

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	21.670.213,14	8,74%	523	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	10.597.917,56	4,27%	1.071	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	14.146.832,24	5,71%	815	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.797.203,89	1,93%	577	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	9.611.843,19	3,88%	318	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	3.000.139,39	1,21%	91	0,93%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	2.426.742,32	0,98%	61	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	2.903.989,55	1,17%	251	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	463 dias	19.051.487,65	7,68%	270	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	6.840.342,86	2,76%	234	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.691.946,28	0,68%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	973.378,75	0,39%	83	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	11.166.249,89	4,50%	814	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	20.896.960,80	8,43%	1.063	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	11.655.765,66	4,70%	1.006	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.872.473,14	1,97%	872	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.328.150,82	2,15%	168	0,72%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.848.367,43	2,76%	85	1,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.524.727,00	1,02%	77	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.206.149,66	1,70%	242	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2022)

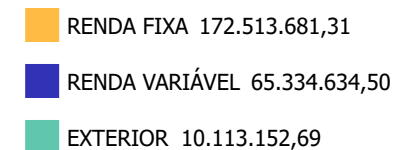
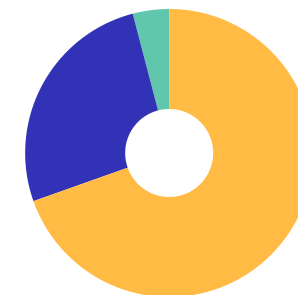
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	4.425.412,47	1,78%	192	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	586.451,01	0,24%	2.308	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.290.936,61	0,92%	68	0,42%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	1.871.899,49	0,75%	30.434	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.351.418,06	1,75%	1.967	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	3.127.963,56	1,26%	155	0,62%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.304.226,90	0,93%	3.523	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	3.319.427,48	1,34%	1.463	0,48%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	4.329.107,95	1,75%	167	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.972.812,87	0,80%	127	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.654.368,23	1,47%	4.062	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.810.054,09	1,13%	24.093	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	2.456.263,01	0,99%	17	1,19%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.800.319,08	1,13%	94	0,49%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.382.982,64	0,96%	18.281	0,75%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	1.789.468,95	0,72%	66	0,14%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	1.748.251,57	0,71%	61	0,27%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	753.647,47	0,30%	887	0,79%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.133.844,37	0,86%	154	0,15%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.565.478,32	0,63%	76	1,23%	Artigo 9º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.122.462,01	0,86%	518	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.942.340,88	1,19%	181	0,99%	Artigo 10º, Inciso I
BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	1.856.634,33	0,75%	34.500	0,21%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	5.869.514,99	2,37%	8.603	0,26%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	5.169.581,51	2,08%	126	0,66%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.069.498,81	0,83%	10.758	0,10%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.537.460,95	1,02%	8.278	0,30%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.036.390,32	1,22%	912	0,23%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL AGRO II FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	5.791.369,35	2,34%	18	4,42%	Artigo 10º, Inciso II
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	681.000,00	0,27%		0,63%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		488.216,48	0,20%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			247.961.468,50				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			488.216,48				Artigo 6º
PL Total			248.449.684,98				

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

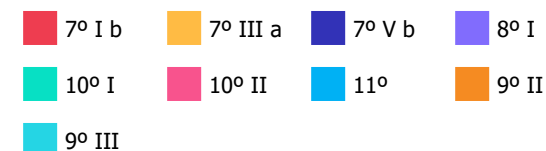
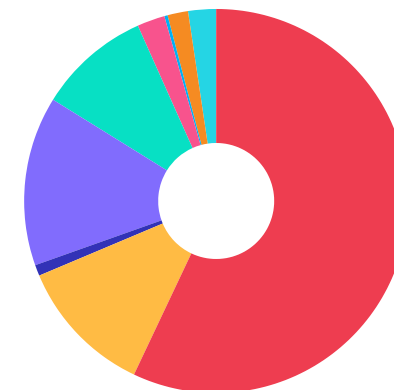
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	19,79%	62,59%	155.199.083,13
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	141.431.013,17	57,04%	15,22%	19,79%	62,59%	13.768.069,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	28.791.731,53	11,61%	12,91%	17,22%	50,00%	95.189.002,72
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,22%	20,00%	49.592.293,70
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	2.290.936,61	0,92%	0,00%	3,25%	5,00%	10.107.136,82
Total Renda Fixa	100,00%	172.513.681,31	69,57%	28,13%	77,27%	200,18%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	35.380.843,36	14,27%	8,82%	10,00%	20,00%	14.211.450,34
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,76%	20,00%	49.592.293,70
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	23.481.421,79	9,47%	2,44%	3,25%	10,00%	1.314.725,06
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	5.791.369,35	2,34%	0,00%	1,40%	5,00%	6.606.704,08
Artigo 11º	5,00%	681.000,00	0,27%	0,00%	0,31%	5,00%	11.717.073,43
Total Renda Variável	30,00%	65.334.634,50	26,35%	11,26%	16,72%	60,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	4.291.367,99	1,73%	0,00%	2,50%	5,00%	8.106.705,44
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	5.821.784,70	2,35%	3,75%	2,50%	10,00%	18.974.362,15
Total Exterior	10,00%	10.113.152,69	4,08%	3,75%	5,00%	15,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	101.100.645,93	40,77	0,36
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	91.155.514,35	36,76	-
ITAÚ UNIBANCO	20.221.667,31	8,16	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	11.878.227,03	4,79	0,00
AGBI REAL ASSETS	5.791.369,35	2,34	-
ITAÚ DTVM	5.266.317,10	2,12	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	4.206.149,66	1,70	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.654.368,23	1,47	0,21
GENIAL INVESTIMENTOS	2.382.982,64	0,96	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	2.304.226,90	0,93	0,00

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	62,59
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	141.431.013,17	57,04	15,22	62,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	28.791.731,53	11,61	12,91	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	2.290.936,61	0,92	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	35.380.843,36	14,27	8,82	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso II	4.291.367,99	1,73	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	5.821.784,70	2,35	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso I	23.481.421,79	9,47	2,44	10,00
Artigo 10º, Inciso II	5.791.369,35	2,34	0,00	5,00
Artigo 11º	681.000,00	0,27	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,36%	6,28%	-0,07%	4,90%	9,42%	14,98%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,05%	6,17%	0,00%	4,95%	9,27%	14,82%	1,44%	0,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,11%	5,99%	-0,18%	4,77%	9,08%	14,35%	1,43%	0,04%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,17%	8,53%	1,13%	5,88%	15,25%	33,96%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,84%	3,18%	-1,34%	3,77%	9,77%	20,20%	4,45%	0,05%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,00%	6,62%	0,35%	5,38%	9,88%	15,12%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	6,48%	0,32%	5,28%	9,60%	14,55%	1,32%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,17%	-	-0,28%	4,56%	-	-	1,45%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,05%	6,58%	0,40%	5,38%	9,75%	14,69%	1,30%	0,04%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-3,13%	-0,05%	-3,23%	1,48%	2,97%	0,84%	5,10%	0,06%
IMA-B (Benchmark)	1,10%	4,57%	-0,15%	4,78%	5,54%	8,99%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	4,40%	-0,17%	4,65%	5,26%	8,45%	3,18%	0,06%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,86%	3,92%	-0,90%	4,28%	4,58%	7,85%	3,47%	0,07%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-3,39%	-2,08%	-4,50%	0,90%	-0,46%	-3,76%	8,80%	0,08%
CDI (Benchmark)	1,17%	7,74%	3,25%	6,16%	10,20%	13,18%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,08%	7,01%	2,99%	5,60%	9,08%	10,75%	0,01%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,64%	6,98%	2,71%	5,60%	11,01%	15,07%	0,56%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,90%	7,77%	2,71%	6,34%	11,51%	15,01%	0,33%	0,01%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,16%	7,74%	3,24%	6,07%	10,23%	12,93%	0,01%	0,01%
IPCA (Benchmark)	-0,36%	4,39%	-0,37%	2,79%	8,73%	19,25%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,06%	6,24%	0,22%	5,13%	9,71%	14,56%	1,57%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01%	-	-	-	-	-	4,04%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	-	-	-	-	-	3,12%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,14%	7,06%	0,26%	5,50%	9,93%	14,73%	0,55%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,61%	6,77%	2,21%	5,24%	9,98%	11,78%	1,47%	0,02%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,32%	5,81%	1,99%	4,85%	7,25%	7,74%	1,41%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,47%	6,96%	2,51%	5,40%	8,49%	8,48%	0,58%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,15%	6,17%	2,27%	5,26%	7,77%	9,67%	1,07%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,14%	-	0,26%	2,06%	-	-	0,55%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	-4,24%	-17,02%	-4,29%	-9,80%	-12,55%	12,99%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-3,34%	-13,18%	-2,23%	-5,81%	-7,22%	20,28%	8,60%	0,21%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	-3,21%	-12,18%	-1,74%	-5,21%	-5,32%	23,81%	8,98%	0,21%
Global BDRX (Benchmark)	-3,05%	-24,45%	5,20%	-10,08%	-15,31%	0,66%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,92%	-25,19%	4,51%	-10,76%	-16,57%	-3,06%	10,67%	0,21%
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,66%	-23,40%	5,48%	-8,91%	-12,80%	2,78%	10,40%	0,21%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,34%	9,89%	1,62%	6,89%	17,43%	39,05%	-	-
BRASIL AGRO II FIP MULTIESTRATÉGIA	44,05%	43,09%	43,81%	43,36%	78,83%	84,20%	-	0,49%
IDIV (Benchmark)	4,27%	11,21%	-2,58%	5,93%	4,28%	24,51%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	3,56%	8,46%	-2,64%	0,38%	-2,12%	15,39%	6,78%	0,20%
Ibovespa (Benchmark)	6,16%	4,48%	-1,64%	-3,20%	-7,79%	10,22%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,77%	-0,18%	-3,54%	-3,37%	-5,17%	19,86%	9,11%	0,20%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6,54%	3,13%	0,39%	3,02%	-11,29%	7,56%	7,56%	0,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7,53%	1,88%	2,16%	-2,77%	-19,37%	-8,44%	9,76%	0,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	6,84%	1,37%	1,50%	-3,59%	-17,51%	-8,53%	9,81%	0,24%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	7,04%	1,81%	1,00%	-3,50%	-11,73%	-0,35%	8,86%	0,21%

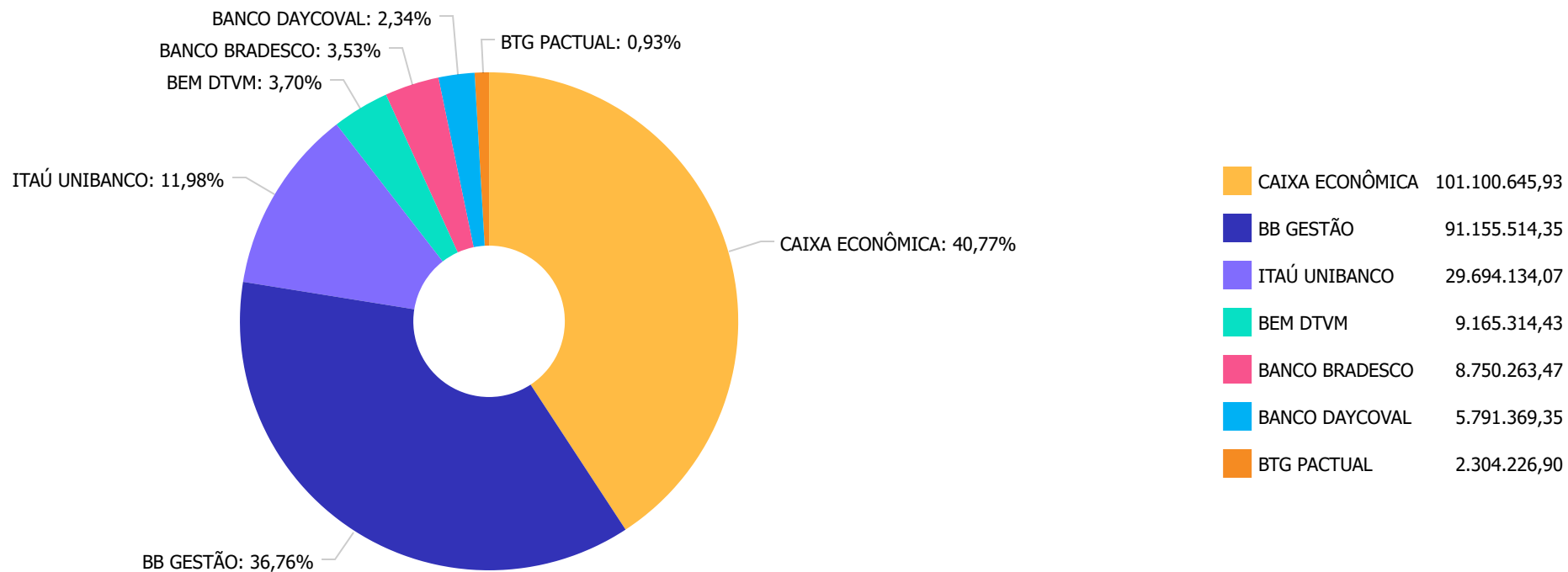
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,74%	-0,42%	2,42%	-3,15%	-26,88%	-25,93%	10,79%	0,27%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	8,60%	9,65%	2,54%	4,73%	-8,09%	6,00%	9,52%	0,25%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	6,88%	9,14%	-0,18%	6,10%	-0,65%	16,67%	7,36%	0,20%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	5,31%	7,98%	-1,49%	-2,31%	-6,76%	7,58%	8,61%	0,23%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	6,89%	3,27%	0,57%	-1,00%	-12,52%	-1,85%	8,92%	0,22%
CDI (Benchmark)	1,17%	7,74%	3,25%	6,16%	10,20%	13,18%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,48%	7,43%	2,60%	5,70%	9,54%	12,49%	0,40%	0,02%
BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	-3,26%	-12,53%	-1,88%	-5,50%	-5,89%	22,69%	9,01%	0,21%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2,21%	7,59%	2,61%	5,35%	7,70%	12,73%	1,19%	0,04%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3,50%	9,03%	3,39%	6,50%	9,15%	14,31%	1,27%	0,05%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3,55%	8,72%	2,75%	4,88%	6,90%	12,24%	2,30%	0,07%
MSCI ACWI (Benchmark)	-4,03%	-24,62%	2,86%	-11,55%	-16,72%	-0,77%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-3,24%	-12,18%	-1,75%	-5,28%	-5,31%	23,21%	9,01%	0,21%
IFIX (Benchmark)	5,76%	6,11%	5,52%	8,58%	8,23%	6,98%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	9,38%	0,98%	9,43%	6,05%	-6,25%	-55,54%	9,95%	0,13%

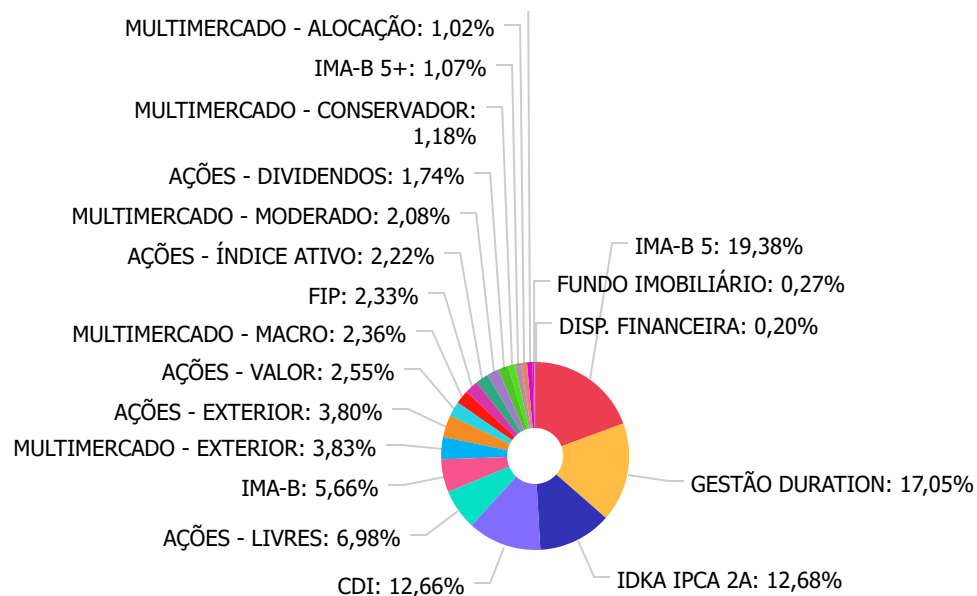
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,05%	-24,45%	5,20%	-10,08%	-15,31%	0,66%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,92%	-25,19%	4,51%	-10,76%	-16,57%	-3,06%	10,67%	0,21%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,02%	-24,46%	3,59%	-10,41%	-14,42%	-0,51%	11,53%	0,21%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,66%	-23,40%	5,48%	-8,91%	-12,80%	2,78%	10,40%	0,21%
MSCI WORLD (Benchmark)	-4,51%	-24,55%	3,09%	-11,16%	-15,78%	1,28%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-1,60%	-21,05%	4,86%	-9,20%	-11,14%	11,29%	11,62%	0,18%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-2,28%	-24,40%	3,62%	-5,03%	-15,78%	10,35%	11,00%	0,22%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU...	-3,23%	-30,94%	4,61%	-12,52%	-28,65%	-	10,15%	0,22%

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



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

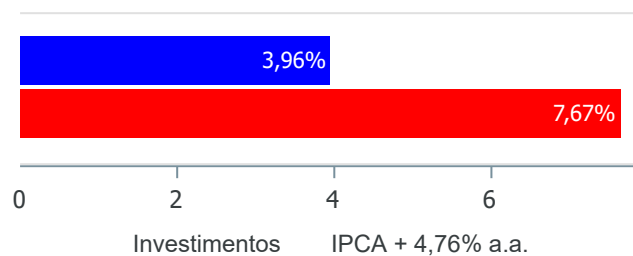


IMA-B 5	48.158.912,89	GESTÃO DURATION	42.370.763,51	IDKA IPCA 2A	31.494.878,36
CDI	31.460.551,27	AÇÕES - LIVRES	17.344.658,79	IMA-B	14.072.313,64
MULTIMERCADO - EXTERIOR	9.505.639,88	AÇÕES - EXTERIOR	9.441.935,76	AÇÕES - VALOR	6.324.230,93
MULTIMERCADO - MACRO	5.869.514,99	FIP	5.791.369,35	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.510.946,20
MULTIMERCADO - MODERADO	5.169.581,51	AÇÕES - DIVIDENDOS	4.329.107,95	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.942.340,88
IMA-B 5+	2.665.325,03	MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.537.460,95	CRÉDITO PRIVADO	2.290.936,61
FUNDO IMOBILIÁRIO	681.000,00	DISP. FINANCEIRA	488.216,48		

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	234.424.707,43	301.328,19	1.922.133,74	233.102.202,87	298.300,99	298.300,99	0,13%	0,13%	0,93%	0,93%	13,68%	2,91%
Fevereiro	233.102.202,87	2.294.202,82	1.691.855,28	233.963.724,78	259.174,37	557.475,36	0,11%	0,24%	1,36%	2,30%	10,35%	2,48%
Março	233.963.724,78	2.073.902,96	1.506.737,15	239.626.015,70	5.095.125,11	5.652.600,47	2,17%	2,42%	2,03%	4,38%	55,17%	3,30%
Abril	239.626.015,70	1.735.458,24	1.200.318,08	237.629.164,87	-2.531.990,99	3.120.609,48	-1,05%	1,34%	1,41%	5,86%	22,82%	2,68%
Mai	237.629.164,87	2.341.100,39	1.731.913,55	240.240.405,17	2.002.053,46	5.122.662,94	0,84%	2,19%	0,88%	6,79%	32,24%	3,08%
Junho	240.240.405,17	16.967.767,55	16.047.582,44	237.419.044,02	-3.741.546,26	1.381.116,68	-1,55%	0,60%	1,06%	7,92%	7,61%	3,02%
Julho	237.419.044,02	32.696.880,63	31.940.725,22	241.844.271,68	3.669.072,25	5.050.188,93	1,54%	2,15%	-0,29%	7,60%	28,31%	2,77%
Agosto	241.844.271,68	4.006.005,05	4.749.061,35	245.381.866,96	4.280.651,58	9.330.840,51	1,77%	3,96%	0,06%	7,67%	51,63%	3,16%

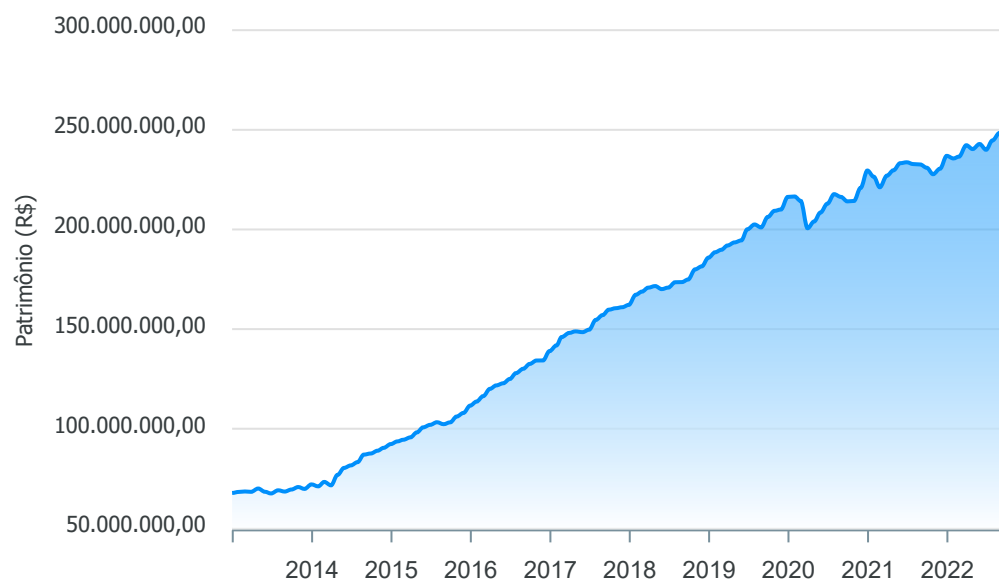
Investimentos x Meta de Rentabilidade



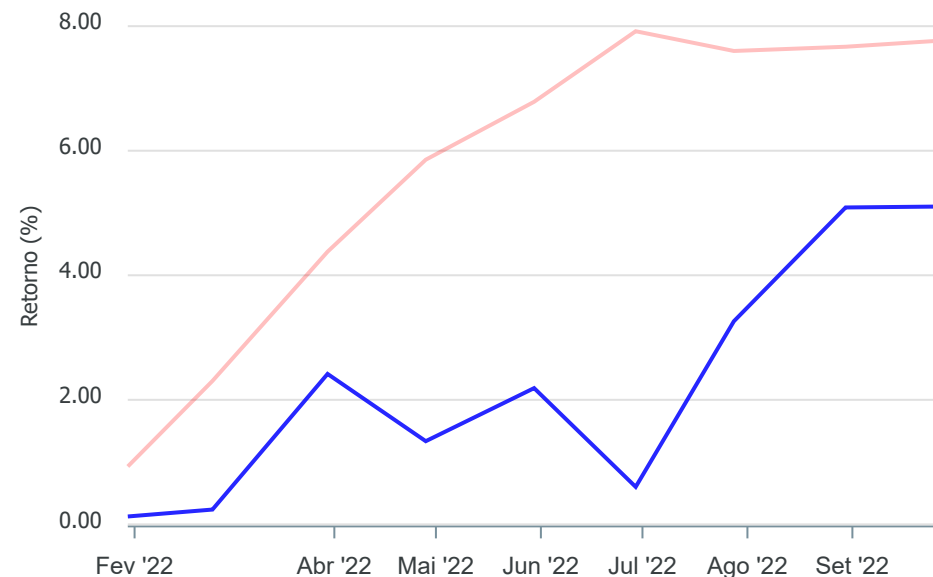
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	11.004.200,76	0,00	0,00	11.166.249,89	162.049,13	1,47%	1,47%	0,58%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.259.019,36	0,00	0,00	5.328.150,82	69.131,46	1,31%	1,31%	1,41%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	581.899,71	0,00	2.193,44	586.451,01	6.744,74	1,16%	1,16%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	21.424.309,38	0,00	0,00	21.670.213,14	245.903,76	1,15%	1,15%	1,07%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.746.133,13	0,00	0,00	4.797.203,89	51.070,76	1,08%	1,08%	3,18%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.007.560,05	0,00	44.882,03	973.378,75	10.700,73	1,06%	-3,39%	8,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	2.471.206,06	0,00	70.642,98	2.426.742,32	26.179,24	1,06%	1,01%	4,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	4.385.962,35	0,00	0,00	4.425.412,47	39.450,12	0,90%	0,90%	0,33%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	6.789.680,38	0,00	0,00	6.848.367,43	58.687,05	0,86%	0,86%	3,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.664.151,09	4.098.174,29	2.940.997,57	4.872.473,14	51.145,33	0,66%	1,08%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	2.508.605,29	0,00	0,00	2.524.727,00	16.121,71	0,64%	0,64%	0,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.180.646,77	0,00	0,00	4.206.149,66	25.502,89	0,61%	0,61%	1,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.484.416,77	0,00	1.493.211,50	0,00	8.794,73	0,59%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	2.984.361,19	0,00	0,00	3.000.139,39	15.778,20	0,53%	0,53%	3,12%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.289.656,88	0,00	0,00	2.290.936,61	1.279,73	0,06%	0,06%	1,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	11.650.218,92	0,00	0,00	11.655.765,66	5.546,74	0,05%	0,05%	1,30%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.145.967,29	0,00	0,00	14.146.832,24	864,95	0,01%	0,01%	1,32%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.741.382,21	0,00	49.483,20	1.691.946,28	47,27	0,00%	-2,84%	4,45%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	10.602.642,10	0,00	0,00	10.597.917,56	-4.724,54	-0,04%	-0,04%	1,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	20.919.711,17	0,00	0,00	20.896.960,80	-22.750,37	-0,11%	-0,11%	1,43%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.061.399,40	0,00	211.098,42	6.840.342,86	-9.958,12	-0,14%	-3,13%	5,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	9.625.438,44	0,00	0,00	9.611.843,19	-13.595,25	-0,14%	-0,14%	0,55%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.078.587,43	0,00	0,00	19.051.487,65	-27.099,78	-0,14%	-0,14%	0,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	2.992.994,17	0,00	84.518,99	2.903.989,55	-4.485,63	-0,15%	-0,17%	1,45%
Total Renda Fixa	172.600.150,30	4.098.174,29	4.897.028,13	172.513.681,31	712.384,85	0,41%		1,50%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRASIL AGRO II FIP MULTISTRATÉGIA	4.020.355,03	0,00	0,00	5.791.369,35	1.771.014,32	44,05%	-	-
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.880.339,94	0,00	0,00	3.127.963,56	247.623,62	8,60%	8,60%	9,52%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	630.000,00	0,00	0,00	681.000,00	51.000,00	8,10%	9,38%	9,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.604.336,09	0,00	0,00	2.800.319,08	195.982,99	7,53%	7,53%	9,76%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	2.226.360,08	0,00	0,00	2.382.982,64	156.622,56	7,03%	7,03%	8,86%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.105.490,67	0,00	0,00	3.319.427,48	213.936,81	6,89%	6,89%	8,92%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.419.303,12	0,00	0,00	3.654.368,23	235.065,11	6,87%	6,87%	7,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	2.299.022,42	0,00	0,00	2.456.263,01	157.240,59	6,84%	6,84%	9,81%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.637.604,70	0,00	0,00	2.810.054,09	172.449,39	6,54%	6,54%	7,56%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.179.188,15	0,00	0,00	2.304.226,90	125.038,75	5,74%	5,74%	10,79%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.873.341,76	0,00	0,00	1.972.812,87	99.471,11	5,31%	5,31%	8,61%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.153.448,31	0,00	0,00	4.351.418,06	197.969,75	4,77%	4,77%	9,11%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4.180.508,88	0,00	0,00	4.329.107,95	148.599,07	3,55%	3,55%	6,78%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.450.485,73	0,00	0,00	2.537.460,95	86.975,22	3,55%	3,55%	2,30%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	4.994.956,38	0,00	0,00	5.169.581,51	174.625,13	3,50%	3,50%	1,27%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.742.446,58	0,00	0,00	5.869.514,99	127.068,41	2,21%	2,21%	1,19%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.899.441,03	0,00	0,00	2.942.340,88	42.899,85	1,48%	1,48%	0,40%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.136.989,22	0,00	0,00	3.036.390,32	-100.598,90	-3,21%	-3,21%	8,98%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.138.777,40	0,00	0,00	2.069.498,81	-69.278,59	-3,24%	-3,24%	9,01%
BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	1.919.277,67	0,00	0,00	1.856.634,33	-62.643,34	-3,26%	-3,26%	9,01%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.936.628,59	0,00	0,00	1.871.899,49	-64.729,10	-3,34%	-3,34%	8,60%
Total Renda Variável	61.428.301,75	0,00	0,00	65.334.634,50	3.906.332,75	6,36%		6,67%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.818.637,24	0,00	0,00	1.789.468,95	-29.168,29	-1,60%	-1,60%	11,62%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	1.789.030,69	0,00	0,00	1.748.251,57	-40.779,12	-2,28%	-2,28%	11,00%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	778.781,83	0,00	0,00	753.647,47	-25.134,36	-3,23%	-3,23%	10,15%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.624.867,27	0,00	0,00	1.565.478,32	-59.388,95	-3,66%	-3,66%	10,40%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.208.944,67	0,00	0,00	2.122.462,01	-86.482,66	-3,92%	-3,92%	10,67%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.223.298,16	0,00	0,00	2.133.844,37	-89.453,79	-4,02%	-4,02%	11,53%
Total Exterior	10.443.559,86	0,00	0,00	10.113.152,69	-330.407,17	-3,16%		11,00%

Disclaimer

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

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

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

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

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

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

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

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