

2022 Relatório Mensal

Julho

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MPS nº 519 de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V, e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.2, ítem 3.2.6, aprovado pela Portaria SPREV nº 3030, de 15 de Março de 2021.



Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.423.269.66	3,88%	158.438.013,43	5,95%	7º l b
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.975.839,38	5,76%	4.928.627.960,16	0,28%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	26.288.523,36	10,84%	6.564.821.510,69	0,40%	7º l b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.865.166,44	11,49%	749.544.414,58	3,72%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.576.914,53	2,30%	5.189.858.068,29	0,11%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.156.324,82	2,13%	3.068.003.584,32	0,17%	7º I b
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	970.210,13	0,40%	3.541.984.553,06	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.448.086,45	0,60%	473.736.972,65	0,31%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.654.712,25	3,57%	6.217.671.822,00	0,14%	7° I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.237.212,58	7,52%	10.426.166.067,57	0,17%	7° I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.628.042,58	6,44%	1.156.132.227,79	1,35%	7° I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.335.140,75	4,67%	3.885.055.392,30	0,29%	7º I b
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	5.086.399,24	2,10%	156.141.056,14	3,26%	7º III a
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	8.163.706,44	3,36%	178.168.466,21	4,58%	7º III a
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.701.857,71	3,59%	3.228.816.159,93	0,27%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.536.900,31	0,63%	1.538.685.373,47	0,10%	8º I
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.555.327,61	3,11%	1.409.031.482,53	0,54%	8º I
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2.674.139,55	1,10%	839.233.210,18	0,32%	8º I
BB I INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	4.822.886,93	1,99%	260.202.991,96	1,85%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.534.703,32	1,46%	662.923.806,58	0,53%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	5.855.087,23	2,41%	481.284.828,56	1,22%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	228.533,22	0,09%	230.324.731,46	0,10%	8º I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	2.193.734,84	0,90%	592.084.307,09	0,37%	8º I
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	16.810.476,58	6,93%	908.139.368,81	1,85%	8º I
OCCAM FIC AÇÕES	858.672,73	0,35%	996.020.408,79	0,09%	8º I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	809.691,79	0,33%	321.106.658,19	0,25%	8º I
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	2.269.208,19	0,94%	1.085.261.572,86	0,21%	8º I

## Investimentos

242.621.826,20

# Disponibilidades Financeiras

\$ 1.246.156,22

## Total Carteira

243.867.982,42

# Governança (Pró Gestão)

Não possui



Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5.605.180,97	2,31%	513.986.694,29	1,09%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.753.992,47	5,67%	2.340.707.282,75	0,59%	9º III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.106.021,68	1,69%	2.180.940.739,20	0,19%	10° I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1.946.126,40	0,80%	122.731.667,21	1,59%	10° I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	744.596,06	0,31%	155.972.117,32	0,48%	10° I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	805.140,00	0,33%	99.272.880,00	0,81%	11°

### Investimentos

242.621.826,20

# Disponibilidades Financeiras

\$ 1.246.156,22

## Total Carteira

\$ 243.867.982,42

# Governança (Pró Gestão)

Não possui



Artigos	Limite (%) Utilizado			Livre	Polític	GAP Superior			
Artigos	Liffile (%)	Liffile (%) Utilizado		Livie			Inferior % Alvo %		GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	0,00%	0,00	100,00%	242.621.826,20	0,00%	10,00%	100,00%	242.621.826,20
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	59,58%	144.559.442,93	40,42%	98.062.383,27	0,00%	40,00%	100,00%	98.062.383,27
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	9,05%	21.951.963,39	50,95%	123.621.132,33	0,00%	10,00%	60,00%	123.621.132,33
8º I - Fundos de Ações	30,00%	20,26%	49.149.362,30	9,74%	23.637.185,56	0,00%	26,00%	30,00%	23.637.185,56
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	7,98%	19.359.173,44	2,02%	4.903.009,18	0,00%	10,00%	10,00%	4.903.009,18
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	2,80%	6.796.744,14	7,20%	17.465.438,48	0,00%	3,00%	10,00%	17.465.438,48
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,33%	805.140,00	4,67%	11.325.951,31	0,00%	1,00%	5,00%	11.325.951,31

Renda Fixa	
\$ 166.511.406,32	68,63%
Renda Variavel	
\$ 49.149.362,30	20,26%
Estruturados	
\$ 6.796.744,14	2,80%
Fundo Imobiliário	
\$ 805.140,00 0	,33%
Exterior	
\$ 19.359.173,44	7.98%

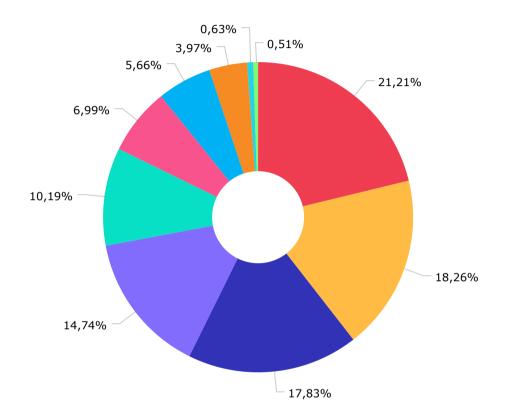


	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,73	6,00	2,63	5,41	7,68	8,19	0,36	0,77
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41	4,13	1,56	4,09	4,69	5,26	0,88	1,86
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10,11	-9,24	2,53	-4,16	1,13	36,18	8,96	18,88
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,01	-10,54	-0,49	-6,91	-5,18		7,93	16,70
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,88	-22,14	3,94	-13,74	-11,05	16,19	11,49	24,21
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-0,44	-7,68	-3,11	-8,03	-15,15	-63,58	5,09	10,71
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	4,42	-2,68	-5,19	-8,79	-17,73	-1,62	8,11	17,09
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5,11	-3,38	-4,45	-8,61	-20,44	-11,34	7,37	15,53
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	-0,88						9,77	20,57
CDI - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05		
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,04	6,80	3,23	6,00	10,06	13,98	0,03	0,07
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,02	6,35	3,05	5,60	9,14	11,44	0,00	0,00
IBOVESPA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25		
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	9,67	5,79	-1,62	4,39	-0,85	42,47	11,76	24,77
OCCAM FIC AÇÕES	3,41	-0,75	-2,76	-6,82	-13,67	-1,97	7,13	15,02
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	4,63	-1,46	-4,21	-7,84	-15,24	0,04	7,60	16,00
BB I INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	4,61	-2,16	-4,56	-8,46	-16,05	-1,63	7,67	16,15
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	4,23	-5,16	-6,69	-11,78	-19,61	-9,35	7,77	16,37
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,46	-5,79	-3,69	-10,19	-35,41	-30,12	8,50	17,90
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1,54		-0,19	-2,83			2,08	4,38
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	-2,79						4,90	10,33
BX - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	4,40	-1,57	-4,69	-7,90	-16,32	1,03		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3,78	-8,64	-8,63	-10,99	-23,76	-12,16	6,00	12,64



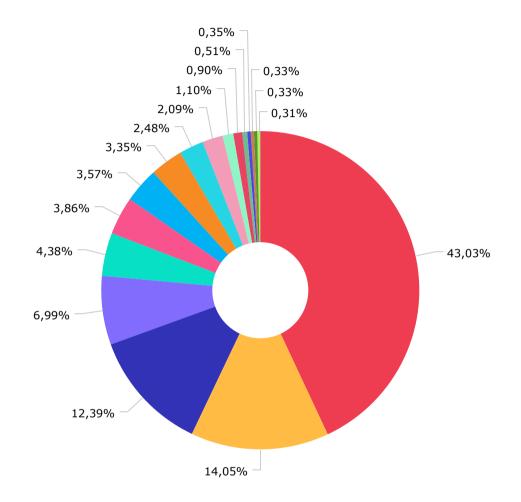
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
	ivies	Allo	JIVI	Olvi	IZIVI	24101	vart - Ivies	voiatilidade - ivies
IDIV - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	1,98	6,66	-2,58	-0,76	-0,49	13,65		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,85	5,97	-2,86	-1,18	-2,31	8,41	6,27	13,20
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	3,36	4,73	-3,06	-3,75	-6,73	7,17	6,40	13,48
IMA-B - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-0,88	3,43	-0,28	4,20	3,25	5,86		
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,33	2,93	0,78	2,97	3,22	1,24	1,51	3,18
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
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	-1,16	3,00	-0,48	3,68	1,80	-1,46	2,64	5,55
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,02	2,53	-0,39	3,51	-0,27	-3,34	2,62	5,53
IMA-B 5 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	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
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	6,47	1,09	6,39	9,71	14,96	1,22	2,56
IMA-B 5+ - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-1,84	0,16	-1,79	1,79	-3,22	-2,89		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,86	-0,04	-1,86	1,62	-3,54	-3,55	3,92	8,26
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,91	0,00	-1,88	1,65	-3,73	-3,54	3,99	8,41
IPCA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-0,68	4,77	0,46	4,21	10,07	19,97		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08	7,21	0,92	7,11	10,41	15,65	0,76	1,61
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,79	5,41	2,09	4,71	5,36	6,31	0,99	2,08





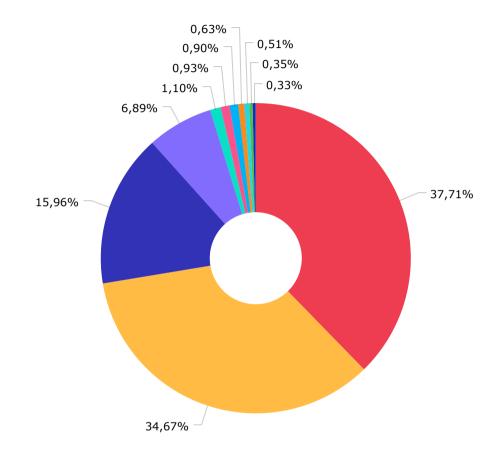
Não definido	51.735.151,45
IMA-B 5	44.525.735,94
IMA-B 5+	43.493.209,02
IMA-B	35.947.117,83
Ibovespa	24.861.596,94
IDIV	17.039.009,80
IPCA	13.811.037,07
CDI	9.672.067,84
IBX	1.536.900,31
Disponibilidades Financeiras	1.246.156,22





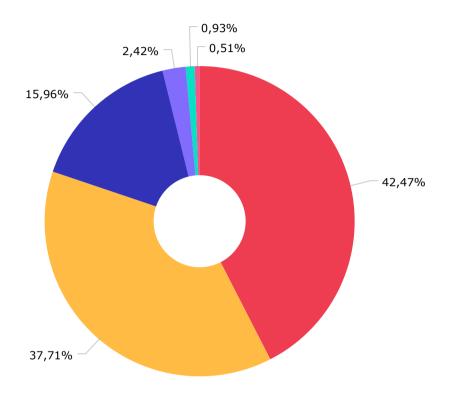
Renda Fixa Indexados	104.931.000,24
Ações Livre	34.255.312,87
Renda Fixa Duração Livre Soberano	30.205.173,03
Ações Dividendos	17.039.009,80
Ações Indexados	10.677.974,16
Renda Fixa Duração Alta Soberano	9.423.269,66
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	8.701.857,71
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	8.163.706,44
Multimercados Livre	6.052.148,08
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	5.086.399,24
Ações Sustentabilidade/Governança	2.674.139,55
Fundos de Mono Ação	2.193.734,84
Disponibilidades Financeiras	1.246.156,22
Ações Valor/Crescimento	858.672,73
Ações Índice Ativo	809.691,79
FII TVM Gestão Ativa	805.140,00
Não classificado	744.596,06

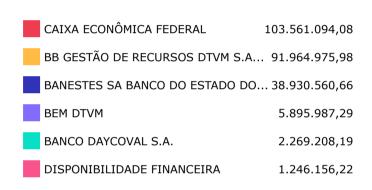


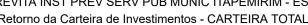


BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A	91.964.975,98
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	84.556.882,66
BANESTES DISTRIBUIDORA DE TITU	38.930.560,66
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU	16.810.476,58
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	2.690.722,46
TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA	2.269.208,19
CAIXA DTVM	2.193.734,84
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	1.536.900,31
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.246.156,22
OCCAM BRASIL GESTAO DE RECURSO	858.672,73
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	809.691,79



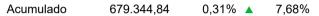


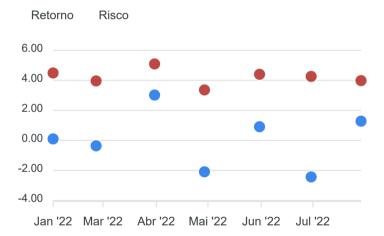




0	Mais	7	Val	lia
	Consultoria			

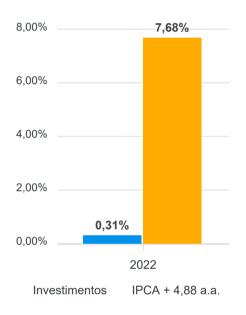
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	232.069.557,82	4.607.647,27	6.757.029,00	230.155.645,41	235.469,32	0,10% 🔺	0,94%	4,49%
Fevereiro	230.155.645,41	7.000.000,00	5.006.517,80	231.302.578,54	-846.549,07	-0,36% 🔻	1,37%	3,96%
Março	231.302.578,54	7.233.576,52	5.412.495,27	240.168.733,78	7.045.073,99	3,02% 🔺	2,04%	5,09%
Abril	240.168.733,78	4.597.513,48	836.517,80	238.819.569,69	-5.110.159,77	-2,09% 🔻	1,42%	3,36%
Maio	238.819.569,69	3.160.000,00	1.747.953,86	242.416.371,77	2.184.755,94	0,91% 🔺	0,89%	4,40%
Junho	242.416.371,77	2.000.000,00	2.000.000,00	236.514.523,13	-5.901.848,64	-2,43% 🔻	1,07%	4,26%
Julho	236.514.523,13	5.634.700,00	2.600.000,00	242.621.826,20	3.072.603,07	1,28% 🔺	-0,28%	3,98%













RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
		, ,			*		
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	5.049.573,57	0,00	0,00	5.086.399,24	36.825,67	0,73% 🔺	0,36%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.520.445,41	0,00	0,00	9.423.269,66	-97.175,75	<b>-1,02%</b> ▼	2,62%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	8.259.135,20	0,00	0,00	8.163.706,44	-95.428,76	-1,16% <b>▼</b>	2,64%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.586.815,39	3.634.700,00	600.000,00	8.701.857,71	80.342,32	0,87% 🔺	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.919.457,16	0,00	0,00	13.975.839,38	56.382,22	0,41% 🔺	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	26.289.315,04	0,00	0,00	26.288.523,36	-791,68	0,00% 🔻	1,22%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.391.928,80	0,00	0,00	27.865.166,44	-526.762,36	-1,86% <b>▼</b>	3,92%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.626.741,64	0,00	0,00	5.576.914,53	-49.827,11	-0,89% 🔻	2,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.152.314,45	0,00	0,00	5.156.324,82	4.010,37	0,08% 🔺	0,76%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	960.454,72	0,00	0,00	970.210,13	9.755,41	1,02% 🔺	0,00%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.452.827,27	0,00	0,00	1.448.086,45	-4.740,82	-0,33% 🔻	1,51%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.587.207,71	0,00	0,00	8.654.712,25	67.504,54	0,79% 🔺	0,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.233.442,52	0,00	0,00	18.237.212,58	3.770,06	0,02% 🔺	1,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.931.637,59	0,00	0,00	15.628.042,58	-303.595,01	-1,91% <b>▼</b>	3,99%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.440.950,01	0,00	0,00	11.335.140,75	-105.809,26	-0,92% 🔻	2,47%
	164.402.246,48	3.634.700,00	600.000,00	166.511.406,32	-925.540,16	-0,55%	2,06%



RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.480.964,59	0,00	0,00	1.536.900,31	55.935,72	3,78% 🔺	6,00%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.966.016,85	0,00	0,00	7.555.327,61	589.310,76	8,46% 🔺	8,50%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	4.529.859,95	0,00	2.000.000,00	2.674.139,55	144.279,60	3,19% 🔺	8,11%
BB I INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	4.610.473,25	0,00	0,00	4.822.886,93	212.413,68	4,61% 🔺	7,67%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.362.945,55	0,00	0,00	3.534.703,32	171.757,77	5,11% 🔺	7,37%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	5.595.913,19	0,00	0,00	5.855.087,23	259.174,04	4,63% 🔺	7,60%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	224.391,74	0,00	0,00	228.533,22	4.141,48	1,85% 🔺	6,27%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	2.213.115,89	0,00	0,00	2.193.734,84	-19.381,05	-0,88% ▼	9,77%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.729.165,55	0,00	0,00	4.106.021,68	376.856,13	10,11% 🔺	8,96%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	808.718,40	0,00	0,00	805.140,00	-3.578,40	-0,44% 🔻	5,09%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	16.263.727,48	0,00	0,00	16.810.476,58	546.749,10	3,36% 🔺	6,40%
OCCAM FIC AÇÕES	830.378,93	0,00	0,00	858.672,73	28.293,80	3,41% 🔺	7,13%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1.916.589,90	0,00	0,00	1.946.126,40	29.536,50	1,54% 🔺	2,08%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	765.975,19	0,00	0,00	744.596,06	-21.379,13	-2,79% 🔻	4,90%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	776.825,53	0,00	0,00	809.691,79	32.866,26	4,23% 🔺	7,77%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.269.208,19	269.208,19	13,46% 🔺	11,76%
-	54.075.061,99	2.000.000,00	2.000.000,00	56.751.246,44	2.676.184,45	4,95%	7,41%





INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5.287.520,84	0,00	0,00	5.605.180,97	317.660,13	6,01% 🔺	7,93%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12.749.693,82	0,00	0,00	13.753.992,47	1.004.298,65	7,88% 🔺	11,49%
	18.037.214,66	0,00	0,00	19.359.173,44	1.321.958,78	7,33%	2,30%





<u>29/07/2022</u>

#### 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 mantem 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 mantem 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, mantem 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, 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, 16 de agosto de 2022.

Mais Valia Consultoria Ltda EPP