

# 2022

## Relatório Mensal

# Julho

## 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	8.132.542,07	2,70%	4.928.627.960,16	0,17%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.838.980,07	1,61%	9.515.072.681,60	0,05%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	722.089,34	0,24%	5.189.858.068,29	0,01%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.106.505,27	3,69%	4.977.668.769,91	0,22%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	732.278,04	0,24%	2.837.899.627,90	0,03%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.078.530,26	6,67%	3.068.003.584,32	0,65%	7º I b
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.811.476,24	3,26%	546.066.831,92	1,80%	7º I b
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.054.499,08	3,34%	3.748.160.148,32	0,27%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.339.569,83	3,10%	6.217.671.822,00	0,15%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	26.628.450,01	8,84%	10.530.457.571,28	0,25%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	43.732.742,90	14,52%	10.426.166.067,57	0,42%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.082.209,11	12,31%	1.156.132.227,79	3,21%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	437.863,49	0,15%	3.885.055.392,30	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.652.920,60	0,88%	558.260.089,74	0,48%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.334.404,16	4,43%	5.065.234.429,28	0,26%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	58.130,40	0,02%	761.462.879,89	0,01%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	404.649,69	0,13%	142.719.815,45	0,28%	7º I b
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	656.049,82	0,22%	766.955.657,92	0,09%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	21.136.175,25	7,02%	10.247.937.610,00	0,21%	7º III a
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.007.587,96	1,33%	808.122.410,04	0,50%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	426.396,69	0,14%	1.265.147.070,67	0,03%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	21.264.945,85	7,06%	5.194.423.550,27	0,41%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	602.798,61	0,20%	2.105.457.404,21	0,03%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	19.301.309,94	6,41%	2.528.329.321,30	0,76%	7º III a
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1.424.447,81	0,47%	705.460.548,71	0,20%	7º III a
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.551.151,94	2,18%	222.821.350,04	2,94%	7º V b
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	479.222,57	0,16%	238.649.849,43	0,20%	8º I

## Investimentos

\$ 301.198.821,06

## Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

## Total Carteira

\$ 301.198.821,06

## Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	202.593,38	0,07%	674.542.913,01	0,03%	8º I
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	189.895,76	0,06%	466.800.295,62	0,04%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.608.159,46	1,20%	2.427.382.604,51	0,15%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.089.078,96	0,69%	553.337.313,47	0,38%	8º I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	499.566,32	0,17%	252.198.817,23	0,20%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.928.966,86	0,97%	464.904.422,68	0,63%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.280.743,49	2,42%	2.340.707.282,75	0,31%	9º III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	368.088,93	0,12%	48.083.075,56	0,77%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	8.257.016,17	2,74%	1.437.147.092,41	0,57%	10º I
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	258.920,43	0,09%	241.042.517,87	0,11%	10º I
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	517.864,30	0,17%	239.789.401,43	0,22%	NE

Investimentos

\$ 301.198.821,06

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 301.198.821,06

Governança (Pró Gestão)

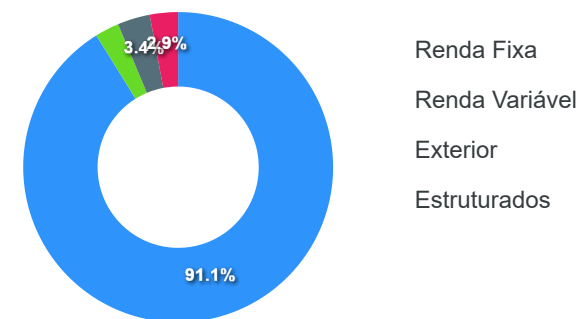
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	66,12%	199.147.840,56 33,88%
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	22,85%	68.819.711,93 37,15%
7° V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	2,18%	6.551.151,94 2,82%
8° I - Fundos de Ações	30,00%	2,35%	7.068.516,45 27,65%
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,39%	10.209.710,35 6,61%
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	2,95%	8.884.025,53 7,05%
Não Enquadrado	0,00%	0,17%	517.864,30 -0,17%

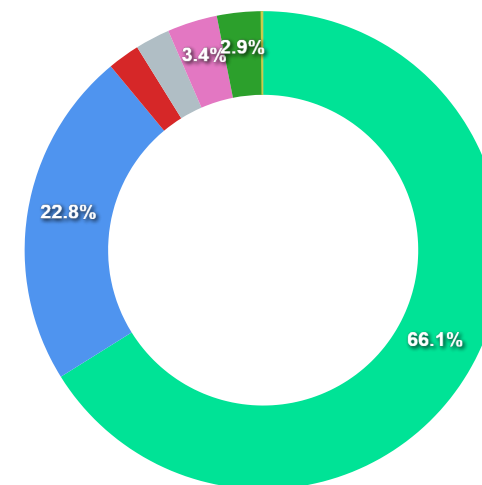
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos



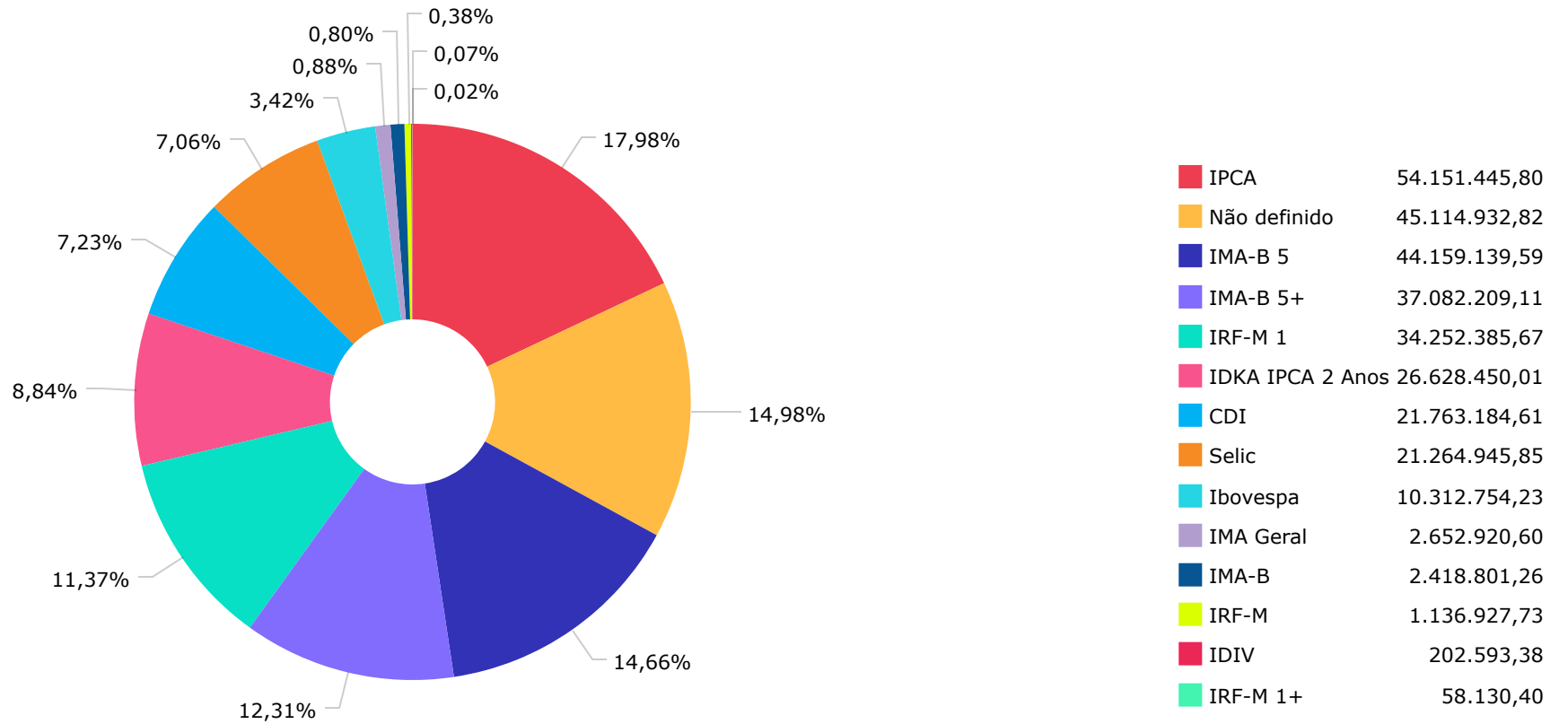
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	20,00%	100,00%	301.198.821,06	8° I - Fundos de Ações	2,35%	0,00%	10,00%	30,00%	83.291.129,87
7° I b - FI 100% Títulos TN	66,12%	0,00%	34,00%	100,00%	102.050.980,50	9° III - Ações - BDR Nível I	3,39%	0,00%	8,00%	10,00%	19.910.171,76
7° III a - FI Referenciados RF	22,85%	0,00%	20,00%	60,00%	111.899.580,71	10° I - Fundos Multimercados	2,95%	0,00%	5,00%	10,00%	21.235.856,58
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	2,18%	0,00%	3,00%	5,00%	8.508.789,11	Não Enquadrado	0,17%	0,00%	0,00%	0,00%	-517.864,30

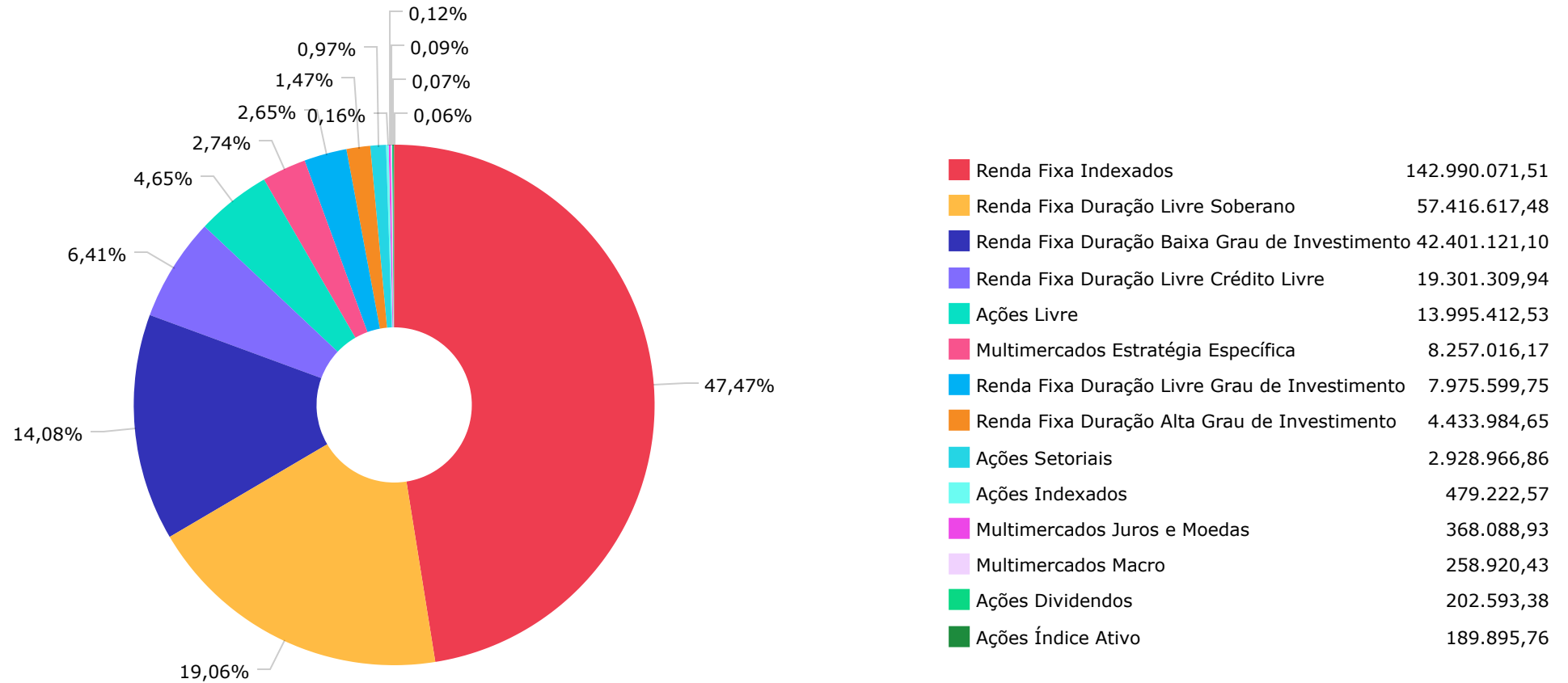
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>NÃO DEFINIDO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,22	6,22	0,82	6,21	9,51	15,66	1,40	2,96
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-0,13	6,67	1,14	6,38	8,10	11,38	0,93	1,97
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41	4,13	1,56	4,09	4,69	5,26	0,88	1,86
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	10,09	-9,27	2,48	-4,21	1,10	36,82	8,94	18,83
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,88	-22,14	3,94	-13,74	-11,05	16,19	11,49	24,21
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,07		-2,36				0,76	1,61
<b>CDI - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1,03	6,86	3,11	6,08	9,93	12,57	0,11	0,23
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,04	6,64	3,16	5,81	9,68	12,43	0,01	0,03
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,75	5,92	2,55	5,26	9,01	12,80	0,73	1,55
<b>IBOVESPA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,63	14,98	3,17	7,45	1,83	2,04	7,13	15,02
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	6,06	10,34	1,80	4,42	-9,37	0,46	7,18	15,13
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	4,57	-2,45	-4,69	-8,70	-16,47	-2,60	7,68	16,16
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	6,30	0,97	-2,43	-5,43	-17,29	-3,51	8,51	17,93
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6,01	-3,20	-2,21	-4,48	-18,57	0,76	7,73	16,29
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	6,11	-5,25	-4,98	-9,90	-28,09	-18,19	8,20	17,27
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12,38	-22,83	-3,06	-16,51	-35,91	-16,58	12,96	27,30
<b>IDIV - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,67	4,37	-1,42	-2,39	-5,30	8,05	7,15	15,06
<b>IDKA IPCA 2 ANOS - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29	6,10	0,78	6,08	9,41	15,38	1,48	3,12

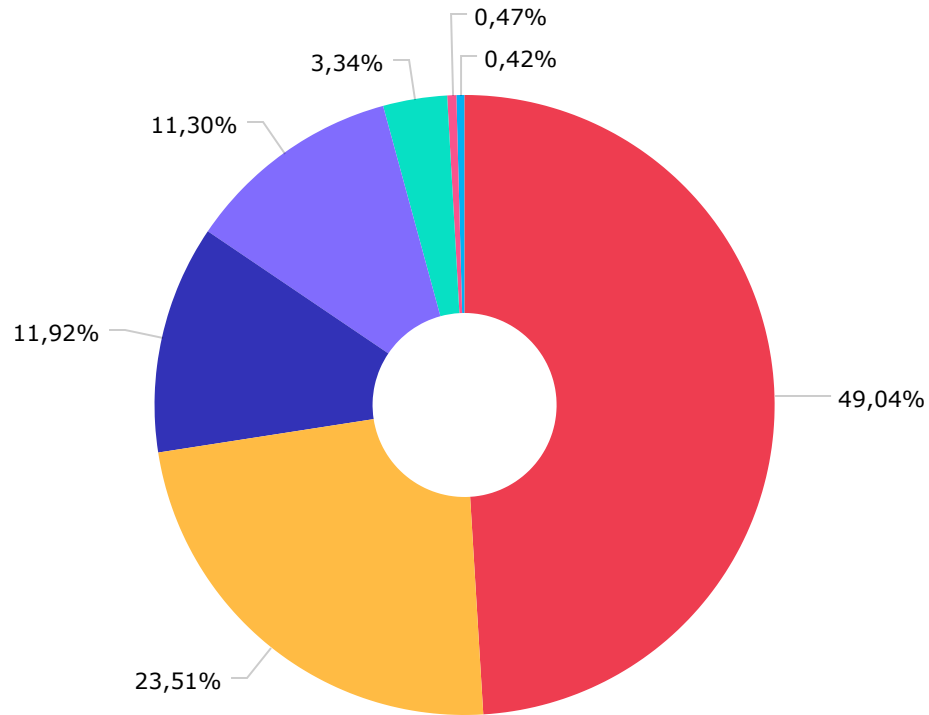
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>IMA GERAL - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>0,47</b>	<b>4,98</b>	<b>1,83</b>	<b>4,76</b>	<b>5,95</b>	<b>7,72</b>		
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43	4,65	1,75	4,61	5,63	6,57	1,10	2,32
<b>IMA-B - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>-0,88</b>	<b>3,43</b>	<b>-0,28</b>	<b>4,20</b>	<b>3,25</b>	<b>5,86</b>		
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,95	3,27	-0,44	4,06	2,99	5,28	2,43	5,12
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,89	3,27	-0,26	4,07	2,97	5,30	2,49	5,25
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,92	3,29	-0,35	4,07	2,97	5,33	2,47	5,21
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,89	3,29	-0,29	4,09	2,96	5,30	2,40	5,05
<b>IMA-B 5 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>0,01</b>	<b>6,62</b>	<b>1,13</b>	<b>6,50</b>	<b>10,04</b>	<b>15,61</b>		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02	6,53	1,12	6,44	9,84	15,08	1,21	2,55
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	-0,01	6,30	1,01	6,22	9,48	14,02	1,25	2,63
<b>IMA-B 5+ - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>-1,84</b>	<b>0,16</b>	<b>-1,79</b>	<b>1,79</b>	<b>-3,22</b>	<b>-2,89</b>		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,91	0,00	-1,88	1,65	-3,73	-3,54	3,99	8,41
<b>IPCA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>-0,68</b>	<b>4,77</b>	<b>0,46</b>	<b>4,21</b>	<b>10,07</b>	<b>19,97</b>		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08	7,21	0,92	7,11	10,41	15,65	0,76	1,61
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,80	6,12	2,60	5,57	9,65	10,96	0,36	0,76
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	-0,55	5,23	0,57	5,41	8,23	13,82	1,91	4,02
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,79	5,41	2,09	4,71	5,36	6,31	0,99	2,08
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,34	4,43	1,51	4,19	5,32	5,43	1,08	2,28
<b>IRF-M - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>1,15</b>	<b>3,36</b>	<b>2,11</b>	<b>3,45</b>	<b>3,42</b>	<b>1,97</b>		
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,00	5,97	2,89	5,30	7,85	9,76	0,24	0,50
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13	3,27	2,06	3,40	3,17	1,42	1,48	3,11

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>IRF-M 1 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>1,05</b>	<b>6,09</b>	<b>2,96</b>	<b>5,43</b>	<b>8,11</b>	<b>10,26</b>		
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03	5,96	2,92	5,31	7,90	9,64	0,25	0,52
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03	5,94	2,90	5,30	7,87	9,75	0,25	0,52
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04	5,95	2,91	5,30	7,86	9,57	0,25	0,53
<b>IRF-M 1+ - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>1,20</b>	<b>1,94</b>	<b>1,68</b>	<b>2,45</b>	<b>1,01</b>	<b>-2,37</b>		
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15	1,77	1,57	2,32	0,67	-2,96	2,32	4,88
<b>SELIC - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>	<b>1,03</b>	<b>6,49</b>	<b>3,11</b>	<b>5,72</b>	<b>9,39</b>	<b>12,05</b>		
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08	6,85	3,29	6,03	10,11	12,91	0,01	0,02

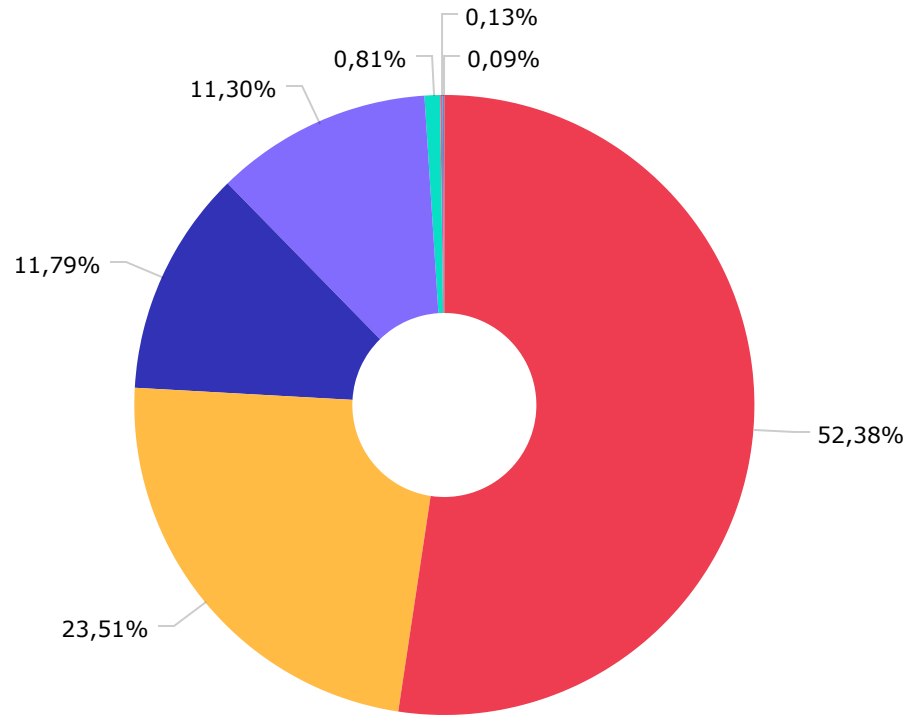








CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	147.700.984,54
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	70.811.339,55
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	35.902.895,88
ITAU UNIBANCO S.A.	34.028.303,15
CAIXA DTVM	10.054.499,08
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA...	1.424.447,81
XP GESTAO DE RECURSOS LTDA	1.276.351,05

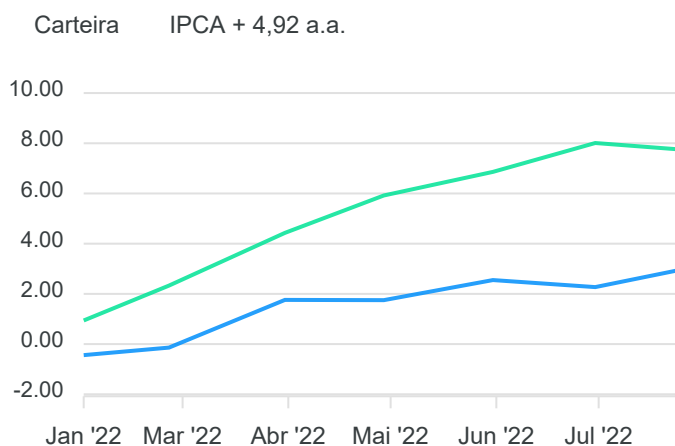
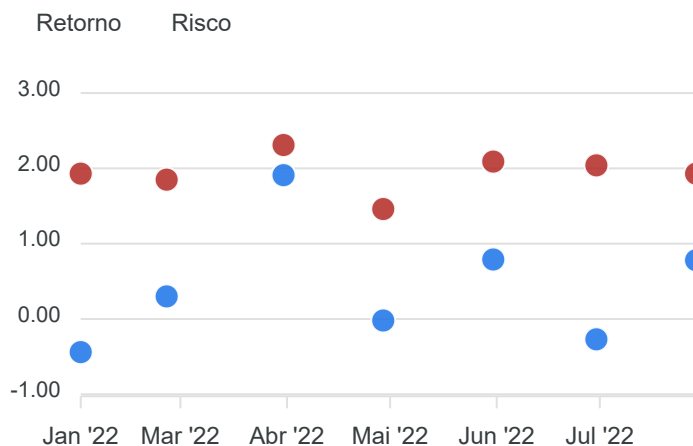


CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	157.755.483,62
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	70.811.339,55
BANCO BRADESCO S.A.	35.510.406,74
ITAU UNIBANCO S.A.	34.028.303,15
INTRAG DTVM LTDA	2.441.878,43
BEM DTVM	392.489,14
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIRO...	258.920,43

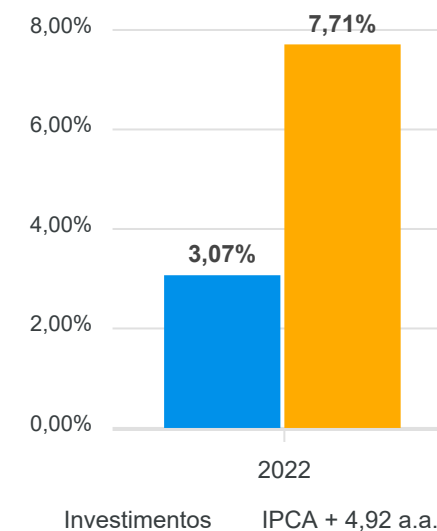
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	279.624.240,93	2.170.172,20	803.243,98	279.747.225,35	-1.243.943,80	-0,44% ▼	0,94%	1,93%
Fevereiro	279.747.225,35	2.578.174,19	927.658,99	282.243.315,30	845.574,75	0,30% ▲	1,38%	1,85%
Março	282.243.315,30	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%
Julho	296.894.307,47	2.768.343,02	781.054,13	301.198.821,06	2.317.224,70	0,78% ▲	-0,28%	1,93%

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 8.806.716,54 3,07% ▲ 7,71%



Retorno e Meta Acumulado



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.099.733,25	0,00	0,00	8.132.542,07	32.808,82	0,41% ▲	0,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.849.692,71	0,00	0,00	4.838.980,07	-10.712,64	-0,22% ▼	1,40%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	662.339,48	0,00	0,00	656.049,82	-6.289,66	-0,95% ▼	2,43%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	728.540,86	0,00	0,00	722.089,34	-6.451,52	-0,89% ▼	2,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.991.954,46	0,00	0,00	11.106.505,27	114.550,81	1,04% ▲	0,25%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	724.086,68	0,00	0,00	732.278,04	8.191,36	1,13% ▲	1,48%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	18.250.939,25	2.671.113,97	0,00	21.136.175,25	214.122,03	1,02% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.062.914,02	0,00	0,00	20.078.530,26	15.616,24	0,08% ▲	0,76%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.993.924,74	0,00	0,00	4.007.587,96	13.663,22	0,34% ▲	1,08%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	426.449,20	0,00	0,00	426.396,69	-52,51	-0,01% ▼	1,25%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.711.043,60	0,00	0,00	9.811.476,24	100.432,64	1,03% ▲	0,25%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	21.038.273,13	0,00	0,00	21.264.945,85	226.672,72	1,08% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.047.007,18	0,00	0,00	10.054.499,08	7.491,90	0,07% ▲	0,76%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.046.441,65	0,00	781.054,13	9.339.569,83	74.182,31	0,74% ▲	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	26.706.555,60	0,00	0,00	26.628.450,01	-78.105,59	-0,29% ▼	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	43.710.550,64	13.152,71	0,00	43.732.742,90	9.039,55	0,02% ▲	1,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.802.579,14	0,00	0,00	37.082.209,11	-720.370,03	-1,91% ▼	3,99%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	441.950,77	0,00	0,00	437.863,49	-4.087,28	-0,92% ▼	2,47%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.641.457,22	0,00	0,00	2.652.920,60	11.463,38	0,43% ▲	1,10%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.559.920,00	0,00	0,00	6.551.151,94	-8.768,06	-0,13% ▼	0,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.124.497,56	74.505,84	0,00	13.334.404,16	135.400,76	1,03% ▲	0,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	47.877,65	9.570,50	0,00	58.130,40	682,25	1,19% ▲	2,32%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	608.241,27	0,00	0,00	602.798,61	-5.442,66	-0,89% ▼	2,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	19.147.731,77	0,00	0,00	19.301.309,94	153.578,17	0,80% ▲	0,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	400.653,13	0,00	0,00	404.649,69	3.996,56	1,00% ▲	0,24%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1.432.272,88	0,00	0,00	1.424.447,81	-7.825,07	-0,55% ▼	1,91%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
	272.257.627,84	2.768.343,02	781.054,13	274.518.704,43	273.787,70	0,10%	1,19%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	458.288,29	0,00	0,00	479.222,57	20.934,28	4,57% ▲	7,68%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	193.549,24	0,00	0,00	202.593,38	9.044,14	4,67% ▲	7,15%
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	178.647,76	0,00	0,00	189.895,76	11.248,00	6,30% ▲	8,51%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.403.761,17	0,00	0,00	3.608.159,46	204.398,29	6,01% ▲	7,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	364.330,37	0,00	0,00	368.088,93	3.758,56	1,03% ▲	0,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.968.801,56	0,00	0,00	2.089.078,96	120.277,40	6,11% ▲	8,20%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	7.500.216,53	0,00	0,00	8.257.016,17	756.799,64	10,09% ▲	8,94%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	488.258,78	0,00	0,00	517.864,30	29.605,52	6,06% ▲	7,18%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	468.507,31	0,00	0,00	499.566,32	31.059,01	6,63% ▲	7,13%
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	256.987,67	0,00	0,00	258.920,43	1.932,76	0,75% ▲	0,73%
-	15.281.348,68	0,00	0,00	16.470.406,28	1.189.057,60	7,78%	8,08%



INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.606.217,89	0,00	0,00	2.928.966,86	322.748,97	12,38% ▲	12,96%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.749.113,06	0,00	0,00	7.280.743,49	531.630,43	7,88% ▲	11,49%
	9.355.330,95	0,00	0,00	10.209.710,35	854.379,40	9,13%	3,72%

## **Cenário Econômico**

O fechamento de julho, caracterizou-se como sendo de recuperação dos principais índices de mercados, e as carteiras de investimentos que possuíam diversificação, experimentaram bons retornos. No segmento de renda variável, na segunda quinzena do mês, foi de melhor resultado com o Ibovespa fechando em 103 mil pontos, acumulando uma alta no mês de 4,69%. A atenção com a inflação ainda segue como o principal assunto nos debates econômicos, ao redor do mundo, principalmente levando-se em conta o fato de seguir disseminada e resiliente nas principais economias globais. Isso tem provocado um movimento geral dos bancos centrais de elevação na taxa básica de juros das economias, ao redor do mundo, a fim de frear a atividade econômica e reduzir a pressão sobre os preços de mercado trazendo com isso incertezas quanto aos seus limites, e deprimindo parcela de valorização das aquisições de títulos e fundos com carteira formada por títulos públicos federais. Entretanto, isso não tira as boas perspectivas de valorizações dos ativos, tanto no segmento de renda fixa, como no segmento de renda variável nos meses restantes do ano de 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 demonstra recuperação face o aumento das taxas de juros visando a contenção do processo inflacionário. Tal cenário de recuperação da conjuntura econômica interna também favoreceu os mercados de Bolsa e Ativos Reais, proporcionando um resultado consolidado da carteira mais satisfatório.

### **Retorno dos Fundos de Investimentos**

A carteira na parcela referente a fundos de investimentos, 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, 16 de agosto de 2022.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP