

2022

Relatório Mensal

Julho

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	10.202.426,98	14,48%	0,00		7º I a
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	308.304,80	0,44%	5.189.858.068,29	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	760.019,16	1,08%	197.862.387,41	0,38%	7º I b
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1.336.211,36	1,90%	207.881.599,07	0,64%	7º I b
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	542.323,50	0,77%	3.748.160.148,32	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.419.451,63	4,85%	6.217.671.822,00	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.629.205,80	3,73%	10.530.457.571,28	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.113.842,44	7,26%	10.426.166.067,57	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.198.426,83	3,12%	3.885.055.392,30	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.020.330,70	1,45%	5.065.234.429,28	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.755,00	0,04%	17.603.375.022,43	0,00%	7º I b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	443.723,95	0,63%	3.323.314.760,57	0,01%	7º III a
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.099.884,18	5,82%	808.122.410,04	0,51%	7º III a
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.786.550,76	2,54%	7.176.589.326,21	0,02%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	6.591.601,28	9,35%	120.554.059,97	5,47%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1.620.874,10	2,30%	302.582.149,24	0,54%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.110.911,22	1,58%	2.105.457.404,21	0,05%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.596.807,03	3,68%	2.528.329.321,30	0,10%	7º III a
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	590.553,06	0,84%	356.557.920,10	0,17%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.868,90	0,00%	2.186.258.657,96	0,00%	7º III a
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.414.672,22	2,01%	839.233.210,18	0,17%	8º I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	1.956.111,67	2,78%	302.369.535,51	0,65%	8º I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.693.758,57	2,40%	466.800.295,62	0,36%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	832.404,09	1,18%	1.409.026.324,92	0,06%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.973.419,10	4,22%	662.923.806,58	0,45%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.748.036,12	2,48%	230.324.731,46	0,76%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.119.235,17	1,59%	1.188.455.182,40	0,09%	8º I

Investimentos

\$ 70.471.192,23

Disponibilidades Financeiras

\$ 1.187.956,06

Total Carteira

\$ 71.659.148,29

Governança (Pró Gestão)

Não possui

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.448.761,74	2,06%	2.427.382.604,51	0,06%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	698.175,74	0,99%	193.692.206,94	0,36%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	371.457,52	0,53%	553.337.313,47	0,07%	8º I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	181.477,26	0,26%	190.508.393,18	0,10%	8º I
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1.028.395,76	1,46%	76.864.579,01	1,34%	9º II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	664.793,40	0,94%	622.030.531,24	0,11%	9º II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	1.083.266,29	1,54%	286.089.629,20	0,38%	9º II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.440.955,98	2,04%	2.340.707.282,75	0,06%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.262.174,96	1,79%	157.643.459,44	0,80%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	451.429,96	0,64%	2.260.228.327,23	0,02%	10º I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.697.594,00	5,25%	2.180.940.739,20	0,17%	10º I

Investimentos

 70.471.192,23

Disponibilidades Financeiras

 1.187.956,06

Total Carteira

 71.659.148,29

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	4.347,871487	126.088,27
NTN-B - 15/05/2035	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,6800%	20	4.531,735658	90.634,71
NTN-B - 15/08/2040	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7500%	49	4.686,547456	229.640,83
NTN-B - 15/05/2045	26/03/2020	Curva - Taxa: 4,5500%	146	4.841,383170	706.841,94
NTN-B - 15/05/2045	09/09/2021	Curva - Taxa: 4,8600%	351	4.652,688230	1.633.093,57
NTN-B - 15/05/2045	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	72	4.712,383302	339.291,60
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2019	Curva - Taxa: 4,4000%	122	5.104,715883	622.775,34
NTN-B - 15/08/2050	31/03/2020	Curva - Taxa: 4,4600%	71	5.060,680952	359.308,35
NTN-B - 15/08/2050	02/04/2020	Curva - Taxa: 4,5900%	146	4.967,202382	725.211,55
NTN-B - 15/08/2050	06/04/2020	Curva - Taxa: 4,6800%	123	4.904,003807	603.192,47
NTN-B - 15/08/2050	08/04/2020	Curva - Taxa: 4,6300%	122	4.938,963110	602.553,50
NTN-B - 15/08/2050	09/04/2020	Curva - Taxa: 4,7300%	124	4.869,415182	603.807,48
NTN-B - 15/08/2050	15/05/2020	Curva - Taxa: 4,6400%	147	4.931,940160	724.995,20
NTN-B - 15/08/2050	23/11/2020	Curva - Taxa: 4,3400%	3	5.149,328752	15.447,99
NTN-B - 15/08/2050	10/03/2021	Curva - Taxa: 4,1500%	19	5.294,502927	100.595,56
NTN-B - 15/08/2050	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7800%	69	4.835,197234	333.628,61
NTN-B - 15/05/2055	01/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	359	4.846,433157	1.739.869,50
NTN-B - 15/05/2055	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,8000%	134	4.816,794874	645.450,51

Investimentos

\$ 70.471.192,23

Disponibilidades Financeiras

\$ 1.187.956,06

Total Carteira

\$ 71.659.148,29

Governança (Pró Gestão)

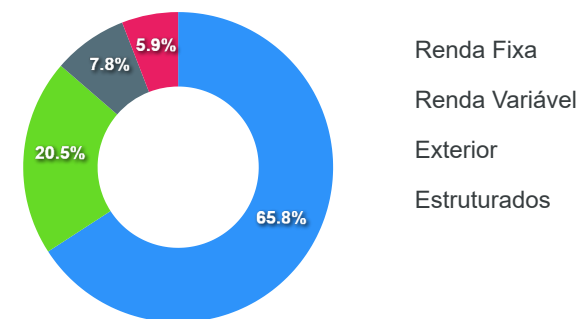
Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	14,24%	10.202.426,98 85,76%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	24,22%	17.358.871,22 75,78%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	26,30%	18.843.774,48 33,70%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	20,15%	14.437.509,20 9,85%
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,87%	2.776.455,45 6,13%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,77%	2.703.130,94 6,23%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	5,79%	4.149.023,96 4,21%

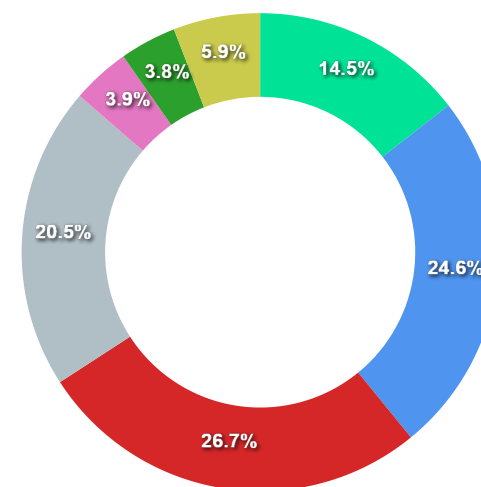
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos

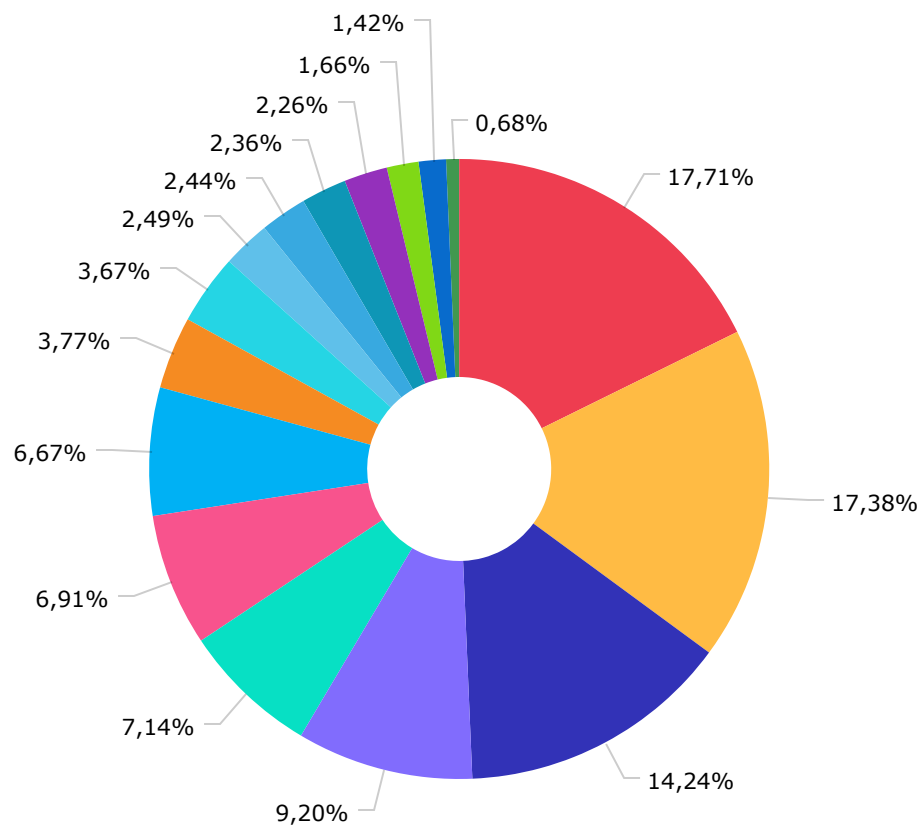


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	14,24%	0,00%	15,00%	100,00%	61.456.721,31	8º I - Fundos de Ações	20,15%	0,00%	7,00%	30,00%	7.060.235,29
7º I b - FI 100% Títulos TN	24,22%	0,00%	50,00%	100,00%	54.300.277,07	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	21.497.744,49
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.582.957,41	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	7.165.914,83
7º III a - FI Referenciados RF	26,30%	0,00%	11,00%	60,00%	24.151.714,49	9º II - Constituídos no Brasil	3,87%	0,00%	1,00%	10,00%	4.389.459,38
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	42.995.488,97	9º III - Ações - BDR Nível I	3,77%	0,00%	4,00%	10,00%	4.462.783,89
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	14.331.829,66	10º I - Fundos Multimercados	5,79%	0,00%	5,00%	10,00%	3.016.890,87
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.582.957,41	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.582.957,41
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.582.957,41	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.582.957,41
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.582.957,41	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.582.957,41
						12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.582.957,41

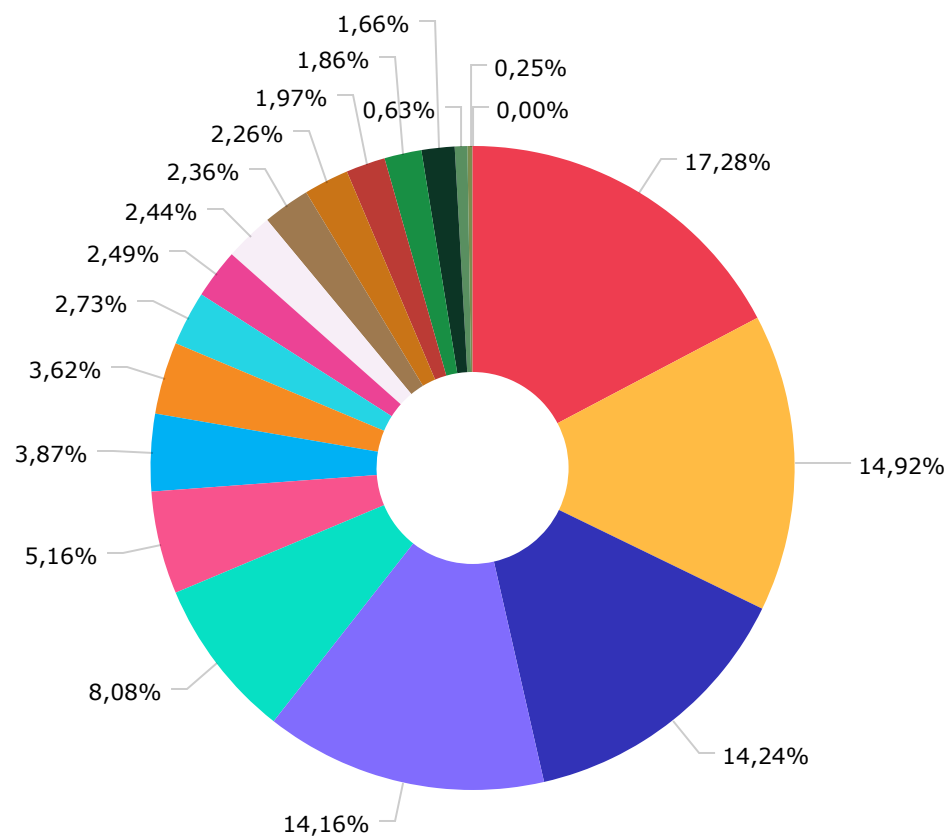
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05		
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,04	6,80	3,24	5,95	10,06	13,17	0,02	0,04
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02	6,60	3,15	5,76	9,53	11,70	0,02	0,03
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,20	5,26	1,31	3,94	3,93	10,14	1,71	3,59
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	7,65	-22,08	3,82	-13,58	-10,66	19,00		
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5,27	-13,19	6,38	-9,73	-1,12	29,41	10,05	21,17
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,88	-22,14	3,94	-13,74	-11,05	16,19	11,49	24,21
IBOVESPA - BENCHMARK	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25		
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4,67	2,12	-4,11	-1,69	-10,02	2,35	6,45	13,59
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	4,66	-1,67	-4,38	-8,08	-15,44	-0,23	7,70	16,22
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	6,30	0,97	-2,43	-5,43	-17,29	-3,51	8,51	17,93
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	4,42	-2,68	-5,19	-8,79	-17,73	-1,62	8,11	17,09
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6,01	-3,20	-2,21	-4,48	-18,57	0,76	7,73	16,29
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5,11	-3,38	-4,45	-8,61	-20,44	-11,34	7,37	15,53
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	5,88	-5,12	-4,25	-9,75	-25,68	-16,32	8,21	17,30
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	6,11	-5,25	-4,98	-9,90	-28,09	-18,19	8,20	17,27
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	4,41	-8,29	-4,12	-12,50	-28,44	-22,76	7,64	16,09
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,51	-5,83	-3,75	-10,31	-35,56	-30,25	8,55	18,01
IDIV - BENCHMARK	1,98	6,66	-2,58	-0,76	-0,49	13,65		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,85	5,97	-2,86	-1,18	-2,31	8,41	6,27	13,20
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	-0,17	6,66	1,15	6,61	10,11	16,59		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29	6,10	0,78	6,08	9,41	15,38	1,48	3,12

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA GERAL - BENCHMARK	0,47	4,98	1,83	4,76	5,95	7,72		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	0,42	4,79	1,64	4,59	5,23	6,84	1,19	2,50
IMA-B - BENCHMARK	-0,88	3,43	-0,28	4,20	3,25	5,86		
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,76	3,57	-0,20	4,23	3,56	5,97	2,14	4,51
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,89	3,27	-0,26	4,07	2,97	5,30	2,49	5,25
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,92	3,29	-0,35	4,07	2,97	5,33	2,47	5,21
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,89	3,29	-0,29	4,09	2,96	5,30	2,40	5,05
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,01	6,62	1,13	6,50	10,04	15,61		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02	6,53	1,12	6,44	9,84	15,08	1,21	2,55
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-1,84	0,16	-1,79	1,79	-3,22	-2,89		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,86	-0,02	-1,87	1,55	-3,95	-3,83	3,96	8,34
IPCA - BENCHMARK	-0,68	4,77	0,46	4,21	10,07	19,97		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,80	6,12	2,60	5,57	9,65	10,96	0,36	0,76
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,63	4,98	2,18	4,64	7,20	8,56	0,56	1,18
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64	4,97	2,04	4,77	6,06	7,29	0,65	1,36
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,79	5,41	2,09	4,71	5,36	6,31	0,99	2,08
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,34	4,43	1,51	4,19	5,32	5,43	1,08	2,28
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,07		-2,36				0,76	1,61
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,52						2,51	5,29
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,05	6,09	2,96	5,43	8,11	10,26		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03	5,94	2,90	5,30	7,87	9,75	0,25	0,52

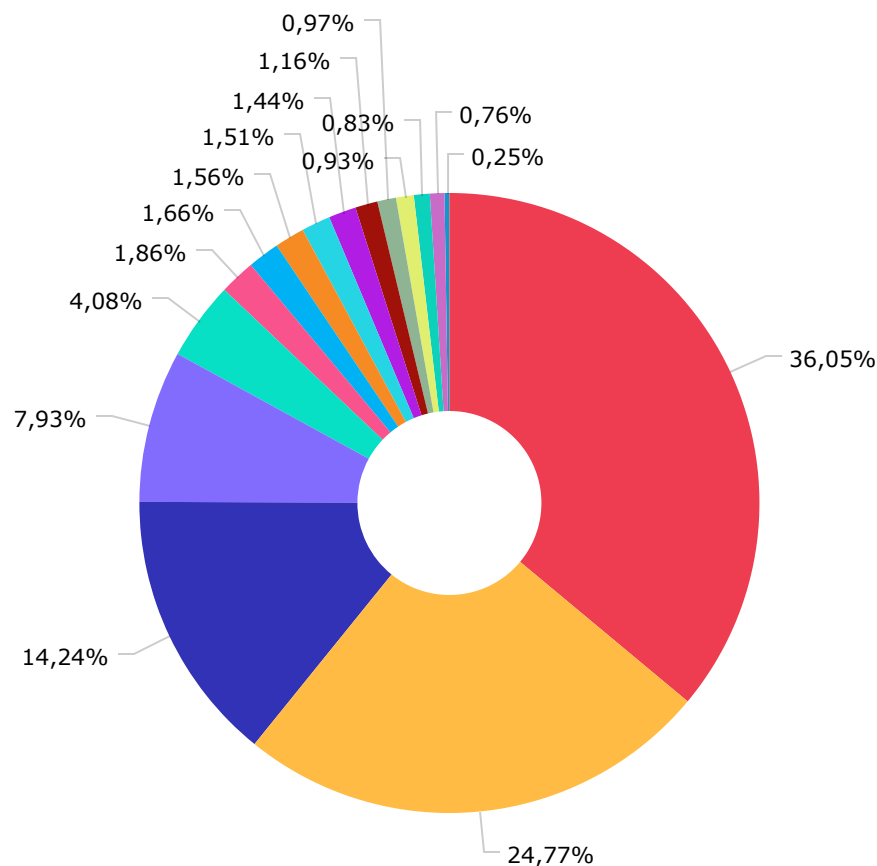
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
SELIC - BENCHMARK	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05		
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,01	6,30	3,06	5,52	9,17	11,45	0,01	0,02
MSCI WORLD - BENCHMARK	6,84	-20,99	3,62	-13,05	-9,35	18,81		
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	6,27	-17,95	2,86	-10,57	-8,71	16,26	8,73	18,39
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	11,73	-40,87	-4,59	-28,01	-38,67	-22,68	19,84	41,78
MSCI ACWI - BENCHMARK	5,85	-21,45	2,90	-13,91	-10,79	15,22		
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10,11	-9,24	2,53	-4,16	1,13	36,18	8,96	18,88
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	7,67	-21,75	1,61	-11,94	-13,52		11,62	24,46



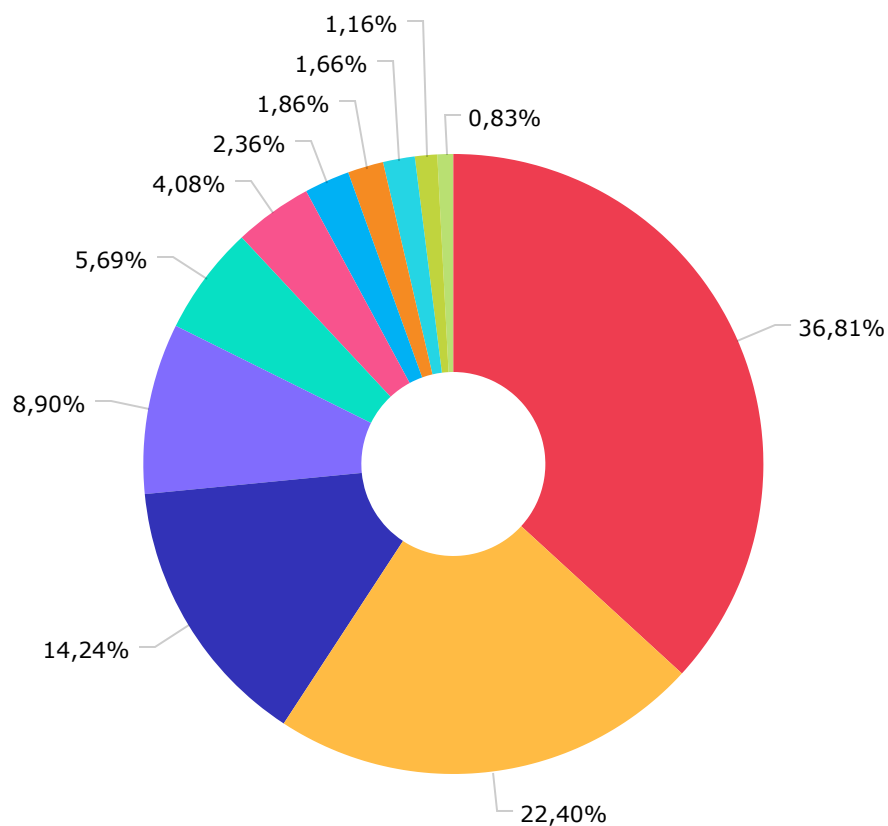
Ibovespa	12.689.473,08
IPCA	12.452.762,51
Títulos Públicos	10.202.426,98
IMA-B 5+	6.591.601,28
IMA-B 5	5.113.842,44
IMA-B	4.953.854,21
MSCI ACWI	4.780.860,29
Global BDRX	2.703.130,94
IDKA IPCA 2 Anos	2.629.205,80
Selic	1.786.550,76
IDIV	1.748.036,12
MSCI WORLD	1.693.189,16
IMA Geral	1.620.874,10
Disponibilidades Financeiras	1.187.956,06
IRF-M 1	1.020.330,70
CDI	485.053,86



Renda Fixa Indexados	12.381.021,79
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	10.691.485,46
Títulos Públicos	10.202.426,98
Ações Livre	10.146.584,30
Renda Fixa Duração Livre Soberano	5.786.826,30
Multimercados Livre	3.697.594,00
Ações Investimento no Exterior	2.776.455,45
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	2.596.807,03
Ações Indexados	1.956.111,67
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	1.786.550,76
Ações Dividendos	1.748.036,12
Ações Índice Ativo	1.693.758,57
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	1.620.874,10
Ações Sustentabilidade/Governança	1.414.672,22
Renda Fixa Duração Alta Soberano	1.336.211,36
Disponibilidades Financeiras	1.187.956,06
Multimercados Macro	451.429,96
Ações Valor/Crescimento	181.477,26
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	2.868,90



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.834.358,78
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN...	17.748.780,56
TESOURO NACIONAL	10.202.426,98
ITAU UNIBANCO S.A.	5.679.201,25
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	2.926.720,13
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	1.336.211,36
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.187.956,06
CONSTANCIA INVESTIMENTOS LTDA.	1.119.235,17
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.083.266,29
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT B...	1.028.395,76
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	832.404,09
ITAÚ DTVM S.A.	698.175,74
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT...	664.793,40
SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...	593.421,96
CAIXA DTVM	542.323,50
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	181.477,26



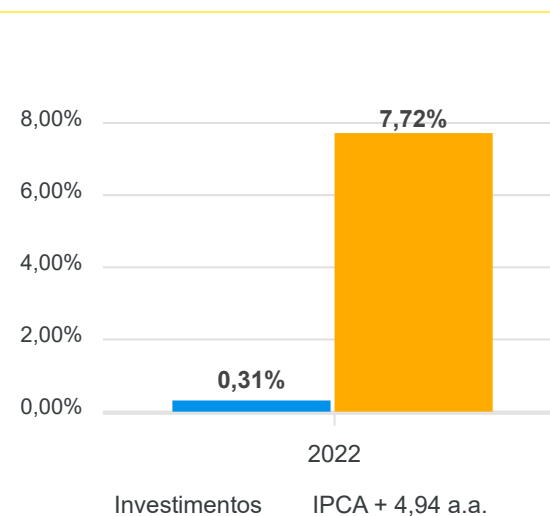
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	26.376.682,28
BANCO BRADESCO S.A.	16.055.021,99
TESOURO NACIONAL	10.202.426,98
ITAU UNIBANCO S.A.	6.377.376,99
BEM DTVM	4.077.737,29
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	2.926.720,13
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	1.693.189,16
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S...	1.336.211,36
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.187.956,06
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	832.404,09
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	593.421,96

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%
Mai	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%
Julho	68.278.597,03	7.233.091,24	6.522.272,67	70.471.192,23	1.481.776,63	214.614,09	2,15% ▲	0,31%	-0,28%	7,72%	4,02%	3,82%

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

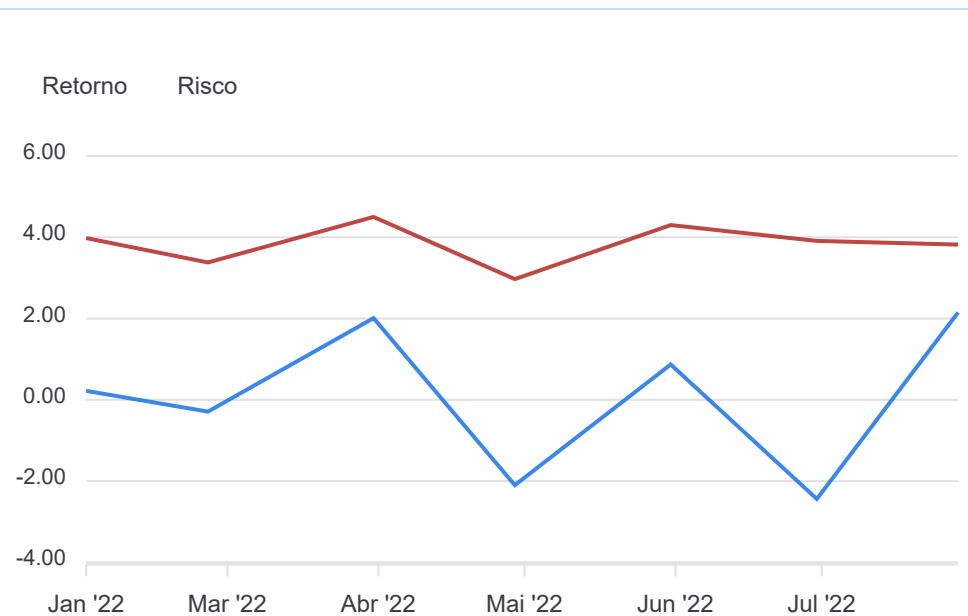
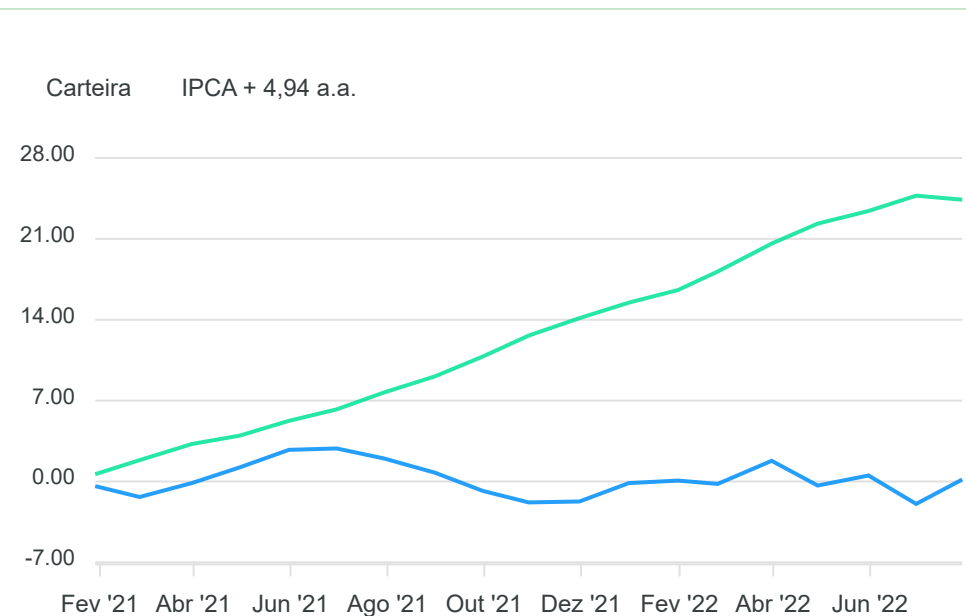


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	10.162.885,82	0,00	0,00	10.202.426,98	39.541,16	0,39% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	440.907,38	0,00	0,00	443.723,95	2.816,57	0,64% ▲	0,65%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	311.059,36	0,00	0,00	308.304,80	-2.754,56	-0,89% ▼	2,40%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1.346.487,71	0,00	0,00	1.336.211,36	-10.276,35	-0,76% ▼	2,14%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.093.623,08	0,00	2.000.000,00	4.099.884,18	6.261,10	0,10% ▲	1,08%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.796.883,13	0,00	28.272,67	1.786.550,76	17.940,30	1,00% ▲	0,01%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2.625.078,22	4.000.000,00	0,00	6.591.601,28	-33.476,94	-0,51% ▼	3,96%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	3.620.724,05	0,00	2.000.000,00	1.620.874,10	150,05	0,00% ▲	1,19%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	541.919,39	0,00	0,00	542.323,50	404,11	0,07% ▲	0,76%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.393.795,14	0,00	2.000.000,00	3.419.451,63	25.656,49	0,48% ▲	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.636.917,79	0,00	0,00	2.629.205,80	-7.711,99	-0,29% ▼	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.097.934,55	2.000.000,00	0,00	5.113.842,44	15.907,89	0,31% ▲	1,21%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.218.948,30	0,00	0,00	2.198.426,83	-20.521,47	-0,92% ▼	2,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.009.911,80	0,00	0,00	1.020.330,70	10.418,90	1,03% ▲	0,25%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.443,84	0,00	0,00	30.755,00	311,16	1,02% ▲	0,02%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.120.941,62	0,00	0,00	1.110.911,22	-10.030,40	-0,89% ▼	2,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.576.144,53	0,00	0,00	2.596.807,03	20.662,50	0,80% ▲	0,36%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	586.857,14	0,00	0,00	590.553,06	3.695,92	0,63% ▲	0,56%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.348,90	483.091,24	494.000,00	2.868,90	3.428,76	0,69% ▲	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	750.000,00	0,00	760.019,16	10.019,16	1,34% ▲	2,51%
	45.621.811,75	7.233.091,24	6.522.272,67	46.405.072,68	72.442,36	0,16%	1,33%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.354.828,49	0,00	0,00	1.414.672,22	59.843,73	4,42% ▲	8,11%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	1.868.965,68	0,00	0,00	1.956.111,67	87.145,99	4,66% ▲	7,70%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.593.433,08	0,00	0,00	1.693.758,57	100.325,49	6,30% ▲	8,51%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	767.129,84	0,00	0,00	832.404,09	65.274,25	8,51% ▲	8,55%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.828.935,16	0,00	0,00	2.973.419,10	144.483,94	5,11% ▲	7,37%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	446.087,00	0,00	0,00	451.429,96	5.342,96	1,20% ▲	1,71%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.716.358,21	0,00	0,00	1.748.036,12	31.677,91	1,85% ▲	6,27%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.358.223,92	0,00	0,00	3.697.594,00	339.370,08	10,11% ▲	8,96%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.069.253,24	0,00	0,00	1.119.235,17	49.981,93	4,67% ▲	6,45%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.366.690,98	0,00	0,00	1.448.761,74	82.070,76	6,01% ▲	7,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	659.412,80	0,00	0,00	698.175,74	38.762,94	5,88% ▲	8,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	350.071,10	0,00	0,00	371.457,52	21.386,42	6,11% ▲	8,20%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	173.809,53	0,00	0,00	181.477,26	7.667,73	4,41% ▲	7,64%
-	17.553.199,03	0,00	0,00	18.586.533,16	1.033.334,13	5,89%	7,72%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	967.754,26	0,00	0,00	1.028.395,76	60.641,50	6,27% ▲	8,73%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.335.739,25	0,00	0,00	1.440.955,98	105.216,73	7,88% ▲	11,49%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.198.943,77	0,00	0,00	1.262.174,96	63.231,19	5,27% ▲	10,05%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	595.009,20	0,00	0,00	664.793,40	69.784,20	11,73% ▲	19,84%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.006.139,77	0,00	0,00	1.083.266,29	77.126,52	7,67% ▲	11,62%
	5.103.586,25	0,00	0,00	5.479.586,39	376.000,14	7,37%	9,38%

Cenário Econômico

O fechamento de julho, caracterizou-se como sendo de recuperação dos principais índices de mercados, e as carteiras de investimentos que possuíam diversificação, experimentaram bons retornos. No segmento de renda variável, na segunda quinzena do mês, foi de melhor resultado com o Ibovespa fechando em 103 mil pontos, acumulando uma alta no mês de 4,69%. A atenção com a inflação ainda segue como o principal assunto nos debates econômicos, ao redor do mundo, principalmente levando-se em conta o fato de seguir disseminada e resiliente nas principais economias globais. Isso tem provocado um movimento geral dos bancos centrais de elevação na taxa básica de juros das economias, ao redor do mundo, a fim de frear a atividade econômica e reduzir a pressão sobre os preços de mercado trazendo com isso incertezas quanto aos seus limites, e deprimindo parcela de valorização das aquisições de títulos e fundos com carteira formada por títulos públicos federais. Entretanto, isso não tira as boas perspectivas de valorizações dos ativos, tanto no segmento de renda fixa, como no segmento de renda variável nos meses restantes do ano de 2022.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

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

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

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

Rentabilidade e Risco (por ativo)

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

Distribuição por Benchmarks

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

Distribuição por Classificação ANBIMA

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

Distribuição por Gestoras e Administradoras

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

Retorno da Carteira de Investimentos

A rentabilidade apresentada no período demonstra recuperação face o aumento das taxas de juros visando a contenção do processo inflacionário. Tal cenário de recuperação da conjuntura econômica interna também favoreceu os mercados de Bolsa e Ativos Reais, proporcionando um resultado consolidado da carteira mais satisfatório.

Retorno dos Fundos de Investimentos

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

Rio de Janeiro, 16 de agosto de 2022.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

