

# **RELATORIO DE INVESTIMENTOS**

## **JUNHO 2022**

### **2 Trimestre - 1 Semestre**

## **SUMÁRIO**

1. Apresentação .....	3
2. Parecer do Comitê de Investimentos .....	3
3. Aprovação do Conselho de Administração .....	3

  
  
  
  
Página 2 de 3

## APRESENTAÇÃO

Este documento apresenta a posição da carteira de investimentos do São Roque Prev por segmentos e ativos, por tipo de risco, por instituição financeira e por limites da Política de Investimentos, e o acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos.

Tem por objetivo demonstrar os resultados das ações do deliberadas pelo Comitê de Investimentos.

Após cada reunião é elaborado uma ata que fica a disposição dos Conselhos de Administração e Fiscal para acompanhamento e homologação.

## 1. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos do São Roque Prev analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês jun/2022 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do São Roque Prev e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

## 2. APROVAÇÃO DO CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO

O Conselho de Administração, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, HOMOLOGA o relatório de investimentos referente ao mês de junho de 2022, em reunião realizada em 26 de julho de 2022.

Rosana Teixeira de Carvalho



Lisete de Fátima Oliveira



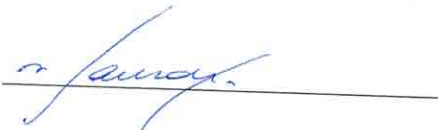
Silvia Cristina de Almas de Alcântara



Solange Siqueira Duarte Silva



Mauracy Moraes de Oliveira





CRÉDITO  
& MERCADO

# Relatório Analítico dos Investimentos

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

**Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			79.996.678,20	20,39%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	39.077.551,07	9,96%	820	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.627.788,00	0,67%	597	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	496.103,57	0,13%	1.068	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	19.533.544,82	4,98%	241	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	35.969.414,56	9,17%	868	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	30.142.737,40	7,68%	1.073	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	675.293,10	0,17%	1.024	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.413.472,02	0,36%	798	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.526.895,96	2,17%	859	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	20.279.633,77	5,17%	974	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	10.184.207,27	2,60%	102	1,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.894.804,71	3,03%	253	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	19.617.241,10	5,00%	134	2,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	13.051.386,83	3,33%	204	0,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.255.587,80	0,32%	262	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	36.265.339,47	9,25%	248	1,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	10.388.098,50	2,65%	282	0,43%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	19.541.953,80	4,98%	743	4,94%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	5.714.700,24	1,46%	44	0,00%	Artigo 8º, Inciso I



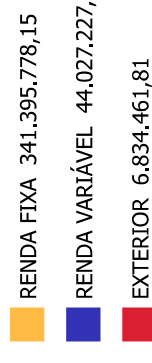
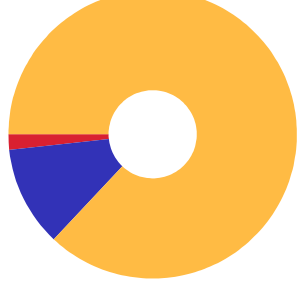
**Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.502.255,81	0,64%	17.281	0,32%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.451.255,84	0,62%	522	0,11%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.880.950,16	0,48%	3.368	1,23%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	510.612,02	0,13%	3.355	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	18.259.961,81	4,66%	9.294	1,96%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		162.731,07	0,04%		0,00%	DF - Artigo 6º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>392.257.467,83</b>				
<b>DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS</b>			<b>162.731,07</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>392.420.198,90</b>				



**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%	79.996.678,20	20,39%	0,00%	25,00%	50,00%	116.132.055,72
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	129.935.904,54	33,13%	12,00%	17,00%	50,00%	66.192.829,38
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	131.463.195,41	33,51%	10,00%	25,00%	60,00%	103.891.285,29
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,00%	20,00%	78.451.493,57
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	19.612.873,39
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>341.395.778,15</b>	<b>87,03%</b>	<b>22,00%</b>	<b>87,00%</b>	<b>185,00%</b>	

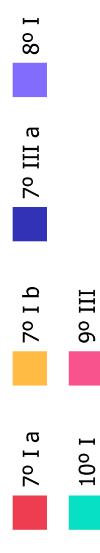




**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2022)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	25.256.654,04	6,44%	4,00%	10,00%	15,00%	33.581.966,13
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	18.770.573,83	4,79%	0,00%	1,00%	5,00%	842.299,56
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>44.027.227,87</b>	<b>11,22%</b>	<b>4,00%</b>	<b>11,00%</b>	<b>20,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.834.461,81	1,74%	0,00%	2,00%	5,00%	12.778.411,58
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>6.834.461,81</b>	<b>1,74%</b>	<b>0,00%</b>	<b>2,00%</b>	<b>5,00%</b>	







**Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2022)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	123.346.962,48	31,45	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	112.585.726,80	28,70	0,01
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLI...	79.996.678,20	20,39	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	36.265.339,47	9,25	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	22.079.011,98	5,63	0,00
ITAÚ UNIBANCO	12.269.048,66	3,13	0,00
ITAÚ DTVM	5.714.700,24	1,46	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'	79.996.678,20	20,39	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	129.935.904,54	33,13	12,00	50,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	121.075.096,91	30,87	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	25.256.654,04	6,44	4,00	15,00
Artigo 9º, Inciso III	6.834.461,81	1,74	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	18.770.573,83	4,79	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	4,85%	2,56%	4,85%	6,92%	8,69%	0,17%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,33%	6,51%	2,65%	6,51%	9,84%	16,18%	1,23%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,32%	6,47%	2,63%	6,47%	9,74%	16,08%	1,26%	0,04%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,41%	4,22%	1,36%	4,22%	3,19%	10,06%	2,09%	0,06%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,36%	4,21%	1,40%	4,21%	3,50%	10,92%	2,06%	0,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	4,22%	1,41%	4,22%	3,48%	10,88%	2,02%	0,06%
<b>CDI (Benchmark)</b>	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08%	5,71%	3,07%	5,71%	9,36%	12,01%	0,02%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,93%	4,87%	2,63%	4,87%	7,48%	8,72%	0,01%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,03%	5,54%	2,90%	5,54%	8,98%	11,54%	0,01%	0,01%



**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
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,04%	5,69%	2,94%	5,69%	9,23%	11,71%	0,03%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,10%	5,89%	3,06%	5,89%	9,64%	12,36%	0,07%	0,01%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,23%	4,59%	2,22%	4,59%	3,73%	6,51%	1,57%	0,03%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,09%	4,95%	2,32%	4,95%	4,93%	7,33%	1,55%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,79%	5,28%	2,57%	5,28%	8,95%	10,68%	0,42%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	7,13%	3,08%	7,13%	10,31%	16,86%	1,37%	0,04%



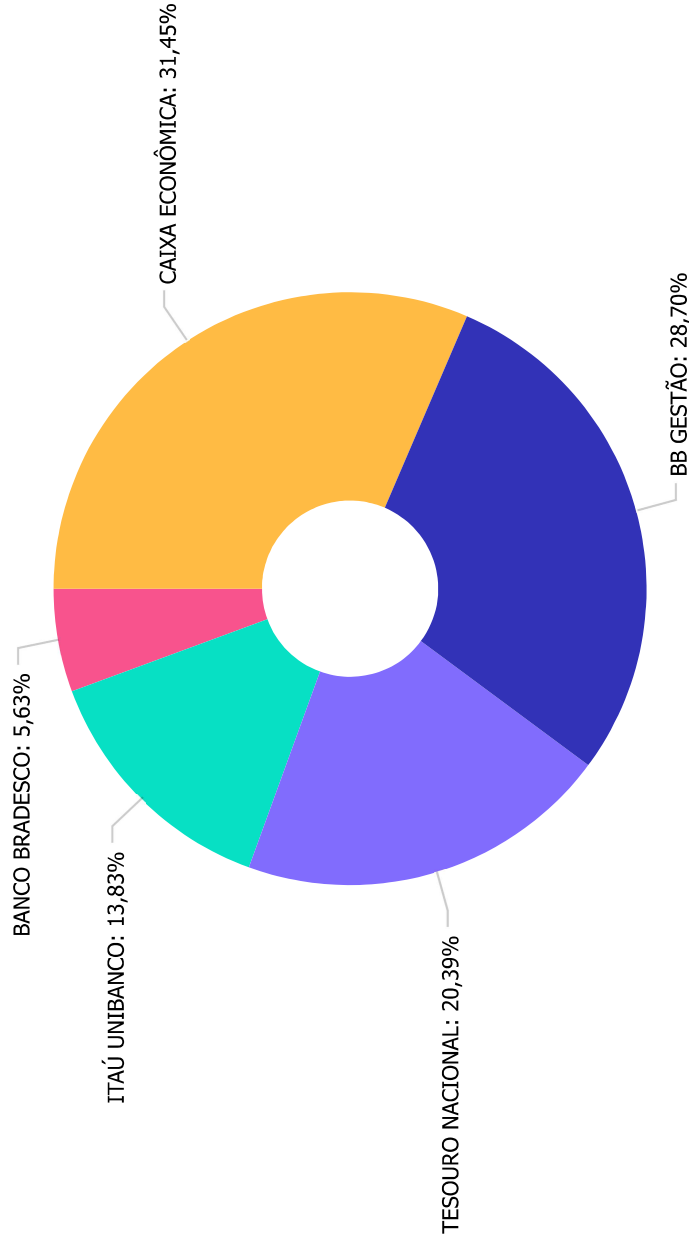
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	1,34%	-27,01%	-8,36%	-27,01%	-10,80%	14,52%	-	-
<b>BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	0,02%	-27,37%	-9,82%	-27,37%	-11,10%	9,17%	11,56%	0,20%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	0,79%	-27,61%	-10,27%	-27,61%	-12,10%	12,50%	-	-
<b>CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	0,83%	-27,83%	-10,22%	-27,83%	-13,08%	9,72%	12,50%	0,20%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-	-
<b>ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES</b>	-10,17%	-5,66%	-16,21%	-5,66%	-25,85%	-3,67%	8,33%	0,20%
<b>BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES</b>	-11,05%	-5,03%	-15,73%	-5,03%	-22,86%	2,62%	9,03%	0,20%
<b>CDI (Benchmark)</b>	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
<b>CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP</b>	1,14%	6,48%	3,15%	6,48%	9,77%	11,75%	0,25%	0,01%
<b>CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP</b>	-2,31%	3,37%	-2,88%	3,37%	0,22%	8,47%	2,56%	0,06%

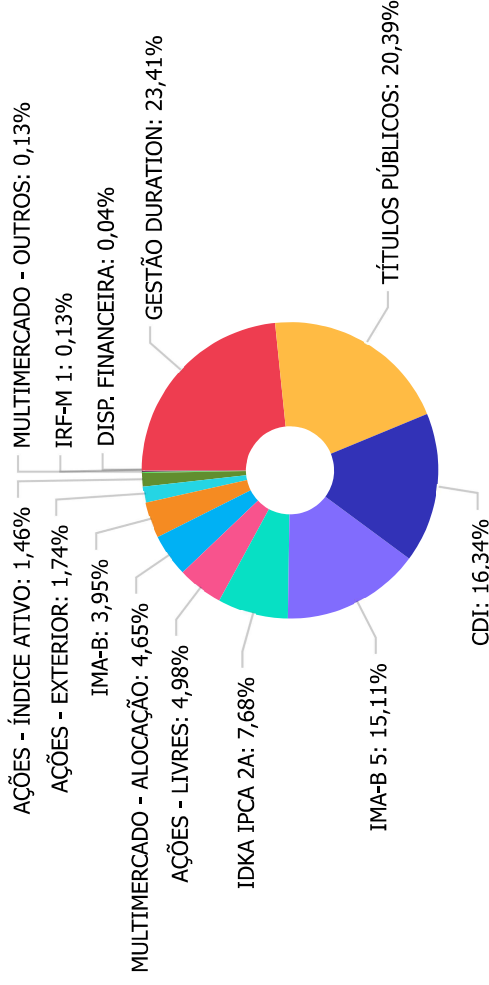


**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	1,34%	-27,01%	-8,36%	-27,01%	-10,80%	14,52%	-	-
<b>BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	0,02%	-27,37%	-9,82%	-27,37%	-11,10%	9,17%	11,56%	0,20%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	0,79%	-27,61%	-10,27%	-27,61%	-12,10%	12,50%	-	-
<b>CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	0,83%	-27,83%	-10,22%	-27,83%	-13,08%	9,72%	12,50%	0,20%
<b>ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	0,09%	-17,54%	-4,60%	-17,54%	-1,35%	21,99%	10,72%	0,16%



CAIXA ECONÔMICA	123.346.962,48
BB GESTÃO	112.585.726,80
TESOURO NACIONAL	79.996.678,20
ITAÚ UNIBANCO	54.249.088,37
BANCO BRADESCO	22.079.011,98



■ GESTÃO DURATION	91.851.995,13	■ TÍTULOS PÚBLICOS	79.996.678,20	■ CDI	64.140.819,77	■ IM-A-B 5	59.286.388,99
■ IDKA IPCA 2A	30.142.737,40	■ AÇÕES - LIVRES	19.541.953,80	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	18.259.961,81	■ IM-A-B	15.481.055,09
■ AÇÕES - EXTERIOR	6.834.461,81	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.714.700,24	■ MULTIMERCADO - OUTROS	510.612,02	■ IRF-M 1	496.103,57
■ DISP. FINANCEIRA	162.731,07						



**Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2022)**

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	30/06/2022	19.713	4058,06717400	4058,06717400	79.996.678,20	79.996.678,20	Curva

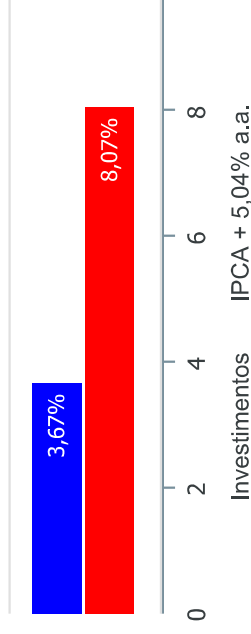




Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	376.717.647,44	10.356.964,81	11.768.751,83	379.574.284,25	4.268.423,83	4.268.423,83	1,13%	1,13%	0,95%	0,95%	118,92%	2,69%
Fevereiro	379.574.284,25	2.182.941,52	2.015.508,23	382.172.076,40	2.430.358,86	6.698.782,69	0,64%	1,78%	1,39%	2,35%	75,72%	2,11%
Março	382.172.076,40	3.579.604,77	1.763.527,83	393.494.117,69	9.505.964,35	16.204.747,04	2,48%	4,30%	2,06%	4,46%	96,48%	3,06%
Abril	393.494.117,69	4.280.705,01	964.179,46	392.627.311,29	-4.183.331,95	12.021.415,09	-1,05%	3,20%	1,44%	5,96%	53,73%	2,44%
Mai	392.627.311,29	86.263.391,03	110.415.112,13	372.968.820,27	4.493.230,08	16.514.645,17	1,14%	4,38%	0,90%	6,91%	63,39%	2,39%
Junho	372.968.820,27	245.721.598,23	223.724.601,75	392.257.467,83	-2.708.348,92	13.806.296,25	-0,69%	3,67%	1,08%	8,07%	45,42%	1,94%

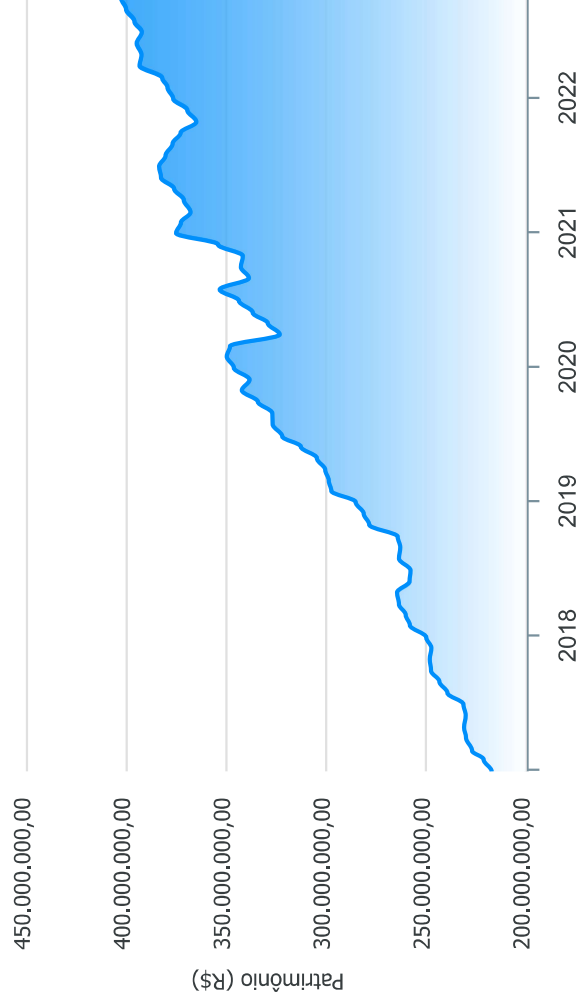
Investimentos x Meta de Rentabilidade



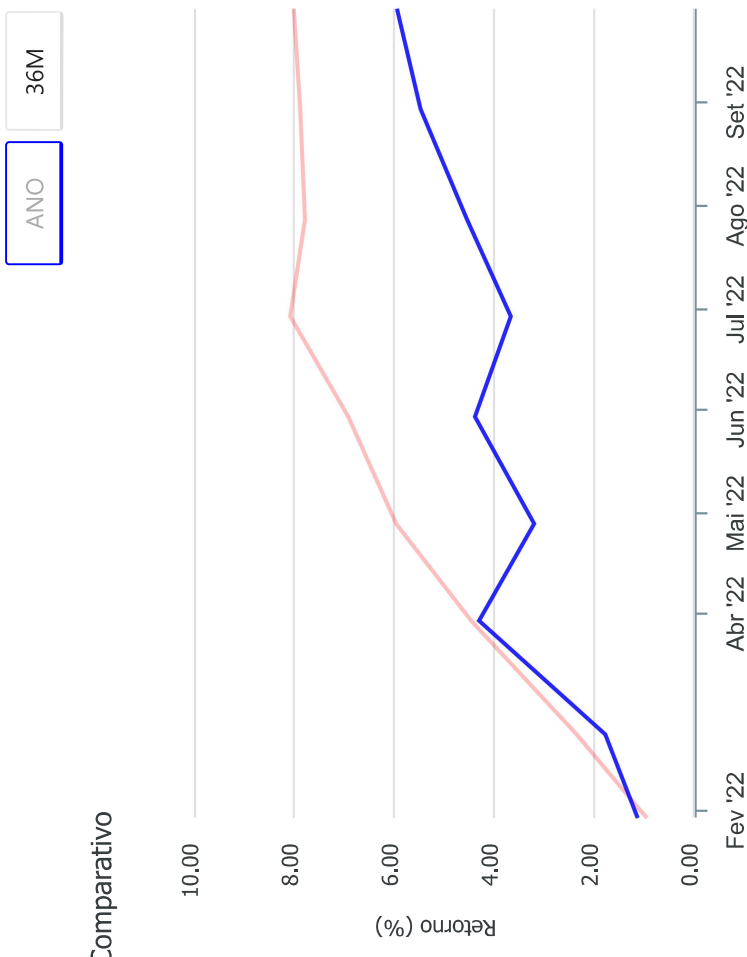


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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



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
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	11.773.824,71	0,00	11.894.804,71	120.980,00	1,03%	1,08%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	7.682.322,92	803.222,15	35.915,62	8.526.895,96	77.266,51	0,91%	0,93%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	19.339.637,84	0,00	19.000.000,00	496.103,57	156.465,73	0,81%	0,92%	0,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	35.982.771,68	0,00	0,00	36.265.339,47	282.567,79	0,79%	0,79%	0,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	10.326.860,09	0,00	10.388.098,50	61.238,41	0,59%	1,10%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	19.469.777,58	0,00	0,00	19.533.544,82	63.767,24	0,33%	0,33%	1,37%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	40.951.797,03	0,00	2.000.000,00	39.077.551,07	125.754,04	0,31%	0,32%	1,26%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	35.886.726,97	0,00	0,00	35.969.414,56	82.687,59	0,23%	0,23%	1,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	33.603.640,16	0,00	33.000.000,00	675.293,10	71.652,94	0,21%	0,33%	1,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	22.000.000,00	1.756.218,42	20.279.633,77	35.852,19	0,16%	1,03%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	54.880.439,96	15.161.162,10	40.000.000,01	30.142.737,40	101.135,35	0,14%	0,22%	1,39%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	19.600.460,94	0,00	0,00	19.617.241,10	16.780,16	0,09%	0,09%	1,55%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	92.999.963,51	79.996.678,20	13.051.386,83	48.101,52	0,05%	1,04%	0,03%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	79.996.678,20	0,00	79.996.678,20	0,00	0,00%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	10.212.120,16	0,00	10.184.207,27	-27.912,89	-0,27%	-0,41%	2,09%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.637.089,93	0,00	0,00	2.627.788,00	-9.301,93	-0,35%	-0,35%	2,02%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.260.086,58	0,00	0,00	1.255.587,80	-4.498,78	-0,36%	-0,36%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.418.840,91	0,00	0,00	1.413.472,02	-5.368,89	-0,38%	-0,38%	2,05%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>272.713.592,50</b>	<b>243.273.830,92</b>	<b>175.788.812,25</b>	<b>341.395.778,15</b>	<b>1.197.166,98</b>	<b>0,35%</b>		<b>0,97%</b>



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 (%)	(%) Insttit	Var - Mês
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	20.284.393,09	0,00	20.000.000,00	510.612,02	226.218,93	1,12%	1,14%	0,25%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	15.204.009,43	0,00	15.161.162,10	0,00	-42.847,33	-0,28%	-10,81%	8,22%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	18.626.111,62	0,00	0,00	18.259.961,81	-366.149,81	-1,97%	-2,31%	2,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10.996.924,53	0,00	10.326.860,09	0,00	-670.064,44	-6,09%	-10,46%	8,99%
ITAÚ FOF RPI IBOVESA ATIVO FIC AÇÕES	6.361.446,94	0,00	0,00	5.714.700,24	-646.746,70	-10,17%	-10,17%	8,33%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	21.970.214,25	0,00	0,00	19.541.953,80	-2.428.260,45	-11,05%	-11,05%	9,03%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>93.443.099,86</b>	<b>0,00</b>	<b>45.488.022,19</b>	<b>44.027.227,87</b>	<b>-3.927.849,80</b>	<b>-4,20%</b>		<b>6,16%</b>



**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 FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.431.138,81	2.447.767,31	2.447.767,31	2.451.255,84	20.117,03	0,41%	0,83%	12,50%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.879.191,23	0,00	0,00	1.880.950,16	1.758,93	0,09%	0,09%	10,72%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.501.797,87	0,00	0,00	2.502.255,81	457,94	0,02%	0,02%	11,56%
<b>Total Exterior</b>	<b>6.812.127,91</b>	<b>2.447.767,31</b>	<b>2.447.767,31</b>	<b>6.834.461,81</b>	<b>22.333,90</b>	<b>0,24%</b>		<b>11,66%</b>

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2022****FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	40.027.510,34	0,00	2.000.000,00	39.077.551,07	1.050.040,73	2,62%	2,63%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	32.844.221,07	0,00	33.000.000,00	675.293,10	831.072,03	2,53%	2,65%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	35.187.986,25	0,00	0,00	35.969.414,56	781.428,31	2,22%	2,22%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA...	25.523.263,26	10.000.000,00	0,00	36.265.339,47	742.076,21	2,09%	2,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	10.386.847,03	59.161.162,10	40.000.000,01	30.142.737,40	594.728,28	0,86%	2,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	19.029.886,45	0,00	19.000.000,00	496.103,57	466.217,12	2,45%	2,56%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	19.173.182,31	0,00	0,00	19.617.241,10	444.058,79	2,32%	2,32%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	21.776.888,84	560.925,27	20.000.000,00	2.627.788,00	289.973,89	1,30%	1,41%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	23.438.299,00	11.773.824,71	11.894.804,71	230.330,42	0,98%	3,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	6.387.846,60	5.121.918,63	3.203.862,78	8.526.895,96	220.993,51	1,92%	2,63%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	30.045.781,51	0,00	29.000.000,00	1.255.587,80	209.806,29	0,70%	1,40%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	11.511.397,59	0,00	11.664.474,29	0,00	153.076,70	1,33%	1,35%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	16.284.771,96	0,00	15.000.000,00	1.413.472,02	128.700,06	0,79%	1,39%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	10.085.658,97	10.212.120,16	10.212.120,16	10.184.207,27	98.548,30	0,49%	1,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	20.000.000,00	560.925,27	19.533.544,82	94.470,09	0,47%	3,08%
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	10.326.860,09	0,00	10.388.098,50	61.238,41	0,59%	3,06%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	92.999.963,51	79.996.678,20	13.051.386,83	48.101,52	0,05%	2,94%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	22.000.000,00	1.756.218,42	20.279.633,77	35.852,19	0,16%	2,90%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	79.996.678,20	0,00	79.996.678,20	0,00	0,00%	-



**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
Total Renda Fixa	278.265.242,18	333.817.926,96	277.168.103,84	341.395.778,15	6.480.712,85	1,94%	



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
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	19.888.930,21	0,00	20.000.000,00	510.612,02	621.681,81	3,13%	3,15%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	18.734.079,01	0,00	0,00	18.259.961,81	-474.117,20	-2,53%	-2,87%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	16.220.796,27	0,00	15.161.162,10	0,00	-1.059.634,17	-6,53%	-16,40%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	17.468.611,15	0,00	10.000.000,00	5.714.700,24	-1.753.910,91	-10,04%	-16,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	12.249.644,18	0,00	10.326.860,09	0,00	-1.922.784,09	-15,70%	-19,62%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	23.190.372,43	0,00	0,00	19.541.953,80	-3.648.418,63	-15,73%	-15,73%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>107.752.433,25</b>	<b>0,00</b>	<b>55.488.022,19</b>	<b>44.027.227,87</b>	<b>-8.237.183,19</b>	<b>-7,64%</b>	





**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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.971.642,66	0,00	0,00	1.880.950,16	-90.692,50	-4,60%	-4,60%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.774.592,12	0,00	0,00	2.502.255,81	-272.336,31	-9,82%	-9,82%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.730.207,48	2.447.767,31	2.447.767,31	2.451.255,84	-278.951,64	-5,39%	-10,22%
<b>Total Exterior</b>	<b>7.476.442,26</b>	<b>2.447.767,31</b>	<b>2.447.767,31</b>	<b>6.834.461,81</b>	<b>-641.980,45</b>	<b>-6,47%</b>	



**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 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	38.584.501,46	0,00	2.000.000,00	39.077.551,07	2.493.049,61	6,46%	6,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	31.654.599,46	0,00	33.000.000,00	675.293,10	2.020.693,64	6,38%	6,51%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	44.360.024,71	0,00	10.000.000,00	35.969.414,56	1.609.389,85	3,63%	4,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA...	24.867.765,58	10.000.000,00	0,00	36.265.339,47	1.397.573,89	4,01%	5,28%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	29.235.473,76	0,00	29.000.000,00	1.255.587,80	1.020.114,04	3,49%	4,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	69.161.162,10	40.000.000,01	30.142.737,40	981.575,31	1,42%	6,41%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	18.692.461,02	0,00	0,00	19.617.241,10	924.780,08	4,95%	4,95%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	18.613.923,23	0,00	19.000.000,00	496.103,57	882.180,34	4,74%	4,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	21.191.116,19	560.925,27	20.000.000,00	2.627.788,00	875.746,54	4,03%	4,22%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	15.837.848,60	0,00	15.000.000,00	1.413.472,02	575.623,42	3,63%	4,25%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	11.200.738,14	0,00	11.664.474,29	0,00	463.736,15	4,14%	4,16%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	9.809.541,60	10.212.120,16	10.212.120,16	10.184.207,27	374.665,67	1,87%	4,22%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	5.686.679,40	11.241.429,73	8.751.650,67	8.526.895,96	350.437,50	2,07%	4,87%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	23.438.299,00	11.773.824,71	11.894.804,71	230.330,42	0,98%	5,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	20.000.000,00	560.925,27	19.533.544,82	94.470,09	0,47%	7,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	10.326.860,09	0,00	10.388.098,50	61.238,41	0,59%	5,89%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	92.999.963,51	79.996.678,20	13.051.386,83	48.101,52	0,05%	5,69%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	22.000.000,00	1.756.218,42	20.279.633,77	35.852,19	0,16%	5,54%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	79.996.678,20	0,00	79.996.678,20	0,00	0,00%	-
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>269.734.673,15</b>	<b>349.937.438,06</b>	<b>292.715.891,73</b>	<b>341.395.778,15</b>	<b>14.439.558,67</b>	<b>4,42%</b>	



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	13.871.260,04	0,00	15.161.162,10	0,00	1.289.902,06	9,30%	-2,24%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	19.267.759,40	0,00	20.000.000,00	510.612,02	1.242.852,62	6,45%	6,48%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	17.602.673,28	0,00	0,00	18.259.961,81	657.288,53	3,73%	3,37%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	15.515.214,23	0,00	10.000.000,00	5.714.700,24	199.486,01	1,29%	-5,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	11.027.239,75	0,00	10.326.860,09	0,00	-700.379,66	-6,35%	-10,71%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	20.576.212,61	0,00	0,00	19.541.953,80	-1.034.258,81	-5,03%	-5,03%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>97.860.359,31</b>	<b>0,00</b>	<b>55.488.022,19</b>	<b>44.027.227,87</b>	<b>1.654.890,75</b>	<b>1,69%</b>	



**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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.280.935,32	0,00	0,00	1.880.950,16	-399.985,16	-17,54%	-17,54%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.445.214,89	0,00	0,00	2.502.255,81	-942.959,08	-27,37%	-27,37%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	3.396.464,77	2.447.767,31	2.447.767,31	2.451.255,84	-945.208,93	-16,17%	-27,83%
<b>Total Exterior</b>	<b>9.122.614,98</b>	<b>2.447.767,31</b>	<b>2.447.767,31</b>	<b>6.834.461,81</b>	<b>-2.288.153,17</b>	<b>-19,78%</b>	



#### 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.