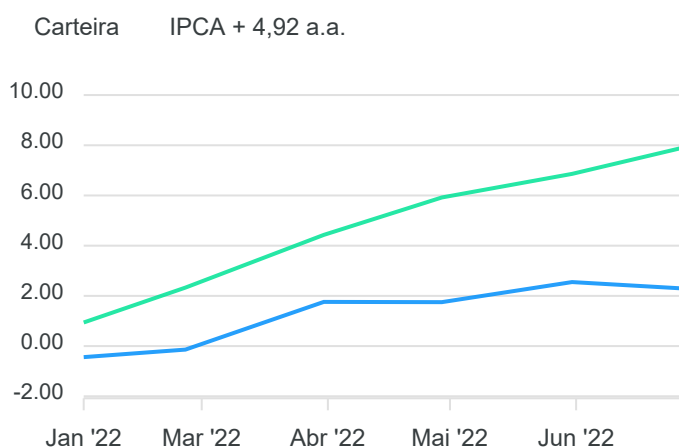
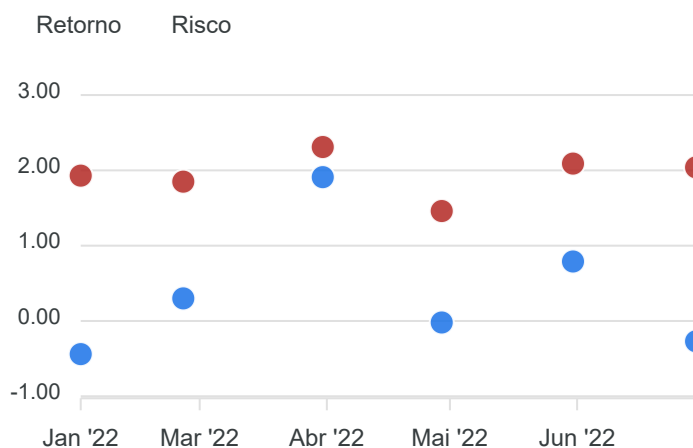
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	148.439.184,56
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	67.434.706,89
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	35.541.887,67
ITAU UNIBANCO S.A.	32.785.494,53
CAIXA DTVM	10.047.007,18
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA...	1.432.272,88
XP GESTAO DE RECURSOS LTDA	1.213.753,76



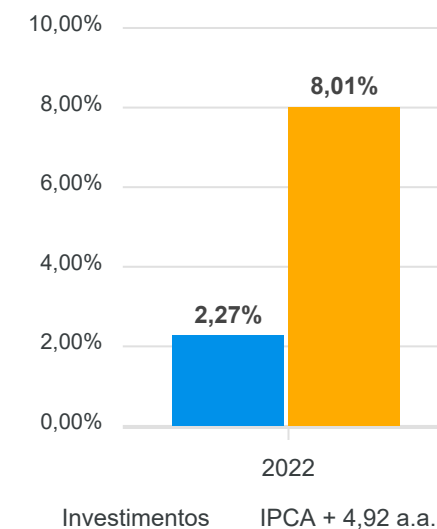
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	279.624.240,93	2.170.172,20	803.243,98	279.747.225,35	-1.243.943,80	-0,44% ▼	0,94%	1,93%
Fevereiro	279.747.225,35	2.578.174,19	927.658,99	282.243.315,30	845.574,75	0,30% ▲	1,38%	1,85%
Março	282.243.315,30	4.071.434,84	2.371.798,38	289.365.624,97	5.422.673,21	1,91% ▲	2,05%	2,31%
Abril	289.365.624,97	2.627.947,54	933.666,93	291.015.434,72	-44.470,86	-0,02% ▼	1,43%	1,46%
Mai	291.015.434,72	2.808.812,08	67.506,71	296.073.713,05	2.316.972,96	0,79% ▲	0,89%	2,09%
Junho	296.073.713,05	32.709.149,84	31.081.241,00	296.894.307,47	-807.314,42	-0,27% ▼	1,07%	2,04%

Retorno Acumulado			
Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	5.024.304,16	1,76%	4,43%
2º Trim	1.465.187,68	0,50%	3,43%
1º Sem	6.489.491,84	2,27%	8,01%

Acumulado 6.489.491,84 2,27% ▲ 8,01%



Retorno e Meta Acumulado



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.066.034,03	0,00	20.000.000,00	8.099.733,25	33.699,22	0,12% ▲	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.836.821,64	0,00	0,00	4.849.692,71	12.871,07	0,27% ▲	1,38%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	665.041,18	0,00	0,00	662.339,48	-2.701,70	-0,41% ▼	2,09%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	731.119,78	0,00	0,00	728.540,86	-2.578,92	-0,35% ▼	2,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.891.954,15	0,00	0,00	10.991.954,46	100.000,31	0,92% ▲	0,17%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	721.644,91	0,00	0,00	724.086,68	2.441,77	0,34% ▲	1,76%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	18.065.602,16	0,00	0,00	18.250.939,25	185.337,09	1,03% ▲	0,01%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.981.065,23	0,00	0,00	3.993.924,74	12.859,51	0,32% ▲	1,08%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	425.271,75	0,00	0,00	426.449,20	1.177,45	0,28% ▲	1,27%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.622.487,53	0,00	0,00	9.711.043,60	88.556,07	0,92% ▲	0,17%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.813.866,90	0,00	0,00	21.038.273,13	224.406,23	1,08% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	20.971.975,53	0,00	10.908.993,87	10.046.441,65	-16.540,01	-0,08% ▼	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	26.646.776,87	0,00	0,00	26.706.555,60	59.778,73	0,22% ▲	1,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	40.873.994,87	2.699.830,02	0,00	43.710.550,64	136.725,75	0,31% ▲	1,23%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.222.970,80	0,00	0,00	37.802.579,14	-420.391,66	-1,10% ▼	3,18%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	443.629,47	0,00	0,00	441.950,77	-1.678,70	-0,38% ▼	2,05%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.631.018,91	0,00	0,00	2.641.457,22	10.438,31	0,40% ▲	1,08%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.532.617,60	0,00	0,00	6.559.920,00	27.302,40	0,42% ▲	1,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.167.851,28	9.319,82	172.247,13	13.124.497,56	119.573,59	0,91% ▲	0,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	47.856,27	0,00	0,00	47.877,65	21,38	0,04% ▲	2,55%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	610.420,61	0,00	0,00	608.241,27	-2.179,34	-0,36% ▼	2,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	18.998.538,84	0,00	0,00	19.147.731,77	149.192,93	0,79% ▲	0,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	396.967,90	0,00	0,00	400.653,13	3.685,23	0,93% ▲	0,17%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1.429.695,15	0,00	0,00	1.432.272,88	2.577,73	0,18% ▲	1,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	20.000.000,00	0,00	20.062.914,02	62.914,02	0,31% ▲	1,37%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	10.047.007,18	47.007,18	0,47% ▲	1,37%

---

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
	269.795.223,36	32.709.149,84	31.081.241,00	272.257.627,84	834.495,64	0,31%	1,18%

---

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	518.218,38	0,00	0,00	458.288,29	-59.930,09	-11,56% ▼	8,86%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	213.124,59	0,00	0,00	193.549,24	-19.575,35	-9,18% ▼	7,94%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	201.119,14	0,00	0,00	178.647,76	-22.471,38	-11,17% ▼	8,29%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.829.035,93	0,00	0,00	3.403.761,17	-425.274,76	-11,11% ▼	8,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	360.899,61	0,00	0,00	364.330,37	3.430,76	0,95% ▲	0,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.198.880,00	0,00	0,00	1.968.801,56	-230.078,44	-10,46% ▼	8,99%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	8.133.646,63	0,00	0,00	7.500.216,53	-633.430,10	-7,79% ▼	13,65%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	526.024,80	0,00	0,00	488.258,78	-37.766,02	-7,18% ▼	8,32%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	496.353,30	0,00	0,00	468.507,31	-27.845,99	-5,61% ▼	7,97%
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	254.598,98	0,00	0,00	256.987,67	2.388,69	0,94% ▲	0,20%
-	16.731.901,36	0,00	0,00	15.281.348,68	-1.450.552,68	-8,67%	10,69%



INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.852.864,08	0,00	0,00	2.606.217,89	-246.646,19	-8,65% ▼	13,65%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.693.724,25	0,00	0,00	6.749.113,06	55.388,81	0,83% ▲	12,50%
	9.546.588,33	0,00	0,00	9.355.330,95	-191.257,38	-2,00%	3,80%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.694.916,23	0,00	20.000.000,00	8.099.733,25	404.817,02	1,46% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.258.832,48	2.477.056,39	0,00	4.849.692,71	113.803,84	2,40% ▲
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	653.423,08	0,00	0,00	662.339,48	8.916,40	1,36% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	718.398,17	0,00	0,00	728.540,86	10.142,69	1,41% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.717.504,24	0,00	0,00	10.991.954,46	274.450,22	2,56% ▲
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	718.255,08	0,00	0,00	724.086,68	5.831,60	0,81% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	15.189.245,24	2.572.715,45	0,00	18.250.939,25	488.978,56	2,75% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	20.000.000,00	0,00	20.062.914,02	62.914,02	0,31% ▲
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.927.460,64	0,00	0,00	3.993.924,74	66.464,10	1,69% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	415.860,79	0,00	0,00	426.449,20	10.588,41	2,55% ▲
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.468.804,26	0,00	0,00	9.711.043,60	242.239,34	2,56% ▲
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.411.844,12	0,00	0,00	21.038.273,13	626.429,01	3,07% ▲
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	10.047.007,18	47.007,18	0,47% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	21.284.109,75	0,00	11.633.483,64	10.046.441,65	395.815,54	1,86% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	26.056.441,72	0,00	0,00	26.706.555,60	650.113,88	2,50% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.925.525,36	2.725.147,64	0,00	43.710.550,64	1.059.877,64	2,49% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.776.217,81	0,00	0,00	37.802.579,14	26.361,33	0,07% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	435.891,91	0,00	0,00	441.950,77	6.058,86	1,39% ▲
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.593.880,36	0,00	0,00	2.641.457,22	47.576,86	1,83% ▲
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.381.878,40	0,00	0,00	6.559.920,00	178.041,60	2,79% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.870.939,31	370.989,98	448.931,00	13.124.497,56	331.499,27	2,50% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	47.930,72	0,00	0,00	47.877,65	-53,07	-0,11% ▼
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	599.864,22	0,00	0,00	608.241,27	8.377,05	1,40% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	18.667.712,02	0,00	0,00	19.147.731,77	480.019,75	2,57% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	390.452,76	0,00	0,00	400.653,13	10.200,37	2,61% ▲
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1.400.937,68	0,00	0,00	1.432.272,88	31.335,20	2,24% ▲

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
	260.606.326,35	38.145.909,46	32.082.414,64	272.257.627,84	5.587.806,67	2,10%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	559.661,24	0,00	0,00	458.288,29	-101.372,95	-18,11% ▼
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	223.179,62	0,00	0,00	193.549,24	-29.630,38	-13,28% ▼
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	210.471,24	0,00	0,00	178.647,76	-31.823,48	-15,12% ▼
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.938.361,48	0,00	0,00	3.403.761,17	-534.600,31	-13,57% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	354.199,05	0,00	0,00	364.330,37	10.131,32	2,86% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.449.366,41	0,00	0,00	1.968.801,56	-480.564,85	-19,62% ▼
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	8.817.869,40	0,00	0,00	7.500.216,53	-1.317.652,87	-14,94% ▼
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	527.175,89	0,00	0,00	488.258,78	-38.917,11	-7,38% ▼
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	502.402,41	0,00	0,00	468.507,31	-33.895,10	-6,75% ▼
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	250.308,69	0,00	0,00	256.987,67	6.678,98	2,67% ▲
	17.832.995,43	0,00	0,00	15.281.348,68	-2.551.646,75	-14,31%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.409.144,57	0,00	0,00	2.606.217,89	-802.926,68	-23,55% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.517.158,62	0,00	0,00	6.749.113,06	-768.045,56	-10,22% ▼
	10.926.303,19	0,00	0,00	9.355.330,95	-1.570.972,24	-14,38%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.150.441,15	0,00	20.000.000,00	8.099.733,25	949.292,10	3,50% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.175.779,69	2.477.056,39	0,00	4.849.692,71	196.856,63	4,23% ▲
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	635.281,68	0,00	0,00	662.339,48	27.057,80	4,26% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	699.074,11	0,00	0,00	728.540,86	29.466,75	4,22% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.681.171,95	0,00	200.259,50	10.991.954,46	511.042,01	4,78% ▲
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	709.121,87	0,00	0,00	724.086,68	14.964,81	2,11% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	15.234.897,45	2.572.715,45	435.679,49	18.250.939,25	879.005,84	4,94% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	20.000.000,00	0,00	20.062.914,02	62.914,02	0,31% ▲
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.837.419,39	0,00	0,00	3.993.924,74	156.505,35	4,08% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	401.118,98	0,00	0,00	426.449,20	25.330,22	6,31% ▲
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.259.927,00	0,00	0,00	9.711.043,60	451.116,60	4,87% ▲
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	17.476.415,69	2.470.586,29	0,00	21.038.273,13	1.091.271,15	5,47% ▲
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	10.047.007,18	47.007,18	0,47% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	21.553.228,38	0,00	12.399.726,47	10.046.441,65	892.939,74	4,14% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.097.140,87	0,00	0,00	26.706.555,60	1.609.414,73	6,41% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.456.202,54	2.748.750,40	0,00	43.710.550,64	2.505.597,70	6,08% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.959.342,37	2.098.103,97	0,00	37.802.579,14	745.132,80	2,01% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	423.929,18	0,00	0,00	441.950,77	18.021,59	4,25% ▲
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.526.345,68	8.687,87	0,00	2.641.457,22	106.423,67	4,20% ▲
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.141.609,60	0,00	0,00	6.559.920,00	418.310,40	6,81% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.565.982,10	1.187.656,76	2.141.852,49	13.124.497,56	512.711,19	3,48% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	47.584,11	0,00	0,00	47.877,65	293,54	0,62% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	583.686,41	0,00	0,00	608.241,27	24.554,86	4,21% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	17.197.373,52	1.000.000,00	0,00	19.147.731,77	950.358,25	5,22% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	381.845,68	0,00	0,00	400.653,13	18.807,45	4,93% ▲
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1.353.631,19	0,00	0,00	1.432.272,88	78.641,69	5,81% ▲

REDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
	250.548.550,59	44.563.557,13	35.177.517,95	272.257.627,84	12.323.038,07	4,74%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	0,00	538.190,65	0,00	458.288,29	-79.902,36	-14,85% ▼
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	487.118,62	0,00	538.190,65	0,00	51.072,03	10,48% ▲
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	194.119,98	0,00	0,00	193.549,24	-570,74	-0,29% ▼
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	188.064,93	0,00	0,00	178.647,76	-9.417,17	-5,01% ▼
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.727.302,25	0,00	0,00	3.403.761,17	-323.541,08	-8,68% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	344.453,08	0,00	0,00	364.330,37	19.877,29	5,77% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.204.941,65	0,00	0,00	1.968.801,56	-236.140,09	-10,71% ▼
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	7.633.435,33	1.394.535,52	0,00	7.500.216,53	-1.527.754,32	-16,92% ▼
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	469.354,07	0,00	0,00	488.258,78	18.904,71	4,03% ▲
XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	435.189,76	0,00	469.407,39	0,00	34.217,63	7,86% ▲
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	469.407,39	0,00	468.507,31	-900,08	-0,19% ▼
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	244.445,40	0,00	0,00	256.987,67	12.542,27	5,13% ▲
	15.928.425,07	2.402.133,56	1.007.598,04	15.281.348,68	-2.041.611,91	-11,79%



INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.795.681,32	0,00	0,00	2.606.217,89	-1.189.463,43	-31,34% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.351.583,95	0,00	0,00	6.749.113,06	-2.602.470,89	-27,83% ▼
	13.147.265,27	0,00	0,00	9.355.330,95	-3.791.934,32	-28,84%

## Cenário Econômico

O primeiro semestre de 2022, foi muito desafiador para os gestores de recursos. Apesar de estar em momentos distintos, tanto o Brasil quanto as principais economias globais enfrentaram um cenário muito difícil e de alta volatilidade.

Iniciando pelo Brasil, podemos destacar dois momentos. O primeiro em que o cenário contava com perspectivas de baixo crescimento, bem próximas de zero, desemprego em patamares mais elevados e inflação anual na casa de dois dígitos. Já em um segundo momento os dados apurados se mostraram melhores que as previsões e as revisões para projeções econômicas passaram a apresentar melhor resultado para o PIB ao final de 2022. Os dados de desemprego vieram também melhores que o esperado, fechando em 9,8% no semestre, melhor resultado desde 2016 e redução das projeções da inflação para o segundo semestre, motivadas pela aprovação da PEC do teto do ICMS, que reduziu sensivelmente os preços dos combustíveis, energia e telefonia nos estados onde já foram implantadas. Some-se a isso, o benefício de ter iniciado a elevação da taxa básica de juros da economia ainda em 2021. Mas ainda persiste no mercado uma desconfiança com relação a parte fiscal, adicionando aí outro fator, que seria a aprovação da PEC das bondades, um pacote de benefícios à população vulnerável, que tem trazido para o mercado, uma série de dúvidas com relação aos gastos do governo e principalmente o respeito ao limite do teto de gastos.

Nos EUA, a grande injeção de capital realizada pelo FED, banco central americano, acabou evitando uma queda forte da economia americana durante o pico da pandemia do COVID, e provocou rapidamente a retomada da economia.

Com desemprego extremamente baixo e forte crescimento, mas com desestruturação da cadeia de produção ao redor do mundo, os gargalos produtivos se formaram e trouxeram aos EUA, um fenômeno inflacionário muito forte, fechando o primeiro semestre em 8,6% no acumulado de 12 meses, níveis mais elevados dos últimos 40 anos. Em um primeiro momento o FED, tratou a inflação com um fenômeno pontual, mas com o passar dos meses, acabou identificando como algo disseminado e persistente, sendo necessário uma intervenção mais forte por parte do FED, que viu a necessidade da elevação da taxa básica de juros em um ritmo mais forte que o esperado pelo mercado. A força em que o FED precisou agir, trouxe certas dúvidas ao mercado com relação a possível recessão na economia americana, afetando principalmente as economias em desenvolvimento.

Já na zona do EURO, a inflação que no acumulado de 12 meses ficou em 8,1%, também se fez muito presente, destacamos alguns fatores predominantes. O primeiro ponto é com relação ao conflito em solo europeu entre Rússia e Ucrânia, que provocou uma crise energética e uma forte elevação dos preços. O segundo ponto é a forte recuperação da economia europeia no primeiro semestre de 2022 e por fim a questão dos gargalos nas indústrias provocados pela escassez de matéria prima. Como este fenômeno tem se mostrado resiliente, o Banco Central europeu já deixou claro que iniciará o processo de elevação da taxa básica de juros no segundo semestre, e que fará o necessário para trazer a inflação para o centro da meta que é de 2%.

E por fim, a economia chinesa, que não sofreu muito durante o pico da pandemia, mas que por conta da política do governo chinês, de manter os casos de Covid muito próximo de zero, tem provocado rígidos lockdowns dificultando o escoamento da produção e aumentando os gargalos produtivos nas principais economias globais. Mesmo diante desses fatores a economia chinesa segue em expansão, com perspectiva de crescimento ao redor de 5% em 2022.

## **Análise da Carteira de Investimentos**

### **Carteira de Investimentos**

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

### **Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos**

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2022. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos, demonstra apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2022 ainda não foram integralmente atingidos.

### **Rentabilidade e Risco (por ativo)**

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, evidencia a qualidade e consistência de seus resultados.

### **Distribuição por Benchmarks**

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscaram replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

### **Distribuição por Classificação ANBIMA**

A carteira mantém a alocação em fundos de investimento que seguem as características de estratégias e fatores de risco definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

### **Distribuição por Gestoras e Administradoras**

A carteira na parcela referente a fundos de investimento, mantém a totalidade dos recursos aplicados em fundos cujos gestores e administradores são instituições regulares junto aos órgãos de Controle e Fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

### **Retorno da Carteira de Investimentos**

A rentabilidade apresentada no período, voltou a ser impactada de forma contundente pela conjuntura econômica incerta, e a persistência do processo inflacionário ascendente, mantendo as taxas de juros reais negativas, e pressionando os mercados de Bolsa e Ativos Reais gerando alavancagem demasiada e distorcida de preços, e fazendo com que os riscos da carteira permaneçam sensíveis.

### **Análise dos Fundos de Investimento presentes na Carteira de Investimentos**

A carteira na parcela referente a fundos de investimentos, como se pode ver nas lâminas individuais de cada fundo, mantém a concentração em fundos regulados, e em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Tal distribuição fica adequada à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2022, assim como atende os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 12 de julho de 2022.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração  
0,30%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+3

Quantidade de Cotistas  
439

Patrimônio Líquido Fundo  
5.102.683.195,98

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
Não definido

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em cotas de fundo de investimentos que apresentem carteira composta por ativos financeiros de renda fixa, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA).

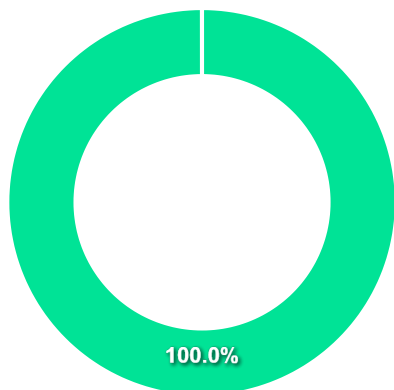
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,33%	3,71%	1,67%	3,71%	4,01%	6,69%	1,11%	2,33%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB TOP IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.221.639,12	65,37	Fundos de Inve...	04/08/2022
Cotas de BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	735.515,08	14,92	Fundos de Inve...	04/08/2022
Cotas de BB TOP IMA-B 5 ALOCAÇÃO FI RENDA FIXA	363.707,91	7,38	Fundos de Inve...	04/08/2022
Cotas de BB TOP IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	329.463,12	6,68	Fundos de Inve...	04/08/2022
Cotas de BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	277.655,16	5,63	Fundos de Inve...	04/08/2022
Outras Disponibilidades	741,71	0,02	Valores a paga...	04/08/2022
Outros Valores a receber	32,93	0,00	Valores a paga...	04/08/2022
Valores a pagar / Controladoria	20,81	0,00	Valores a paga...	04/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	3,45	0,00	Valores a paga...	04/08/2022
Valores a pagar / Auditoria	0,31	0,00	Valores a paga...	04/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-44,82	0,00	Valores a paga...	04/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-57,67	0,00	Valores a paga...	04/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	4.927.980,38	99.99%
Valores a pagar/receber	696,72	0.01%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+1

Quantidade de Cotistas  
1.077

Patrimônio Líquido Fundo  
9.717.321.383,29

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
Não definido

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

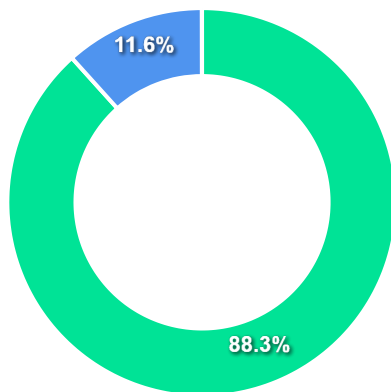
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,27%	6,46%	2,54%	6,46%	9,84%	16,85%	1,38%	2,90%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	8.405.814,94	88.34%
Operação compromissada	1.107.092,81	11.64%
Outros	1.910,95	0.02%
Valores a pagar/receber	359,17	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	5.197.279,95	54,62	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	2.370.430,91	24,91	Títulos Federa...	05/08/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2025	1.107.092,81	11,64	Operação compr...	05/08/2022
NTN-B - Venc: 15/05/2023	838.104,08	8,81	Títulos Federa...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	1.055,76	0,01	Outros	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	442,44	0,00	Outros	05/08/2022
Outras Disponibilidades	423,12	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	375,60	0,00	Outros	05/08/2022
Outros Valores a receber	38,68	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	37,15	0,00	Outros	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,73	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	21,56	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Auditoria	2,88	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	0,34	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	0,08	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-75,42	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-79,80	0,00	Valores a paga...	05/08/2022



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+1

Quantidade de Cotistas  
597

Patrimônio Líquido Fundo  
5.700.982.768,47

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
IMA-B

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e ou operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

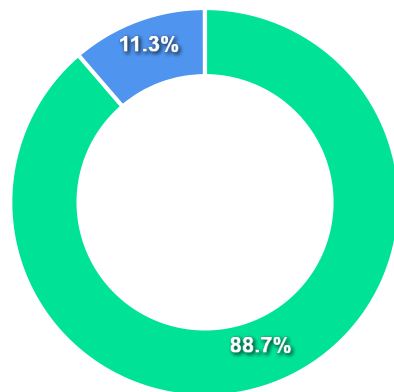
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,35%	4,22%	1,41%	4,22%	3,48%	10,88%	2,02%	4,26%
Indicador de Desempenho (CVM)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	4.604.198,29	88.71%
Operação compromissada	584.503,08	11.26%
Outros	770,04	0.01%
Valores a pagar/receber	425,19	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2025	584.503,08	11,26	Operação compr...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	571.563,83	11,01	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	515.602,60	9,93	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	495.744,31	9,55	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	432.873,69	8,34	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	370.802,51	7,14	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	361.497,15	6,97	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	350.814,01	6,76	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	350.636,80	6,76	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	309.944,32	5,97	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	293.941,30	5,66	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	271.141,60	5,22	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	232.164,10	4,47	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	26.571,47	0,51	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	13.000,43	0,25	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	7.900,18	0,15	Títulos Federa...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	481,41	0,01	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	300,26	0,01	Outros	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	236,31	0,00	Outros	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	179,36	0,00	Outros	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	152,16	0,00	Outros	05/08/2022
Outros Valores a receber	38,68	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	16,35	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	12,25	0,00	Outros	05/08/2022
Valores a pagar / Auditoria	2,88	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	0,04	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas / DAP FUTURO BM...	-15,53	0,00	Outros	05/08/2022

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração  
0,10%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
1.068

Patrimônio Líquido Fundo  
5.103.254.867,87

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
IRF-M 1

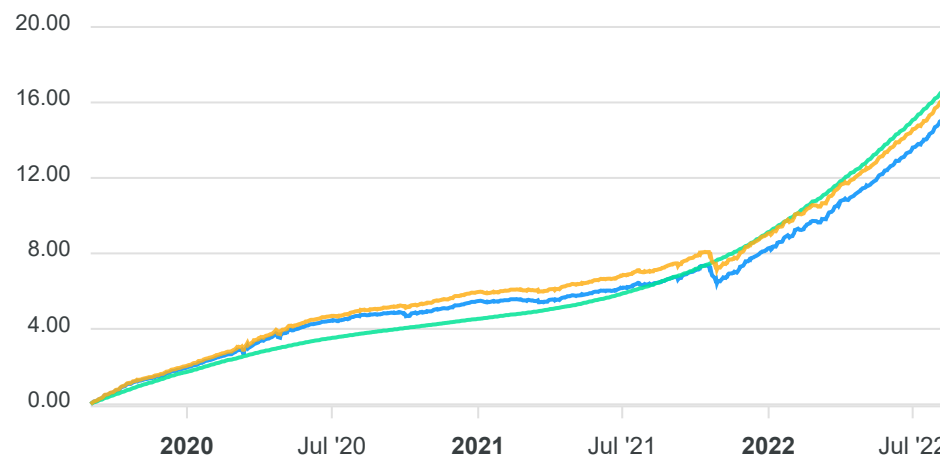
Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que mantenham 100% de suas carteiras em Títulos Públicos Federais.

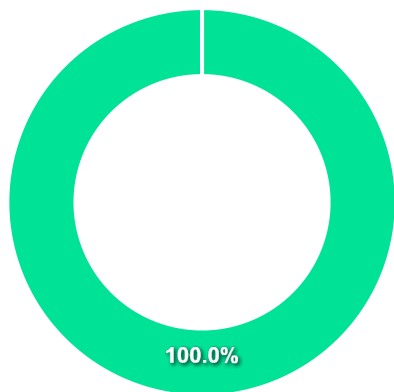
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,92%	4,85%	2,56%	4,85%	6,92%	8,69%	0,17%	0,36%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA	4.977.720,49	100,00	Fundos de Inve...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	19,75	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	3,26	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa Anbid	1,09	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,11	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-27,72	0,00	Valores a paga...	03/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	4.977.720,49	100.00%
Valores a pagar/receber	-3,52	-0.00%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+1

Quantidade de Cotistas  
453

Patrimônio Líquido Fundo  
3.520.668.596,00

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
IRF-M

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

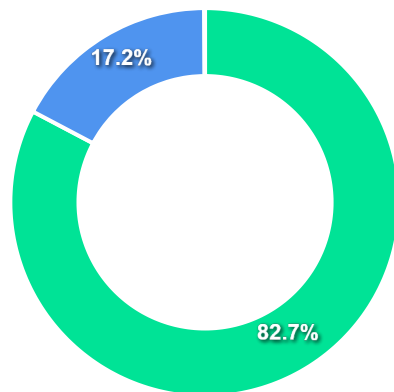
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,34%	2,11%	0,81%	2,11%	1,51%	1,42%	1,76%	3,71%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,37%	2,19%	0,83%	2,19%	1,76%	1,90%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	2.348.095,04	82.74%
Operação compromissada	487.442,99	17.18%
Derivativos	1.941,14	0.07%
Valores a pagar/receber	448,17	0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/202...	487.442,99	17,18	Operação compr...	05/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	388.428,88	13,69	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc: 01/01/2024	358.266,31	12,62	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2023	335.852,65	11,83	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	286.037,46	10,08	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2027	216.293,27	7,62	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2029	117.148,04	4,13	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc: 01/10/2022	83.079,79	2,93	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc: 01/07/2025	74.140,59	2,61	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2024	59.716,65	2,10	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc: 01/03/2025	59.667,49	2,10	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	59.603,85	2,10	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc: 01/03/2026	59.527,83	2,10	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2026	59.482,62	2,10	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/01/2023	56.793,86	2,00	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc: 01/04/2024	27.916,10	0,98	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-F - Venc: 01/01/2031	26.010,66	0,92	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc: 01/01/2025	22.427,92	0,79	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-F - Venc: 01/01/2033	14.978,73	0,53	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/01/2026	13.260,57	0,47	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc: 01/04/2023	12.217,57	0,43	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	9.445,56	0,33	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2024	3.957,49	0,14	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/10/2024	3.841,14	0,14	Títulos Federa...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	464,50	0,02	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	438,70	0,02	Derivativos	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF31	417,15	0,01	Derivativos	05/08/2022

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração  
0,15%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
241

Patrimônio Líquido Fundo  
2.872.769.394,76

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
IPCA

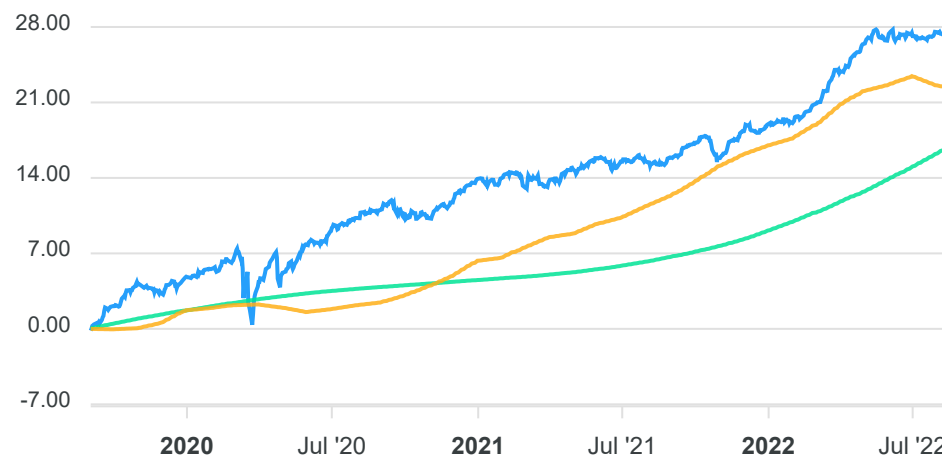
Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento  
Aplica seus recursos exclusivamente em títulos públicos federais ou operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais.

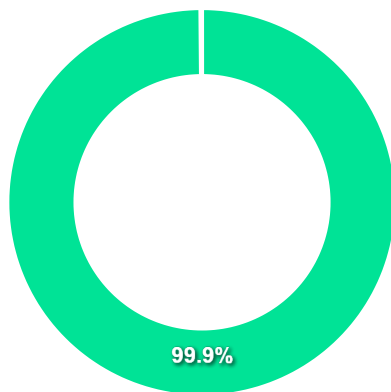
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,33%	7,12%	3,08%	7,12%	10,31%	16,86%	1,37%	2,89%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc: 15/05/2023	3.063.886,40	99,87	Títulos Federa...	05/08/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2025	4.060,87	0,13	Operação compr...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	88,04	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a receber	34,38	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	13,91	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	5,82	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	2,21	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Auditoria	1,44	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-18,22	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-24,51	0,00	Valores a paga...	05/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.063.886,40	99.86%
Operação compromissada	4.060,87	0.13%
Valores a pagar/receber	103,06	0.00%



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador BANCO BRADESCO S.A.
Gestão BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 229
Patrimônio Líquido Fundo 591.945.993,72

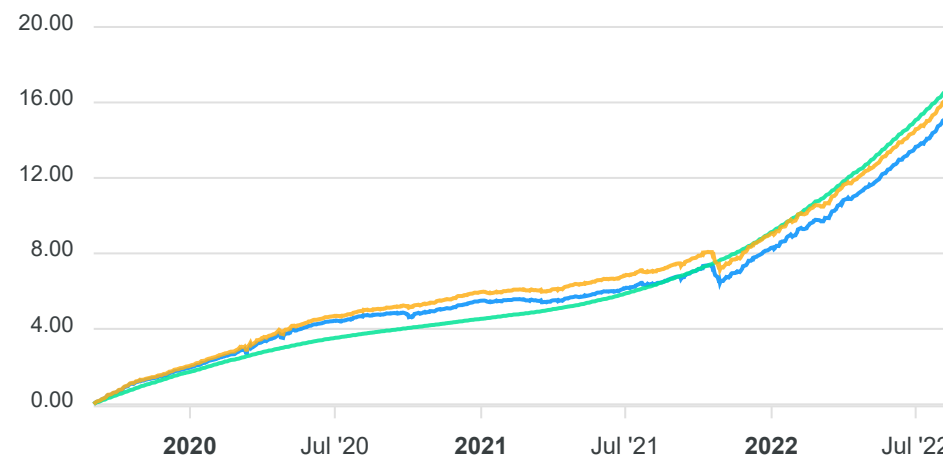
**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Indicador de Desempenho (CVM) IRF-M 1
Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento Aplica seus recursos em oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

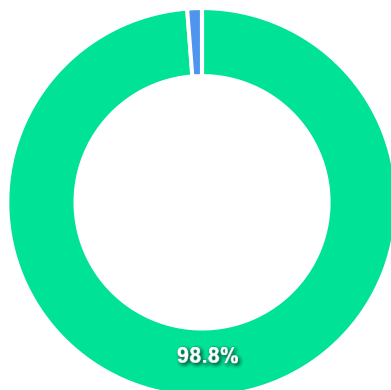
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,92%	4,87%	2,56%	4,87%	7,00%	8,75%	0,17%	0,35%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	539.518,87	98.80%
Operação compromissada	6.599,89	1.21%
Derivativos	62,63	0.01%
Valores a pagar/receber	-114,56	-0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
LTN - Venc.: 01/01/2023	154.289,99	28,25	Títulos Federa...	02/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	135.012,12	24,72	Títulos Federa...	02/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2023	88.810,91	16,26	Títulos Federa...	02/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	47.087,04	8,62	Títulos Federa...	02/08/2022
LFT - Venc: 01/03/2026	39.288,37	7,19	Títulos Federa...	02/08/2022
LTN - Venc: 01/10/2022	39.096,37	7,16	Títulos Federa...	02/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2026	24.982,70	4,58	Títulos Federa...	02/08/2022
LTN - Venc: 01/04/2023	9.161,34	1,68	Títulos Federa...	02/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2024	6.599,89	1,21	Operação compr...	02/08/2022
LFT - Venc: 01/03/2025	1.790,02	0,33	Títulos Federa...	02/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	64,95	0,01	Derivativos	02/08/2022
Outros Valores a receber	23,41	0,00	Valores a paga...	02/08/2022
Outras Disponibilidades	10,45	0,00	Valores a paga...	02/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ23	1,70	0,00	Derivativos	02/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV22	1,33	0,00	Derivativos	02/08/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF23	-5,35	0,00	Derivativos	02/08/2022
Outros Valores a pagar	-148,42	-0,03	Valores a paga...	02/08/2022

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA DTVM

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
218

Patrimônio Líquido Fundo  
3.451.516.253,51

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
Não definido

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa.

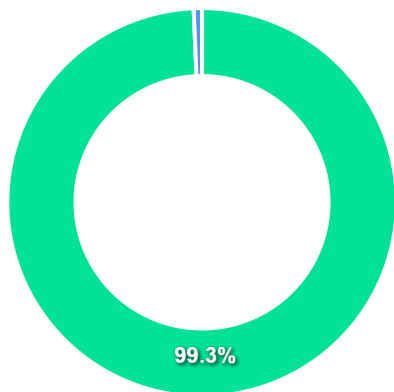
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,32%	-%	-0,26%	-%	-%	-%	1,37%	2,89%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc: 15/05/2023	3.722.426,65	99,31	Títulos Federa...	08/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	25.882,86	0,69	Operação compr...	08/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	28,58	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	15,03	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	13,87	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outras Disponibilidades	10,64	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	7,49	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,46	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-22,16	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a pagar	-125,58	0,00	Valores a paga...	08/08/2022

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.722.426,65	99.31%
Operação compromissada	25.882,86	0.69%
Valores a pagar/receber	-67,67	-0.00%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
868

Patrimônio Líquido Fundo  
6.957.180.815,09

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
IPCA

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento  
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA  
MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA, CNPJ:  
10.948.555/0001-13.

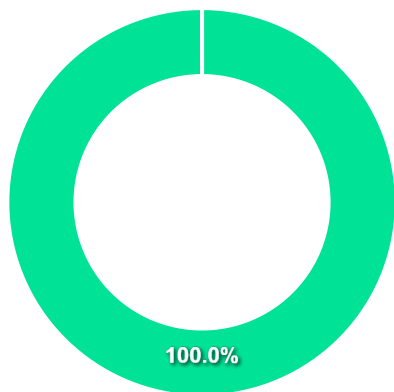
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,23%	4,59%	2,22%	4,59%	3,73%	6,51%	1,57%	3,30%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA...	6.218.198,45	100,01	Fundos de Inve...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,72	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	24,04	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	13,87	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,84	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Ajustes Quantidades Patrimônio D...	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-75,64	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a pagar	-428,60	-0,01	Valores a paga...	08/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	6.218.198,45	100.01%
Valores a pagar/receber	-433,77	-0.01%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
1.073

Patrimônio Líquido Fundo  
11.226.926.091,22

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
IDKA IPCA 2 Anos

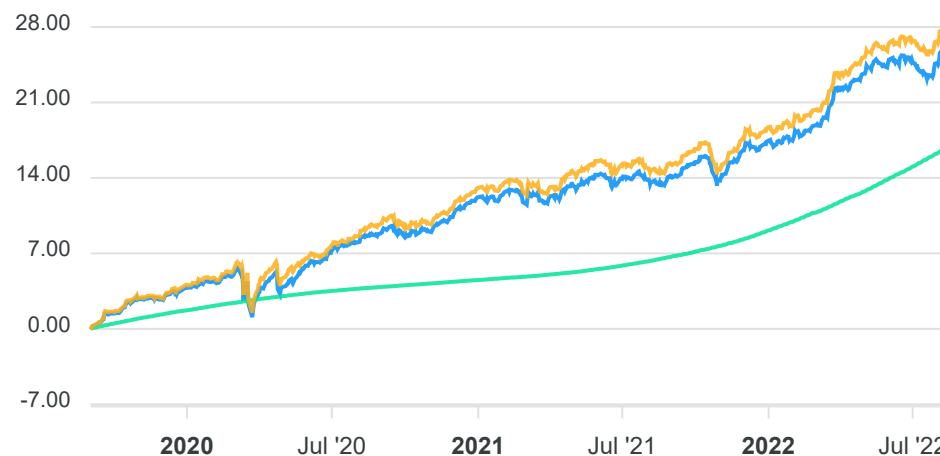
Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em títulos públicos federais indexados a taxas pré e pós-fixadas e/ou índices de preços.

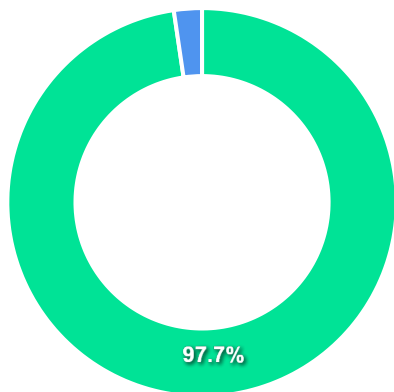
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,22%	6,41%	2,50%	6,41%	9,66%	16,68%	1,39%	2,93%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,47%	6,85%	2,86%	6,85%	10,11%	17,88%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	10.286.252,41	97.68%
Operação compromissada	244.327,93	2.32%
Derivativos	308,73	0.00%
Valores a pagar/receber	81,35	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	9.741.737,17	92,51	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	325.293,70	3,09	Títulos Federa...	08/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	244.327,93	2,32	Operação compr...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	188.138,46	1,79	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	29.891,01	0,28	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	1.192,08	0,01	Títulos Federa...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ24	308,73	0,00	Derivativos	08/08/2022
Outros Valores a receber	308,73	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outras Disponibilidades	64,52	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	45,19	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,72	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	24,30	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	24,04	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,84	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Permanência	0,01	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Ajustes Quantidades Patrimônio D...	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
NTN-B - Venc: 15/05/2023	0,00	0,00	Títulos Federa...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-62,70	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a pagar	-355,30	0,00	Valores a paga...	08/08/2022



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
1.024

Patrimônio Líquido Fundo  
11.084.704.335,99

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
IMA-B 5

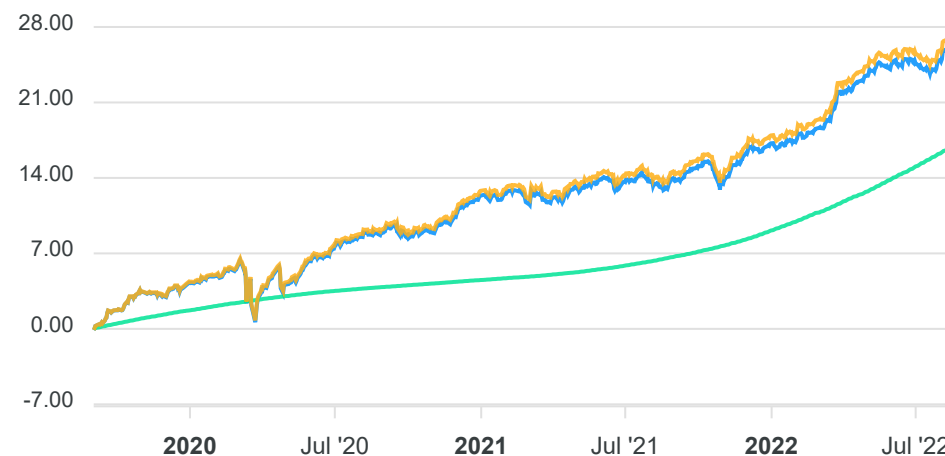
Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Aplica 100% dos recursos em títulos públicos federais, em operações finais e/ou compromissadas, tendo como parâmetro de rentabilidade o IMA-B 5.

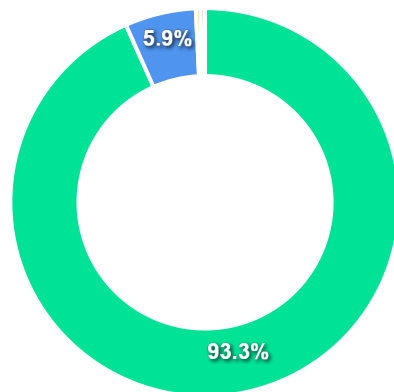
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,33%	6,51%	2,65%	6,51%	9,84%	16,18%	1,23%	2,59%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



## CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	9.804.998,56	93.34%
Operação compromissada	620.114,96	5.90%
Valores a pagar/receber	40.271,00	0.38%
Outros	39.012,64	0.37%
Derivativos	408,70	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	2.575.573,73	24,70	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	2.040.519,57	19,57	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.719.098,89	16,49	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	1.653.290,80	15,86	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	1.383.161,34	13,27	Títulos Federa...	09/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2023	620.114,96	5,95	Operação compr...	09/08/2022
NTN-B - Venc: 15/05/2027	408.316,92	3,92	Títulos Federa...	09/08/2022
Outros Valores a receber	39.015,06	0,37	Valores a paga...	09/08/2022
Vendas a termo a receber / RENDA FIXA TERMO	39.012,64	0,37	Outros	09/08/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	11.960,63	0,11	Títulos Federa...	09/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2026	11.896,52	0,11	Títulos Federa...	09/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	1.180,16	0,01	Títulos Federa...	09/08/2022
Outras Disponibilidades	1.135,11	0,01	Valores a paga...	09/08/2022
Outros Valores a receber	408,70	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	368,88	0,00	Derivativos	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	44,75	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	39,82	0,00	Derivativos	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,72	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	25,56	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	24,04	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,84	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Permanência	0,04	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a pagar / Ajustes Quantidades Patrimônio D...	0,00	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-62,22	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Outros Valores a pagar	-352,60	0,00	Valores a paga...	09/08/2022

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
272

Patrimônio Líquido Fundo  
1.212.673.784,01

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
IMA-B 5+

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Investe em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços.

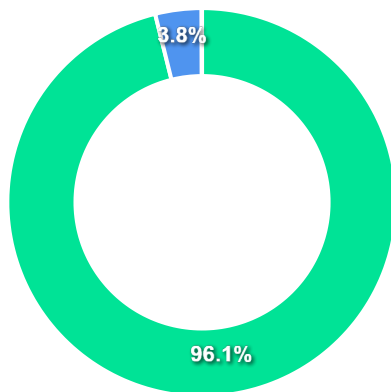
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,10%	1,95%	0,07%	1,95%	-2,61%	5,50%	3,18%	6,70%
Indicador de Desempenho (CVM)	-1,10%	2,03%	0,12%	2,03%	-2,16%	6,18%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.111.518,24	96.12%
Operação compromissada	44.266,38	3.83%
Valores a pagar/receber	373,16	0.03%
Derivativos	174,73	0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	247.478,13	21,41	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	166.562,59	14,41	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	164.256,42	14,21	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	159.839,03	13,83	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	148.139,48	12,81	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	117.686,72	10,18	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	66.065,83	5,71	Títulos Federa...	08/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	44.266,38	3,83	Operação compr...	08/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	25.033,62	2,17	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc: 15/08/2032	11.562,25	1,00	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc: 15/08/2060	4.894,16	0,42	Títulos Federa...	08/08/2022
Outras Disponibilidades	221,44	0,02	Valores a paga...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ28	174,73	0,02	Derivativos	08/08/2022
Outros Valores a receber	174,73	0,02	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	24,04	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	4,90	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,46	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	3,42	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Permanência	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Ajustes Quantidades Patrimônio D...	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-6,90	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-13,86	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a pagar	-39,07	0,00	Valores a paga...	08/08/2022

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
798

Patrimônio Líquido Fundo  
4.111.516.095,57

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
IMA-B

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Aplica 100% dos seus recursos em títulos do Tesouro Nacional em operações finais e/ou compromissadas tendo como parâmetro de rentabilidade o subíndice IMA-B.

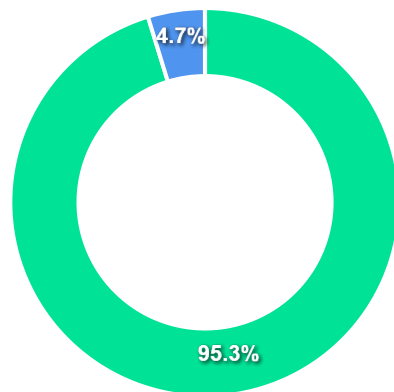
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,38%	4,25%	1,39%	4,25%	3,52%	10,96%	2,05%	4,32%
Indicador de Desempenho (CVM)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



## CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.701.011,09	95.26%
Operação compromissada	183.725,71	4.73%
Valores a pagar/receber	384,76	0.01%
Derivativos	65,61	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	486.347,59	12,52	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	403.068,14	10,37	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	354.957,98	9,14	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	342.818,34	8,82	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	283.142,91	7,29	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	275.554,42	7,09	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	270.294,36	6,96	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	267.614,52	6,89	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	260.908,78	6,72	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	241.142,42	6,21	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	207.363,07	5,34	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	186.515,16	4,80	Títulos Federa...	08/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	183.725,71	4,73	Operação compr...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	81.364,78	2,09	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	20.792,56	0,54	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2022	11.961,60	0,31	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	5.996,24	0,15	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	1.168,24	0,03	Títulos Federa...	08/08/2022
Outras Disponibilidades	437,26	0,01	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a receber	65,61	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	52,70	0,00	Derivativos	08/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	24,04	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	16,51	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	12,91	0,00	Derivativos	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	11,73	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,84	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Permanência	0,01	0,00	Valores a paga...	08/08/2022

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
166

Patrimônio Líquido Fundo  
571.753.898,32

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
IMA Geral

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Investe seus recursos em títulos públicos federais em operações finais e/ou compromissadas tendo como parâmetro de rentabilidade o Índice IMA Geral.

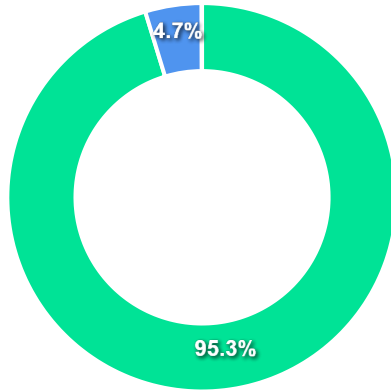
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,40%	4,20%	1,83%	4,20%	5,03%	7,86%	1,08%	2,28%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,43%	4,49%	1,90%	4,49%	5,34%	9,08%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	532.060,69	95.29%
Operação compromissada	26.090,36	4.67%
Valores a pagar/receber	117,49	0.02%
Derivativos	114,13	0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
LFT - Venc.: 01/09/2027	122.755,49	21,99	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc: 01/03/2024	64.591,99	11,57	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc: 01/03/2025	59.667,49	10,69	Títulos Federa...	08/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	26.090,36	4,67	Operação compr...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	23.064,22	4,13	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc: 15/05/2023	20.270,44	3,63	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	20.010,23	3,58	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc: 01/01/2024	19.252,63	3,45	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	18.137,01	3,25	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	15.705,29	2,81	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2023	14.387,37	2,58	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	13.024,27	2,33	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	12.606,05	2,26	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	12.243,21	2,19	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	11.974,85	2,15	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2026	11.896,52	2,13	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	10.822,33	1,94	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	10.591,50	1,90	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	9.787,53	1,75	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc.: 01/01/2023	9.465,64	1,70	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	8.935,54	1,60	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2027	8.593,51	1,54	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	8.288,14	1,48	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2029	5.374,62	0,96	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc: 01/07/2025	4.942,71	0,89	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2024	4.748,99	0,85	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc: 01/01/2025	3.737,99	0,67	Títulos Federa...	08/08/2022



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
1.175

Patrimônio Líquido Fundo  
5.096.804.349,76

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
IRF-M 1

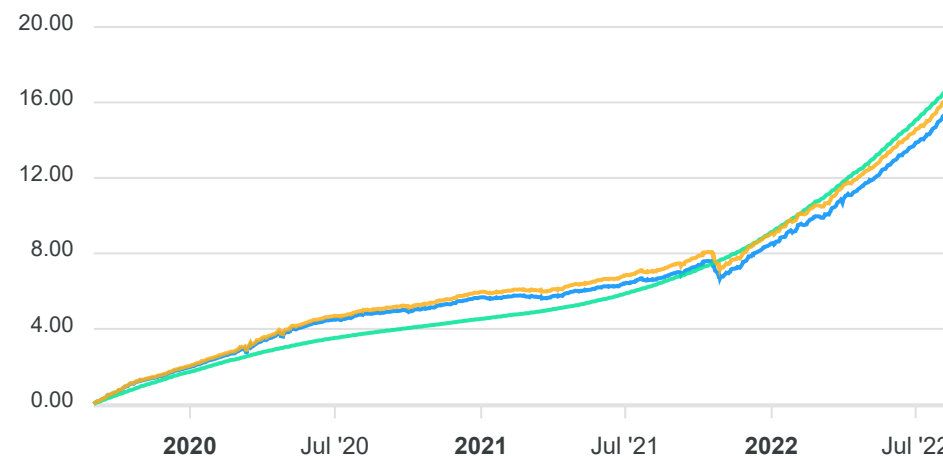
Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Investe seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas e/ou pós-fixadas SELIC/CDI.

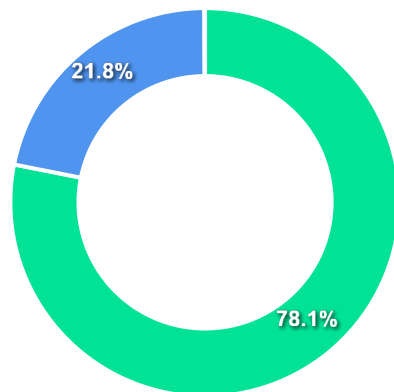
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,91%	4,86%	2,58%	4,86%	6,94%	8,89%	0,17%	0,35%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



## CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.957.547,23	78.12%
Operação compromissada	1.104.493,40	21.80%
Valores a pagar/receber	3.277,16	0.06%
Derivativos	625,97	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	1.523.075,72	30,07	Títulos Federa...	08/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2023	1.104.493,40	21,81	Operação compr...	08/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2023	986.689,16	19,48	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc: 01/10/2022	693.765,14	13,70	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc.: 01/01/2023	412.702,06	8,15	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2022	260.726,93	5,15	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	44.254,32	0,87	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc: 01/04/2023	36.333,89	0,72	Títulos Federa...	08/08/2022
Outras Disponibilidades	2.822,36	0,06	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a receber	625,41	0,01	Valores a paga...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	488,32	0,01	Derivativos	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF23	96,70	0,00	Derivativos	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ23	35,46	0,00	Derivativos	08/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	24,04	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	21,81	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	14,91	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV22	5,49	0,00	Derivativos	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,84	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Permanência	0,12	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Ajustes Quantidades Patrimônio D...	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN22	0,00	0,00	Derivativos	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-27,72	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-31,29	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a pagar	-177,32	0,00	Valores a paga...	08/08/2022

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
206

Patrimônio Líquido Fundo  
1.835.852.466,18

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
IRF-M 1+

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré e/ou pós-fixadas.

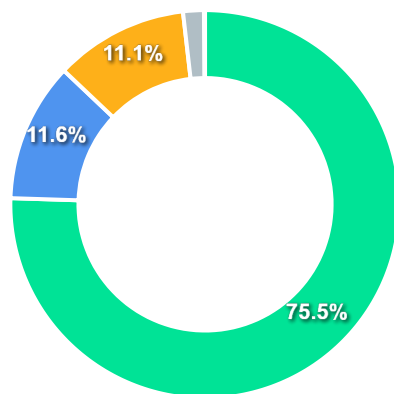
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,04%	0,62%	-0,11%	0,62%	-1,34%	-2,63%	2,55%	5,38%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,09%	0,73%	-0,06%	0,73%	-1,02%	-2,10%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



## CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	739.729,64	75.50%
Valores a pagar/receber	113.529,98	11.59%
Outros	108.675,88	11.09%
Operação compromissada	16.883,96	1.72%
Derivativos	892,31	0.09%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
LTN - Venc: 01/01/2024	137.496,42	18,06	Títulos Federa...	09/08/2022
Outros Valores a receber	108.678,26	14,27	Valores a paga...	09/08/2022
Vendas a termo a receber / RENDA FIXA TERMO	108.675,88	14,27	Outros	09/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2027	101.320,59	13,31	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	99.835,68	13,11	Títulos Federa...	09/08/2022
LTN - Venc: 01/07/2025	83.319,90	10,94	Títulos Federa...	09/08/2022
LTN - Venc: 01/01/2025	69.152,75	9,08	Títulos Federa...	09/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2024	68.464,65	8,99	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2029	62.111,57	8,16	Títulos Federa...	09/08/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	53.822,83	7,07	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-F - Venc: 01/01/2031	33.640,46	4,42	Títulos Federa...	09/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2022	26.315,51	3,46	Títulos Federa...	09/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/04/2023	16.883,96	2,22	Operação compr...	09/08/2022
NTN-F - Venc: 01/01/2033	4.249,29	0,56	Títulos Federa...	09/08/2022
Outras Disponibilidades	4.013,22	0,53	Valores a paga...	09/08/2022
Outros Valores a receber	887,84	0,12	Valores a paga...	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF24	279,44	0,04	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ24	170,19	0,02	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF29	91,58	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF27	87,57	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	74,25	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF31	60,40	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	54,14	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF33	38,42	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN25	36,33	0,00	Derivativos	09/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	21,37	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	2,38	0,00	Valores a paga...	09/08/2022

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão  
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração  
0,18%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
59

Patrimônio Líquido Fundo  
142.319.131,43

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
IRF-M

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Investe em ativos de renda fixa relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, à taxa de juros doméstica e/ou índices de preço.

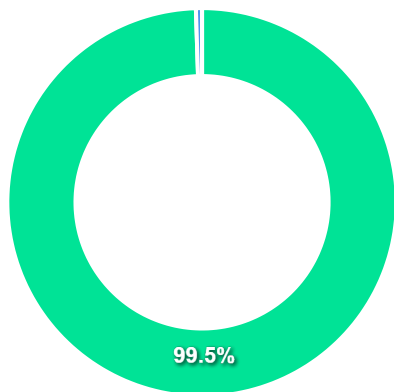
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,93%	4,93%	2,61%	4,93%	7,03%	8,93%	0,17%	0,35%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,37%	2,19%	0,83%	2,19%	1,76%	1,90%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
LTN - Venc.: 01/07/2023	45.737,62	32,05	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/01/2023	34.076,32	23,88	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	28.789,35	20,17	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/10/2022	17.593,37	12,33	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc.: 01/03/2028	12.656,41	8,87	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/04/2023	2.748,40	1,93	Títulos Federa...	05/08/2022
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/202...	719,89	0,50	Operação compr...	05/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	418,47	0,29	Títulos Federa...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	50,98	0,04	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a receber	6,74	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1	1,33	0,00	Derivativos	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1	-0,40	0,00	Derivativos	05/08/2022
Outros Valores a pagar	-78,66	-0,06	Valores a paga...	05/08/2022

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	142.019,94	99.51%
Operação compromissada	719,89	0.50%
Derivativos	0,93	0.00%
Valores a pagar/receber	-20,94	-0.01%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração  
0,30%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+1

Quantidade de Cotistas  
228

Patrimônio Líquido Fundo  
786.311.506,32

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)  
IMA-B

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

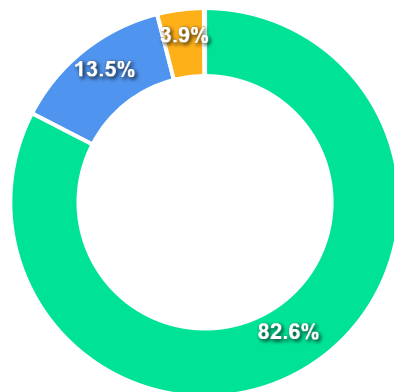
Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 80% de seu patrimônio líquido representado por ativos financeiros de forma a acompanhar, direta ou indiretamente, a variação diária da taxa de juros doméstica e/ou índice de preços.

**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,41%	4,26%	1,36%	4,26%	3,58%	10,95%	2,09%	4,39%
Indicador de Desempenho (CVM)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	633.392,58	82.58%
Operação compromissada	103.224,66	13.46%
Debêntures	29.621,68	3.86%
Valores a pagar/receber	507,59	0.07%
Outros	216,22	0.03%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2025	103.224,66	13,46	Operação compr...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	74.850,92	9,76	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	66.315,71	8,65	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	61.854,94	8,06	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	55.975,01	7,30	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	52.362,97	6,83	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	51.128,34	6,67	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	49.672,60	6,48	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	49.085,32	6,40	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	45.746,50	5,96	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	42.255,00	5,51	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	35.282,75	4,60	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	34.698,27	4,52	Títulos Federa...	05/08/2022
Debênture Simples - TAEE33	13.715,93	1,79	Debêntures	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	8.070,30	1,05	Títulos Federa...	05/08/2022
Debênture simples - ERDV17	6.415,43	0,84	Debêntures	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	6.093,95	0,79	Títulos Federa...	05/08/2022
Debênture simples - PETR45	5.909,88	0,77	Debêntures	05/08/2022
Debênture Simples - CCRDD1	2.571,31	0,34	Debêntures	05/08/2022
Debêntures - MOVIDA PARTICIPAÇÕES S.A. (21.314.559...	1.009,14	0,13	Debêntures	05/08/2022
Outras Disponibilidades	497,33	0,06	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	83,85	0,01	Outros	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	58,66	0,01	Outros	05/08/2022
Outros Valores a receber	34,38	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	29,54	0,00	Outros	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	17,47	0,00	Outros	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	14,68	0,00	Outros	05/08/2022



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
974

Patrimônio Líquido Fundo  
9.838.414.136,64

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)  
CDI

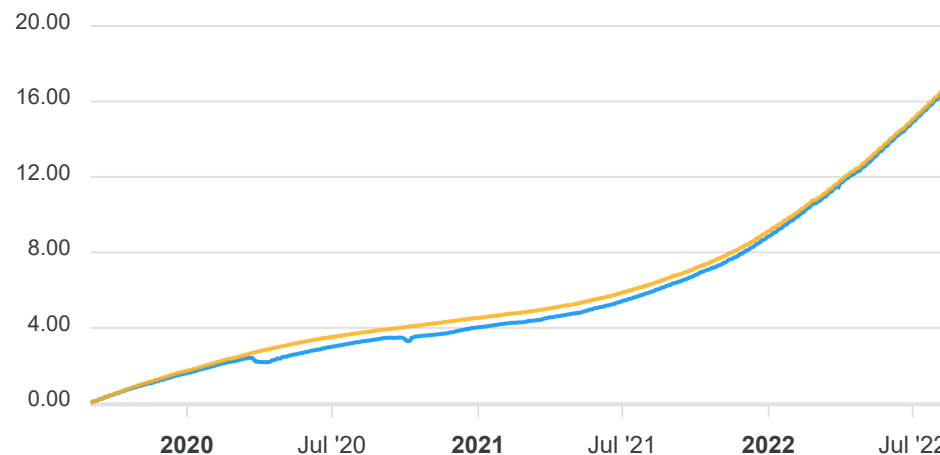
Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

Política de Investimento  
Investe, no mínimo, 80% de sua carteira em cotas de fundo investimento cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

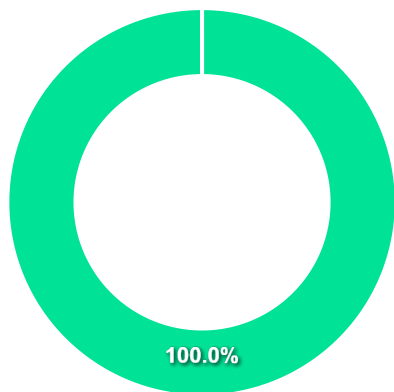
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,03%	5,54%	2,90%	5,54%	8,98%	11,54%	0,01%	0,02%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L...	10.248.046,80	100,00	Fundos de Inve...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,73	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	2,82	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	1,86	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa Anbid	1,09	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-81,33	0,00	Valores a paga...	03/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	10.248.046,80	100.00%
Valores a pagar/receber	-47,83	-0.00%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BANCO BRADESCO S.A.

---

Gestão  
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

---

Taxa de Administração  
0,40%

---

Taxa de Performance  
Não possui

---

Disponibilidade de Resgate  
D+4

---

Quantidade de Cotistas  
176

---

Patrimônio Líquido Fundo  
857.365.563,33

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

---

Indicador de Desempenho (CVM)  
IPCA

---

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento

---

Política de Investimento  
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de renda fixa, os quais atuam nos mercados de juros pré e pós-fixados e índices de preços, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

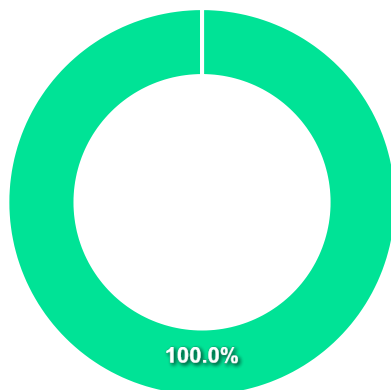
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,32%	4,08%	1,69%	4,08%	4,75%	6,86%	1,08%	2,28%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BRAM FEDERAL II FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	344.794,92	42,67	Fundos de Inve...	02/08/2022
Cotas de BRAM IMA-B FI RENDA FIXA	229.095,07	28,35	Fundos de Inve...	02/08/2022
Cotas de BRAM INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA	148.144,03	18,33	Fundos de Inve...	02/08/2022
Cotas de BRAM IMA-B 5 FI RENDA FIXA	71.360,58	8,83	Fundos de Inve...	02/08/2022
Cotas de BRAM IDKA PRÉ 5 FI RENDA FIXA	9.482,08	1,17	Fundos de Inve...	02/08/2022
Cotas de BRAM IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.338,77	0,54	Fundos de Inve...	02/08/2022
Cotas de BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	760,68	0,09	Fundos de Inve...	02/08/2022
Cotas de BRAM H VOLGA FI RENDA FIXA LP	400,97	0,05	Fundos de Inve...	02/08/2022
Outros Valores a receber	21,28	0,00	Valores a paga...	02/08/2022
Cotas de BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	18,86	0,00	Fundos de Inve...	02/08/2022
Outras Disponibilidades	10,27	0,00	Valores a paga...	02/08/2022
Outros Valores a pagar	-305,10	-0,04	Valores a paga...	02/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	808.395,96	100.03%
Valores a pagar/receber	-273,55	-0.03%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BANCO BRADESCO S.A.

Gestão  
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+1

Quantidade de Cotistas  
166

Patrimônio Líquido Fundo  
1.352.871.181,17

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)  
IMA-B 5

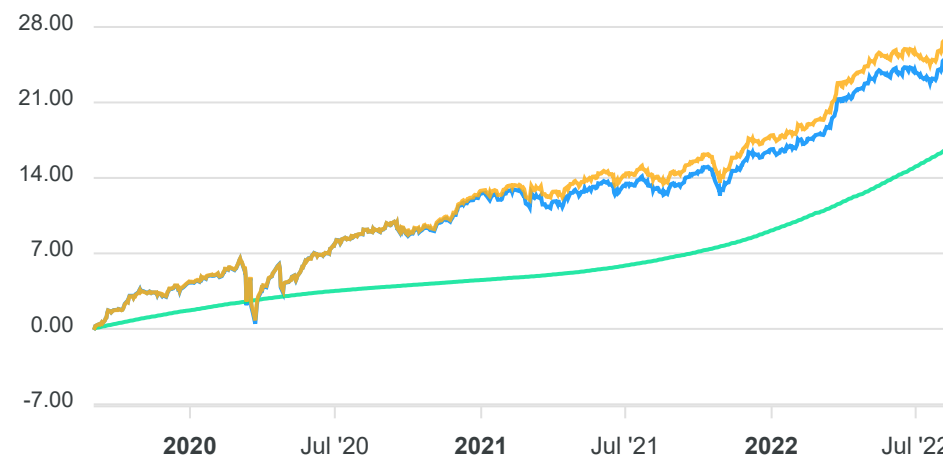
Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento

Política de Investimento  
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa, que atuem principalmente no mercado de índices de preços.

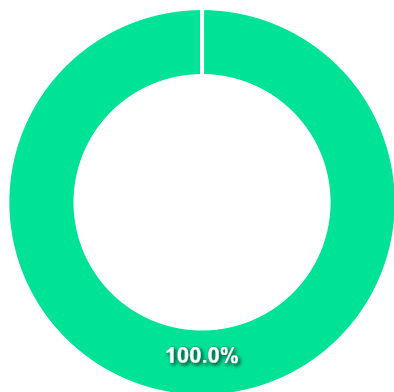
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,28%	6,31%	2,55%	6,31%	9,47%	15,15%	1,27%	2,67%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BRAM IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.265.389,12	100,02	Fundos de Inve...	02/08/2022
Outros Valores a receber	25,27	0,00	Valores a paga...	02/08/2022
Outras Disponibilidades	10,20	0,00	Valores a paga...	02/08/2022
Outros Valores a pagar	-277,52	-0,02	Valores a paga...	02/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.265.389,12	100.02%
Valores a pagar/receber	-242,05	-0.02%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BANCO BRADESCO S.A.

Gestão  
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
253

Patrimônio Líquido Fundo  
4.894.755.710,10

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)  
Selic

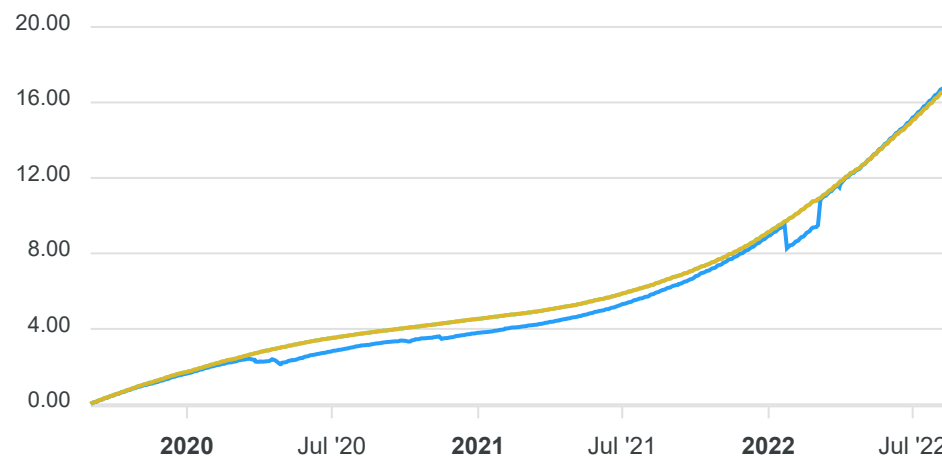
Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de forma a acompanhar, direta ou indiretamente, a variação do CDI.

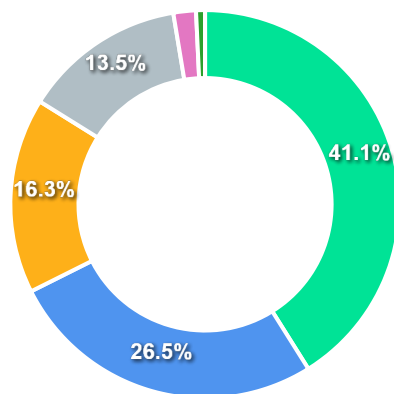
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,08%	5,71%	3,07%	5,71%	9,36%	12,01%	0,02%	0,04%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



## CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	2.135.321,25	41.11%
Títulos Privados	1.377.212,97	26.51%
Títulos Federais	845.989,23	16.29%
Debêntures	701.739,20	13.51%
Fundos de Investimento	97.310,67	1.87%
Letra Hipotecária	38.549,12	0.74%
Derivativos	-391,41	-0.01%
Valores a pagar/receber	-1.307,49	-0.03%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	1.498.939,91	28,86	Operação compr...	02/08/2022
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/202...	636.381,34	12,25	Operação compr...	02/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2027	313.969,41	6,04	Títulos Federa...	02/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2028	246.257,38	4,74	Títulos Federa...	02/08/2022
LTN - Venc: 01/01/2024	194.786,38	3,75	Títulos Federa...	02/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	182.819,08	3,52	Títulos Privad...	02/08/2022
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A. (60....	109.402,69	2,11	Títulos Privad...	02/08/2022
Debênture simples - ELPLA4	101.067,98	1,95	Debêntures	02/08/2022
Debênture Simples - NCFP14	98.088,54	1,89	Debêntures	02/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	83.370,61	1,61	Títulos Privad...	02/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	81.237,91	1,56	Títulos Privad...	02/08/2022
LFT - Venc.: 01/03/2027	77.033,46	1,48	Títulos Federa...	02/08/2022
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90...	74.654,19	1,44	Títulos Privad...	02/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	41.178,82	0,79	Títulos Privad...	02/08/2022
Letra Financeira - BANCO BBM S.A. (15.114.366/0001...	38.549,12	0,74	Letra Hipotecá...	02/08/2022
Debênture Simples - BSA313	37.268,96	0,72	Debêntures	02/08/2022
Cotas de BANCOS EMISSORES DE CARTÃO DE CRÉDITO STO...	35.166,40	0,68	Fundos de Inve...	02/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	33.256,08	0,64	Títulos Privad...	02/08/2022
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/00...	32.370,38	0,62	Títulos Privad...	02/08/2022
Debênture simples - ECOV14	31.399,04	0,60	Debêntures	02/08/2022
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A. (60....	30.833,23	0,59	Títulos Privad...	02/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	29.571,37	0,57	Títulos Privad...	02/08/2022
Letra Financeira - BANCO TOYOTA BRASIL S.A. (03.21...	27.634,66	0,53	Títulos Privad...	02/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	27.421,81	0,53	Títulos Privad...	02/08/2022
Debênture simples - ALS015	25.044,29	0,48	Debêntures	02/08/2022
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A. (60....	24.533,97	0,47	Títulos Privad...	02/08/2022
Letra Financeira - PORTOSEG FINANCEIRA S.A. (04.86...	22.549,17	0,43	Títulos Privad...	02/08/2022



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
262

Patrimônio Líquido Fundo  
2.202.359.178,53

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)  
IMA-B

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que apliquem em ativos financeiros de renda fixa, com prazo médio superior a 365 dias.

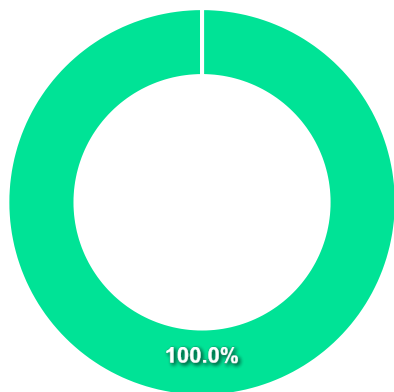
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,36%	4,21%	1,40%	4,21%	3,50%	10,92%	2,06%	4,34%
Indicador de Desempenho (CVM)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de CAIXA MASTER BRASIL FI RENDA FIXA REFEREN...	2.105.540,25	100,00	Fundos de Inve...	08/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	24,04	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	4,48	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,46	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Ajustes Quantidades Patrimônio D...	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-12,59	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-14,02	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a pagar	-71,34	0,00	Valores a paga...	08/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.105.540,25	100.00%
Valores a pagar/receber	-64,97	-0.00%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão  
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração  
 0,40%

Taxa de Performance  
 Não possui

Disponibilidade de Resgate  
 D+1

Quantidade de Cotistas  
 248

Patrimônio Líquido Fundo  
 2.668.371.249,57

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
 Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)  
 IPCA

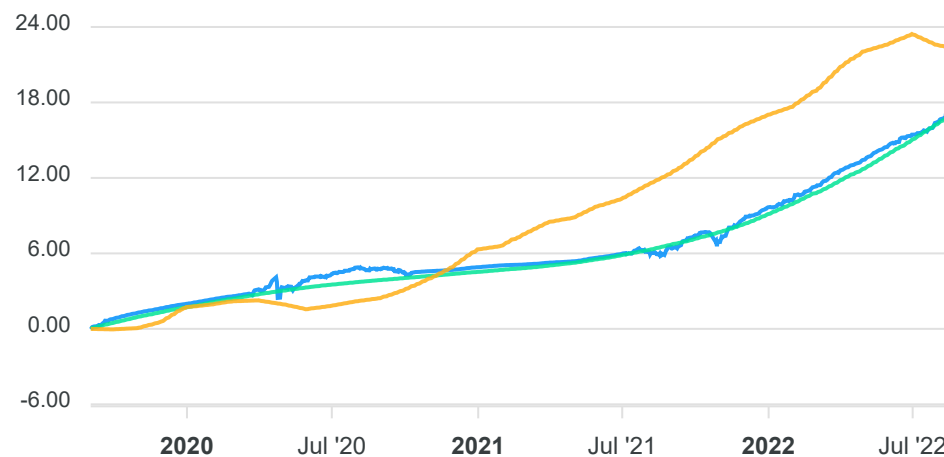
Classificação ANBIMA  
 Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre

Política de Investimento  
 Alocar preponderante em cotas de fundos de investimento de renda fixa atrelados ao IMA e seus sub-índices, podendo alocar também em fundos de investimento de renda fixa que seguem o CDI.

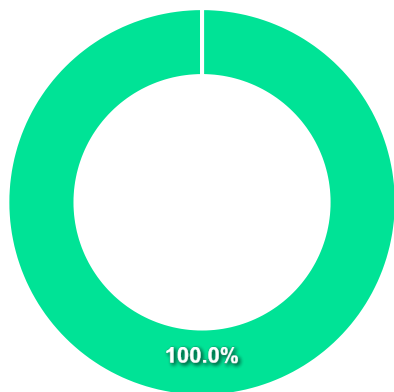
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,79%	5,28%	2,57%	5,28%	8,95%	10,68%	0,42%	0,89%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	2.523.803,97	99,82	Fundos de Inve...	05/08/2022
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	5.328,06	0,21	Fundos de Inve...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	69,72	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a receber	18,94	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	-891,38	-0,04	Valores a paga...	05/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.529.132,04	100.03%
Valores a pagar/receber	-802,71	-0.03%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
INTRAG DTVM LTDA

Gestão  
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA.

Taxa de Administração  
0,50%

Taxa de Performance  
20,00%

Disponibilidade de Resgate  
D+1 du ou D+5 du

Quantidade de Cotistas  
8.957

Patrimônio Líquido Fundo  
784.041.551,98

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)  
IPCA

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento

Política de Investimento  
Aplica seus recursos, principalmente, em títulos públicos, títulos privados e outros ativos atrelados a juros que acompanhem direta ou indiretamente o índice de IPCA.

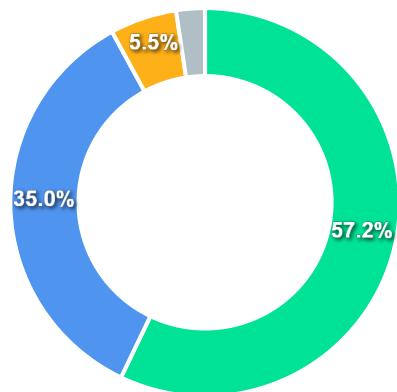
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,18%	5,81%	2,24%	5,81%	8,68%	16,71%	1,65%	3,48%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	462.949,47	57.16%
Debêntures	283.486,95	35.00%
Títulos Privados	44.906,47	5.54%
Fundos de Investimento	19.371,94	2.39%
Valores a pagar/receber	-778,58	-0.10%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	81.688,48	10,09	Títulos Federa...	10/06/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	81.441,30	10,06	Títulos Federa...	10/06/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	81.083,85	10,01	Títulos Federa...	10/06/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	80.255,77	9,91	Títulos Federa...	10/06/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	41.619,89	5,14	Títulos Federa...	10/06/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	40.640,50	5,02	Títulos Federa...	10/06/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	39.897,48	4,93	Títulos Federa...	10/06/2022
Debênture Simples - GRRB24	19.458,90	2,40	Debêntures	10/06/2022
Cotas de SANTANDER CASH BLACK FI RENDA FIXA REFERE...	19.371,94	2,39	Fundos de Inve...	10/06/2022
Debênture Simples - SBSPC2	16.510,05	2,04	Debêntures	10/06/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	16.322,19	2,02	Títulos Federa...	10/06/2022
Debênture simples - LORTA7	12.768,30	1,58	Debêntures	10/06/2022
Debênture Simples - TAEE33	12.213,03	1,51	Debêntures	10/06/2022
Debênture Simples - VAMO33	11.726,63	1,45	Debêntures	10/06/2022
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO S.A. (60.701.190/...	11.523,86	1,42	Títulos Privad...	10/06/2022
Debênture simples - PETR45	11.257,51	1,39	Debêntures	10/06/2022
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO S.A. (60.701.190/...	11.135,96	1,37	Títulos Privad...	10/06/2022
Debênture Simples - LIGHD7	10.798,51	1,33	Debêntures	10/06/2022
Debênture Simples - OMGE31	10.761,88	1,33	Debêntures	10/06/2022
Debênture Simples - GEPA28	10.254,84	1,27	Debêntures	10/06/2022
Debênture Simples - LCAMD1	9.602,16	1,19	Debêntures	10/06/2022
Debênture Simples - UNDAB2	9.216,63	1,14	Debêntures	10/06/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	8.831,50	1,09	Títulos Privad...	10/06/2022
Debênture simples - BTOW15	7.695,50	0,95	Debêntures	10/06/2022
Debênture Simples - CMDT33	7.250,25	0,90	Debêntures	10/06/2022
Debênture simples - ERDV17	7.176,46	0,89	Debêntures	10/06/2022
Debênture simples - CSAN33	7.161,05	0,88	Debêntures	10/06/2022

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
115

Patrimônio Líquido Fundo  
219.095.498,14

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso V, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)  
Não definido

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em ativos financeiros expostos diretamente ao risco das variações das taxas de juros pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA).

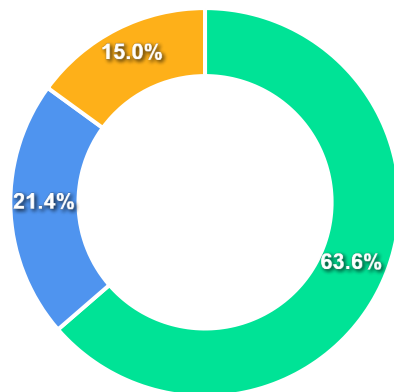
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,42%	6,81%	2,79%	6,81%	7,85%	13,60%	1,14%	2,40%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



## CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	141.783,22	63.63%
Operação compromissada	47.676,96	21.40%
Títulos Privados	33.355,84	14.97%
Valores a pagar/receber	8,30	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	71.189,94	31,95	Títulos Federa...	08/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2023	47.676,96	21,40	Operação compr...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	22.534,15	10,11	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	18.341,95	8,23	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	14.779,33	6,63	Títulos Federa...	08/08/2022
DPGE - BANCO MERCANTIL DO BRASIL S.A. (17.184.037/...	14.651,22	6,58	Títulos Privad...	08/08/2022
NTN-B - Venc: 15/05/2023	10.563,75	4,74	Títulos Federa...	08/08/2022
Letra Financeira - PARANÁ BANCO S.A. (14.388.334/0...	6.914,16	3,10	Títulos Privad...	08/08/2022
DPGE - BES INVESTIMENTO DO BRASIL S.A. - BANCO DE ...	6.779,07	3,04	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO BV S.A. (59.588.111/0001-...	5.011,39	2,25	Títulos Privad...	08/08/2022
NTN-B - Venc: 15/05/2027	4.374,10	1,96	Títulos Federa...	08/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	12,82	0,01	Valores a paga...	08/08/2022
Outras Disponibilidades	10,23	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,92	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	0,57	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-1,32	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-3,64	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-3,81	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a pagar	-7,47	0,00	Valores a paga...	08/08/2022



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração  
1,50%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+4

Quantidade de Cotistas  
7.379

Patrimônio Líquido Fundo  
231.443.985,24

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)  
Ibovespa

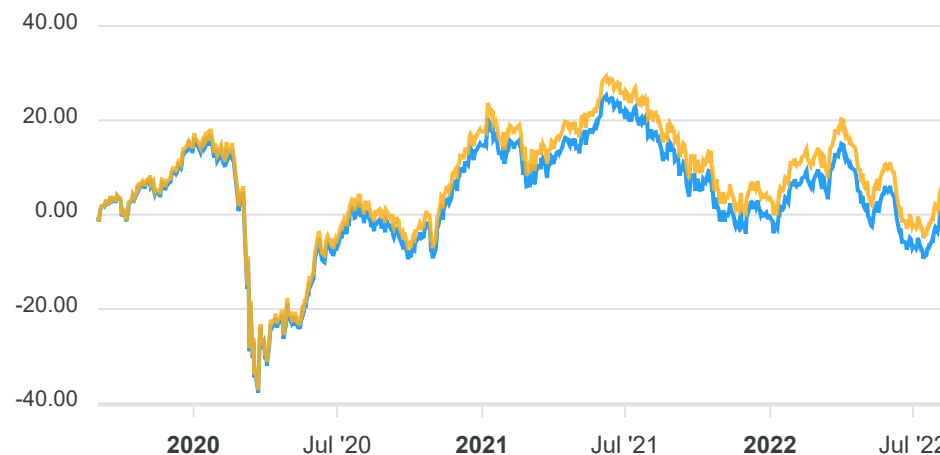
Classificação ANBIMA  
Ações Indexados

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento, os quais investem em ativos financeiros que reflitam o comportamento da carteira teórica do Ibovespa.

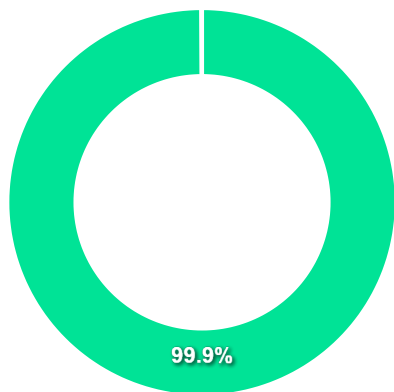
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-11,56%	-6,71%	-18,11%	-6,71%	-23,39%	0,63%	8,86%	18,66%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB TOP INDEXADO IBOVESPA FI AÇÕES	238.466,90	99,92	Fundos de Inve...	04/08/2022
Outros Valores a receber	275,21	0,12	Valores a paga...	04/08/2022
Outras Disponibilidades	214,21	0,09	Valores a paga...	04/08/2022
Outros Valores a receber	4,38	0,00	Valores a paga...	04/08/2022
Valores a pagar / Taxa Anbid	0,44	0,00	Valores a paga...	04/08/2022
Valores a pagar / Controladoria	-1,92	0,00	Valores a paga...	04/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-2,19	0,00	Valores a paga...	04/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-3,81	0,00	Valores a paga...	04/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-8,93	0,00	Valores a paga...	04/08/2022
Valores a pagar / IR a recolher	-15,72	-0,01	Valores a paga...	04/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-41,61	-0,02	Valores a paga...	04/08/2022
Valores a pagar / Cotas a resgatar	-236,24	-0,10	Valores a paga...	04/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	238.466,90	99.92%
Valores a pagar/receber	183,82	0.08%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador BEM DTVM
Gestão BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM
Taxa de Administração 1,50%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+4
Quantidade de Cotistas 996
Patrimônio Líquido Fundo 658.062.057,54

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução Artigo 8º, Inciso I
Indicador de Desempenho (CVM) IDIV
Classificação ANBIMA Ações Dividendos
Política de Investimento Aplica seus recursos em ações de empresas com consistente histórico e perspectivas de recebimento de dividendos.

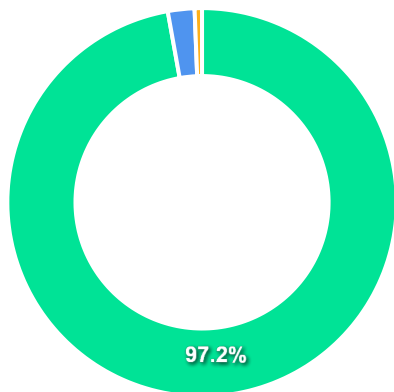
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-9,18%	-0,29%	-13,28%	-0,29%	-12,84%	10,61%	7,94%	16,73%
Indicador de Desempenho (CVM)	-8,38%	4,58%	-9,43%	4,58%	-4,10%	18,72%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	655.508,75	97.18%
Operação compromissada	14.906,89	2.21%
Valores a pagar/receber	4.127,27	0.61%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
PETROBRAS PN - PETR4	91.440,79	13,56	Ações	02/08/2022
VALE ON N1 - VALE3	64.580,20	9,57	Ações	02/08/2022
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	40.583,15	6,02	Ações	02/08/2022
BRDESCO PN N1 - BBDC4	27.224,56	4,04	Ações	02/08/2022
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	25.908,03	3,84	Ações	02/08/2022
AMBEV S/A ON - ABEV3	22.705,72	3,37	Ações	02/08/2022
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	21.849,39	3,24	Ações	02/08/2022
BRASIL ON NM - BBAS3	18.920,22	2,80	Ações	02/08/2022
B3 ON NM - B3SA3	18.686,26	2,77	Ações	02/08/2022
KLABIN S/A UNT N2 - KLBN11	16.821,22	2,49	Ações	02/08/2022
SUL AMERICA UNT N2 - SULA11	16.570,69	2,46	Ações	02/08/2022
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	16.371,36	2,43	Ações	02/08/2022
WEG ON NM - WEGE3	15.216,72	2,26	Ações	02/08/2022
JBS ON NM - JBSS3	15.090,12	2,24	Ações	02/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2024	14.906,89	2,21	Operação compr...	02/08/2022
LOCALIZA ON NM - RENT3	14.613,99	2,17	Ações	02/08/2022
ENERGISA UNT N2 - ENGI11	13.409,08	1,99	Ações	02/08/2022
AREZZO CO ON NM - ARZZ3	13.246,23	1,96	Ações	02/08/2022
ITAUSA PN N1 - ITSA4	13.003,80	1,93	Ações	02/08/2022
BRADSPAR PN N1 - BRAP4	12.842,87	1,90	Ações	02/08/2022
LOJAS RENNEN ON NM - LREN3	12.834,55	1,90	Ações	02/08/2022
SABESP ON NM - SBSP3	11.580,52	1,72	Ações	02/08/2022
TELEF BRASIL ON - VIVT3	11.505,77	1,71	Ações	02/08/2022
BTGP BANCO UNT - BPAC11	10.973,26	1,63	Ações	02/08/2022
REDE D OR ON NM - RDOR3	10.199,61	1,51	Ações	02/08/2022
ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	10.087,23	1,50	Ações	02/08/2022
VIBRA ON NM - VBBR3	8.916,08	1,32	Ações	02/08/2022

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BEM DTVM

Gestão  
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração  
1,50%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+4

Quantidade de Cotistas  
158

Patrimônio Líquido Fundo  
424.182.243,03

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)  
Ibovespa

Classificação ANBIMA  
Ações Índice Ativo

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 67% dos seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição e certificados de depósito de ações, cotas de Fundos de ações e cotas dos Fundos de índice de ações. O fundo não pode conter mais de 20 empresas emissoras de ações.

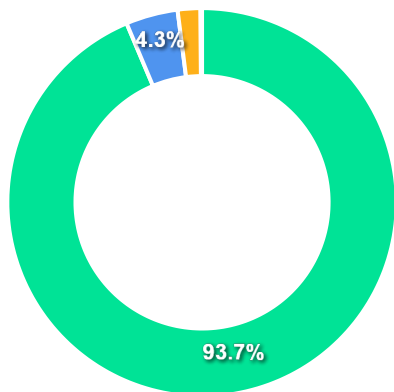
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-11,17%	-5,01%	-15,12%	-5,01%	-25,98%	-0,10%	8,29%	17,46%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	437.232,26	93.67%
Operação compromissada	20.175,20	4.32%
Fundos de Investimento	8.716,16	1.87%
Valores a pagar/receber	676,67	0.14%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
PETROBRAS PN - PETR4	78.062,12	16,72	Ações	02/08/2022
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	51.829,37	11,10	Ações	02/08/2022
ELETRORBRAS PNB N1 - ELET6	43.936,44	9,41	Ações	02/08/2022
VALE ON N1 - VALE3	27.442,93	5,88	Ações	02/08/2022
BRASIL ON NM - BBAS3	24.538,73	5,26	Ações	02/08/2022
GRUPO SOMA ON NM - SOMA3	20.420,34	4,37	Ações	02/08/2022
VAMOS ON NM - VAMO3	20.309,06	4,35	Ações	02/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2024	20.175,20	4,32	Operação compr...	02/08/2022
BRADESCO PN N1 - BBDC4	19.550,38	4,19	Ações	02/08/2022
GRUPO SBF ON NM - SBF3	19.009,94	4,07	Ações	02/08/2022
INTELBRAS ON NM - INTB3	17.439,67	3,74	Ações	02/08/2022
SABESP ON NM - SBSP3	16.974,60	3,64	Ações	02/08/2022
TOTVS ON NM - TOTS3	14.883,23	3,19	Ações	02/08/2022
ENEVA ON NM - ENEV3	14.677,65	3,14	Ações	02/08/2022
SUL AMERICA UNT N2 - SULA11	14.637,33	3,14	Ações	02/08/2022
VIBRA ON NM - VBBR3	13.799,52	2,96	Ações	02/08/2022
3R PETROLEUMON NM - RRRP3	11.951,23	2,56	Ações	02/08/2022
SLC AGRICOLA ON NM - SLCE3	10.747,17	2,30	Ações	02/08/2022
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	8.750,15	1,87	Ações	02/08/2022
Cotas de ETF BRADESCO IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - B...	8.572,68	1,84	Fundos de Inve...	02/08/2022
VIVARA S.A. ON NM - VIVA3	8.272,43	1,77	Ações	02/08/2022
Outros Valores a receber	1.224,63	0,26	Valores a paga...	02/08/2022
Cotas de ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍN...	143,48	0,03	Fundos de Inve...	02/08/2022
Outras Disponibilidades	10,17	0,00	Valores a paga...	02/08/2022
Outros Valores a pagar	-558,13	-0,12	Valores a paga...	02/08/2022

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão  
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração  
1,90%

Taxa de Performance  
20,00%

Disponibilidade de Resgate  
D+24

Quantidade de Cotistas  
26.685

Patrimônio Líquido Fundo  
1.911.192.204,59

Patrimônio Líquido Master  
2.383.481.665,49

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)  
Ibovespa

Classificação ANBIMA  
Ações Livre

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do ITAÚ  
DUNAMIS MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 18.138.837/0001-67.

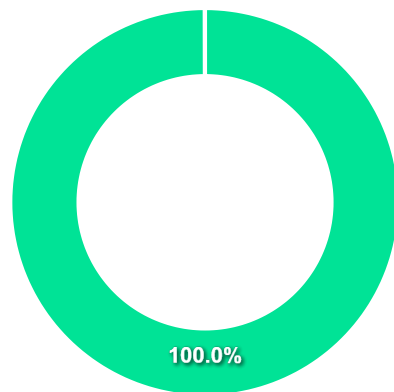
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-11,11%	-8,68%	-13,57%	-8,68%	-25,55%	2,22%	8,32%	17,52%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ DUNAMIS MASTER FI AÇÕES	1.952.597,80	99,73	Fundos de Inve...	05/08/2022
Outros Valores a receber	7.568,39	0,39	Valores a paga...	05/08/2022
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	4.598,46	0,23	Fundos de Inve...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	70,00	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	-7.004,16	-0,36	Valores a paga...	05/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.957.196,26	99.97%
Valores a pagar/receber	634,23	0.03%



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão  
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração  
2,50%

Taxa de Performance  
20,00%

Disponibilidade de Resgate  
D+24

Quantidade de Cotistas  
99

Patrimônio Líquido Fundo  
420.106.519,35

Patrimônio Líquido Master  
537.669.914,17

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)  
Ibovespa

Classificação ANBIMA  
Ações Livre

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do ITAÚ  
PHOENIX FI AÇÕES, CNPJ: 09.094.073/0001-64.

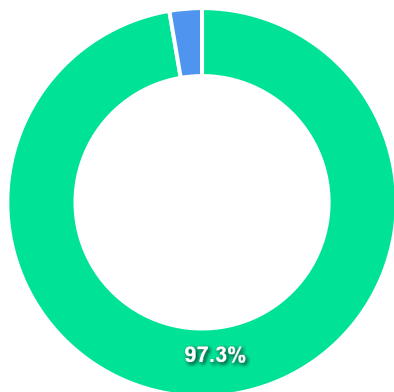
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,46%	-10,71%	-19,62%	-10,71%	-32,68%	-18,43%	8,99%	18,92%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ PHOENIX FI AÇÕES	419.677,49	97,10	Fundos de Inve...	05/08/2022
Outros Valores a receber	12.262,82	2,84	Valores a paga...	05/08/2022
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	922,29	0,21	Fundos de Inve...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	70,00	0,02	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	-704,90	-0,16	Valores a paga...	05/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	420.599,79	97.31%
Valores a pagar/receber	11.627,91	2.69%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
INTRAG DTVM LTDA

Gestão  
XP GESTAO DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração  
3,00%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+4

Quantidade de Cotistas  
2.270

Patrimônio Líquido Fundo  
251.804.459,59

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)  
Ibovespa

Classificação ANBIMA  
Ações Livre

Política de Investimento  
Aplica seus recursos, principalmente, nos mercados de renda variável, podendo investir, também, em outras modalidades e fatores de risco tais como renda fixa, cambial, derivativos e cotas de outros fundos de investimento.

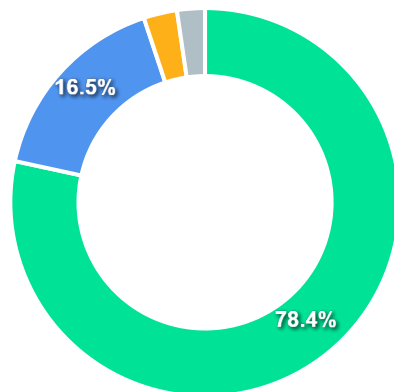
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-5,61%	7,83%	-6,75%	7,83%	-8,37%	1,77%	7,97%	16,78%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/08/202...	40.996,85	16,50	Operação compr...	09/05/2022
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	26.020,54	10,48	Ações	09/05/2022
PETROBRAS PN - PETR4	18.870,50	7,60	Ações	09/05/2022
BRASIL ON NM - BBAS3	18.603,20	7,49	Ações	09/05/2022
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	16.098,92	6,48	Ações	09/05/2022
ENERGISA UNT N2 - ENGI11	16.059,44	6,47	Ações	09/05/2022
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	15.760,91	6,35	Ações	09/05/2022
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	15.176,62	6,11	Ações	09/05/2022
HYPERMARCAS ON NM - HYPE3	14.709,80	5,92	Ações	09/05/2022
PAGUE MENOS ON NM - PGMN3	9.493,09	3,82	Ações	09/05/2022
BRDESCO PN N1 - BBDC4	7.384,39	2,97	Ações	09/05/2022
GPS ON NM - GGPS3	7.350,69	2,96	Ações	09/05/2022
COPASA ON NM - CSMG3	7.100,47	2,86	Ações	09/05/2022
Outros Valores a receber	6.938,27	2,79	Valores a paga...	09/05/2022
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	6.931,85	2,79	Ações	09/05/2022
Cotas de SANTANDER CASH BLACK FI RENDA FIXA REFERE...	5.792,72	2,33	Fundos de Inve...	09/05/2022
CIELO ON NM - CIEL3	4.784,82	1,93	Ações	09/05/2022
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	4.168,36	1,68	Ações	09/05/2022
UNIFIQUE ON NM - FIQE3	3.376,59	1,36	Ações	09/05/2022
ELETROBRAS PNB N1 - ELET6	2.866,71	1,15	Ações	09/05/2022
Cotas de SANTANDER CASH RED FI RENDA FIXA REFERENC...	1.099,87	0,44	Fundos de Inve...	09/05/2022
Outras Disponibilidades	2,00	0,00	Valores a paga...	09/05/2022
Outros Valores a pagar	-1.195,41	-0,48	Valores a paga...	09/05/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	194.756,90	78.41%
Operação compromissada	40.996,85	16.50%
Fundos de Investimento	6.892,59	2.77%
Valores a pagar/receber	5.744,85	2.31%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração  
1,90%

Taxa de Performance  
20,00%

Disponibilidade de Resgate  
D+3

Quantidade de Cotistas  
22.691

Patrimônio Líquido Fundo  
420.593.709,32

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 9º, Inciso III

Indicador de Desempenho (CVM)  
Ibovespa

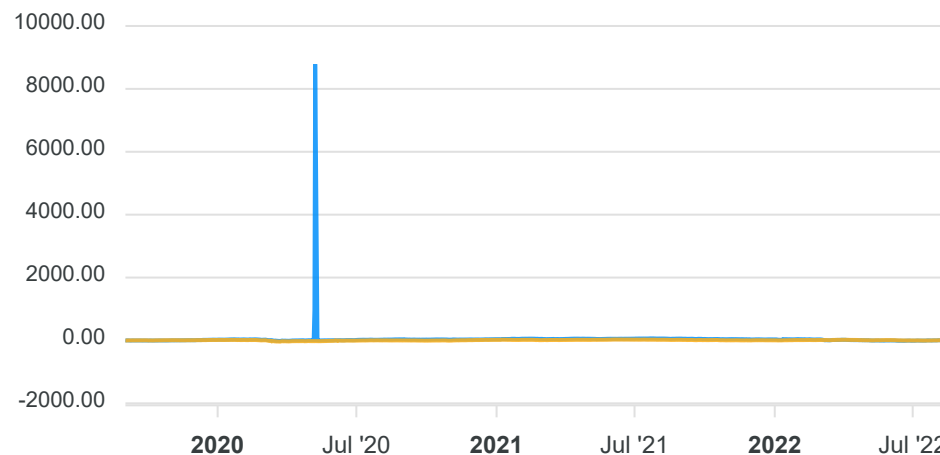
Classificação ANBIMA  
Ações Setoriais

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em carteira de ativos financeiros direcionada para ações de emissão de empresas com destacado uso para tecnologia.

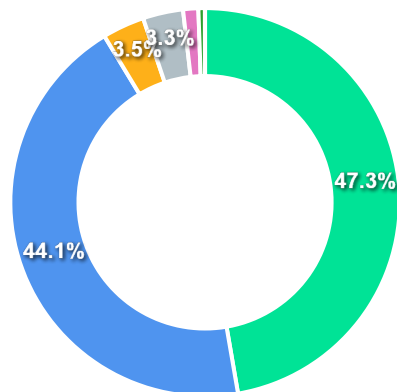
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-8,65%	-31,34%	-23,55%	-31,34%	-41,86%	-19,23%	13,65%	28,75%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



## CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Brazilian Depository Receipts	219.853,22	47.29%
Ações	204.880,03	44.07%
Valores a pagar/receber	16.256,58	3.50%
Operação compromissada	15.536,94	3.34%
Investimento no Exterior	5.859,21	1.26%
Fundos de Investimento	2.486,56	0.53%
Outros	65,56	0.01%
Derivativos	-33,15	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
TOTVS ON NM - TOTS3	49.779,89	10,71	Ações	05/08/2022
SINQIA ON NM - SQIA3	36.379,71	7,83	Ações	05/08/2022
TESLA INC DRN - TSLA34	31.342,27	6,74	Brazilian Depo...	05/08/2022
ALPHABET DRN A - GOGL34	23.644,74	5,09	Brazilian Depo...	05/08/2022
Outros Valores a receber	22.982,17	4,94	Valores a paga...	05/08/2022
APPLE DRN - AAPL34	22.512,01	4,84	Brazilian Depo...	05/08/2022
TIM ON NM - TIMS3	21.530,34	4,63	Ações	05/08/2022
TELEF BRASIL ON - VIVT3	19.613,97	4,22	Ações	05/08/2022
MICROSOFT DRN - MSFT34	19.564,11	4,21	Brazilian Depo...	05/08/2022
AMAZON DRN - AMZO34	16.054,08	3,45	Brazilian Depo...	05/08/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/09/2022	15.536,94	3,34	Operação compr...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	15.083,28	3,24	Valores a paga...	05/08/2022
NVIDIA CORP DRN - NVDC34	14.164,92	3,05	Brazilian Depo...	05/08/2022
POSITIVO INF ON NM - POSI3	13.655,39	2,94	Ações	05/08/2022
THERMFISCHER DRN - TMOS34	10.982,49	2,36	Brazilian Depo...	05/08/2022
MERCADOLIBRE DRN - MELI34	10.082,63	2,17	Brazilian Depo...	05/08/2022
AMGEN DRN - AMGN34	8.463,96	1,82	Brazilian Depo...	05/08/2022
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - POSI3	7.379,88	1,59	Ações	05/08/2022
CISCO DRN - CSCO34	7.346,04	1,58	Brazilian Depo...	05/08/2022
BRISANET ON NM - BRIT3	7.116,75	1,53	Ações	05/08/2022
LOCAWEB ON NM - LWSA3	6.840,41	1,47	Ações	05/08/2022
CSU CARDSYST ON NM - CARD3	6.034,99	1,30	Ações	05/08/2022
META PLAT DRN - FBOK34	6.004,86	1,29	Brazilian Depo...	05/08/2022
PAYPAL HOLD DRN - PYPL34	5.973,75	1,28	Brazilian Depo...	05/08/2022
GILEAD DRN - GILD34	5.797,54	1,25	Brazilian Depo...	05/08/2022
BAIDU INC DRN - BIDU34	5.458,36	1,17	Brazilian Depo...	05/08/2022
NETFLIX DRN - NFLX34	4.920,74	1,06	Brazilian Depo...	05/08/2022

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,70%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+4

Quantidade de Cotistas  
522

Patrimônio Líquido Fundo  
2.225.410.384,30

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 9º, Inciso III

Indicador de Desempenho (CVM)  
Não definido

Classificação ANBIMA  
Ações Livre

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em recibos de ações de empresas estrangeiras negociados no Brasil, baseando-se na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.

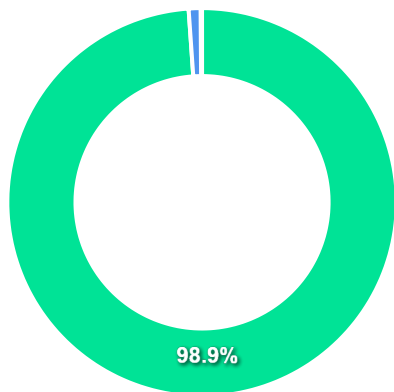
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,83%	-27,83%	-10,22%	-27,83%	-13,08%	9,72%	12,50%	26,32%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



## CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Brazilian Depository Receipts	2.314.817,24	98.90%
Fundos de Investimento	22.977,29	0.98%
Valores a pagar/receber	1.642,95	0.07%
Outros	1.185,17	0.05%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
APPLE DRN - AAPL34	210.472,01	8,99	Brazilian Depo...	08/08/2022
MICROSOFT DRN - MSFT34	166.762,17	7,12	Brazilian Depo...	08/08/2022
AMAZON DRN - AMZO34	109.517,05	4,68	Brazilian Depo...	08/08/2022
TESLA INC DRN - TSLA34	73.206,30	3,13	Brazilian Depo...	08/08/2022
ALPHABET DRN C - GOGL35	58.080,56	2,48	Brazilian Depo...	08/08/2022
ALPHABET DRN A - GOGL34	52.190,48	2,23	Brazilian Depo...	08/08/2022
UNITEDHEALTH DRN - UNHH34	40.340,14	1,72	Brazilian Depo...	08/08/2022
TAIWANSMFAC DRN - TSMC34	36.407,33	1,56	Brazilian Depo...	08/08/2022
NVIDIA CORP DRN - NVDC34	35.983,80	1,54	Brazilian Depo...	08/08/2022
EXXON MOBIL DRN - EXXO34	32.626,32	1,39	Brazilian Depo...	08/08/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - M1TA34	29.116,77	1,24	Brazilian Depo...	08/08/2022
WAL MART DRN - WALM34	28.710,37	1,23	Brazilian Depo...	08/08/2022
MASTERCARD DRN - MSCD34	27.185,57	1,16	Brazilian Depo...	08/08/2022
JPMORGAN DRN - JPMC34	26.981,02	1,15	Brazilian Depo...	08/08/2022
PG DRN - PGC034	26.591,02	1,14	Brazilian Depo...	08/08/2022
CHEVRON DRN - CHVX34	25.335,65	1,08	Brazilian Depo...	08/08/2022
LILLY DRN - LILY34	24.864,95	1,06	Brazilian Depo...	08/08/2022
HOME DEPOT DRN - HOME34	24.715,24	1,06	Brazilian Depo...	08/08/2022
Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA RE...	22.977,29	0,98	Fundos de Inve...	08/08/2022
PFIZER DRN - PFIZ34	22.650,64	0,97	Brazilian Depo...	08/08/2022
COCA COLA DRN - COCA34	21.908,60	0,94	Brazilian Depo...	08/08/2022
BANKAMERICA DRN - BOAC34	21.597,29	0,92	Brazilian Depo...	08/08/2022
TOYOTAMO DRN - TMO34	20.925,64	0,89	Brazilian Depo...	08/08/2022
ABBVIE DRN - ABBV34	20.148,39	0,86	Brazilian Depo...	08/08/2022
ALIBABAGR DRN - BABA34	19.246,97	0,82	Brazilian Depo...	08/08/2022
COSTCO DRN - COWC34	18.997,00	0,81	Brazilian Depo...	08/08/2022
THERMFISCHER DRN - TMOS34	18.691,90	0,80	Brazilian Depo...	08/08/2022



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão  
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração  
0,35%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+1

Quantidade de Cotistas  
28

Patrimônio Líquido Fundo  
48.184.890,26

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 10º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)  
CDI

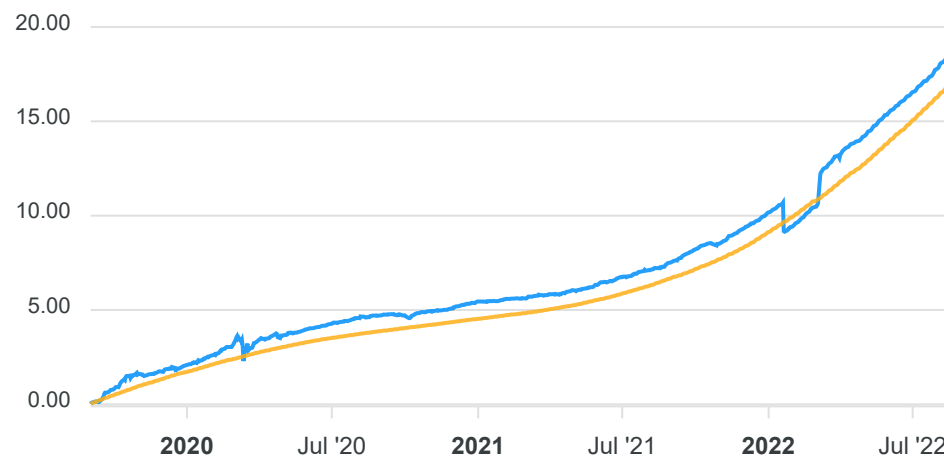
Classificação ANBIMA  
Multimercados Juros e Moedas

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em cotas de fundo de investimentos de ativos de renda fixa de diferentes naturezas e características, admitindo-se estratégias que impliquem risco de juros, índice de preço e moeda estrangeira.

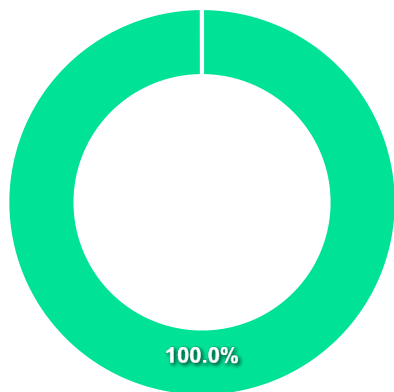
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,95%	5,77%	2,86%	5,77%	9,16%	11,76%	0,08%	0,18%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ VERSO P FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	19.669,91	40,91	Fundos de Inve...	05/08/2022
Cotas de ITAÚ VERSO E FX FI MULTIMERCADO	7.679,65	15,97	Fundos de Inve...	05/08/2022
Cotas de ITAÚ UNIBANCO FIDELIDADE W3 FI RENDA FIXA	5.781,20	12,02	Fundos de Inve...	05/08/2022
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	5.289,12	11,00	Fundos de Inve...	05/08/2022
Cotas de ITAÚ VERSO JM FI MULTIMERCADO	3.861,02	8,03	Fundos de Inve...	05/08/2022
Cotas de ITAÚ FIDELIDADE T FI RENDA FIXA	3.847,41	8,00	Fundos de Inve...	05/08/2022
Cotas de ITAÚ JUROS OCEAN FI RENDA FIXA	1.944,18	4,04	Fundos de Inve...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	29,99	0,06	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a receber	4,21	0,01	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	-23,61	-0,05	Valores a paga...	05/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	48.072,49	99.98%
Valores a pagar/receber	10,59	0.02%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão  
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração  
1,00%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+1

Quantidade de Cotistas  
1.008

Patrimônio Líquido Fundo  
1.374.157.964,02

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 10º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)  
Não definido

Classificação ANBIMA  
Multimercados Estratégia Específica

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento de diversas classes, os quais investem, principalmente, em ativos que tenham como principal fator de risco a variação do preço do índice S&P 500.

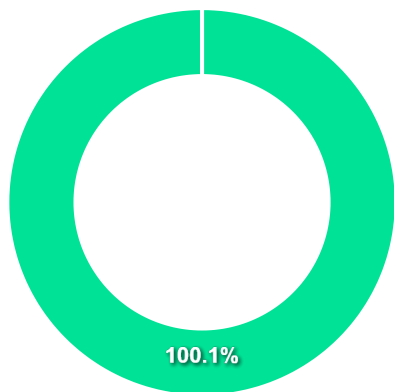
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-7,79%	-17,59%	-14,94%	-17,59%	-5,80%	31,34%	13,65%	28,75%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ INDEX S&P500® FI MULTIMERCADO	1.431.073,82	99,58	Fundos de Inve...	05/08/2022
Outros Valores a receber	21.765,76	1,51	Valores a paga...	05/08/2022
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	6.956,80	0,48	Fundos de Inve...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	64,98	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	-22.714,26	-1,58	Valores a paga...	05/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.438.030,61	100.06%
Valores a pagar/receber	-883,52	-0.06%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S/A

Gestão  
XP GESTAO DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração  
1,25%

Taxa de Performance  
20,00%

Disponibilidade de Resgate  
D+1 du

Quantidade de Cotistas  
7.536

Patrimônio Líquido Fundo  
256.661.702,83

Patrimônio Líquido Master  
252.159.138,73

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 10º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)  
CDI

Classificação ANBIMA  
Multimercados Macro

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do XP  
MACRO INSTITUCIONAL MASTER FI MULTIMERCADO, CNPJ:  
26.541.175/0001-08.

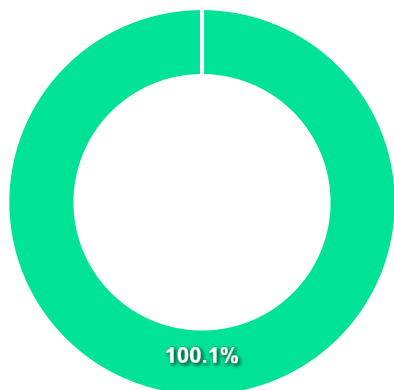
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,94%	5,13%	2,67%	5,13%	8,17%	13,57%	0,20%	0,43%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	246.421,29	100.09%
Valores a pagar/receber	-217,37	-0.09%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de XP MACRO INSTITUCIONAL MASTER FI MULTIMER...	241.042,52	97,90	Fundos de Inve...	06/08/2022
Outros Valores a receber	1.557,51	0,63	Valores a paga...	06/08/2022
Cotas de BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REF...	537,88	0,22	Fundos de Inve...	06/08/2022
Cotas de BNY MELLON ARX LIQUIDEZ V FI RENDA FIXA R...	537,88	0,22	Fundos de Inve...	06/08/2022
Cotas de BNY MELLON ARX LIQUIDEZ VI FI RENDA FIXA ...	537,88	0,22	Fundos de Inve...	06/08/2022
Cotas de BNY MELLON ARX LIQUIDEZ IV FI RENDA FIXA ...	537,88	0,22	Fundos de Inve...	06/08/2022
Cotas de BNY MELLON ARX LIQUIDEZ IX FI RENDA FIXA ...	537,88	0,22	Fundos de Inve...	06/08/2022
Cotas de BNY MELLON ARX LIQUIDEZ III FI RENDA FIXA...	537,88	0,22	Fundos de Inve...	06/08/2022
Cotas de BNY MELLON ARX LIQUIDEZ VIII FI RENDA FIX...	537,88	0,22	Fundos de Inve...	06/08/2022
Cotas de BNY MELLON ARX LIQUIDEZ X FI RENDA FIXA R...	537,88	0,22	Fundos de Inve...	06/08/2022
Cotas de BNY MELLON ARX LIQUIDEZ VII FI RENDA FIXA...	537,88	0,22	Fundos de Inve...	06/08/2022
Cotas de BNY MELLON ARX LIQUIDEZ II FI RENDA FIXA ...	537,88	0,22	Fundos de Inve...	06/08/2022
Outras Disponibilidades	1,02	0,00	Valores a paga...	06/08/2022
Outros Valores a pagar	-1.775,89	-0,72	Valores a paga...	06/08/2022

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
INTRAG DTVM LTDA

Gestão  
XP GESTAO DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração  
2,00%

Taxa de Performance  
20,00%

Disponibilidade de Resgate  
D+33

Quantidade de Cotistas  
1.806

Patrimônio Líquido Fundo  
166.725.341,71

Patrimônio Líquido Master  
212.316.465,17

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Não Enquadrado - RV

Indicador de Desempenho (CVM)  
Ibovespa

Classificação ANBIMA  
Ações Livre

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do XP  
INVESTOR 30 MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 26.776.803/0001-26.

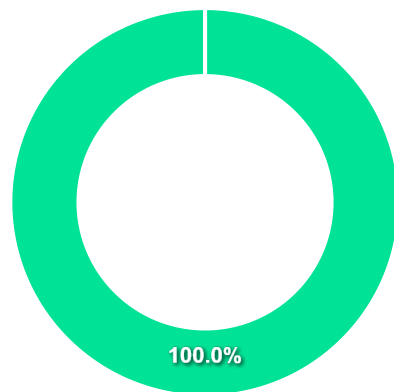
**COMPARATIVO**

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-7,18%	4,03%	-7,38%	4,03%	-18,60%	2,80%	8,32%	17,52%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de XP INVESTOR 30 MASTER FI AÇÕES	185.863,57	98,87	Fundos de Inve...	09/05/2022
Outros Valores a receber	3.500,00	1,86	Valores a paga...	09/05/2022
Cotas de SANTANDER CASH BLACK FI RENDA FIXA REFERE...	2.130,79	1,13	Fundos de Inve...	09/05/2022
Outras Disponibilidades	2,00	0,00	Valores a paga...	09/05/2022
Outros Valores a pagar	-3.516,09	-1,87	Valores a paga...	09/05/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	187.994,36	100.01%
Valores a pagar/receber	-14,09	-0.01%