



Estado de Rondônia
PREFEITURA MUNICIPAL DE JI-PARANÁ
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DE JI-PARANÁ

RELATÓRIO ANALÍTICO DOS INVESTIMENTOS INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DE JI-PARANÁ

Publicação do resultado da Carteira de Investimento do Fundo de Previdência Social de Ji-Paraná em **Julho de 2022**, disponibilizado pela Diretoria Executiva do Instituto de Previdência dos Servidores de Ji-Paraná.

AGOSTINHO CASTELLO BRANCO FILHO
Certificação APIMEC – CGRPPS n. 4873
Presidente do IPREJI
Decreto n. 1166/GAB/PM/JP/2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2022)

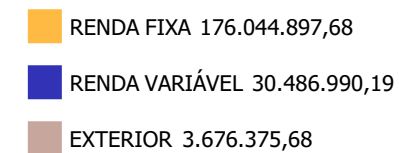
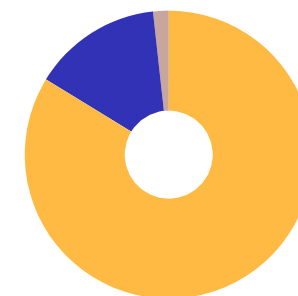
| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|---------|------------|---------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 463 dias | 457.163,72 | 0,22% | 245 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | 15/08/2024 | 470.561,19 | 0,22% | 209 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | D+0 | Não há | 6.852,46 | 0,00% | 321 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | D+0 | Não há | 37.744.278,57 | 17,96% | 837 | 0,61% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 28.290.828,43 | 13,46% | 1.066 | 0,27% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 21.192.511,55 | 10,08% | 1.015 | 0,20% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0 | Não há | 8.498.279,23 | 4,04% | 264 | 0,74% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0 | Não há | 1.183.029,57 | 0,56% | 786 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 5.004.988,06 | 2,38% | 1.167 | 0,10% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0 | Não há | 2.750.035,71 | 1,31% | 198 | 0,36% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0 | Não há | 777.293,17 | 0,37% | 246 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P... | D+3 | Não há | 1.008.205,89 | 0,48% | 533 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 11.105.060,27 | 5,28% | 215 | 0,31% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | D+1 | Não há | 611.112,24 | 0,29% | 131 | 0,07% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 18.244.973,72 | 8,68% | 959 | 0,14% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 13.388.858,31 | 6,37% | 236 | 0,36% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 12.790.270,89 | 6,08% | 596 | 0,07% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | D+1800 | Não há | 12.520.594,70 | 5,96% | 18 | 15,08% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | D+15 | Não há | 3.717.987,76 | 1,77% | 182 | 0,63% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES | D+3 du | Não há | 2.190.199,12 | 1,04% | 17.175 | 0,37% | Artigo 8º, Inciso I |

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2022)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|------------|---------------|-----------------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------|
| CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | D+4 | Não há | 857.548,63 | 0,41% | 2.358 | 1,03% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+4 | Não há | 3.676.375,68 | 1,75% | 517 | 0,16% | Artigo 9º, Inciso III |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L... | D+15 | Não há | 3.928.431,92 | 1,87% | 131 | 0,49% | Artigo 10º, Inciso I |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M... | D+2 du | 720 dias | 8.010.910,87 | 3,81% | 582 | 4,99% | Artigo 10º, Inciso I |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | D+1 | Não há | 7.506.029,78 | 3,57% | 11.377 | 0,34% | Artigo 10º, Inciso I |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP | D+0 | Não há | 2.091.656,18 | 1,00% | 3.368 | 0,24% | Artigo 10º, Inciso I |
| CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11 | Não se ... | Não se aplica | 0,02 | 0,00% | | 0,00% | Artigo 10º, Inciso II |
| AQ3 RENDA FII - ARFI11B | Não se ... | Não se aplica | 2.184.225,91 | 1,04% | | 1,73% | Artigo 11º |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | D+0 | | 123,59 | 0,00% | | 0,00% | DF - Artigo 6º |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 210.208.263,55 | | | | |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | | | 123,59 | | | | Artigo 6º |
| PL Total | | | 210.208.387,14 | | | | |

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

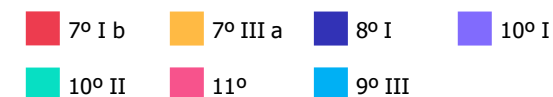
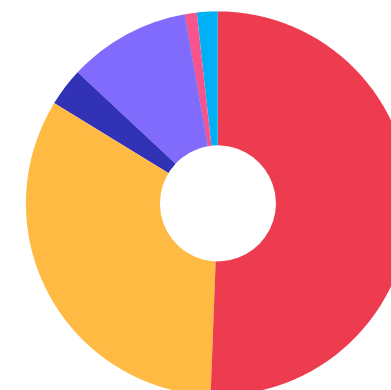
| Artigos - Renda Fixa | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2022 | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|----------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 9,40% | 59,24% | 124.527.375,33 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 106.375.821,66 | 50,60% | 22,43% | 35,40% | 71,24% | 43.376.545,29 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00% | 69.669.076,02 | 33,14% | 0,00% | 13,00% | 50,00% | 35.435.055,76 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 2,25% | 13,00% | 20,00% | 42.041.652,71 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 176.044.897,68 | 83,75% | 24,68% | 70,80% | 200,48% | |



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

| Artigos - Renda Variável | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2022 | | | GAP Superior |
|-----------------------------|---------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 6.765.735,51 | 3,22% | 15,00% | 19,00% | 20,00% | 35.275.917,20 |
| Artigo 8º, Inciso II | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 3,40% | 20,00% | 42.041.652,71 |
| Artigo 10º, Inciso I | 10,00% | 21.537.028,75 | 10,25% | 1,50% | 2,00% | 10,00% | -516.202,40 |
| Artigo 10º, Inciso II | 5,00% | 0,02 | 0,00% | 0,00% | 2,40% | 5,00% | 10.510.413,16 |
| Artigo 11º | 5,00% | 2.184.225,91 | 1,04% | 0,00% | 2,40% | 5,00% | 8.326.187,27 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 30.486.990,19 | 14,50% | 16,50% | 29,20% | 60,00% | |

| Artigos - Exterior | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2022 | | | GAP Superior |
|-----------------------|---------------|---------------------|--------------|--|--------------|---------------|---------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00% | 3.676.375,68 | 1,75% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 17.344.450,68 |
| Total Exterior | 10,00% | 3.676.375,68 | 1,75% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | |



Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2022)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|----------------|---------------|----------------|
| CAIXA DTVM | 194.495.237,03 | 92,53 | 0,66 |
| VERITAS CAPITAL MANAGEMENT | 12.520.594,70 | 5,96 | 0,42 |
| REDITUS INVESTIMENTOS | 2.184.225,91 | 1,04 | 32,82 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 1.008.205,89 | 0,48 | - |
| ÍNDIGO DTVM | 0,02 | 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 | 59,24 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 106.375.821,66 | 50,60 | 22,43 | 71,24 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 69.669.076,02 | 33,14 | 0,00 | 50,00 |
| Artigo 8º, Inciso I | 6.765.735,51 | 3,22 | 15,00 | 20,00 |
| Artigo 8º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20,00 |
| Artigo 10º, Inciso I | 21.537.028,75 | 10,25 | 1,50 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso II | 0,02 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 11º | 2.184.225,91 | 1,04 | 0,00 | 5,00 |

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|------------------|
| 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% | 0,04% |
| IRF-M 1+ (Benchmark) | 1,20% | 1,94% | 1,68% | 2,45% | 1,01% | -2,37% | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,15% | 1,77% | 1,57% | 2,32% | 0,67% | -2,96% | 2,32% | 0,05% |
| IMA-B 5+ (Benchmark) | -1,84% | 0,16% | -1,79% | 1,79% | -3,22% | -2,89% | - | - |
| 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% | 0,08% |
| 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% | 0,01% |
| IMA-B 5 (Benchmark) | 0,01% | 6,62% | 1,13% | 6,50% | 10,04% | 15,61% | - | - |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | -0,32% | 3,18% | 0,79% | 3,21% | 3,47% | 1,48% | 1,51% | 0,06% |
| 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% | 0,04% |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 18,15% | -9,89% | 11,93% | -9,58% | -49,13% | -56,26% | 32,02% | 0,49% |
| IMA-B (Benchmark) | -0,88% | 3,43% | -0,28% | 4,20% | 3,25% | 5,86% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -0,93% | 3,29% | -0,35% | 4,08% | 2,97% | 5,33% | 2,47% | 0,06% |

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|-------|--------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IRF-M (Benchmark) | 1,15% | 3,36% | 2,11% | 3,45% | 3,42% | 1,97% | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,12% | 3,29% | 2,07% | 3,37% | 3,25% | 1,57% | 1,47% | 0,04% |
| CDI (Benchmark) | 1,03% | 6,49% | 3,11% | 5,72% | 9,39% | 12,05% | - | - |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 0,90% | 5,54% | 2,69% | 4,90% | 7,81% | 9,49% | 0,00% | 0,01% |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,02% | 6,35% | 3,05% | 5,60% | 9,14% | 11,44% | 0,00% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 1,01% | 6,66% | 3,18% | 5,83% | 9,79% | 12,43% | 0,03% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | 1,03% | 6,77% | 3,19% | 5,88% | 9,85% | 12,51% | 0,01% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,02% | 6,60% | 3,15% | 5,76% | 9,53% | 11,70% | 0,02% | 0,01% |
| IPCA (Benchmark) | -0,68% | 4,77% | 0,46% | 4,21% | 10,07% | 19,97% | - | - |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 0,62% | 5,60% | 1,98% | 4,75% | 6,22% | 6,99% | 1,42% | 0,02% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,64% | 4,97% | 2,04% | 4,77% | 6,06% | 7,29% | 0,65% | 0,02% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 0,79% | 5,41% | 2,09% | 4,71% | 5,36% | 6,31% | 0,99% | 0,03% |
| Não definido (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,08% | - | -2,36% | - | - | - | 0,76% | - |

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|---------|--------|---------|---------|--------|---------|------------------|
| Global BDRX (Benchmark) | 7,65% | -22,08% | 3,82% | -13,58% | -10,66% | 19,00% | - | - |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 7,88% | -22,14% | 3,94% | -13,74% | -11,05% | 16,19% | 11,49% | 0,21% |
| IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark) | 0,00% | 9,80% | 2,56% | 8,48% | 19,39% | 41,09% | - | - |
| CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Ibovespa (Benchmark) | 4,69% | -1,58% | -4,37% | -8,01% | -15,30% | 0,25% | - | - |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 4,16% | 0,39% | -3,94% | -1,00% | -7,27% | 18,96% | 6,99% | 0,18% |
| CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | 4,39% | -3,79% | -8,16% | -10,65% | -20,47% | -7,72% | 7,59% | 0,22% |
| CDI (Benchmark) | 1,03% | 6,49% | 3,11% | 5,72% | 9,39% | 12,05% | - | - |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 0,72% | 5,34% | 0,87% | 3,86% | 4,80% | 10,19% | 2,10% | 0,04% |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP | 0,86% | 7,39% | 3,05% | 6,30% | 10,34% | 12,42% | 0,31% | 0,01% |
| 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% | 0,21% |
| IFIX (Benchmark) | 0,66% | 0,33% | 0,04% | 1,34% | -0,35% | 2,96% | - | - |
| AQ3 RENDA FII - ARFI11B | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |

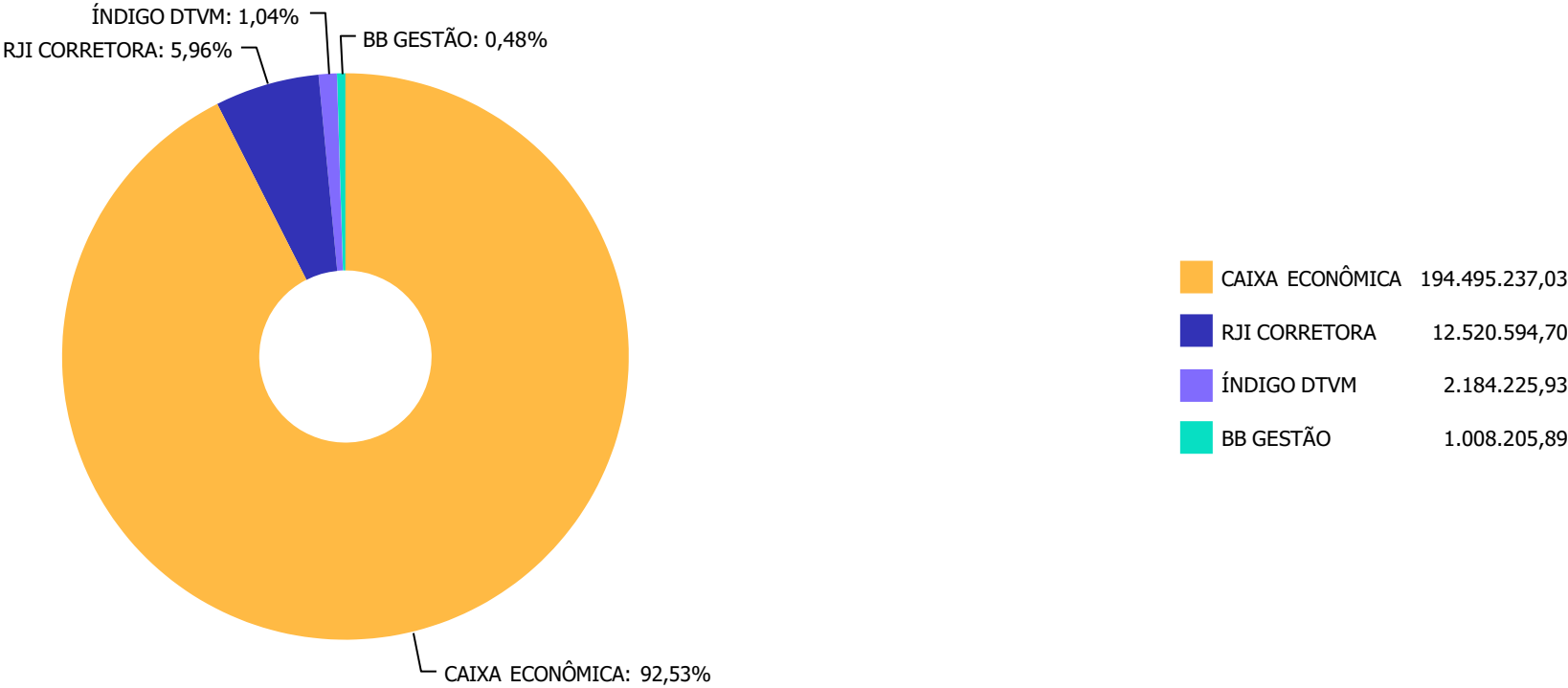
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2022 - RENDA VARIÁVEL

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---------------------------|--------|-----|----|----|-----|-----|---------|------------------|
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES | -0,88% | - | - | - | - | - | 9,77% | - |

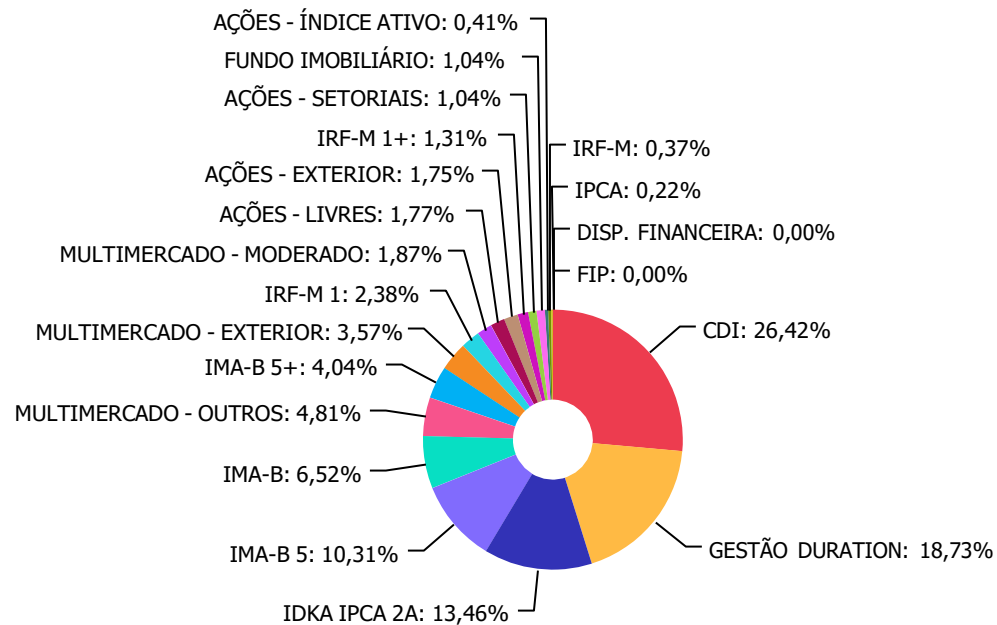
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|---------|-------|---------|---------|--------|---------|------------------|
| Global BDRX (Benchmark) | 7,65% | -22,08% | 3,82% | -13,58% | -10,66% | 19,00% | - | - |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 7,88% | -22,14% | 3,94% | -13,74% | -11,05% | 16,19% | 11,49% | 0,21% |

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



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

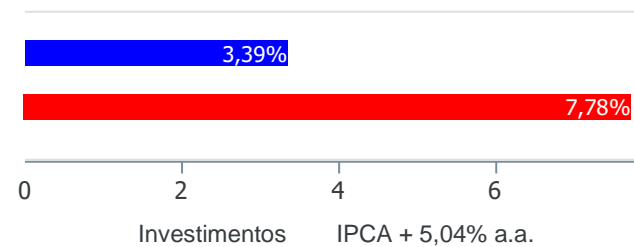


| | | | | | | | |
|------------|---------------|---------------------------|---------------|---------------------|---------------|---------------------------|---------------|
| ■ CDI | 55.536.015,65 | ■ GESTÃO DURATION | 39.363.596,70 | ■ IDKA IPCA 2A | 28.290.828,43 | ■ IMA-B 5 | 21.663.072,74 |
| ■ IMA-B | 13.703.624,27 | ■ MULTIMERCADO - OUTROS | 10.102.567,05 | ■ IMA-B 5+ | 8.498.279,23 | ■ MULTIMERCADO - EXTERIOR | 7.506.029,78 |
| ■ IRF-M 1 | 5.004.988,06 | ■ MULTIMERCADO - MODERADO | 3.928.431,92 | ■ AÇÕES - LIVRES | 3.717.987,76 | ■ AÇÕES - EXTERIOR | 3.676.375,68 |
| ■ IRF-M 1+ | 2.750.035,71 | ■ AÇÕES - SETORIAIS | 2.190.199,12 | ■ FUNDO IMOBILIÁRIO | 2.184.225,91 | ■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO | 857.548,63 |
| ■ IRF-M | 777.293,17 | ■ IPCA | 457.163,72 | ■ DISP. FINANCEIRA | 123,59 | ■ FIP | 0,02 |

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

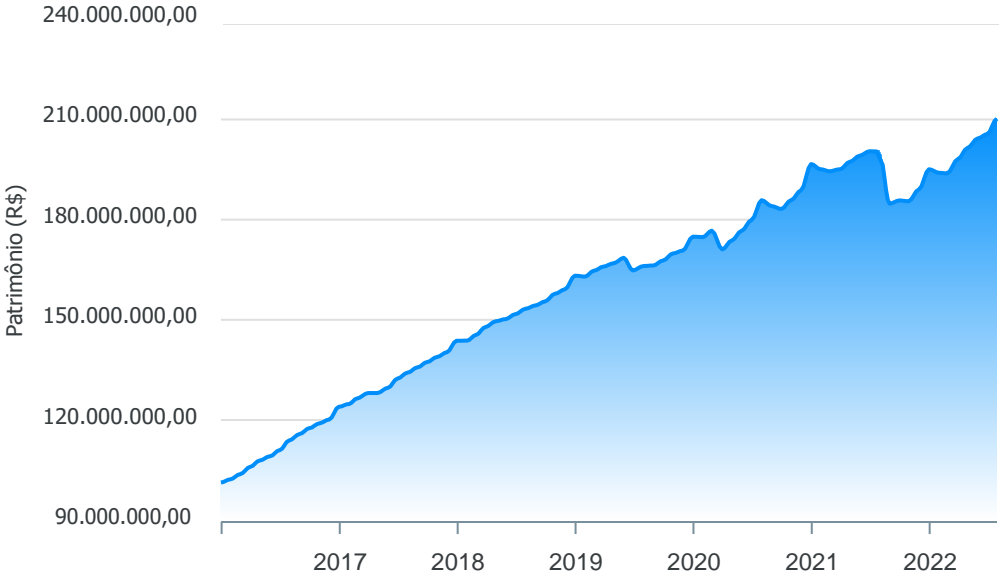
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo no Mês | Retorno | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|---------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro | 195.067.268,70 | 1.121.788,25 | 1.515.213,29 | 194.000.227,77 | -673.615,89 | -673.615,89 | -0,35% | -0,35% | 0,95% | 0,95% | -36,24% | 2,15% |
| Fevereiro | 194.000.227,77 | 73.162.292,09 | 71.867.751,65 | 193.832.676,11 | -1.462.092,10 | -2.135.707,99 | -0,75% | -1,09% | 1,39% | 2,35% | -46,42% | 3,01% |
| Março | 193.832.676,11 | 5.294.820,41 | 3.092.550,99 | 198.126.170,99 | 2.091.225,46 | -44.482,53 | 1,07% | -0,04% | 2,06% | 4,46% | -0,81% | 2,33% |
| Abril | 198.126.170,99 | 3.323.638,28 | 2.025.930,76 | 201.418.119,98 | 1.994.241,47 | 1.949.758,94 | 1,00% | 0,96% | 1,44% | 5,96% | 16,17% | 1,92% |
| Mai | 201.418.119,98 | 5.431.223,51 | 4.046.963,25 | 204.303.320,94 | 1.500.940,70 | 3.450.699,64 | 0,74% | 1,71% | 0,90% | 6,91% | 24,75% | 2,00% |
| Junho | 204.303.320,94 | 7.183.022,60 | 5.601.109,66 | 205.634.492,59 | -250.741,29 | 3.199.958,35 | -0,12% | 1,59% | 1,08% | 8,07% | 19,66% | 2,08% |
| Julho | 205.634.492,59 | 13.699.212,08 | 12.786.822,92 | 210.208.263,55 | 3.661.381,80 | 6.861.340,15 | 1,77% | 3,39% | -0,27% | 7,78% | 43,56% | 3,60% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade

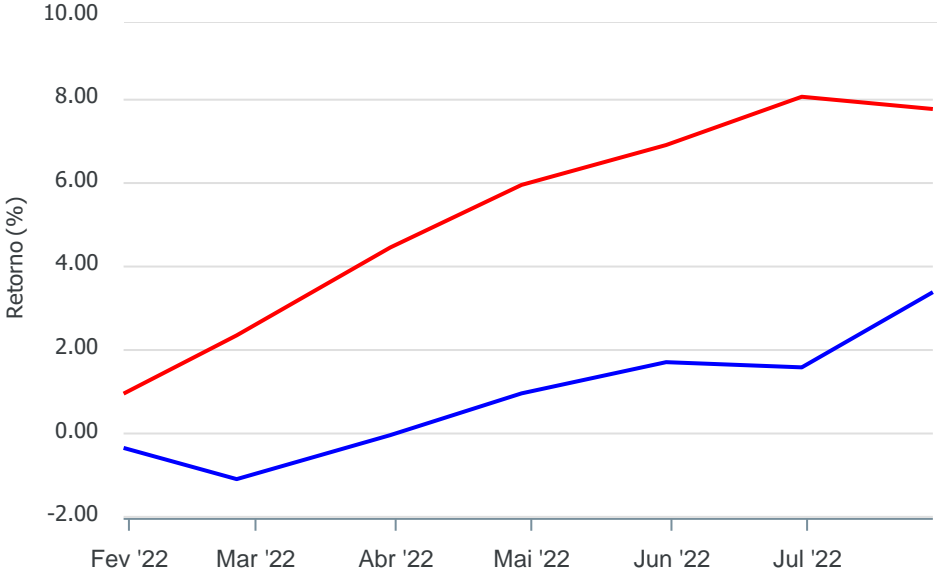


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



ANO 36M

- 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 Julho/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|---------------------|--------------|------------|--------------|
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 10.597.406,29 | 0,00 | 0,00 | 12.520.594,70 | 1.923.188,41 | 18,15% | 18,15% | 32,02% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 768.671,83 | 0,00 | 0,00 | 777.293,17 | 8.621,34 | 1,12% | 1,12% | 1,47% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 12.660.866,81 | 0,00 | 0,00 | 12.790.270,89 | 129.404,08 | 1,02% | 1,02% | 0,02% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 4.454.303,51 | 520.000,00 | 20.000,00 | 5.004.988,06 | 50.684,55 | 1,02% | 1,03% | 0,25% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 18.063.097,88 | 0,00 | 0,00 | 18.244.973,72 | 181.875,84 | 1,01% | 1,01% | 0,03% |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | 12.724.700,31 | 531.000,00 | 0,00 | 13.388.858,31 | 133.158,00 | 1,00% | 1,03% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 3.238.713,23 | 0,00 | 520.000,00 | 2.750.035,71 | 31.322,48 | 0,97% | 1,15% | 2,32% |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 9.788.092,46 | 1.213.000,00 | 0,00 | 11.105.060,27 | 103.967,81 | 0,95% | 1,02% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 38.015.151,33 | 0,00 | 565.000,00 | 37.744.278,57 | 294.127,24 | 0,77% | 0,79% | 0,99% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 1.001.806,23 | 0,00 | 0,00 | 1.008.205,89 | 6.399,66 | 0,64% | 0,64% | 0,65% |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 437.772,62 | 170.000,00 | 0,00 | 611.112,24 | 3.339,62 | 0,55% | 0,62% | 1,42% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 243.906,85 | 2.588.212,08 | 2.828.822,92 | 6.852,46 | 3.556,45 | 0,13% | 0,90% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 456.823,07 | 0,00 | 0,00 | 457.163,72 | 340,65 | 0,07% | 0,07% | 0,76% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 21.188.129,73 | 0,00 | 0,00 | 21.192.511,55 | 4.381,82 | 0,02% | 0,02% | 1,21% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 472.075,90 | 0,00 | 0,00 | 470.561,19 | -1.514,71 | -0,32% | -0,32% | 1,51% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 36.477.209,77 | 0,00 | 8.000.000,00 | 28.290.828,43 | -186.381,34 | -0,51% | -0,29% | 1,48% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 1.194.072,70 | 0,00 | 0,00 | 1.183.029,57 | -11.043,13 | -0,92% | -0,92% | 2,47% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 9.543.241,08 | 0,00 | 853.000,00 | 8.498.279,23 | -191.961,85 | -2,01% | -1,91% | 3,99% |
| Total Renda Fixa | 181.326.041,60 | 5.022.212,08 | 12.786.822,92 | 176.044.897,68 | 2.483.466,92 | 1,37% | | 3,15% |

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|----------------------|---------------------|-------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 6.817.116,42 | 0,00 | 0,00 | 7.506.029,78 | 688.913,36 | 10,11% | 10,11% | 8,96% |
| CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | 821.518,34 | 0,00 | 0,00 | 857.548,63 | 36.030,29 | 4,39% | 4,39% | 7,59% |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 3.569.385,32 | 0,00 | 0,00 | 3.717.987,76 | 148.602,44 | 4,16% | 4,16% | 6,99% |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 3.900.249,85 | 0,00 | 0,00 | 3.928.431,92 | 28.182,07 | 0,72% | 0,72% | 2,10% |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP | 1.399.754,39 | 677.000,00 | 0,00 | 2.091.656,18 | 14.901,79 | 0,72% | 0,86% | 0,31% |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL... | 0,00 | 8.000.000,00 | 0,00 | 8.010.910,87 | 10.910,87 | 0,14% | - | - |
| AQ3 RENDA FII - ARFI11B | 2.182.945,77 | 0,00 | 0,00 | 2.184.225,91 | 1.280,14 | 0,06% | 0,00% | 0,00% |
| CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11 | 0,02 | 0,00 | 0,00 | 0,02 | 0,00 | 0,00% | - | - |
| CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES | 2.209.549,38 | 0,00 | 0,00 | 2.190.199,12 | -19.350,26 | -0,88% | -0,88% | 9,77% |
| Total Renda Variável | 20.900.519,49 | 8.677.000,00 | 0,00 | 30.486.990,19 | 909.470,70 | 3,07% | | 5,79% |

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

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|--|---------------------|-------------|-------------|---------------------|-------------------|--------------|------------|---------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 3.407.931,50 | 0,00 | 0,00 | 3.676.375,68 | 268.444,18 | 7,88% | 7,88% | 11,49% |
| Total Exterior | 3.407.931,50 | 0,00 | 0,00 | 3.676.375,68 | 268.444,18 | 7,88% | | 11,49% |

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.