

2022

Relatório

Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2022

Junho

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
TÍTULOS PÚBLICOS	10.162.885,82	14,88%	0,00		7º I a
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	311.059,36	0,46%	5.700.982.768,47	0,01%	7º I b
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1.346.487,71	1,97%	220.169.097,26	0,61%	7º I b
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	541.919,39	0,79%	3.451.516.253,51	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.393.795,14	7,90%	6.957.180.815,09	0,08%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.636.917,79	3,86%	11.226.926.091,22	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.097.934,55	4,54%	11.084.704.335,99	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.218.948,30	3,25%	4.111.516.095,57	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.009.911,80	1,48%	5.096.804.349,76	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.443,84	0,04%	17.877.663.669,31	0,00%	7º I b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	440.907,38	0,65%	3.751.851.953,61	0,01%	7º III a
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.093.623,08	8,92%	857.365.563,33	0,71%	7º III a
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.796.883,13	2,63%	7.806.519.166,89	0,02%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2.625.078,22	3,84%	119.766.972,71	2,19%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	3.620.724,05	5,30%	343.307.035,91	1,05%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.120.941,62	1,64%	2.202.359.178,53	0,05%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.576.144,53	3,77%	2.668.371.249,57	0,10%	7º III a
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	586.857,14	0,86%	395.626.158,27	0,15%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.348,90	0,02%	2.150.628.295,54	0,00%	7º III a
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.354.828,49	1,98%	849.686.726,55	0,16%	8º I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	1.868.965,68	2,74%	270.424.593,88	0,69%	8º I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.593.433,08	2,33%	424.182.243,03	0,38%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	767.129,84	1,12%	1.325.121.841,07	0,06%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.828.935,16	4,14%	643.233.782,30	0,44%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.716.358,21	2,51%	228.591.211,08	0,75%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.069.253,24	1,57%	1.134.872.520,13	0,09%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.366.690,98	2,00%	2.383.481.665,49	0,06%	8º I

Investimentos

\$ 68.278.597,03

Disponibilidades Financeiras

\$ 71.298,63

Total Carteira

\$ 68.349.895,66

Governança (Pró Gestão)

⚖️ Não possui

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	659.412,80	0,97%	182.938.350,53	0,36%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	350.071,10	0,51%	537.669.914,17	0,07%	8º I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	173.809,53	0,25%	186.106.545,82	0,09%	8º I
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	967.754,26	1,42%	72.016.891,81	1,34%	9º II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	595.009,20	0,87%	568.267.517,75	0,10%	9º II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	1.006.139,77	1,47%	269.329.951,07	0,37%	9º II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.335.739,25	1,96%	2.225.410.384,30	0,06%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.198.943,77	1,76%	153.024.938,69	0,78%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	446.087,00	0,65%	2.466.344.523,92	0,02%	10º I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.358.223,92	4,92%	2.072.988.175,00	0,16%	10º I

Investimentos

\$ 68.278.597,03

Disponibilidades Financeiras

\$ 71.298,63

Total Carteira

\$ 68.349.895,66

Governança (Pró Gestão)

Não possui

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	10/12/2021	Curva - Taxa: 5,0200%	29	4.329,892846	125.566,89
NTN-B - 15/05/2035	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,6800%	20	4.514,220009	90.284,40
NTN-B - 15/08/2040	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7500%	49	4.668,169399	228.740,30
NTN-B - 15/05/2045	26/03/2020	Curva - Taxa: 4,5500%	146	4.823,166985	704.182,38
NTN-B - 15/05/2045	09/09/2021	Curva - Taxa: 4,8600%	351	4.634,041234	1.626.548,47
NTN-B - 15/05/2045	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	72	4.693,868150	337.958,51
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2019	Curva - Taxa: 4,4000%	122	5.086,120849	620.506,74
NTN-B - 15/08/2050	31/03/2020	Curva - Taxa: 4,4600%	71	5.042,000940	357.982,07
NTN-B - 15/08/2050	02/04/2020	Curva - Taxa: 4,5900%	146	4.948,356731	722.460,08
NTN-B - 15/08/2050	06/04/2020	Curva - Taxa: 4,6800%	123	4.885,046454	600.860,71
NTN-B - 15/08/2050	08/04/2020	Curva - Taxa: 4,6300%	122	4.920,067379	600.248,22
NTN-B - 15/08/2050	09/04/2020	Curva - Taxa: 4,7300%	124	4.850,400169	601.449,62
NTN-B - 15/08/2050	15/05/2020	Curva - Taxa: 4,6400%	147	4.913,032904	722.215,84
NTN-B - 15/08/2050	23/11/2020	Curva - Taxa: 4,3400%	3	5.130,814676	15.392,44
NTN-B - 15/08/2050	10/03/2021	Curva - Taxa: 4,1500%	19	5.276,270884	100.249,15
NTN-B - 15/08/2050	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7800%	69	4.816,124539	332.312,59
NTN-B - 15/05/2055	01/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	359	4.827,391656	1.733.033,60
NTN-B - 15/05/2055	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,8000%	134	4.797,715338	642.893,86

Investimentos

\$ 68.278.597,03

Disponibilidades Financeiras

\$ 71.298,63

Total Carteira

\$ 68.349.895,66

Governança (Pró Gestão)

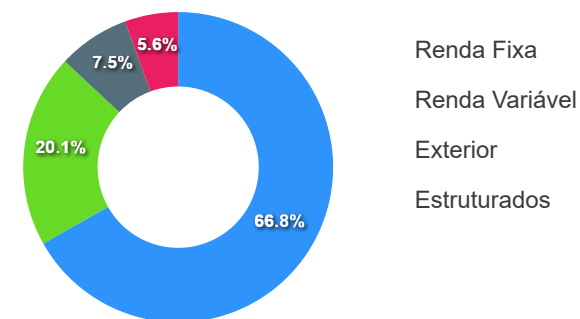
Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	14,87%	10.162.885,82 85,13%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	24,27%	16.587.417,88 75,73%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	27,61%	18.871.508,05 32,39%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	20,12%	13.748.888,11 9,88%
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,76%	2.568.903,23 6,24%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,71%	2.534.683,02 6,29%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	5,57%	3.804.310,92 4,43%

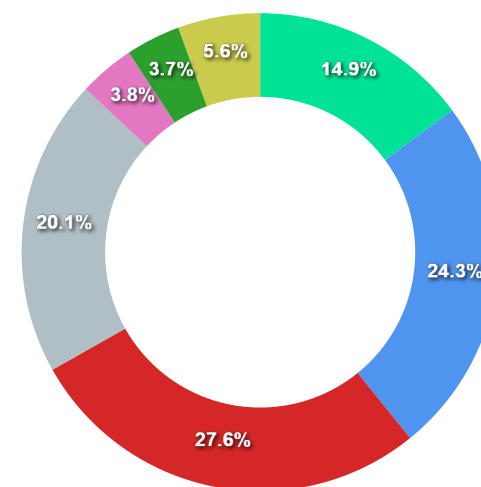
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos



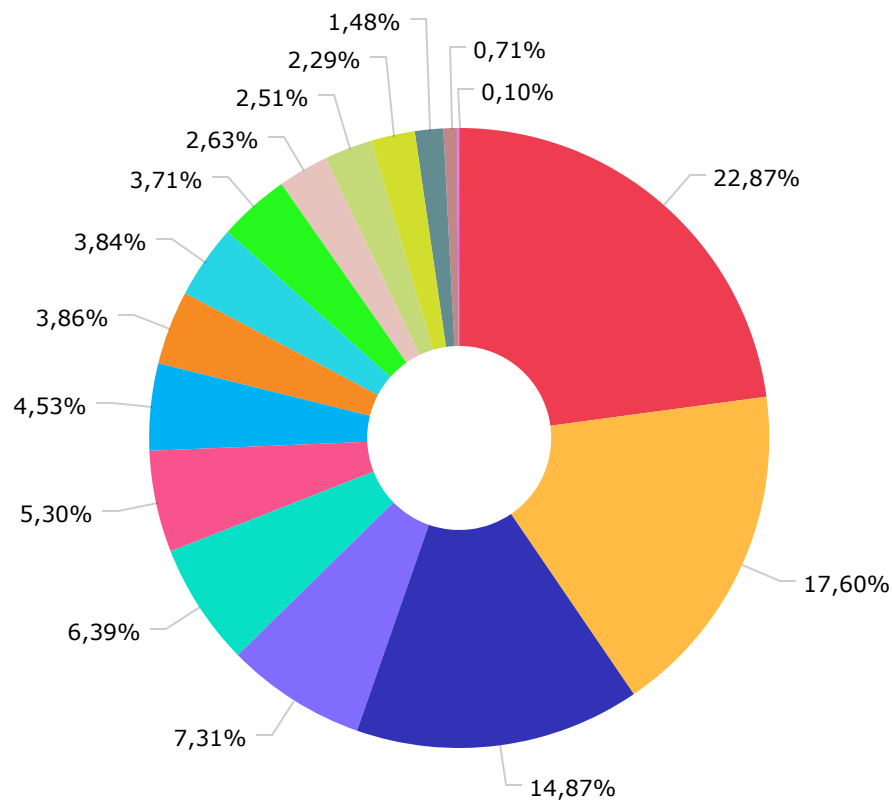
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	14,87%	0,00%	15,00%	100,00%	58.187.009,84
7º I b - FI 100% Títulos TN	24,27%	0,00%	50,00%	100,00%	51.762.477,78
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.417.494,78
7º III a - FI Referenciados RF	27,61%	0,00%	11,00%	60,00%	22.138.429,35
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	41.009.937,40
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	13.669.979,13
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.417.494,78
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.417.494,78
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.417.494,78

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	20,12%	0,00%	7,00%	30,00%	6.756.080,59
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	20.504.968,70
9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	6.834.989,57
9º II - Constituídos no Brasil	3,76%	0,00%	1,00%	10,00%	4.266.086,34
9º III - Ações - BDR Nível I	3,71%	0,00%	4,00%	10,00%	4.300.306,55
10º I - Fundos Multimercados	5,57%	0,00%	5,00%	10,00%	3.030.678,65
10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.417.494,78
10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.417.494,78
11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.417.494,78
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.417.494,78

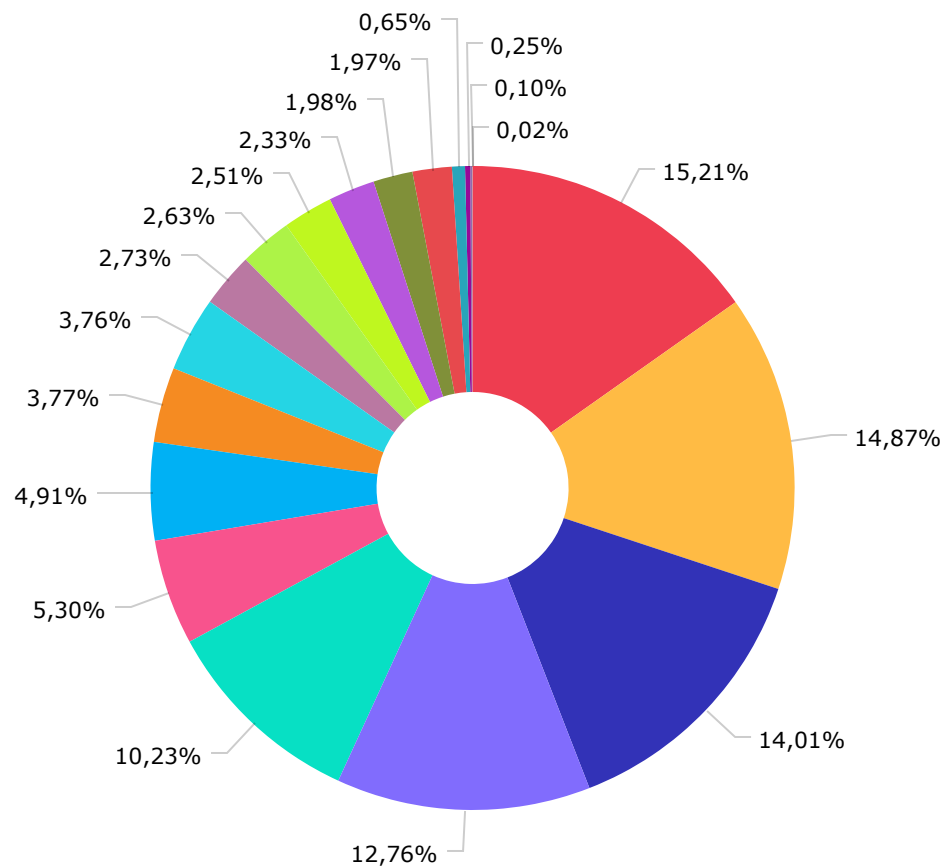
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12		
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,06	5,69	3,02	5,69	9,34	12,30	0,02	0,04
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02	5,52	2,87	5,52	8,84	10,78	0,01	0,03
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,80	4,02	-0,05	4,02	2,32	10,36	1,52	3,21
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	0,79	-27,61	-10,27	-27,61	-12,10	12,50		
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,09	-17,54	-4,60	-17,54	-1,35	21,99	10,72	22,59
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,83	-27,83	-10,22	-27,83	-13,08	9,72	12,50	26,32
IBOVESPA - BENCHMARK	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67		
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-10,77	-2,44	-11,90	-2,44	-17,59	6,05	7,26	15,29
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	-11,51	-6,05	-17,88	-6,05	-22,41	3,16	8,90	18,74
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-11,79	-6,80	-18,32	-6,80	-24,50	2,17	9,10	19,16
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-11,11	-8,68	-13,57	-8,68	-25,55	2,22	8,32	17,52
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-11,17	-5,01	-15,12	-5,01	-25,98	-0,10	8,29	17,46
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-10,49	-8,08	-16,17	-8,08	-27,94	-7,88	7,94	16,71
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-10,46	-10,71	-19,62	-10,71	-32,68	-18,43	8,99	18,92
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	-10,27	-10,39	-19,12	-10,39	-33,09	-13,44	8,35	17,59
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-10,78	-12,17	-16,55	-12,17	-33,74	-18,10	8,72	18,37
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-10,74	-13,21	-21,02	-13,21	-43,33	-30,33	9,08	19,13
IDIV - BENCHMARK	-8,38	4,58	-9,43	4,58	-4,10	18,72		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-8,31	4,05	-9,45	4,05	-7,36	11,21	7,00	14,75
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	2,93

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA GERAL - BENCHMARK	0,43	4,49	1,90	4,49	5,34	9,08		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	0,35	4,35	1,78	4,35	4,48	8,37	1,12	2,36
IMA-B - BENCHMARK	-0,36	4,35	1,43	4,35	3,78	11,48		
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,35	4,37	1,43	4,37	4,05	10,59	1,80	3,78
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
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,33	6,61	2,69	6,61	10,06	16,74		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,33	6,51	2,65	6,51	9,84	16,18	1,23	2,59
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-1,10	2,03	0,12	2,03	-2,16	6,18		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,12	1,87	0,02	1,87	-2,86	5,18	3,21	6,76
IPCA - BENCHMARK	0,67	5,49	2,22	5,49	11,89	21,23		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,79	5,28	2,57	5,28	8,95	10,68	0,42	0,89
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,72	4,32	2,32	4,32	6,83	8,46	0,52	1,10
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46	4,30	2,02	4,30	5,27	8,66	0,81	1,71
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
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,32		-0,26				1,37	2,89
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	0,35
SELIC - BENCHMARK	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12		

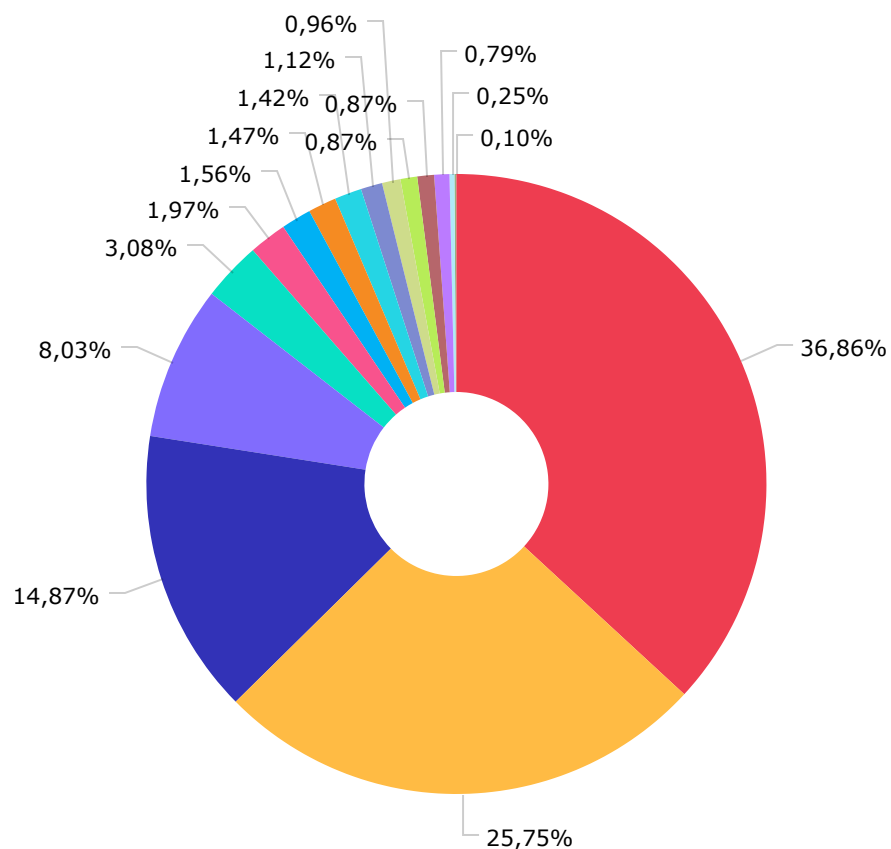
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,00	5,23	2,75	5,23	8,48	10,53	0,01	0,02
MSCI WORLD - BENCHMARK	1,05	-26,05	-7,80	-26,05	-11,63	10,62		
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1,93	-22,79	-5,64	-22,79	-7,85	8,86	8,66	18,23
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-2,83	-47,08	-22,26	-47,08	-44,47	-28,51	20,13	42,39
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	28,82
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	0,33	-27,32	-8,82	-27,32	-14,58		10,12	21,30



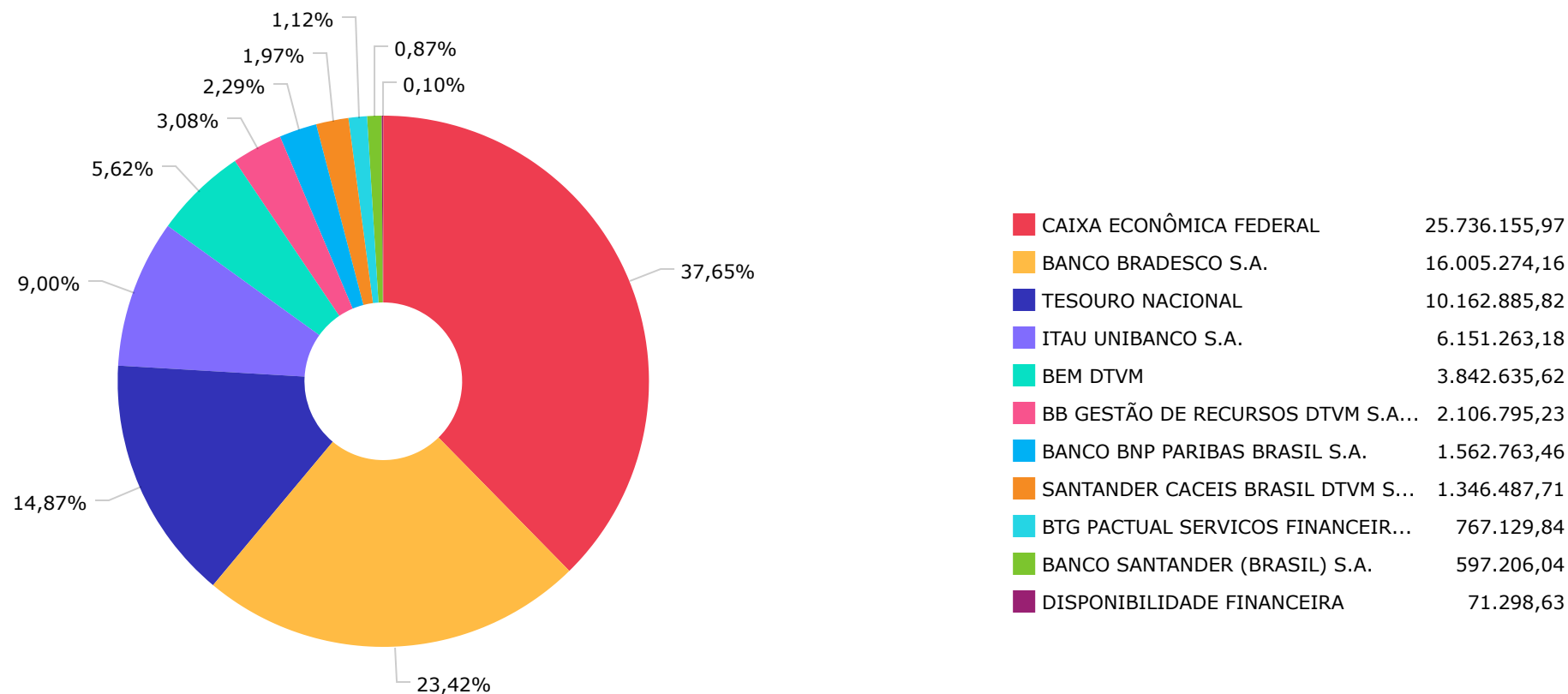
IPCA	15.633.246,66
Ibovespa	12.032.529,90
Títulos Públicos	10.162.885,82
IMA-B	4.997.436,99
MSCI ACWI	4.364.363,69
IMA Geral	3.620.724,05
IMA-B 5	3.097.934,55
IDKA IPCA 2 Anos	2.636.917,79
IMA-B 5+	2.625.078,22
Global BDRX	2.534.683,02
Selic	1.796.883,13
IDIV	1.716.358,21
MSCI WORLD	1.562.763,46
IRF-M 1	1.009.911,80
CDI	486.879,74
Disponibilidades Financeiras	71.298,63



Renda Fixa Indexados	10.395.713,42
Títulos Públicos	10.162.885,82
Ações Livre	9.576.176,14
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	8.718.701,30
Renda Fixa Duração Livre Soberano	6.993.922,89
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	3.620.724,05
Multimercados Livre	3.358.223,92
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	2.576.144,53
Ações Investimento no Exterior	2.568.903,23
Ações Indexados	1.868.965,68
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	1.796.883,13
Ações Dividendos	1.716.358,21
Ações Índice Ativo	1.593.433,08
Ações Sustentabilidade/Governança	1.354.828,49
Renda Fixa Duração Alta Soberano	1.346.487,71
Multimercados Macro	446.087,00
Ações Valor/Crescimento	173.809,53
Disponibilidades Financeiras	71.298,63
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	10.348,90



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.194.236,58
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN...	17.598.707,24
TESOURO NACIONAL	10.162.885,82
ITAU UNIBANCO S.A.	5.491.850,38
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	2.106.795,23
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	1.346.487,71
CONSTANCIA INVESTIMENTOS LTDA.	1.069.253,24
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.006.139,77
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT B...	967.754,26
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	767.129,84
ITAÚ DTVM S.A.	659.412,80
SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...	597.206,04
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT...	595.009,20
CAIXA DTVM	541.919,39
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	173.809,53
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	71.298,63

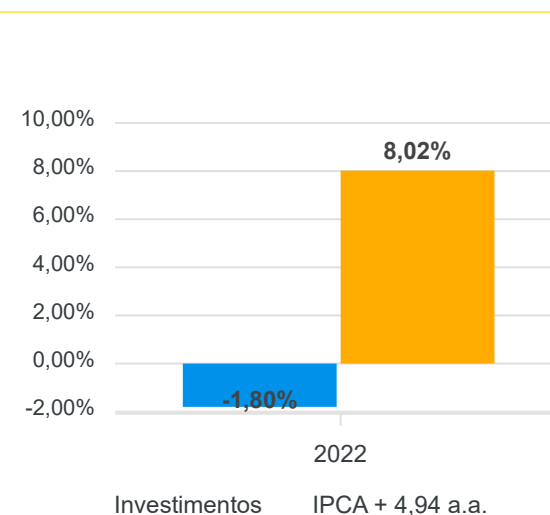


Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	66.118.674,40	90.761,29	461.700,00	65.892.097,87	144.362,18	144.362,18	0,22% ▲	0,22%	0,94%	0,94%	23,40%	3,98%
Fevereiro	65.892.097,87	551.931,79	0,00	66.253.446,38	-190.583,28	-46.221,10	-0,29% ▼	-0,07%	1,38%	2,34%	-2,99%	3,38%
Março	66.253.446,38	7.609.551,74	6.504.000,00	68.710.913,19	1.351.915,07	1.305.693,97	2,01% ▲	1,94%	2,05%	4,43%	43,79%	4,50%
Abril	68.710.913,19	1.030.658,62	361.000,00	67.922.705,36	-1.457.866,45	-152.172,48	-2,10% ▼	-0,21%	1,43%	5,92%	-3,55%	2,97%
Maio	67.922.705,36	1.181.885,38	602.126,32	69.098.265,46	595.801,04	443.628,56	0,87% ▲	0,66%	0,89%	6,87%	9,61%	4,30%
Junho	69.098.265,46	2.537.512,41	1.646.389,74	68.278.597,03	-1.710.791,10	-1.267.162,54	-2,44% ▼	-1,80%	1,08%	8,02%	-22,44%	3,91%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	1.305.693,97	1,94%	4,43%
2º Trim	-2.572.856,51	-3,66%	3,44%
1º Sem	-1.267.162,54	-1,80%	8,02%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado



Gráficos

Gráfico Risco x Retorno

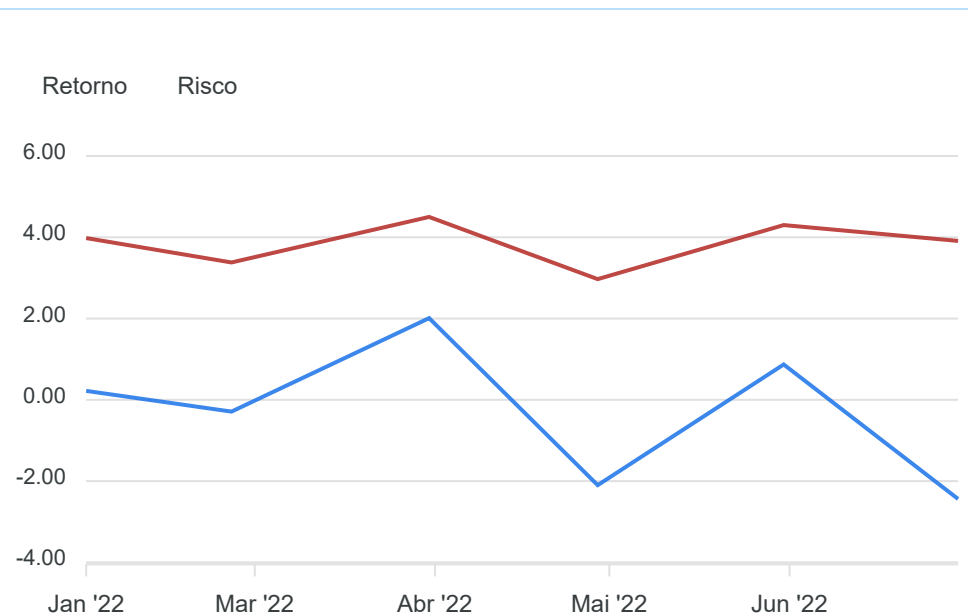
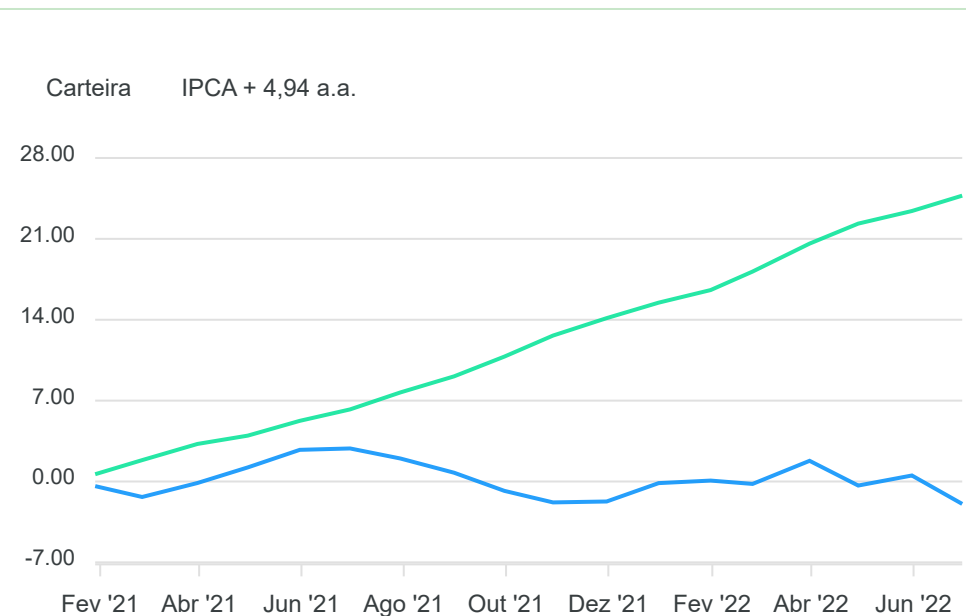


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	10.071.497,70	0,00	0,00	10.162.885,82	91.388,12	0,91% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	438.877,02	0,00	0,00	440.907,38	2.030,36	0,46% ▲	0,81%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	312.160,46	0,00	0,00	311.059,36	-1.101,10	-0,35% ▼	2,02%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1.351.153,39	0,00	0,00	1.346.487,71	-4.665,68	-0,35% ▼	1,80%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.074.003,01	0,00	0,00	6.093.623,08	19.620,07	0,32% ▲	1,08%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.751.008,88	28.272,67	0,00	1.796.883,13	17.601,58	0,99% ▲	0,01%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2.654.902,01	0,00	0,00	2.625.078,22	-29.823,79	-1,12% ▼	3,21%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	3.608.062,27	0,00	0,00	3.620.724,05	12.661,78	0,35% ▲	1,12%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	540.163,89	0,00	0,00	541.919,39	1.755,50	0,32% ▲	1,37%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.381.395,71	0,00	0,00	5.393.795,14	12.399,43	0,23% ▲	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.631.015,43	0,00	0,00	2.636.917,79	5.902,36	0,22% ▲	1,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.087.634,84	0,00	0,00	3.097.934,55	10.299,71	0,33% ▲	1,23%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.372.256,65	858.602,24	0,00	2.218.948,30	-11.910,59	-0,53% ▼	2,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.000.804,71	0,00	0,00	1.009.911,80	9.107,09	0,91% ▲	0,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.135,42	0,00	0,00	30.443,84	308,42	1,02% ▲	0,01%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.124.957,96	0,00	0,00	1.120.941,62	-4.016,34	-0,36% ▼	2,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.556.072,05	0,00	0,00	2.576.144,53	20.072,48	0,79% ▲	0,42%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	582.678,91	0,00	0,00	586.857,14	4.178,23	0,72% ▲	0,52%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.854,67	841.647,76	837.400,00	10.348,90	4.246,47	0,50% ▲	0,02%
	44.570.634,98	1.728.522,67	837.400,00	45.621.811,75	160.054,10	0,35%	1,04%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.535.856,22	0,00	0,00	1.354.828,49	-181.027,73	-11,79% ▼	9,10%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.112.062,17	0,00	0,00	1.868.965,68	-243.096,49	-11,51% ▼	8,90%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.793.864,58	0,00	0,00	1.593.433,08	-200.431,50	-11,17% ▼	8,29%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	859.402,24	0,00	0,00	767.129,84	-92.272,40	-10,74% ▼	9,08%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.160.349,37	0,00	0,00	2.828.935,16	-331.414,21	-10,49% ▼	7,94%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	449.675,69	0,00	0,00	446.087,00	-3.588,69	-0,80% ▼	1,52%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.871.905,31	0,00	0,00	1.716.358,21	-155.547,10	-8,31% ▼	7,00%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.641.542,46	0,00	0,00	3.358.223,92	-283.318,54	-7,78% ▼	13,68%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.198.307,39	0,00	0,00	1.069.253,24	-129.054,15	-10,77% ▼	7,26%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	690.257,25	808.989,74	0,00	1.366.690,98	-132.556,01	-8,84% ▼	8,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	733.973,01	0,00	0,00	659.412,80	-74.560,21	-10,16% ▼	8,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	390.981,16	0,00	0,00	350.071,10	-40.910,06	-10,46% ▼	8,99%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	807.505,85	0,00	808.989,74	0,00	1.483,89	0,18% ▲	0,02%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	194.808,14	0,00	0,00	173.809,53	-20.998,61	-10,78% ▼	8,72%
-	19.440.490,84	808.989,74	808.989,74	17.553.199,03	-1.887.291,81	-9,71%	9,09%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	949.385,87	0,00	0,00	967.754,26	18.368,39	1,93% ▲	8,66%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.324.777,07	0,00	0,00	1.335.739,25	10.962,18	0,83% ▲	12,50%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.197.822,61	0,00	0,00	1.198.943,77	1.121,16	0,09% ▲	10,72%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	612.317,82	0,00	0,00	595.009,20	-17.308,62	-2,83% ▼	20,13%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.002.836,27	0,00	0,00	1.006.139,77	3.303,50	0,33% ▲	10,12%
	5.087.139,64	0,00	0,00	5.103.586,25	16.446,61	0,32%	9,78%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	432.176,54	0,00	0,00	440.907,38	8.730,84	2,02% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	306.728,82	0,00	0,00	311.059,36	4.330,54	1,41% ▲
BNB RPPS IMA-B FI RENTA FIXA	1.327.468,68	0,00	0,00	1.346.487,71	19.019,03	1,43% ▲
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	5.992.217,26	0,00	0,00	6.093.623,08	101.405,82	1,69% ▲
BRADERCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI	1.721.424,92	54.990,09	27.000,00	1.796.883,13	47.468,12	2,67% ▲
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENTA FIXA	2.431.633,96	194.000,00	0,00	2.625.078,22	-555,74	-0,02% ▼
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENTA FIXA	3.557.410,93	0,00	0,00	3.620.724,05	63.313,12	1,78% ▲
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	543.355,82	0,00	144.609,32	541.919,39	143.172,89	26,35% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIXA	5.276.616,01	0,00	0,00	5.393.795,14	117.179,13	2,22% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	2.382.756,28	194.000,00	0,00	2.636.917,79	60.161,51	2,33% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	2.381.611,18	647.724,30	0,00	3.097.934,55	68.599,07	2,26% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	1.348.322,45	858.602,24	0,00	2.218.948,30	12.023,61	0,54% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	984.479,07	0,00	0,00	1.009.911,80	25.432,73	2,58% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	29.594,25	0,00	0,00	30.443,84	849,59	2,87% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.105.503,35	0,00	0,00	1.120.941,62	15.438,27	1,40% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	2.511.562,48	0,00	0,00	2.576.144,53	64.582,05	2,57% ▲
SANTANDER ATIVO FIC RENTA FIXA	573.532,32	0,00	0,00	586.857,14	13.324,82	2,32% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENTA FIXA REFERENCIADO DI	2.116,15	1.629.547,42	1.628.917,00	10.348,90	7.602,33	0,47% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	9.893.373,98	0,00	0,00	10.162.885,82	269.511,84	2,72% ▲
	42.801.884,45	3.578.864,05	1.800.526,32	45.621.811,75	1.041.589,57	2,34%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.658.702,39	0,00	0,00	1.354.828,49	-303.873,90	-18,32% ▼
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.275.969,18	0,00	0,00	1.868.965,68	-407.003,50	-17,88% ▼
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.877.279,76	0,00	0,00	1.593.433,08	-283.846,68	-15,12% ▼
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	971.288,73	0,00	0,00	767.129,84	-204.158,89	-21,02% ▼
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.374.440,31	0,00	0,00	2.828.935,16	-545.505,15	-16,17% ▼
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	446.325,52	0,00	0,00	446.087,00	-238,52	-0,05% ▼
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.895.387,43	0,00	0,00	1.716.358,21	-179.029,22	-9,45% ▼
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.949.855,17	0,00	0,00	3.358.223,92	-591.631,25	-14,98% ▼
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.213.690,65	0,00	0,00	1.069.253,24	-144.437,41	-11,90% ▼
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	709.965,29	808.989,74	0,00	1.366.690,98	-152.264,05	-10,02% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	815.251,52	0,00	0,00	659.412,80	-155.838,72	-19,12% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	435.519,96	0,00	0,00	350.071,10	-85.448,86	-19,62% ▼
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	804.412,80	0,00	808.989,74	0,00	4.576,94	0,57% ▲
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	208.289,32	0,00	0,00	173.809,53	-34.479,79	-16,55% ▼
	20.636.378,03	808.989,74	808.989,74	17.553.199,03	-3.083.179,00	-14,94%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1.025.628,64	0,00	0,00	967.754,26	-57.874,38	-5,64% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.121.449,21	362.202,62	0,00	1.335.739,25	-147.912,58	-9,97% ▼
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.256.752,43	0,00	0,00	1.198.943,77	-57.808,66	-4,60% ▼
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	765.334,64	0,00	0,00	595.009,20	-170.325,44	-22,26% ▼
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.103.485,79	0,00	0,00	1.006.139,77	-97.346,02	-8,82% ▼
	5.272.650,71	362.202,62	0,00	5.103.586,25	-531.267,08	-9,43%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	422.733,72	0,00	0,00	440.907,38	18.173,66	4,30% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	298.478,18	0,00	0,00	311.059,36	12.581,18	4,22% ▲
BNB RPPS IMA-B FI RENTA FIXA	1.290.100,57	0,00	0,00	1.346.487,71	56.387,14	4,37% ▲
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	5.854.839,25	0,00	0,00	6.093.623,08	238.783,83	4,08% ▲
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI	1.680.729,76	54.990,09	27.000,00	1.796.883,13	88.163,28	5,08% ▲
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENTA FIXA	0,00	2.531.578,78	0,00	2.625.078,22	93.499,44	3,69% ▲
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENTA FIXA	5.448.944,52	0,00	2.000.000,00	3.620.724,05	171.779,53	3,15% ▲
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	0,00	530.627,67	144.609,32	541.919,39	155.901,04	29,38% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIXA	9.096.798,40	0,00	4.000.000,00	5.393.795,14	296.996,74	3,26% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	0,00	2.531.578,78	0,00	2.636.917,79	105.339,01	4,16% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	0,00	2.985.303,08	0,00	3.097.934,55	112.631,47	3,77% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	1.196.526,99	974.638,56	0,00	2.218.948,30	47.782,75	2,20% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	963.139,95	0,00	0,00	1.009.911,80	46.771,85	4,86% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	28.851,64	0,00	0,00	30.443,84	1.592,20	5,52% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.075.688,92	0,00	0,00	1.120.941,62	45.252,70	4,21% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIXA	2.447.059,60	0,00	0,00	2.576.144,53	129.084,93	5,28% ▲
SANTANDER ATIVO FIC RENTA FIXA	562.549,91	0,00	0,00	586.857,14	24.307,23	4,32% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENTA FIXA REFERENCIADO DI	368.991,75	2.222.391,91	2.594.617,00	10.348,90	13.582,24	0,52% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	9.643.775,77	0,00	0,00	10.162.885,82	519.110,05	5,38% ▲
	40.379.208,93	11.831.108,87	8.766.226,32	45.621.811,75	2.177.720,27	5,01%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.453.622,61	0,00	0,00	1.354.828,49	-98.794,12	-6,80% ▼
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	1.989.243,16	0,00	0,00	1.868.965,68	-120.277,48	-6,05% ▼
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.677.428,67	0,00	0,00	1.593.433,08	-83.995,59	-5,01% ▼
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	883.914,41	0,00	0,00	767.129,84	-116.784,57	-13,21% ▼
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.077.585,36	0,00	0,00	2.828.935,16	-248.650,20	-8,08% ▼
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	428.867,90	0,00	0,00	446.087,00	17.219,10	4,02% ▲
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.649.571,51	0,00	0,00	1.716.358,21	66.786,70	4,05% ▲
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.074.107,63	0,00	0,00	3.358.223,92	-715.883,71	-17,57% ▼
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.096.000,84	0,00	0,00	1.069.253,24	-26.747,60	-2,44% ▼
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	671.917,80	808.989,74	0,00	1.366.690,98	-114.216,56	-7,71% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	735.909,46	0,00	0,00	659.412,80	-76.496,66	-10,39% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	392.058,98	0,00	0,00	350.071,10	-41.987,88	-10,71% ▼
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	800.263,30	0,00	808.989,74	0,00	8.726,44	1,09% ▲
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	197.887,30	0,00	0,00	173.809,53	-24.077,77	-12,17% ▼
	19.128.378,93	808.989,74	808.989,74	17.553.199,03	-1.575.179,90	-8,23%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1.253.433,31	0,00	0,00	967.754,26	-285.679,05	-22,79% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.395.118,42	362.202,62	0,00	1.335.739,25	-421.581,79	-23,99% ▼
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.453.899,87	0,00	0,00	1.198.943,77	-254.956,10	-17,54% ▼
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.124.281,90	0,00	0,00	595.009,20	-529.272,70	-47,08% ▼
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.384.353,04	0,00	0,00	1.006.139,77	-378.213,27	-27,32% ▼
	6.611.086,54	362.202,62	0,00	5.103.586,25	-1.869.702,91	-26,81%

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, mantem 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
0,20%

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

Benchmark
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.

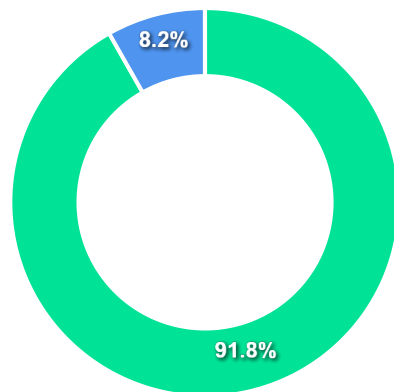
COMPARATIVO

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%
Benchmark	-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	5.176.643,73	91.80%
Operação compromissada	461.462,35	8.18%
Outros	698,31	0.01%
Valores a pagar/receber	166,03	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	708.214,54	12,56	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	597.536,16	10,60	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	494.780,07	8,77	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2027	461.462,35	8,18	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	458.465,23	8,13	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	452.450,48	8,02	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	430.950,14	7,64	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	396.798,75	7,04	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	387.574,63	6,87	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	381.646,15	6,77	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	313.296,19	5,56	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	269.067,94	4,77	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/08/2032	117.394,66	2,08	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/05/2027	114.477,07	2,03	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/08/2060	53.991,73	0,96	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/...	291,66	0,01	Outros
Outras Disponibilidades	201,42	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	116,83	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/...	94,71	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	88,10	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	86,41	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,73	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	20,59	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa Selic	15,10	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	8,03	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	4,64	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,02	0,00	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S.A

Gestão
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
126

Patrimônio Líquido Fundo
220.169.097,26

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Alta Soberano

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em títulos de emissão do Tesouro Nacional atrelados ao IPCA.

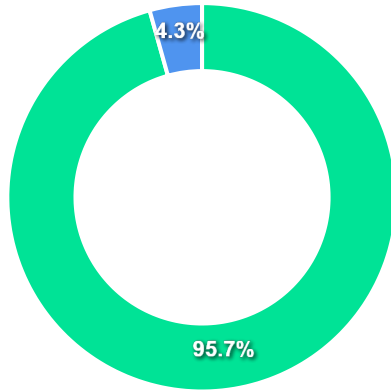
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,35%	4,37%	1,43%	4,37%	4,05%	10,59%	1,80%	3,78%
Benchmark	-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	176.738,59	95.67%
Operação compromissada	8.023,04	4.34%
Valores a pagar/receber	-21,79	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	24.142,43	13,07	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	21.120,80	11,43	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	20.753,18	11,23	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	16.960,85	9,18	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	15.165,96	8,21	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	14.560,12	7,88	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	14.311,57	7,75	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	13.978,00	7,57	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	10.933,80	5,92	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2027	8.023,04	4,34	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	7.362,35	3,99	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	7.110,48	3,85	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/08/2032	5.037,00	2,73	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/05/2027	5.028,45	2,72	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2026	273,59	0,15	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	15,57	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	12,93	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-50,29	-0,03	Valores a pagar/receber

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

Benchmark
IPCA

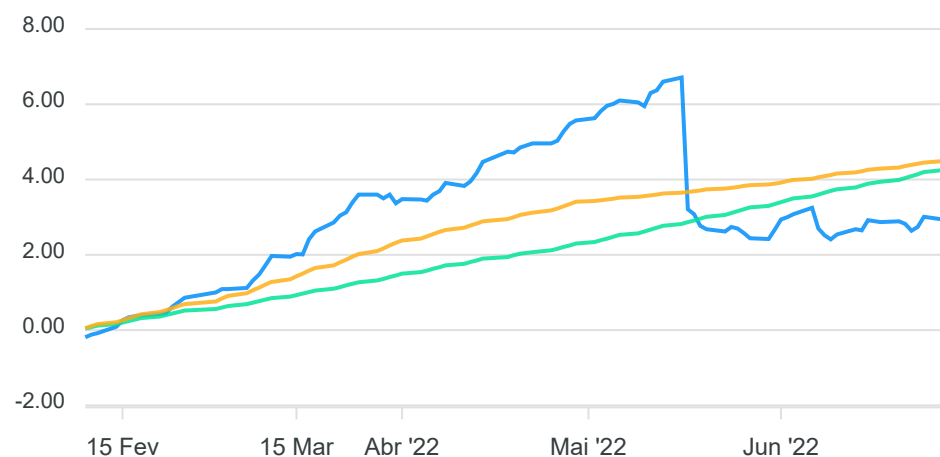
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

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

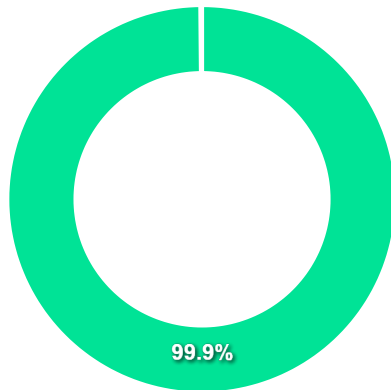
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,32%	-%	-0,26%	-%	-%	-%	1,37%	2,89%
Benchmark	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
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	4.005.264,52	99,86	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/04/2024	5.808,25	0,14	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	11,36	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	5,93	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-150,04	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	4.005.264,52	99.86%
Operação compromissada	5.808,25	0.14%
Valores a pagar/receber	-132,75	-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

Benchmark
IPCA

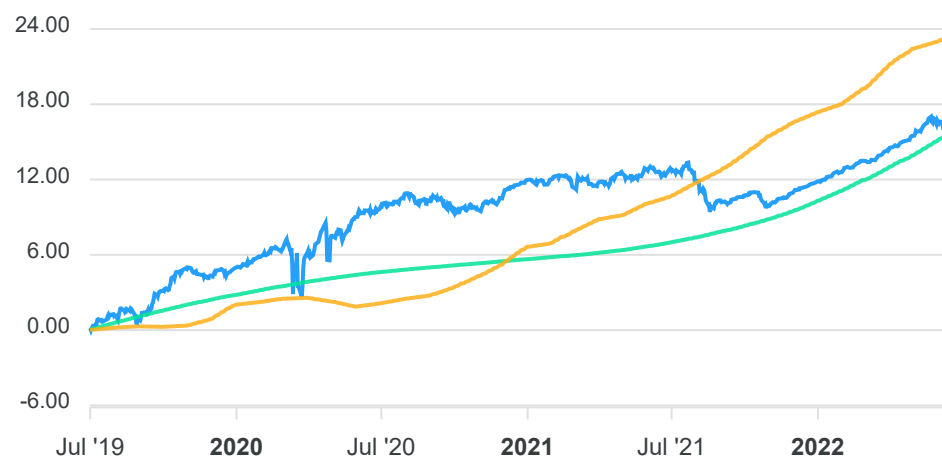
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

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

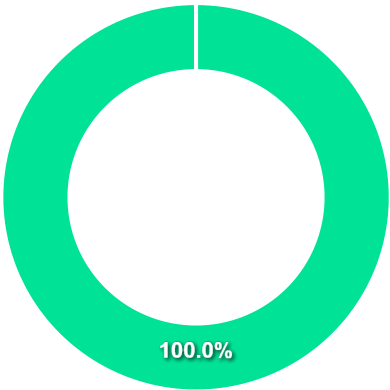
COMPARATIVO

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%
Benchmark	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
Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA LP	5.198.430,96	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	4,99	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-296,11	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.198.430,96	100.01%
Valores a pagar/receber	-291,12	-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

Benchmark
IDKA IPCA 2 Anos

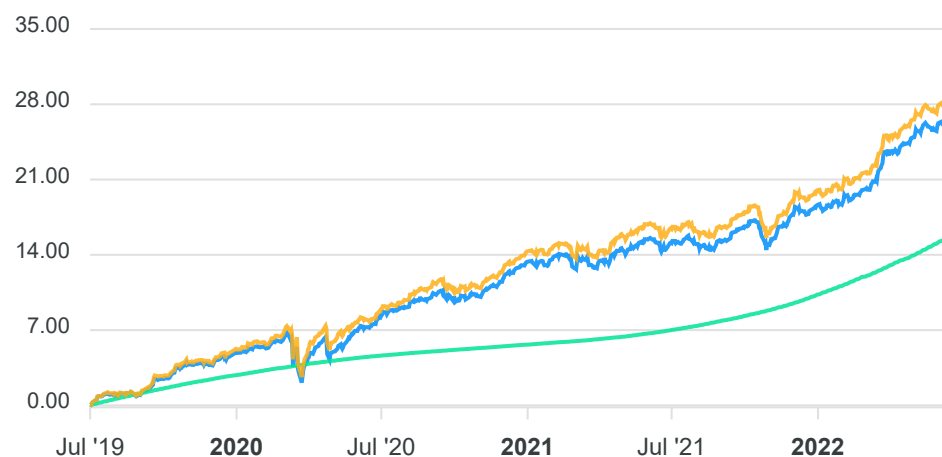
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

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

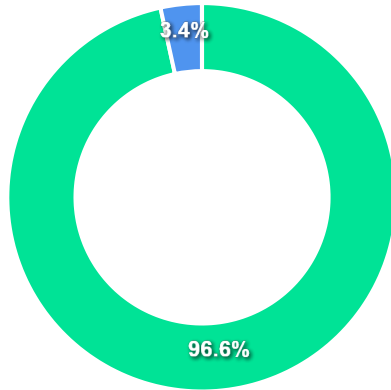
COMPARATIVO

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%
Benchmark	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



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	4.214.944,44	55,55	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	3.080.845,60	40,60	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	259.346,15	3,42	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2023	31.202,06	0,41	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2025	1.245,96	0,02	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	629,46	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	322,15	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ24	317,16	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-266,96	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	7.328.238,06	96.57%
Operação compromissada	259.346,15	3.42%
Valores a pagar/receber	684,64	0.01%
Derivativos	317,16	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
1.024

Patrimônio Líquido Fundo
11.084.704.335,99

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B 5

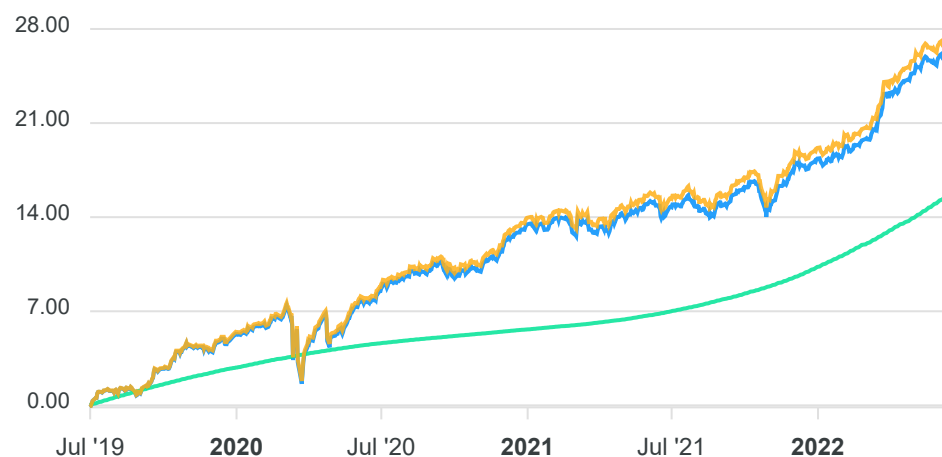
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

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.

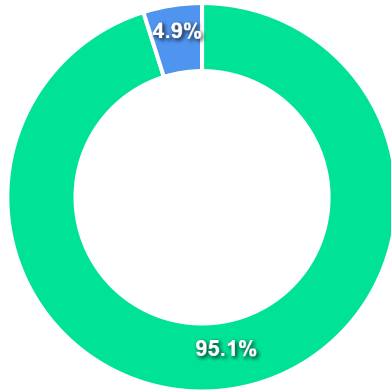
COMPARATIVO

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%
Benchmark	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	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	2.338.118,83	28,27	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	1.651.038,50	19,96	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.558.077,15	18,84	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	1.455.631,17	17,60	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/05/2027	839.208,48	10,15	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2023	402.875,98	4,87	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2023	12.481,88	0,15	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2026	12.435,80	0,15	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2025	1.233,50	0,01	Títulos Federais
Outros Valores a receber	150,06	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	145,07	0,00	Derivativos
Outras Disponibilidades	86,43	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-286,23	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	7.868.225,31	95.13%
Operação compromissada	402.875,98	4.87%
Derivativos	145,07	0.00%
Valores a pagar/receber	-49,75	-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
798

Patrimônio Líquido Fundo
4.111.516.095,57

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
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.

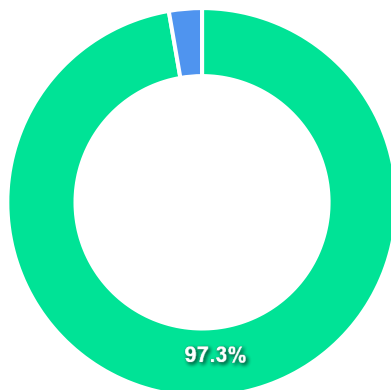
COMPARATIVO

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%
Benchmark	-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	3.627.338,25	97.27%
Operação compromissada	101.983,37	2.73%
Derivativos	20,72	0.00%
Valores a pagar/receber	-76,59	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	477.073,34	12,79	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	406.669,67	10,90	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	332.602,50	8,92	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	317.084,22	8,50	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	310.737,71	8,33	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	301.631,79	8,09	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	276.601,48	7,42	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	262.319,00	7,03	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	254.648,29	6,83	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	203.182,72	5,45	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	179.152,52	4,80	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	177.192,78	4,75	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	101.983,37	2,73	Operação compromissada
NTN-B - Venc: 15/08/2032	80.380,81	2,16	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/08/2060	46.840,38	1,26	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2025	1.221,04	0,03	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	40,58	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	25,71	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	20,72	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-142,88	0,00	Valores a pagar/receber

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

Benchmark
 IRF-M 1

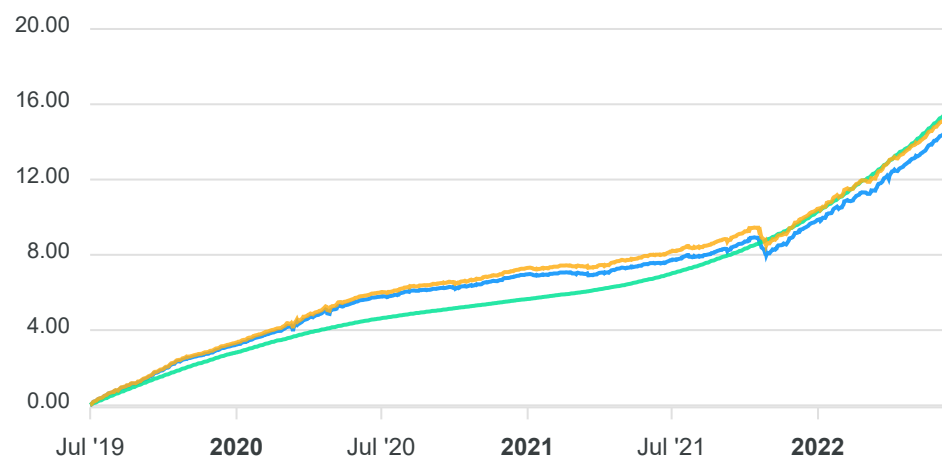
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

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

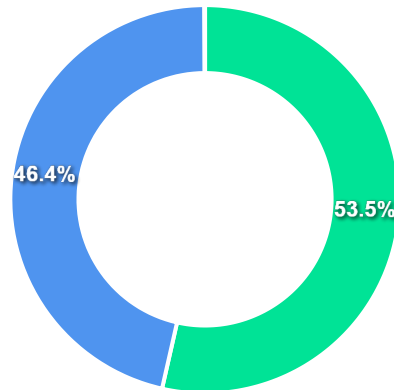
COMPARATIVO

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%
Benchmark	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
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2023	2.756.255,36	46,38	Operação compromissada
LTN - Venc.: 01/01/2023	1.630.215,69	27,43	Títulos Federais
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	1.505.904,77	25,34	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2023	46.182,97	0,78	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	3.866,43	0,07	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	420,13	0,01	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	379,00	0,01	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ23	22,11	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	14,56	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF23	0,16	0,00	Derivativos
LTN - Venc: 01/04/2023	0,00	0,00	Títulos Federais
Outros Valores a pagar	-218,88	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.182.303,43	53.55%
Operação compromissada	2.756.255,36	46.38%
Valores a pagar/receber	4.067,68	0.07%
Derivativos	401,27	0.01%
Outros	14,56	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
 588

Patrimônio Líquido Fundo
 17.877.663.669,31

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
 CDI

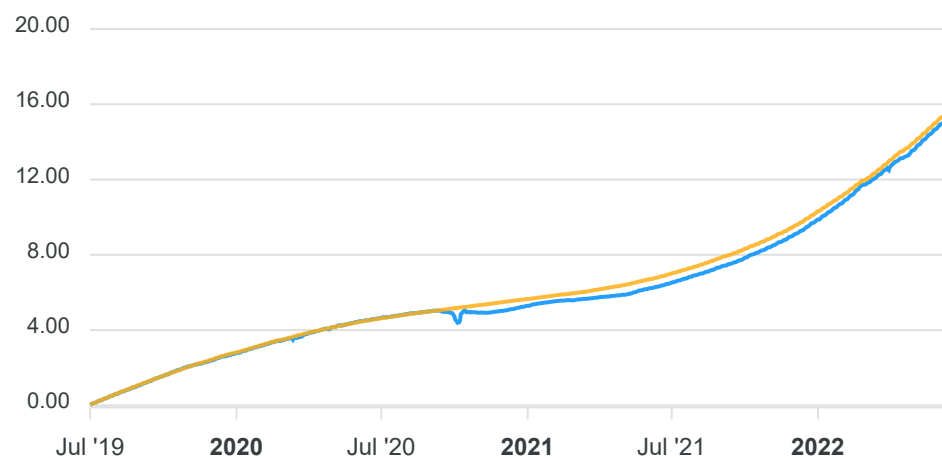
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em títulos públicos federais, com prazo médio de carteira superior 365 dias.

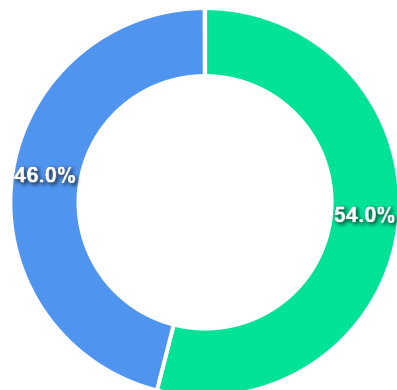
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,02%	5,52%	2,87%	5,52%	8,84%	10,78%	0,01%	0,03%
Benchmark	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	10.312.884,62	54.00%
Operação compromissada	8.786.331,92	46.01%
Valores a pagar/receber	6.698,08	0.04%
Outros	-422,90	-0.00%
Derivativos	-7.229,20	-0.04%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2023	8.786.331,92	45,99	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/09/2023	1.865.833,19	9,77	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2027	1.497.613,56	7,84	Títulos Federais
LTN - Venc: 01/01/2024	1.237.490,82	6,48	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/03/2027	1.134.747,47	5,94	Títulos Federais
LTN - Venc: 01/01/2026	1.062.479,72	5,56	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2026	718.353,95	3,76	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2024	667.040,31	3,49	Títulos Federais
LTN - Venc: 01/04/2024	515.981,81	2,70	Títulos Federais
LTN - Venc: 01/07/2025	484.388,69	2,54	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/03/2024	463.920,37	2,43	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2025	240.062,71	1,26	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/03/2026	146.813,87	0,77	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/03/2028	123.822,62	0,65	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2023	110.726,80	0,58	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2025	43.608,74	0,23	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	15.065,75	0,08	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	5,52	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ24	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF29	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ23	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	0,00	0,00	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	0,00	0,00	Outros
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	0,00	0,00	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições vendidas / Bolsa Mercadoria Futu...	-422,90	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF24	-599,81	0,00	Derivativos

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
547

Patrimônio Líquido Fundo
3.751.851.953,61

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
IPCA

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe de Renda Fixa.

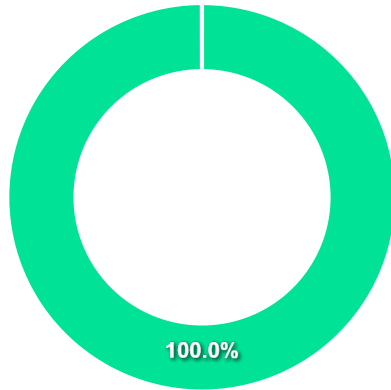
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,46%	4,30%	2,02%	4,30%	5,27%	8,66%	0,81%	1,71%
Benchmark	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
Cotas de BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI...	1.190.386,03	37,76	Fundos de Investimento
Cotas de BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	991.252,52	31,44	Fundos de Investimento
Cotas de BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	970.636,19	30,79	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	718,26	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	6,83	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	1,62	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-20,79	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-24,96	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-36,16	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	3.152.274,73	99.98%
Valores a pagar/receber	644,81	0.02%

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

Benchmark

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.

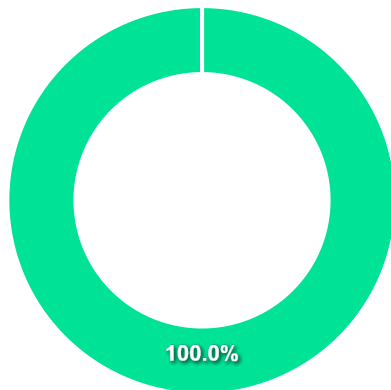
COMPARATIVO

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%
Benchmark	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
Cotas de BRAM FEDERAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	292.876,35	39,85	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B FI RENDA FIXA	225.902,15	30,74	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA	153.938,66	20,95	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IDKA PRÉ 5 FI RENDA FIXA	56.302,35	7,66	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	2.769,08	0,38	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.778,96	0,24	Fundos de Investimento
Cotas de BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	784,16	0,11	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	425,28	0,06	Fundos de Investimento
Cotas de BRAM H VOLGA FI RENDA FIXA LP	415,29	0,06	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	4,42	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-266,82	-0,04	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	735.192,29	100.03%
Valores a pagar/receber	-252,41	-0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,15%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+0

Quantidade de Cotistas

421

Patrimônio Líquido Fundo

7.806.519.166,89

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark

Selic

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Baixa Soberano

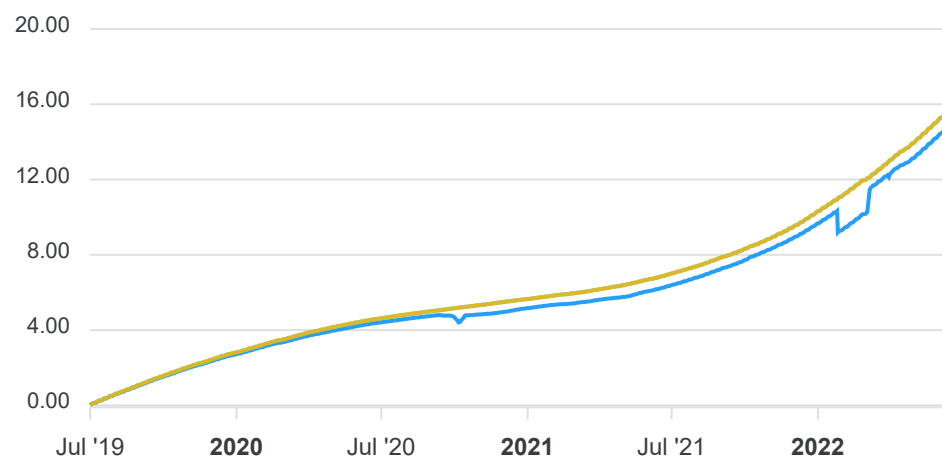
Política de Investimento

Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em carteira composta de ativos ou modalidades operacionais vinculados a variação do CDI, sendo vedada a exposição em moeda estrangeira e renda variável.

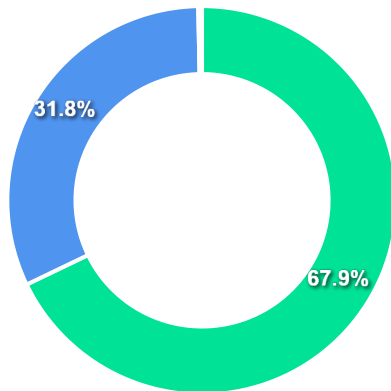
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,00%	5,23%	2,75%	5,23%	8,48%	10,53%	0,01%	0,02%
Benchmark	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. (%)
Títulos Federais	5.892.791,41	67.86%
Operação compromissada	2.764.020,47	31.83%
Valores a pagar/receber	27.301,46	0.31%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2025	2.075.820,13	23,90	Operação compromissada
LFT - Venc: 01/03/2024	1.102.369,35	12,69	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2024	1.091.560,22	12,57	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2023	910.900,42	10,49	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2025	904.071,54	10,41	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2023	624.094,22	7,19	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/03/2025	539.155,80	6,21	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/03/2026	368.900,95	4,25	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2025	344.820,17	3,97	Operação compromissada
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2025	343.380,17	3,95	Operação compromissada
LFT - Venc: 01/03/2027	305.726,46	3,52	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2026	46.012,46	0,53	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	28.680,90	0,33	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	20.653,87	0,24	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-22.033,31	-0,25	Valores a pagar/receber

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

36

Patrimônio Líquido Fundo

119.766.972,71

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark

IMA-B 5+

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento

Política de Investimento

Investe seus recursos em cotas de fundo de investimento, nos 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.

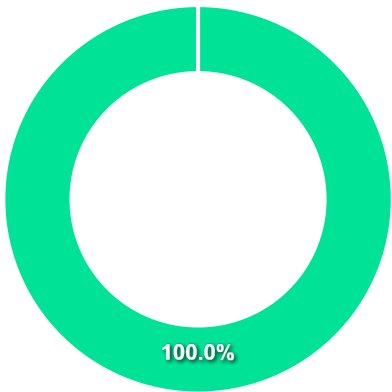
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,12%	1,87%	0,02%	1,87%	-2,86%	5,18%	3,21%	6,76%
Benchmark	-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



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	140.893,38	100,02	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	4,04	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	1,33	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-31,53	-0,02	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	140.893,38	100.02%
Valores a pagar/receber	-26,16	-0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,25%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+1

Quantidade de Cotistas

35

Patrimônio Líquido Fundo

343.307.035,91

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark

IMA Geral

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento

Política de Investimento

Aplica seus recursos, através de outros fundos, nos 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.

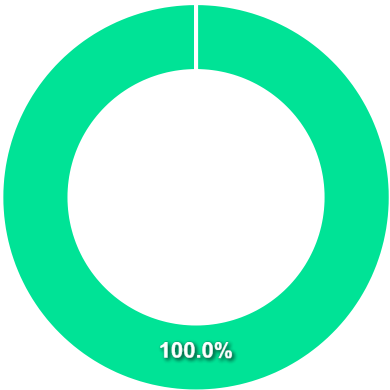
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,35%	4,35%	1,78%	4,35%	4,48%	8,37%	1,12%	2,36%
Benchmark	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



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BRAM IMA-GERAL FI RENDA FIXA	220.641,56	100,02	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	9,89	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	3,53	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-63,13	-0,03	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	220.641,56	100.02%
Valores a pagar/receber	-49,70	-0.02%

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

Benchmark
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.

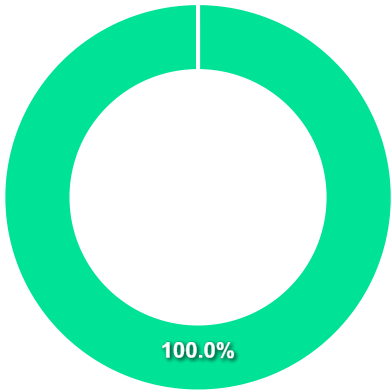
COMPARATIVO

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%
Benchmark	-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
Cotas de CAIXA MASTER BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	1.612.811,53	100,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	4,99	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-61,81	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.612.811,53	100.00%
Valores a pagar/receber	-56,82	-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

Benchmark
 IPCA

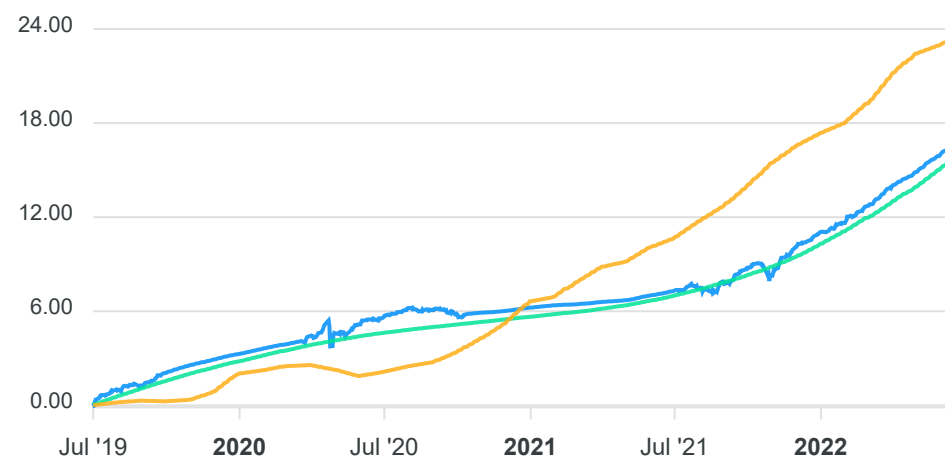
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre

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.

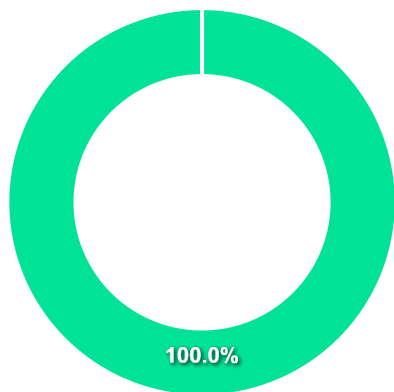
COMPARATIVO

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%
Benchmark	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
Cotas de ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	2.430.012,52	99,83	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.954,98	0,20	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	70,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	8,05	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-800,08	-0,03	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.434.967,50	100.03%
Valores a pagar/receber	-722,03	-0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão
SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração
0,40%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+1
Quantidade de Cotistas
71
Patrimônio Líquido Fundo
395.626.158,27

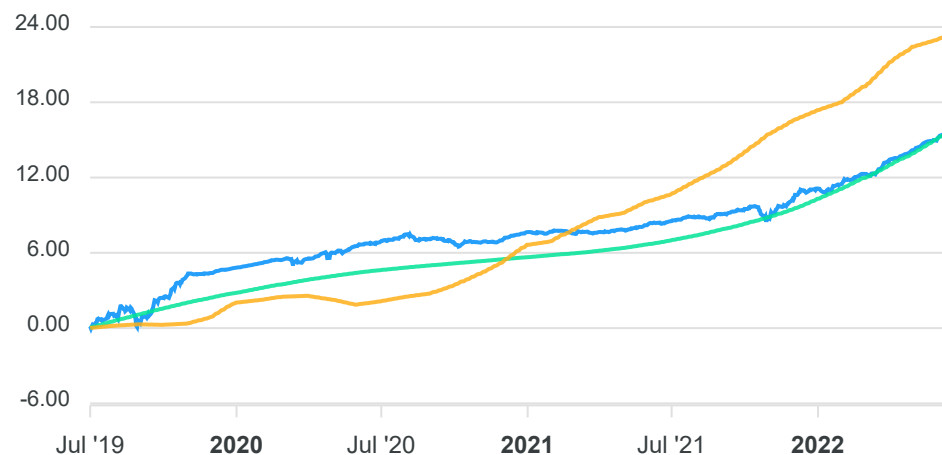
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark
IPCA
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos que invistam em ativos de renda fixa relacionados à variação das taxas de juros pós ou pré-fixados, de índices de preços, ou ambos, sendo vedada a exposição à moeda estrangeira e renda variável.

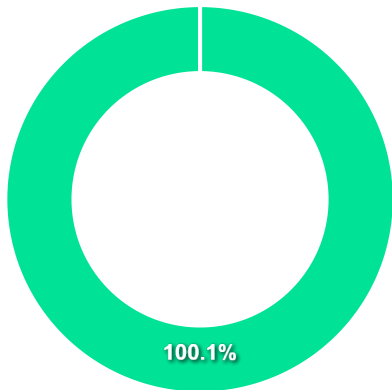
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,72%	4,32%	2,32%	4,32%	6,83%	8,46%	0,52%	1,10%
Benchmark	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
Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS EXCLUSIVE FIC RENDA FI...	196.874,54	59,57	Fundos de Investimento
Cotas de SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	80.202,29	24,27	Fundos de Investimento
Cotas de SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP	53.605,57	16,22	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	21,54	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-242,40	-0,07	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	330.682,40	100.07%
Valores a pagar/receber	-215,86	-0.07%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão
SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração
0,20%
Taxa de Performance
Não possui
Disponibilidade de Resgate
D+0
Quantidade de Cotistas
469
Patrimônio Líquido Fundo
2.150.628.295,54

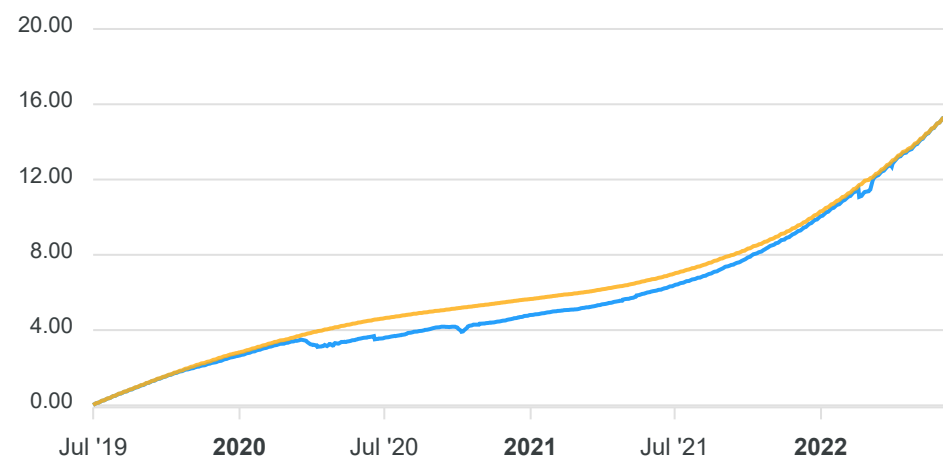
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Benchmark
CDI
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento
Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa e cotas de fundos de índice de renda fixa.

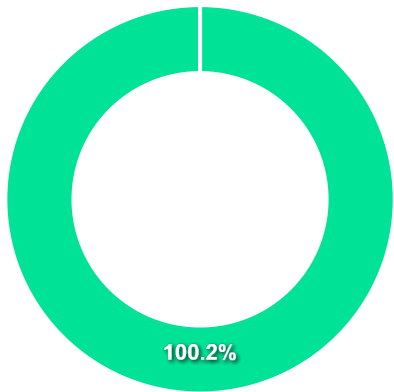
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,06%	5,69%	3,02%	5,69%	9,34%	12,30%	0,02%	0,04%
Benchmark	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de SANTANDER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	2.879.092,09	99,34	Fundos de Investimento
Cotas de SANTANDER DI INSTITUCIONAL EXCLUSIVE FIC RENDA FI...	23.583,14	0,81	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	24,27	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	-95,92	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-4.409,01	-0,15	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.902.675,23	100.15%
Valores a pagar/receber	-4.480,66	-0.15%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 1,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+4

Quantidade de Cotistas
 1.797

Patrimônio Líquido Fundo
 849.686.726,55

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

Classificação ANBIMA
 Ações Sustentabilidade/Governança

Política de Investimento
 Aplica, preponderantemente, em ações de emissão de companhias que, em função de adesão aos padrões de governança corporativa definidos por bolsa de valores.

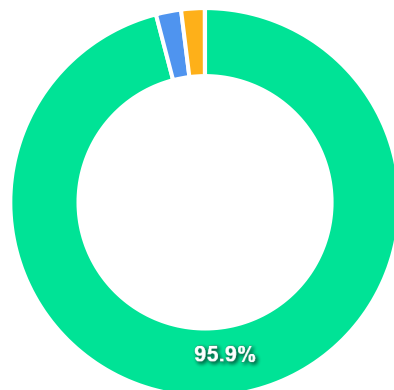
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-11,79%	-6,80%	-18,32%	-6,80%	-24,50%	2,17%	9,10%	19,16%
Benchmark	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	834.818,10	95.94%
Valores a pagar/receber	18.159,00	2.09%
Operação compromissada	16.918,83	1.94%
Outros	232,56	0.03%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	100.275,39	11,52	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	47.339,52	5,44	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	47.338,75	5,44	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	45.180,70	5,19	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	31.186,60	3,58	Ações
B3 ON NM - B3SA3	28.218,43	3,24	Ações
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	28.116,91	3,23	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	25.806,34	2,97	Ações
WEG ON NM - WEGE3	21.640,32	2,49	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	19.756,37	2,27	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	18.528,46	2,13	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	17.299,29	1,99	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/05/2035	16.918,83	1,94	Operação compromissada
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR3	15.639,54	1,80	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	14.714,52	1,69	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	13.263,50	1,52	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	12.534,66	1,44	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	11.319,70	1,30	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	10.351,11	1,19	Ações
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	8.981,71	1,03	Ações
JBS ON NM - JBSS3	8.931,57	1,03	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ELET3	8.714,59	1,00	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	8.543,77	0,98	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	8.501,82	0,98	Ações
COSAN ON NM - CSAN3	7.873,56	0,90	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	7.787,28	0,89	Ações
BRADESCO ON N1 - BBDC3	7.768,28	0,89	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,50%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+3

Quantidade de Cotistas

49

Patrimônio Líquido Fundo

270.424.593,88

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 8º, Inciso I

Benchmark

Ibovespa

Classificação ANBIMA

Ações Indexados

Política de Investimento

Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações, bônus ou recibos de subscrição, Certificados de Depósito de Ações e BDR Nível II e III.

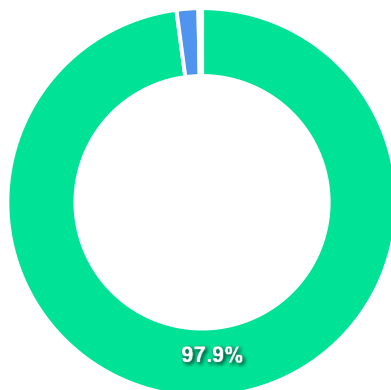
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-11,51%	-6,05%	-17,88%	-6,05%	-22,41%	3,16%	8,90%	18,74%
Benchmark	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	307.511,45	97.90%
Valores a pagar/receber	5.673,63	1.81%
Operação compromissada	867,12	0.28%
Derivativos	68,51	0.02%
Outros	1,90	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	36.885,98	11,74	Ações
VALE ON N1 - VALE3	20.551,89	6,54	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITUB4	12.137,11	3,86	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR4	9.676,83	3,08	Ações
B3 ON NM - B3SA3	8.609,83	2,74	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	8.264,36	2,63	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBDC4	8.255,87	2,63	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR3	7.267,77	2,31	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	6.969,56	2,22	Ações
Outros Valores a receber	6.547,93	2,08	Valores a pagar/receber
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	6.254,48	1,99	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ABEV3	6.072,38	1,93	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ELET3	6.010,37	1,91	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	5.377,79	1,71	Ações
WEG ON NM - WEGE3	5.068,67	1,61	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	4.754,58	1,51	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	4.545,68	1,45	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	4.468,17	1,42	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - BBAS3	4.377,82	1,39	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	4.219,37	1,34	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	4.123,71	1,31	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	4.101,48	1,31	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	3.582,73	1,14	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - WEGE3	3.446,78	1,10	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	3.381,03	1,08	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - GGBR4	3.108,22	0,99	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	3.008,93	0,96	Ações

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

Benchmark
Ibovespa

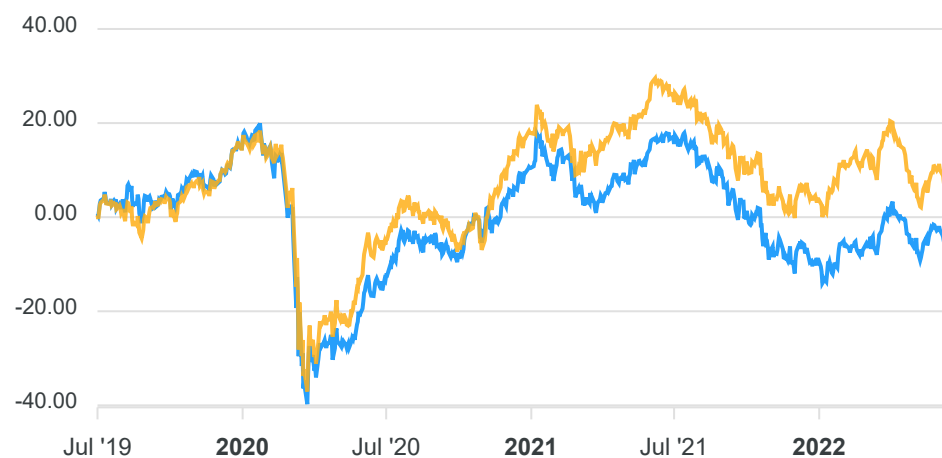
Classificação ANBIMA
Ações Índice Ativo

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.

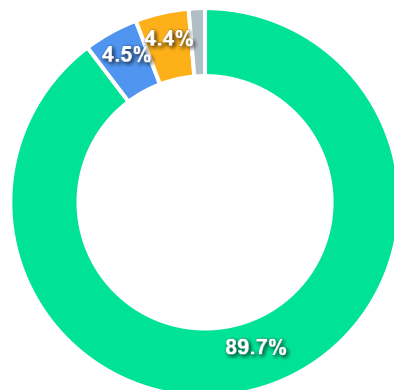
COMPARATIVO

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%
Benchmark	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	428.430,00	89.68%
Fundos de Investimento	21.654,63	4.53%
Operação compromissada	21.225,92	4.44%
Valores a pagar/receber	6.420,26	1.34%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	83.245,58	17,43	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	50.809,20	10,64	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	38.583,95	8,08	Ações
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	31.805,53	6,66	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	24.124,87	5,05	Ações
SABESP ON NM - SBSP3	21.535,59	4,51	Ações
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2024	21.225,92	4,44	Operação compromissada
GERDAU PN N1 - GGBR4	21.025,62	4,40	Ações
GRUPO SOMA ON NM - SOMA3	19.146,72	4,01	Ações
HYPERMARCAS ON NM - HYPE3	18.438,16	3,86	Ações
INTELBRAS ON NM - INTB3	16.998,63	3,56	Ações
VIBRA ON NM - VBBR3	16.849,03	3,53	Ações
Cotas de ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	16.775,61	3,51	Fundos de Investimento
B3 ON NM - B3SA3	14.540,21	3,04	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	13.974,58	2,93	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	11.852,45	2,48	Ações
VIVARA S.A. ON NM - VIVA3	9.750,32	2,04	Ações
SLC AGRICOLA ON NM - SLCE3	9.586,37	2,01	Ações
VAMOS ON NM - VAMO3	8.976,26	1,88	Ações
Outros Valores a receber	8.832,48	1,85	Valores a pagar/receber
MRV ON NM - MRVE3	8.063,43	1,69	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	7.145,11	1,50	Ações
Cotas de ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - S...	4.879,02	1,02	Fundos de Investimento
GRUPO SBF ON NM - SBFG3	1.978,40	0,41	Ações
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-2.422,21	-0,51	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S.A. DTVM

Gestão
 BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
 3,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+4 ou D+33

Quantidade de Cotistas
 3.782

Patrimônio Líquido Fundo
 1.325.317.998,19

Patrimônio Líquido Master
 1.325.121.841,07

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, preponderantemente, em cotas do BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 17.009.959/0001-90.

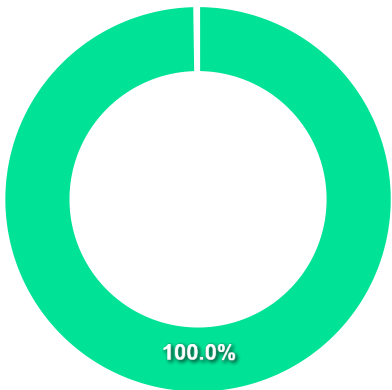
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,74%	-13,21%	-21,02%	-13,21%	-43,33%	-30,33%	9,08%	19,13%
Benchmark	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FIAÇÃOE...	1.425.967,17	100,00	Fundos de Investimento
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/05/2023	3.301,49	0,23	Operação compromissada
Outros Valores a receber	180,84	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-3.476,82	-0,24	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.425.967,17	100.00%
Operação compromissada	3.301,49	0.23%
Valores a pagar/receber	-3.295,98	-0.23%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 1,50%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+25

Quantidade de Cotistas
 1.588

Patrimônio Líquido Fundo
 643.233.782,30

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento de ações geridos por gestores distintos.

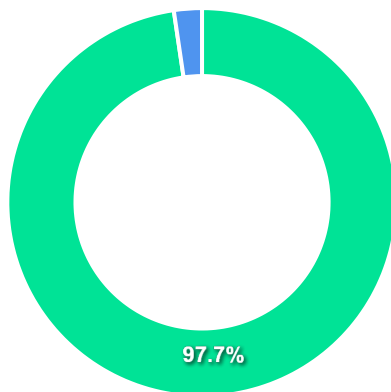
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,49%	-8,08%	-16,17%	-8,08%	-27,94%	-7,88%	7,94%	16,71%
Benchmark	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	667.724,65	97.68%
Valores a pagar/receber	15.886,51	2.32%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de NAVI INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	70.070,33	10,51	Fundos de Investimento
Cotas de MILES CAIXA VIRTUS FIC AÇÕES	58.221,64	8,73	Fundos de Investimento
Cotas de SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FI AÇÕES	58.090,35	8,71	Fundos de Investimento
Cotas de CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	57.413,93	8,61	Fundos de Investimento
Cotas de CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	52.764,94	7,92	Fundos de Investimento
Cotas de VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	52.212,57	7,83	Fundos de Investimento
Cotas de OCEANA SELECTION 30 E FIC AÇÕES	49.793,28	7,47	Fundos de Investimento
Cotas de TRUXT C VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	43.084,04	6,46	Fundos de Investimento
Cotas de APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	35.267,56	5,29	Fundos de Investimento
Cotas de AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	34.747,09	5,21	Fundos de Investimento
Cotas de TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	32.983,96	4,95	Fundos de Investimento
Cotas de MOAT CAIXA AÇÕES FIC AÇÕES	31.294,62	4,69	Fundos de Investimento
Cotas de LEBLON AÇÕES II INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	30.407,32	4,56	Fundos de Investimento
Cotas de BRASIL CAPITAL 30 FIC AÇÕES	27.379,68	4,11	Fundos de Investimento
Cotas de EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	24.814,92	3,72	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	17.289,43	2,59	Valores a pagar/receber
Cotas de CAIXA MASTER TPF FI RENDA FIXA LP	9.178,40	1,38	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.402,93	-0,21	Valores a pagar/receber

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
3.270

Patrimônio Líquido Fundo
228.591.211,08

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
IDIV

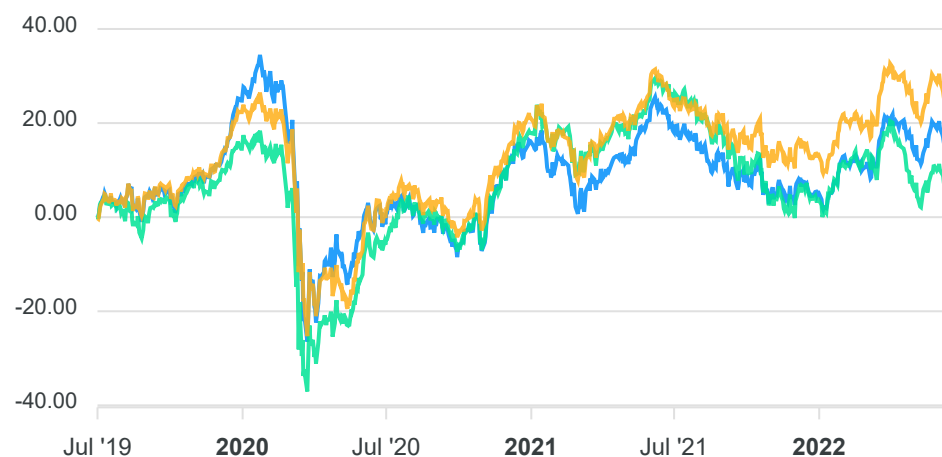
Classificação ANBIMA
Ações Dividendos

Política de Investimento
Aplica seus recursos em ações de empresas que possuam a política e/ou potencial de distribuição de dividendos e/ou juros sobre o capital.

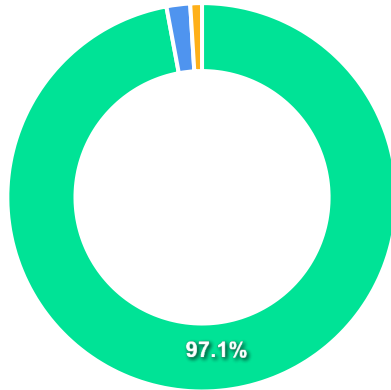
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-8,31%	4,05%	-9,45%	4,05%	-7,36%	11,21%	7,00%	14,75%
Benchmark	-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	233.965,11	97.07%
Valores a pagar/receber	4.728,38	1.96%
Fundos de Investimento	2.344,44	0.97%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	23.801,67	9,87	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	12.260,81	5,09	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	10.929,53	4,53	Ações
B3 ON NM - B3SA3	10.394,05	4,31	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	9.639,08	4,00	Ações
TELEF BRASIL ON - VIVT3	9.520,11	3,95	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	9.466,49	3,93	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	9.405,65	3,90	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	8.267,61	3,43	Ações
ELETROBRAS PNB N1 - ELET6	8.004,95	3,32	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	7.983,86	3,31	Ações
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	7.604,75	3,16	Ações
COPEL PNB N1 - CPLE6	7.351,99	3,05	Ações
JBS ON NM - JBSS3	7.278,71	3,02	Ações
BRADERCO ON N1 - BBDC3	6.435,55	2,67	Ações
Outros Valores a receber	6.249,44	2,59	Valores a pagar/receber
ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	5.874,60	2,44	Ações
BRADERCO PN N1 - BBDC4	5.825,52	2,42	Ações
SANTANDER BR UNT N2 - SANB11	5.733,92	2,38	Ações
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	5.469,16	2,27	Ações
TRAN PAULIST PN N1 - TRPL4	5.319,94	2,21	Ações
SID NACIONAL ON - CSNA3	4.986,17	2,07	Ações
TAESA UNT N2 - TAEE11	4.400,40	1,83	Ações
BRADERPAR PN N1 - BRAP4	4.139,33	1,72	Ações
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	3.818,06	1,58	Ações
CEMIG ON N1 - CMIG3	3.798,66	1,58	Ações
ENERGIAS BR ON NM - ENBR3	3.040,83	1,26	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BEM DTVM

Gestão
 CONSTANCIA INVESTIMENTOS LTDA.

Taxa de Administração
 2,00%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+15

Quantidade de Cotistas
 4.289

Patrimônio Líquido Fundo
 1.134.872.520,13

COMPARATIVO

 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,77%	-2,44%	-11,90%	-2,44%	-17,59%	6,05%	7,26%	15,29%
Benchmark	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		

PERFIL DO FUNDO

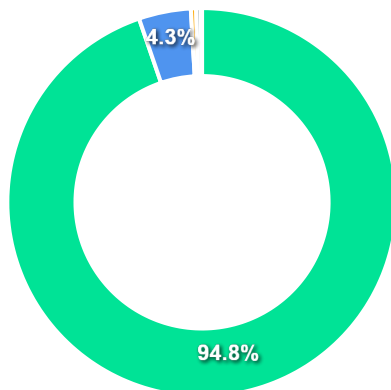
Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
 Ibovespa

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, principalmente, no mercado de renda variável, podendo aproveitar oportunidades disponíveis nos mercados de renda fixa, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento.

CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	1.206.333,73	94.75%
Operação compromissada	55.062,21	4.32%
Valores a pagar/receber	5.567,77	0.44%
Outros	4.941,71	0.39%
Títulos Federais	1.207,88	0.09%
Derivativos	7,37	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
ENERGIAS BR ON NM - ENBR3	67.138,24	5,27	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/05/2025	55.062,21	4,32	Operação compromissada
PETROBRAS PN - PETR4	54.037,76	4,24	Ações
CCR SA ON NM - CCRO3	46.832,22	3,68	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	35.501,87	2,79	Ações
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	35.048,68	2,75	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	33.384,12	2,62	Ações
MINERVA ON NM - BEEF3	27.871,95	2,19	Ações
ALUPAR UNT N2 - ALUP11	27.556,24	2,16	Ações
NEOENERGIA ON ATZ NM - NEOE3	26.129,70	2,05	Ações
ENERGISA UNT N2 - ENGI11	24.347,37	1,91	Ações
ABC BRASIL PN N2 - ABCB4	23.709,55	1,86	Ações
Outros Valores a receber	23.215,89	1,82	Valores a pagar/receber
BANRISUL PNB N1 - BRSR6	22.712,48	1,78	Ações
3R PETROLEUMON NM - RRRP3	21.689,15	1,70	Ações
TUPY ON NM - TUPY3	21.590,49	1,70	Ações
ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	20.986,70	1,65	Ações
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	17.935,22	1,41	Ações
VULCABRAS ON - VULC3	17.613,98	1,38	Ações
BR MALLS PAR ON NM - BRML3	17.465,25	1,37	Ações
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	17.238,06	1,35	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	17.132,45	1,35	Ações
CELUL IRANI ON - RANI3	16.524,89	1,30	Ações
UNIPAR PNB - UNIP6	15.882,58	1,25	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	15.448,67	1,21	Ações
Ação de Companhia Fechada - BRASILAGRO (07.628.528/0001-59...	15.431,23	1,21	Ações
TAURUS ARMASPN N2 - TASA4	15.098,01	1,19	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU 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

Benchmark
 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.

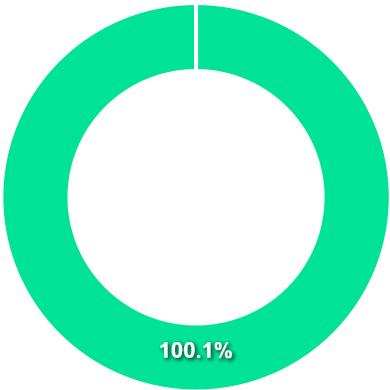
COMPARATIVO

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%
Benchmark	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ DUNAMIS MASTER FI AÇÕES	2.147.481,91	99,88	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	5.089,43	0,24	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	2.904,84	0,14	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	70,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-5.518,55	-0,26	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.152.571,34	100.12%
Valores a pagar/receber	-2.543,71	-0.12%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
ITAÚ DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,80%

Taxa de Performance
10,00%

Disponibilidade de Resgate
D+24

Quantidade de Cotistas
17

Patrimônio Líquido Fundo
182.938.350,53

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos classificados como
Ações, os quais investem em ativos financeiros que tenham como
principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à
negociação no mercado organizado.

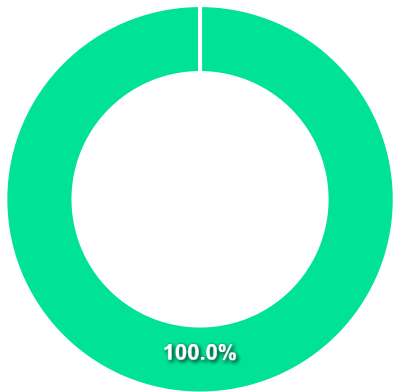
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,27%	-10,39%	-19,12%	-10,39%	-33,09%	-13,44%	8,35%	17,59%
Benchmark	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS MULTIGESTOR X FI...	218.756,34	99,96	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	175,04	0,08	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	42,03	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	4,40	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-142,32	-0,07	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	218.931,38	100.04%
Valores a pagar/receber	-95,89	-0.04%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU 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

Benchmark
 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.

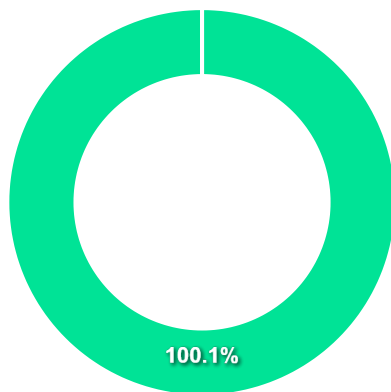
COMPARATIVO

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%
Benchmark	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de ITAÚ PHOENIX FI AÇÕES	473.341,20	99,95	Fundos de Investimento
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	923,49	0,19	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	70,00	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	5,82	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-741,98	-0,16	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	474.264,69	100.14%
Valores a pagar/receber	-666,16	-0.14%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS
S.A.

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
5.057

Patrimônio Líquido Fundo
186.106.545,82

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Valor/Crescimento

Política de Investimento
Aplica seus recursos no mercado de renda variável, utilizando-se de análise fundamentalista, observando entre outros aspectos, a potencialidade do valor intrínseco das ações selecionadas.

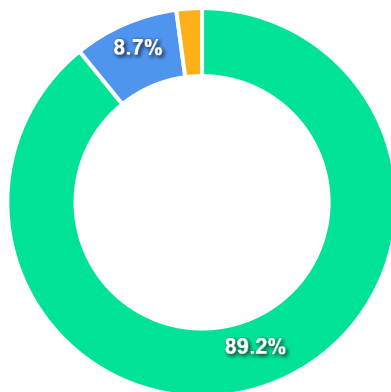
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,78%	-12,17%	-16,55%	-12,17%	-33,74%	-18,10%	8,72%	18,37%
Benchmark	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	178.983,82	89.22%
Operação compromissada	17.486,05	8.72%
Valores a pagar/receber	4.252,00	2.12%
Outros	-123,14	-0.06%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	18.840,45	9,39	Ações
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2027	17.486,05	8,72	Operação compromissada
PETROBRAS PN - PETR4	14.478,31	7,22	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	10.791,16	5,38	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	7.737,66	3,86	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	7.491,10	3,73	Ações
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	7.202,38	3,59	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	6.623,69	3,30	Ações
B3 ON NM - B3SA3	5.955,81	2,97	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	5.327,70	2,66	Ações
Outros Valores a receber	4.750,73	2,37	Valores a pagar/receber
BTGP BANCO UNT - BPAC11	4.619,18	2,30	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	4.343,51	2,17	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	4.008,04	2,00	Ações
ASSAI ON NM - ASAI3	3.865,58	1,93	Ações
WEG ON NM - WEGE3	3.561,71	1,78	Ações
HYPERMARCAS ON NM - HYPE3	3.531,74	1,76	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	3.128,51	1,56	Ações
AREZZO CO ON NM - ARZZ3	2.984,52	1,49	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	2.914,18	1,45	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	2.797,23	1,39	Ações
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	2.470,25	1,23	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	2.449,76	1,22	Ações
BRADESCO ON N1 - BBDC3	2.448,86	1,22	Ações
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	2.390,24	1,19	Ações
JBS ON NM - JBSS3	2.216,29	1,10	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	2.207,63	1,10	Ações

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Gestão

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA

Taxa de Administração

0,70%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+5

Quantidade de Cotistas

76

Patrimônio Líquido Fundo

72.016.891,81

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 9º, Inciso II

Benchmark

MSCI WORLD

Classificação ANBIMA

Ações Investimento no Exterior

Política de Investimento

Aplica, no mínimo, 90% de seus recursos em cotas do BNP PARIBAS GLOBAL LOW VOL EQUITY I CAP (LU0823418115), domiciliado em Luxemburgo.

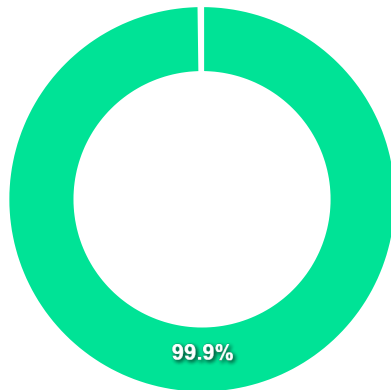
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,93%	-22,79%	-5,64%	-22,79%	-7,85%	8,86%	8,66%	18,23%
Benchmark	1,05%	-26,05%	-7,80%	-26,05%	-11,63%	10,62%		
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
Cotas de PARVEST EQUITY WORLD LOW VOLATILITY I USD CAP	53.005,79	99,12	Fundos de Investimento
Cotas de BNP PARIBAS MASTER CASH FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	438,64	0,82	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	170,40	0,32	Valores a pagar/receber
LFT - Venc: 01/03/2027	74,42	0,14	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2027	37,18	0,07	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	15,44	0,03	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-263,02	-0,49	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	53.444,42	99.94%
Títulos Federais	111,59	0.21%
Valores a pagar/receber	-77,18	-0.14%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Gestão
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA

Taxa de Administração
0,80%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+5

Quantidade de Cotistas
9.812

Patrimônio Líquido Fundo
568.267.517,75

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso II

Benchmark
MSCI WORLD

Classificação ANBIMA
Ações Investimento no Exterior

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do MS
GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY MASTER
INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES, CNPJ:
33.362.028/0001-28.

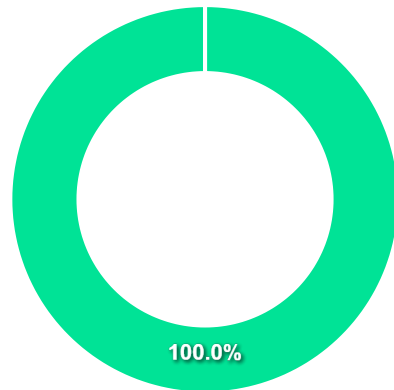
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-2,83%	-47,08%	-22,26%	-47,08%	-44,47%	-28,51%	20,13%	42,39%
Benchmark	1,05%	-26,05%	-7,80%	-26,05%	-11,63%	10,62%		
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
Cotas de MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY MASTER INVESTIME...	618.009,57	99,93	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	1.572,06	0,25	Valores a pagar/receber
Cotas de BNP PARIBAS SOBERANO II FIC RENDA FIXA SIMPLES	699,35	0,11	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	3,09	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.813,08	-0,29	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	618.708,92	100.04%
Valores a pagar/receber	-237,93	-0.04%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA.

Taxa de Administração
0,85%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4 du

Quantidade de Cotistas
371

Patrimônio Líquido Fundo
269.329.951,07

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso II

Benchmark
MSCI ACWI

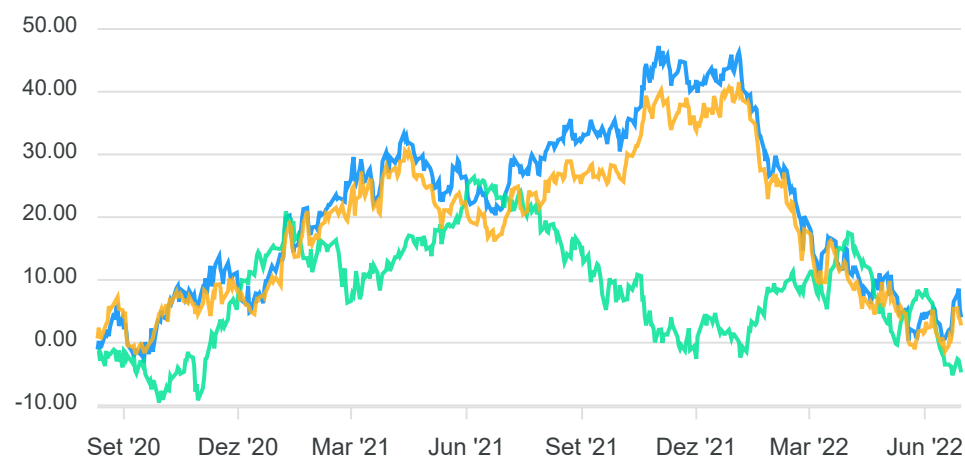
Classificação ANBIMA
Ações Investimento no Exterior

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS
INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES, CNPJ:
37.308.317/0001-08.

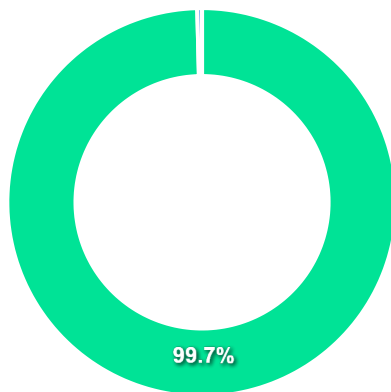
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,33%	-27,32%	-8,82%	-27,32%	-14,58%	-%	10,12%	21,30%
Benchmark	1,26%	-25,79%	-7,28%	-25,79%	-13,20%	8,75%		
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
Cotas de SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD IS IN...	280.377,86	99,68	Fundos de Investimento
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2025	1.106,19	0,39	Operação compromissada
Outros Valores a receber	155,98	0,06	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,10	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-360,41	-0,13	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	280.377,86	99.68%
Operação compromissada	1.106,19	0.39%
Valores a pagar/receber	-204,32	-0.07%

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

Benchmark
Global BDRX

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.

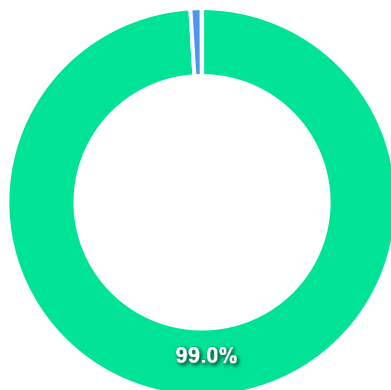
COMPARATIVO

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%
Benchmark	0,79%	-27,61%	-10,27%	-27,61%	-12,10%	12,50%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Brazilian Depositary Receipts	2.045.300,45	99.04%
Fundos de Investimento	18.999,77	0.92%
Valores a pagar/receber	810,20	0.04%
Outros	0,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
APPLE DRN - AAPL34	235.411,03	11,40	Brazilian Depositary Rece...
MICROSOFT DRN - MSFT34	188.460,64	9,13	Brazilian Depositary Rece...
AMAZON DRN - AMZO34	96.939,26	4,69	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET DRN C - GOGL35	61.542,90	2,98	Brazilian Depositary Rece...
ALPHABET DRN A - GOGL34	59.666,54	2,89	Brazilian Depositary Rece...
UNITEDHEALTH DRN - UNHH34	50.128,42	2,43	Brazilian Depositary Rece...
EXXON MOBIL DRN - EXXO34	47.847,72	2,32	Brazilian Depositary Rece...
TAIWANSMFAC DRN - TSMC34	43.006,41	2,08	Brazilian Depositary Rece...
NVIDIA CORP DRN - NVDC34	41.883,53	2,03	Brazilian Depositary Rece...
WAL MART DRN - WALM34	41.231,23	2,00	Brazilian Depositary Rece...
JPMORGAN DRN - JPMC34	40.021,93	1,94	Brazilian Depositary Rece...
CHEVRON DRN - CHVX34	35.363,12	1,71	Brazilian Depositary Rece...
PG DRN - PGC034	35.119,23	1,70	Brazilian Depositary Rece...
MASTERCARD DRN - MSCD34	33.699,98	1,63	Brazilian Depositary Rece...
HOME DEPOT DRN - HOME34	33.320,40	1,61	Brazilian Depositary Rece...
BANKAMERICA DRN - BOAC34	29.997,51	1,45	Brazilian Depositary Rece...
ABBVIE DRN - ABBV34	29.411,89	1,42	Brazilian Depositary Rece...
PFIZER DRN - PFIZ34	27.757,88	1,34	Brazilian Depositary Rece...
MERCK DRN - MRCK34	27.338,45	1,32	Brazilian Depositary Rece...
COCA COLA DRN - COCA34	27.164,53	1,32	Brazilian Depositary Rece...
META PLATFORMS, INC - M1TA34	26.799,75	1,30	Brazilian Depositary Rece...
COSTCO DRN - COWC34	23.666,90	1,15	Brazilian Depositary Rece...
TOYOTAMO DRN - TMC034	23.631,29	1,14	Brazilian Depositary Rece...
ALIBABAGR DRN - BABA34	23.025,47	1,12	Brazilian Depositary Rece...
ORACLE DRN - ORCL34	22.311,68	1,08	Brazilian Depositary Rece...
THERMFISCHER DRN - TMOS34	22.158,88	1,07	Brazilian Depositary Rece...
NOVO NORDISKDRN - N1VO34	22.089,00	1,07	Brazilian Depositary Rece...

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
 1,90%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+3

Quantidade de Cotistas
 3.368

Patrimônio Líquido Fundo
 153.024.938,69

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 9º, Inciso III

Benchmark
 Global BDRX

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento em ações, os quais investem em certificados de ações (BDRs, classificados como Nível I, II ou III) de empresas norte-americanas ou listadas nas bolsas americanas, negociadas no mercado local.

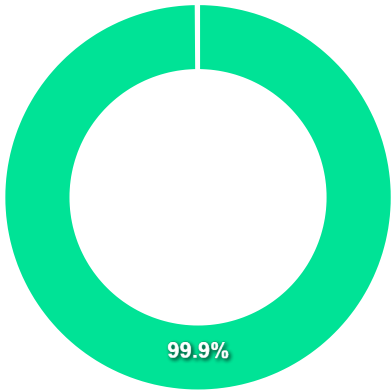
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,09%	-17,54%	-4,60%	-17,54%	-1,35%	21,99%	10,72%	22,59%
Benchmark	0,79%	-27,61%	-10,27%	-27,61%	-12,10%	12,50%		
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
Cotas de ITAÚ FI AÇÕES BDR NÍVEL I	133.443,21	99,41	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	682,76	0,51	Valores a pagar/receber
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	650,38	0,48	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	50,13	0,04	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-586,90	-0,44	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	134.093,59	99.89%
Valores a pagar/receber	145,99	0.11%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
9.808

Patrimônio Líquido Fundo
2.466.344.523,92

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 10º, Inciso I

Benchmark
CDI

Classificação ANBIMA
Multimercados Macro

Política de Investimento
Aplica em fundos que invistam em carteira diversificada de ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro e de capitais, nacional e internacional, com prazo médio superior a 365 dias.

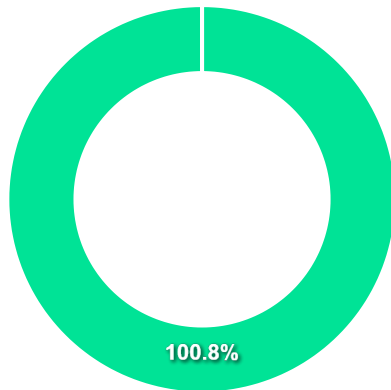
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,80%	4,02%	-0,05%	4,02%	2,32%	10,36%	1,52%	3,21%
Benchmark	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
Cotas de CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	1.055.918,16	51,49	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA MASTER HEDGE FI MULTIMERCADO LP	505.583,57	24,65	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	292.012,59	14,24	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA MASTER HEDGE II FI MULTIMERCADO LP	184.021,27	8,97	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA MASTER TPF FI RENDA FIXA LP	28.891,47	1,41	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	4,99	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-15.721,96	-0,77	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.066.427,06	100.77%
Valores a pagar/receber	-15.716,97	-0.77%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 1,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+1

Quantidade de Cotistas
 12.074

Patrimônio Líquido Fundo
 2.072.988.175,00

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 10º, Inciso I

Benchmark
 MSCI ACWI

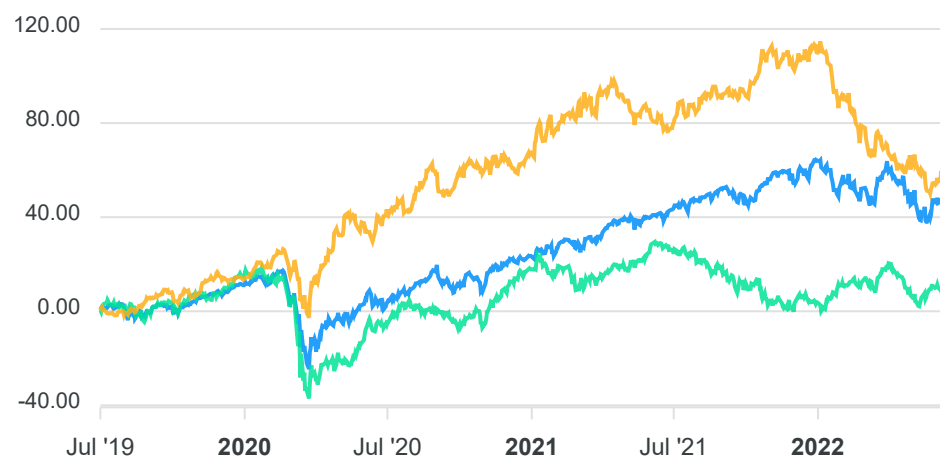
Classificação ANBIMA
 Multimercados Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos nos mercados de renda fixa e renda variável, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial. No mercado de renda variável, realizará operações de derivativos envolvendo contratos futuros de S&P500.

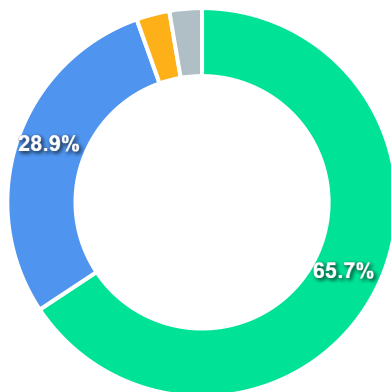
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-7,78%	-17,57%	-14,98%	-17,57%	-5,74%	30,65%	13,68%	28,82%
Benchmark	1,26%	-25,79%	-7,28%	-25,79%	-13,20%	8,75%		
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
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2023	545.069,40	29,69	Operação compromissada
LFT - Venc: 01/09/2027	470.893,10	25,65	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2026	372.452,19	20,29	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/03/2027	299.661,54	16,32	Títulos Federais
Outros Valores a receber	51.952,66	2,83	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercadoria Fut...	51.948,04	2,83	Outros
LFT - Venc: 01/09/2025	35.260,78	1,92	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/03/2028	27.240,98	1,48	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2024	17.345,17	0,94	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/03/2024	15.749,38	0,86	Títulos Federais
LFT - Venc.: 01/09/2023	1.510,18	0,08	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	28,40	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.136,28	-0,06	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.240.113,33	65.68%
Operação compromissada	545.069,40	28.87%
Outros	51.948,04	2.75%
Valores a pagar/receber	50.844,78	2.69%

