



Estado de Rondônia
PREFEITURA MUNICIPAL DE JI-PARANÁ
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DE JI-PARANÁ

RELATÓRIO ANALÍTICO DOS INVESTIMENTOS INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DE JI-PARANÁ

Publicação do resultado da Carteira de Investimento do Fundo de Previdência Social de Ji-Paraná em **Junho/ 2º trimestre e 1º semestre de 2022**, disponibilizado pela Diretoria Executiva do Instituto de Previdência dos Servidores de Ji-Paraná.

AGOSTINHO CASTELLO BRANCO FILHO

Certificação APIMEC – CGRPPS n. 4873

Presidente do IPREJI

Decreto n. 1166/GAB/PM/JP/2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

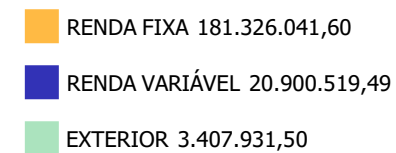
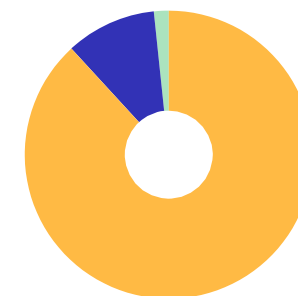
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	463 dias	456.823,07	0,22%	218	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	472.075,90	0,23%	179	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	243.906,85	0,12%	317	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	38.015.151,33	18,49%	868	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	36.477.209,77	17,74%	1.073	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	21.188.129,73	10,30%	1.024	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	9.543.241,08	4,64%	272	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.194.072,70	0,58%	798	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.454.303,51	2,17%	1.175	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	3.238.713,23	1,57%	206	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	768.671,83	0,37%	249	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.001.806,23	0,49%	547	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.788.092,46	4,76%	214	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	437.772,62	0,21%	134	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	18.063.097,88	8,78%	948	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.724.700,31	6,19%	204	0,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.660.866,81	6,16%	588	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	10.597.406,29	5,15%	18	15,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.569.385,32	1,74%	177	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	2.209.549,38	1,07%	18.477	0,32%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	821.518,34	0,40%	2.402	0,99%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.407.931,50	1,66%	522	0,15%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	3.900.249,85	1,90%	136	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	6.817.116,42	3,32%	12.074	0,33%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	1.399.754,39	0,68%	3.355	0,16%	Artigo 10º, Inciso I
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	0,02	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	Não se ...	Não se aplica	2.182.945,77	1,06%		1,73%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		123,59	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			205.634.492,59				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			123,59				Artigo 6º
PL Total			205.634.616,18				

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

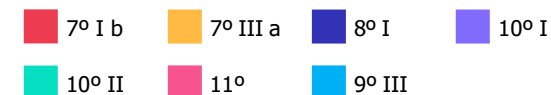
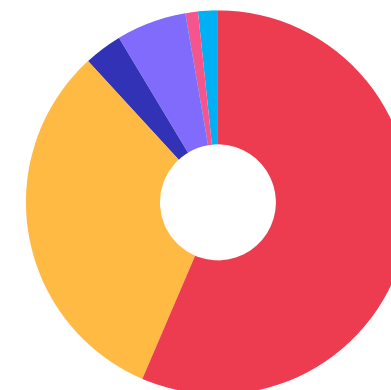
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	9,40%	59,24%	121.817.873,41
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	116.052.299,00	56,44%	22,43%	35,40%	71,24%	30.441.713,52
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	65.273.742,60	31,74%	0,00%	13,00%	50,00%	37.543.503,70
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	2,25%	13,00%	20,00%	41.126.898,52
Total Renda Fixa	100,00%	181.326.041,60	88,18%	24,68%	70,80%	200,48%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	6.600.453,04	3,21%	15,00%	19,00%	20,00%	34.526.445,48
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,40%	20,00%	41.126.898,52
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	12.117.120,66	5,89%	1,50%	2,00%	10,00%	8.446.328,60
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,02	0,00%	0,00%	2,40%	5,00%	10.281.724,61
Artigo 11º	5,00%	2.182.945,77	1,06%	0,00%	2,40%	5,00%	8.098.778,86
Total Renda Variável	30,00%	20.900.519,49	10,16%	16,50%	29,20%	60,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.407.931,50	1,66%	0,00%	0,00%	10,00%	17.155.517,76
Total Exterior	10,00%	3.407.931,50	1,66%	0,00%	0,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	191.852.334,28	93,30	-
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	10.597.406,29	5,15	0,36
REDITUS INVESTIMENTOS	2.182.945,77	1,06	39,94
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.001.806,23	0,49	0,00
ÍNDIGO DTVM	0,02	0,00	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	59,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	116.052.299,00	56,44	22,43	71,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65.273.742,60	31,74	0,00	50,00
Artigo 8º, Inciso I	6.600.453,04	3,21	15,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 10º, Inciso I	12.117.120,66	5,89	1,50	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,02	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	2.182.945,77	1,06	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,47%	6,85%	2,86%	6,85%	10,11%	17,88%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,22%	6,41%	2,50%	6,41%	9,66%	16,68%	1,39%	0,04%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,09%	0,73%	-0,06%	0,73%	-1,02%	-2,10%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,05%	0,62%	-0,11%	0,62%	-1,34%	-2,63%	2,55%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,10%	2,03%	0,12%	2,03%	-2,16%	6,18%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,10%	1,95%	0,07%	1,95%	-2,61%	5,51%	3,18%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	4,86%	2,58%	4,86%	6,94%	8,89%	0,17%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-1,99%	-23,74%	-0,77%	-23,74%	-57,11%	-64,07%	3,85%	0,43%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,22%	3,51%	2,37%	3,51%	3,61%	3,61%	1,44%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,33%	6,51%	2,65%	6,51%	9,84%	16,18%	1,23%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,38%	4,25%	1,39%	4,25%	3,52%	10,96%	2,05%	0,06%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	0,37%	2,19%	0,83%	2,19%	1,76%	1,90%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,34%	2,15%	0,76%	2,15%	1,63%	1,54%	1,76%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	5,28%	2,85%	5,28%	8,43%	10,54%	0,01%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,88%	4,59%	2,50%	4,59%	7,12%	8,63%	0,01%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,06%	5,60%	2,97%	5,60%	9,19%	11,59%	0,04%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,04%	5,69%	2,94%	5,69%	9,23%	11,71%	0,03%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	5,52%	2,87%	5,52%	8,84%	10,78%	0,01%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	4,30%	2,02%	4,30%	5,27%	8,66%	0,81%	0,02%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,09%	4,95%	2,32%	4,95%	4,93%	7,33%	1,55%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,23%	4,59%	2,22%	4,59%	3,73%	6,51%	1,57%	0,03%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,33%	-	-0,26%	-	-	-	1,37%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,79%	-27,61%	-10,27%	-27,61%	-12,10%	12,50%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,83%	-27,83%	-10,22%	-27,83%	-13,08%	9,72%	12,50%	0,20%
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	1,36%	9,81%	4,29%	9,81%	21,40%	42,66%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-
Ibovespa (Benchmark)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-10,52%	-3,62%	-10,56%	-3,62%	-15,12%	21,27%	8,01%	0,17%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-12,87%	-7,83%	-19,44%	-7,83%	-26,66%	-4,30%	9,54%	0,22%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,82%	4,59%	-0,02%	4,59%	3,57%	12,16%	1,93%	0,04%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1,14%	6,48%	3,15%	6,48%	9,77%	11,75%	0,25%	0,01%
MSCI ACWI (Benchmark)	1,26%	-25,79%	-7,28%	-25,79%	-13,20%	8,75%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-7,78%	-17,57%	-14,98%	-17,57%	-5,74%	30,65%	13,68%	0,19%
IFIX (Benchmark)	-0,88%	-0,33%	0,56%	-0,33%	1,48%	-0,38%	-	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%

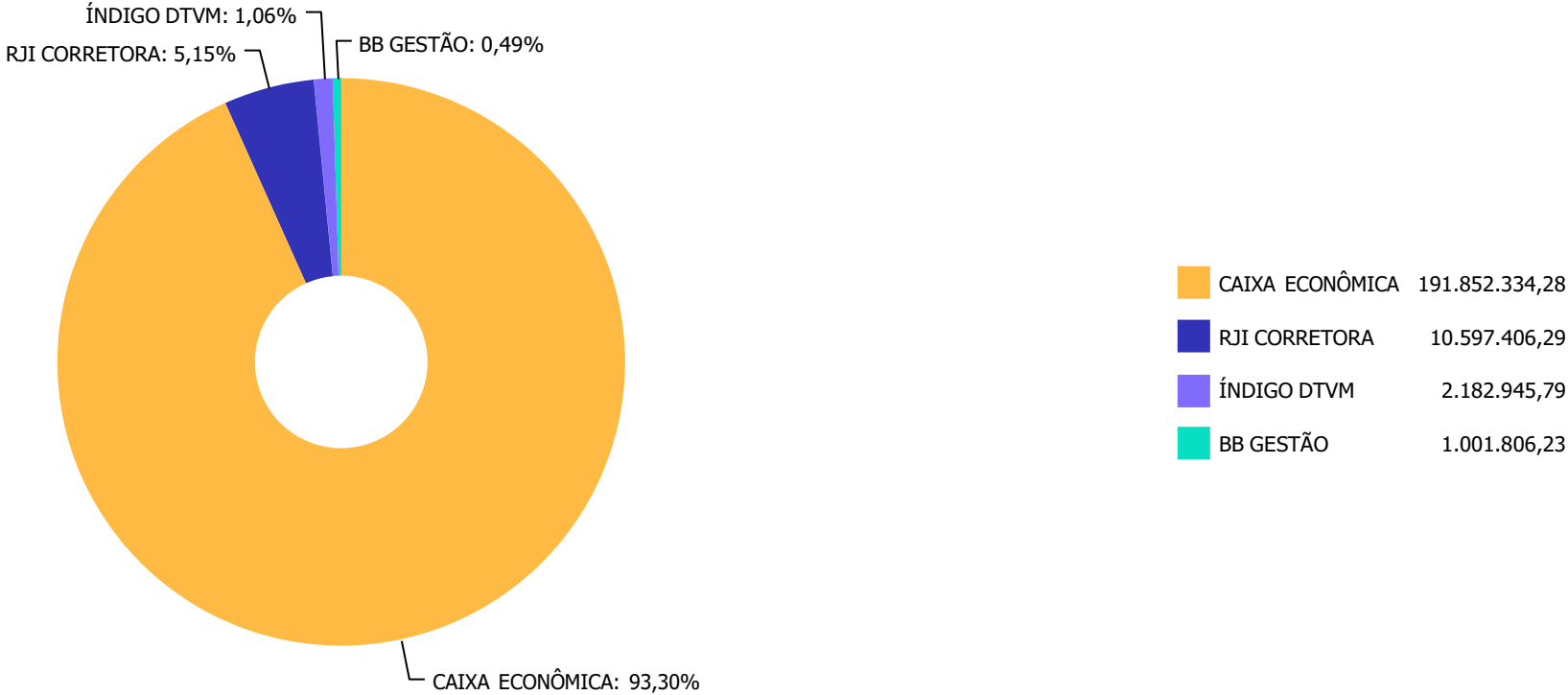
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	11,52%	-	-	-	-	-	10,31%	-

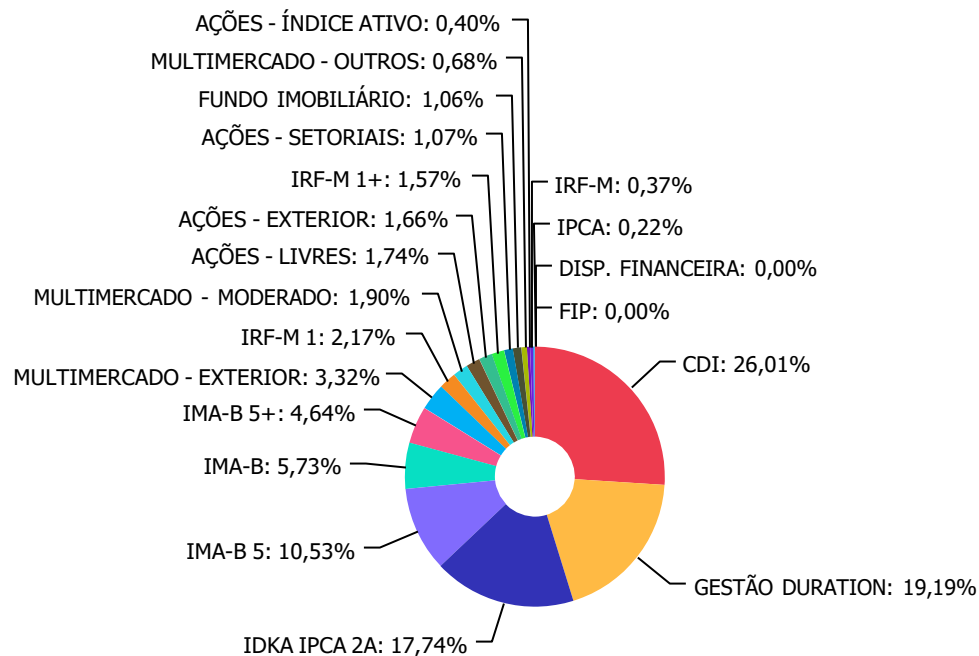
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,79%	-27,61%	-10,27%	-27,61%	-12,10%	12,50%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,83%	-27,83%	-10,22%	-27,83%	-13,08%	9,72%	12,50%	0,20%

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



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

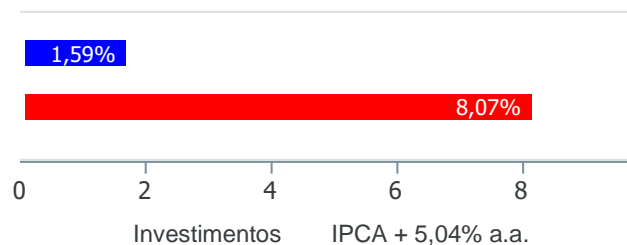


■ CDI	53.480.664,31	■ GESTÃO DURATION	39.454.730,18	■ IDKA IPCA 2A	36.477.209,77	■ IMA-B 5	21.660.205,63
■ IMA-B	11.791.478,99	■ IMA-B 5+	9.543.241,08	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	6.817.116,42	■ IRF-M 1	4.454.303,51
■ MULTIMERCADO - MODERADO	3.900.249,85	■ AÇÕES - LIVRES	3.569.385,32	■ AÇÕES - EXTERIOR	3.407.931,50	■ IRF-M 1+	3.238.713,23
■ AÇÕES - SETORIAIS	2.209.549,38	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.182.945,77	■ MULTIMERCADO - OUTROS	1.399.754,39	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	821.518,34
■ IRF-M	768.671,83	■ IPCA	456.823,07	■ DISP. FINANCEIRA	123,59	■ FIP	0,02

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

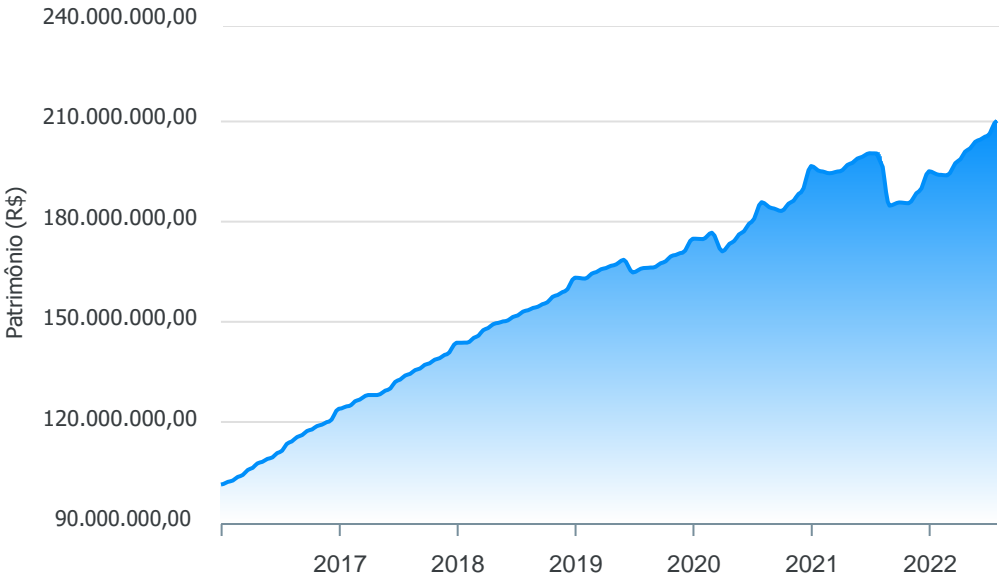
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	195.067.268,70	1.121.788,25	1.515.213,29	194.000.227,77	-673.615,89	-673.615,89	-0,35%	-0,35%	0,95%	0,95%	-36,24%	2,15%
Fevereiro	194.000.227,77	73.162.292,09	71.867.751,65	193.832.676,11	-1.462.092,10	-2.135.707,99	-0,75%	-1,09%	1,39%	2,35%	-46,42%	3,01%
Março	193.832.676,11	5.294.820,41	3.092.550,99	198.126.170,99	2.091.225,46	-44.482,53	1,07%	-0,04%	2,06%	4,46%	-0,81%	2,33%
Abril	198.126.170,99	3.323.638,28	2.025.930,76	201.418.119,98	1.994.241,47	1.949.758,94	1,00%	0,96%	1,44%	5,96%	16,17%	1,92%
Mai	201.418.119,98	5.431.223,51	4.046.963,25	204.303.320,94	1.500.940,70	3.450.699,64	0,74%	1,71%	0,90%	6,91%	24,75%	2,00%
Junho	204.303.320,94	7.183.022,60	5.601.109,66	205.634.492,59	-250.741,29	3.199.958,35	-0,12%	1,59%	1,08%	8,07%	19,66%	2,08%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

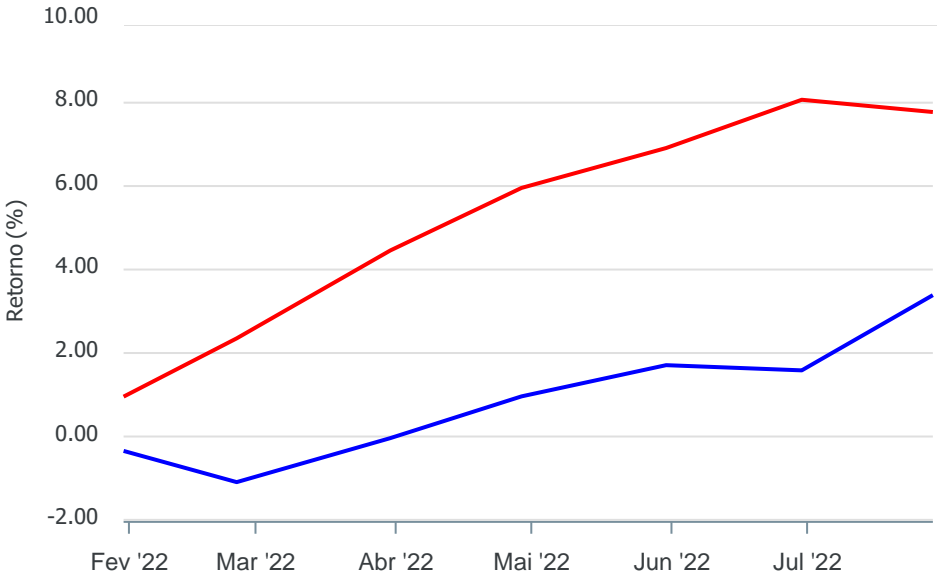


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



ANO 36M

- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.873.529,26	0,00	0,00	18.063.097,88	189.568,62	1,06%	1,06%	0,04%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	12.544.866,82	49.615,88	0,00	12.724.700,31	130.217,61	1,03%	1,04%	0,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.532.602,99	0,00	0,00	12.660.866,81	128.263,82	1,02%	1,02%	0,01%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.761.342,04	0,00	70.000,00	9.788.092,46	96.750,42	0,99%	0,99%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.414.135,92	0,00	0,00	4.454.303,51	40.167,59	0,91%	0,91%	0,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	997.192,96	0,00	0,00	1.001.806,23	4.613,27	0,46%	0,46%	0,81%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	766.035,11	0,00	0,00	768.671,83	2.636,72	0,34%	0,34%	1,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.117.685,55	0,00	0,00	21.188.129,73	70.444,18	0,33%	0,33%	1,23%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	455.343,23	0,00	0,00	456.823,07	1.479,84	0,32%	0,32%	1,37%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	37.927.760,95	0,00	0,00	38.015.151,33	87.390,38	0,23%	0,23%	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	36.395.560,85	0,00	0,00	36.477.209,77	81.648,92	0,22%	0,22%	1,39%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	471.032,96	0,00	0,00	472.075,90	1.042,94	0,22%	0,22%	1,44%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	355.973,29	2.525.406,72	2.641.109,66	243.906,85	3.636,50	0,13%	0,88%	0,01%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	437.398,16	0,00	0,00	437.772,62	374,46	0,09%	0,09%	1,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	5.618.544,54	520.000,00	2.890.000,00	3.238.713,23	-9.831,31	-0,16%	0,04%	2,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	1.200.000,00	0,00	1.194.072,70	-5.927,30	-0,49%	-0,38%	2,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	9.649.368,74	0,00	0,00	9.543.241,08	-106.127,66	-1,10%	-1,10%	3,18%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	10.812.686,81	0,00	0,00	10.597.406,29	-215.280,52	-1,99%	-1,99%	3,85%
Total Renda Fixa	182.131.060,18	4.295.022,60	5.601.109,66	181.326.041,60	501.068,48	0,28%		1,24%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.209.549,38	209.549,38	10,48%	11,52%	10,31%
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	2.088.364,17	0,00	0,00	2.182.945,77	94.581,60	4,53%	0,00%	0,00%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.383.986,19	0,00	0,00	1.399.754,39	15.768,20	1,14%	1,14%	0,25%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,02	0,00	0,00	0,02	0,00	0,00%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.932.609,91	0,00	0,00	3.900.249,85	-32.360,06	-0,82%	-0,82%	1,93%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6.455.300,78	888.000,00	0,00	6.817.116,42	-526.184,36	-7,17%	-7,78%	13,68%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.989.227,59	0,00	0,00	3.569.385,32	-419.842,27	-10,52%	-10,52%	8,01%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	942.808,91	0,00	0,00	821.518,34	-121.290,57	-12,86%	-12,86%	9,54%
Total Renda Variável	18.792.297,57	2.888.000,00	0,00	20.900.519,49	-779.778,08	-3,60%		7,67%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.379.963,19	0,00	0,00	3.407.931,50	27.968,31	0,83%	0,83%	12,50%
Total Exterior	3.379.963,19	0,00	0,00	3.407.931,50	27.968,31	0,83%		12,50%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	35.731.778,65	839.382,00	985.000,00	36.477.209,77	891.049,12	2,44%	2,50%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	36.735.960,71	460.504,00	0,00	38.015.151,33	818.686,62	2,20%	2,22%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	20.640.440,35	0,00	0,00	21.188.129,73	547.689,38	2,65%	2,65%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.542.810,82	0,00	0,00	18.063.097,88	520.287,06	2,97%	2,97%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	11.862.301,92	505.746,88	0,00	12.724.700,31	356.651,51	2,88%	2,94%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.857.045,18	456.131,00	0,00	12.660.866,81	347.690,63	2,82%	2,87%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.378.674,18	1.116.504,00	982.000,00	9.788.092,46	274.914,28	2,62%	2,85%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	10.679.807,48	0,00	226.226,88	10.597.406,29	143.825,69	1,35%	-0,77%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.419.633,56	0,00	78.000,00	4.454.303,51	112.669,95	2,55%	2,58%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	981.968,50	0,00	0,00	1.001.806,23	19.837,73	2,02%	2,02%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	461.135,22	0,00	0,00	472.075,90	10.940,68	2,37%	2,37%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	7.477,50	6.679.733,60	6.450.776,79	243.906,85	7.472,54	0,11%	2,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	9.536.586,17	0,00	0,00	9.543.241,08	6.654,91	0,07%	0,07%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	762.865,00	0,00	0,00	768.671,83	5.806,83	0,76%	0,76%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	436.724,91	0,00	437.772,62	1.047,71	0,24%	2,32%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	458.033,94	0,00	0,00	456.823,07	-1.210,87	-0,26%	-0,26%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	1.200.000,00	0,00	1.194.072,70	-5.927,30	-0,49%	1,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	5.689.477,41	520.000,00	2.952.000,00	3.238.713,23	-18.764,18	-0,30%	-0,11%
Total Renda Fixa	176.745.996,59	12.214.726,39	11.674.003,67	181.326.041,60	4.039.322,29	2,28%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	1.159.581,50	0,00	0,00	2.182.945,77	1.023.364,27	88,25%	0,00%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.209.549,38	209.549,38	10,48%	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	941.617,28	417.579,00	0,00	1.399.754,39	40.558,11	2,98%	3,15%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,02	0,00	0,00	0,02	0,00	0,00%	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.900.989,25	0,00	0,00	3.900.249,85	-739,40	-0,02%	-0,02%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.019.726,99	0,00	0,00	821.518,34	-198.208,65	-19,44%	-19,44%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.990.902,21	0,00	0,00	3.569.385,32	-421.516,89	-10,56%	-10,56%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6.571.604,83	1.305.579,00	0,00	6.817.116,42	-1.060.067,41	-13,46%	-14,98%
Total Renda Variável	17.584.422,08	3.723.158,00	0,00	20.900.519,49	-407.060,59	-1,91%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.795.752,32	0,00	0,00	3.407.931,50	-387.820,82	-10,22%	-10,22%
Total Exterior	3.795.752,32	0,00	0,00	3.407.931,50	-387.820,82	-10,22%	

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	34.262.728,58	999.382,00	985.000,00	36.477.209,77	2.200.099,19	6,24%	6,41%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	35.766.768,31	600.504,00	0,00	38.015.151,33	1.647.879,02	4,53%	4,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	19.892.841,17	0,00	0,00	21.188.129,73	1.295.288,56	6,51%	6,51%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.538.778,96	11.753.497,55	0,00	18.063.097,88	770.821,37	4,46%	5,60%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	12.259.244,43	0,00	12.724.700,31	465.455,88	3,80%	5,69%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	12.209.628,55	0,00	12.660.866,81	451.238,26	3,70%	5,52%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.051.965,97	4.269.470,09	982.000,00	9.788.092,46	448.656,40	4,35%	5,28%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.384.541,95	0,00	1.144.971,72	4.454.303,51	214.733,28	3,99%	4,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	9.360.966,86	0,00	0,00	9.543.241,08	182.274,22	1,95%	1,95%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1.317,41	45.569.382,13	45.465.062,55	243.906,85	138.269,86	0,30%	4,59%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	18.703.612,54	0,00	17.820.783,20	1.001.806,23	118.976,89	0,64%	4,30%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	5.648.334,27	520.000,00	2.952.000,00	3.238.713,23	22.378,96	0,36%	0,62%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	452.454,65	0,00	472.075,90	19.621,25	4,34%	3,51%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	752.505,00	0,00	0,00	768.671,83	16.166,83	2,15%	2,15%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	452.453,00	0,00	456.823,07	4.370,07	0,97%	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	866.157,60	0,00	867.936,82	0,00	1.779,22	0,21%	2,11%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	436.724,91	0,00	437.772,62	1.047,71	0,24%	4,95%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	30.188,34	0,00	30.471,62	0,00	283,28	0,94%	4,85%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	175.522,64	0,00	172.682,35	0,00	-2.840,29	-1,62%	1,85%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	1.200.000,00	0,00	1.194.072,70	-5.927,30	-0,49%	4,25%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.464.624,82	0,00	2.453.667,35	0,00	-10.957,47	-0,44%	4,22%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	13.895.413,34	0,00	226.226,88	10.597.406,29	-3.071.780,17	-22,11%	-23,73%
Total Renda Fixa	158.796.267,76	90.722.741,31	73.100.802,49	181.326.041,60	4.907.835,02	2,78%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	1.237.893,84	0,00	0,00	2.182.945,77	945.051,93	76,34%	0,00%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.209.549,38	209.549,38	10,48%	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.729.144,15	0,00	0,00	3.900.249,85	171.105,70	4,59%	4,59%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.847.964,50	0,00	1.985.392,61	0,00	137.428,11	7,44%	-7,24%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	4.695.177,99	0,00	4.740.774,38	0,00	45.596,39	0,97%	-13,02%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.326.142,26	0,00	1.370.437,34	0,00	44.295,08	3,34%	-4,56%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,00	1.358.464,83	0,00	1.399.754,39	41.289,56	3,04%	6,48%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	2.557.775,46	0,00	2.581.591,96	0,00	23.816,50	0,93%	5,26%
BB ASG BRASIL FIC AÇÕES	728.915,24	0,00	737.795,66	0,00	8.880,42	1,22%	-13,01%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,02	0,00	0,00	0,02	0,00	0,00%	-
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	891.307,55	0,00	0,00	821.518,34	-69.789,21	-7,83%	-7,83%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.703.620,91	0,00	0,00	3.569.385,32	-134.235,59	-3,62%	-3,62%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6.644.883,68	1.435.579,00	0,00	6.817.116,42	-1.263.346,26	-15,63%	-17,57%
Total Renda Variável	27.362.825,60	4.794.043,83	11.415.991,95	20.900.519,49	159.642,01	0,50%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	1.559.187,67	0,00	1.504.597,87	0,00	-54.589,80	-3,50%	-15,61%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	2.626.951,28	0,00	2.128.127,29	0,00	-498.823,99	-18,99%	-32,96%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.722.036,39	0,00	0,00	3.407.931,50	-1.314.104,89	-27,83%	-27,83%
Total Exterior	8.908.175,34	0,00	3.632.725,16	3.407.931,50	-1.867.518,68	-20,96%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.