

2022

Relatório

Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2022

Junho

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
TÍTULOS PÚBLICOS	92.348.023,88	37,28%	0,00		7º I a
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.133.294,86	6,92%	9.717.321.383,29	0,18%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	19.225.756,77	7,76%	6.996.220.208,06	0,27%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.228.398,51	1,71%	5.103.254.867,87	0,08%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	144.534,16	0,06%	258.295.551,92	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.252.716,57	1,31%	6.957.180.815,09	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.719.050,16	4,73%	11.226.926.091,22	0,10%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.318.455,54	3,76%	11.084.704.335,99	0,08%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	823.382,11	0,33%	5.096.804.349,76	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.065.529,77	2,45%	17.877.663.669,31	0,03%	7º I b
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	615,17	0,00%	26.053.019.414,33	0,00%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	5.028.596,66	2,03%	1.328.159.744,16	0,38%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	10.113.784,35	4,08%	9.838.414.136,64	0,10%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	7.066.271,57	2,85%	2.482.745.591,73	0,28%	7º III a
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	12.667.353,52	5,11%	743.360.830,24	1,70%	7º III a
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.533.435,63	3,04%	5.205.931.964,48	0,14%	7º III a
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 1	0,01	0,00%	0,01	100,00% ▲	7º V a
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.404.947,60	2,18%	986.278.946,41	0,55%	8º I
BB AGRO FIC AÇÕES	2.538.148,74	1,02%	432.511.848,31	0,59%	8º I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.307.860,46	0,53%	1.302.667.207,42	0,10%	8º I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.170.283,75	1,28%	679.415.733,50	0,47%	8º I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.461.749,77	0,99%	823.780.283,04	0,30%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.338.096,62	2,16%	2.383.481.665,49	0,22%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.832.748,16	0,74%	537.669.914,17	0,34%	8º I
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	2.581.362,76	1,04%	991.586.962,10	0,26%	8º I
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.088.169,01	0,44%	1.171.391.227,03	0,09%	9º II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.317.666,84	0,94%	535.702.587,54	0,43%	9º III

Investimentos

\$ 247.705.833,50

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 247.705.833,50

Governança (Pró Gestão)
 Não possui

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	390.770,81	0,16%	2.225.410.384,30	0,02%	9º III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.791.211,56	0,72%	20.583.570.437,89	0,01%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.440.654,39	0,99%	1.374.157.964,02	0,18%	10º I
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.618.571,36	0,65%	948.117.020,14	0,17%	10º I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.186.129,43	2,09%	220.468.259,67	2,35%	10º I
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	0,01	0,00%	0,00		10º II
HAZ FII - ATCR11	805.472,41	0,33%	0,00		11º
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	762.790,58	0,31%	9.134.772,31	8,35%	NE

Investimentos

\$ 247.705.833,50

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 247.705.833,50

Governança (Pró Gestão)

⚠ Não possui

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/05/2035	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8500%	302	4.073,945559	1.230.331,56
NTN-B - 15/05/2035	16/03/2022	Curva - Taxa: 5,8950%	478	4.058,182755	1.939.811,36
NTN-B - 15/05/2035	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,3810%	909	4.243,243257	3.857.108,12
NTN-B - 15/05/2035	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,7110%	224	4.123,162972	923.588,51
NTN-B - 15/08/2040	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8480%	619	4.146,075832	2.566.420,94
NTN-B - 15/08/2040	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,4110%	1.182	4.343,443677	5.133.950,43
NTN-B - 15/08/2040	30/03/2022	Curva - Taxa: 5,4660%	586	4.317,876448	2.530.275,60
NTN-B - 15/08/2040	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,7210%	295	4.202,092574	1.239.617,31
NTN-B - 15/05/2045	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8500%	1.053	4.097,101537	4.314.247,92
NTN-B - 15/05/2045	16/03/2022	Curva - Taxa: 5,9410%	1.059	4.052,391768	4.291.482,88
NTN-B - 15/05/2045	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,5010%	2.031	4.275,490248	8.683.520,69
NTN-B - 15/05/2045	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,8200%	508	4.111,999479	2.088.895,74
NTN-B - 15/08/2050	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8500%	1.320	4.163,217633	5.495.447,28
NTN-B - 15/08/2050	16/03/2022	Curva - Taxa: 5,9410%	1.328	4.114,123771	5.463.556,37
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,5210%	2.535	4.348,616905	11.023.743,85
NTN-B - 15/08/2050	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,8200%	637	4.179,606166	2.662.409,13
NTN-B - 15/05/2055	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8400%	1.573	4.116,351687	6.475.021,20
NTN-B - 15/05/2055	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,5200%	3.010	4.308,773479	12.969.408,17
NTN-B - 15/05/2055	30/03/2022	Curva - Taxa: 5,5810%	1.486	4.270,994561	6.346.697,92
NTN-B - 15/05/2055	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,8200%	754	4.127,969531	3.112.489,03

Investimentos

\$ 247.705.833,50

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 247.705.833,50

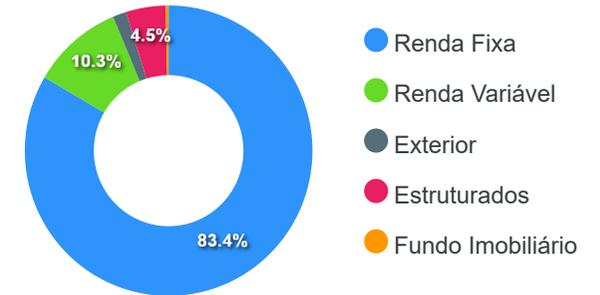
Governança (Pró Gestão)
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Utilizado	Limite (%)	Livre
7° I a - Títulos TN SELIC	100,00%	37,28%	92.348.023,88	62,72%	155.357.809,62
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	31,06%	76.940.330,28	68,94%	170.765.503,22
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	15,09%	37.380.845,07	44,91%	111.242.655,03
7° V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	0,00%	0,01	5,00%	12.385.291,67
8° I - Fundos de Ações	30,00%	9,95%	24.635.197,86	20,05%	49.676.552,19
9° II - Constituídos no Brasil	10,00%	0,44%	1.088.169,01	9,56%	23.682.414,34
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,09%	2.708.437,65	8,91%	22.062.145,70
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	4,46%	11.036.566,74	5,54%	13.734.016,61
10° II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	0,00%	0,01	5,00%	12.385.291,67
11° - Fundos Imobiliários	5,00%	0,33%	805.472,41	4,67%	11.579.819,26
Não Enquadrado	0,00%	0,31%	762.790,58	-0,31%	-762.790,58

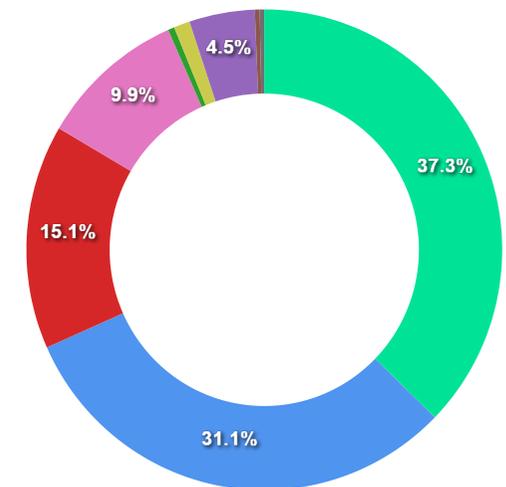
Governança (Pró Gestão)

⚙️ Não possui

Segmentos



Artigos



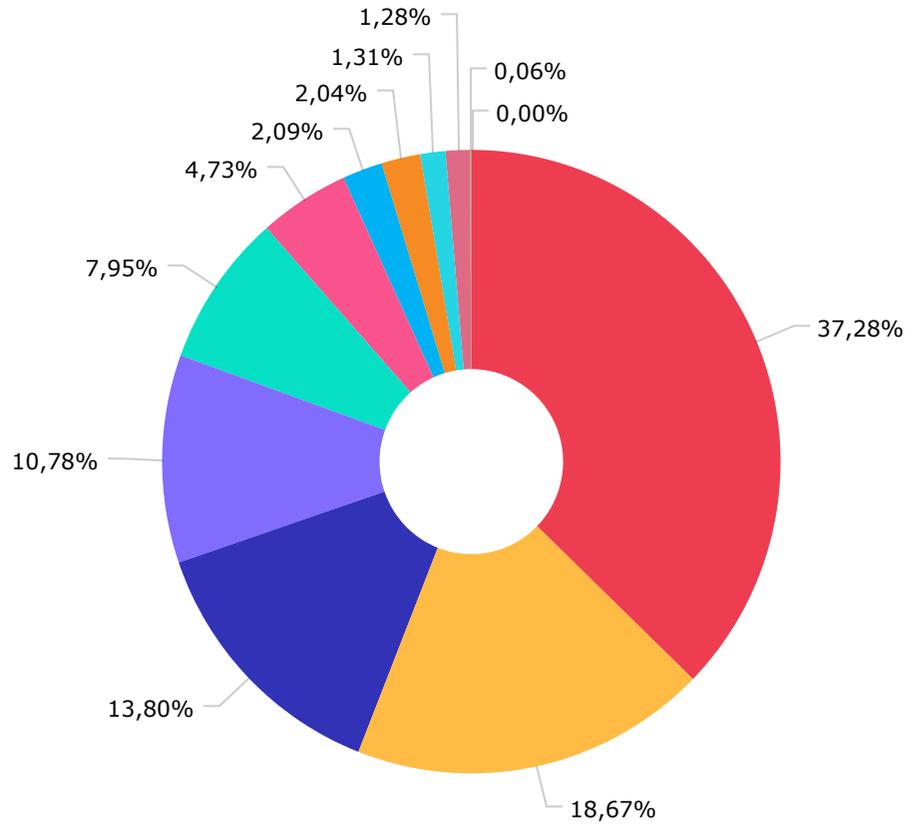
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	37,28%	0,00%	69,22%	80,00%	105.816.642,92
7° I b - FI 100% Títulos TN	31,06%	0,00%	0,00%	50,00%	46.912.586,47
7° III a - FI Referenciados RF	15,09%	0,00%	3,49%	50,00%	86.472.071,68
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	49.541.166,70
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	0,50%	1.238.529,16
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.385.291,68

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8° I - Fundos de Ações	9,95%	0,00%	7,29%	20,00%	24.905.968,84
8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	49.541.166,70
9° II - Constituídos no Brasil	0,44%	0,00%	5,00%	10,00%	23.682.414,34
9° III - Ações - BDR Nível I	1,09%	0,00%	5,00%	10,00%	22.062.145,70
10° I - Fundos Multimercados	4,46%	0,00%	10,00%	10,00%	13.734.016,61
10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	0,07%	173.394,07
11° - Fundos Imobiliários	0,33%	0,00%	0,00%	0,37%	111.039,17
Não Enquadrado	0,31%	0,00%	0,00%	0,00%	-762.790,58

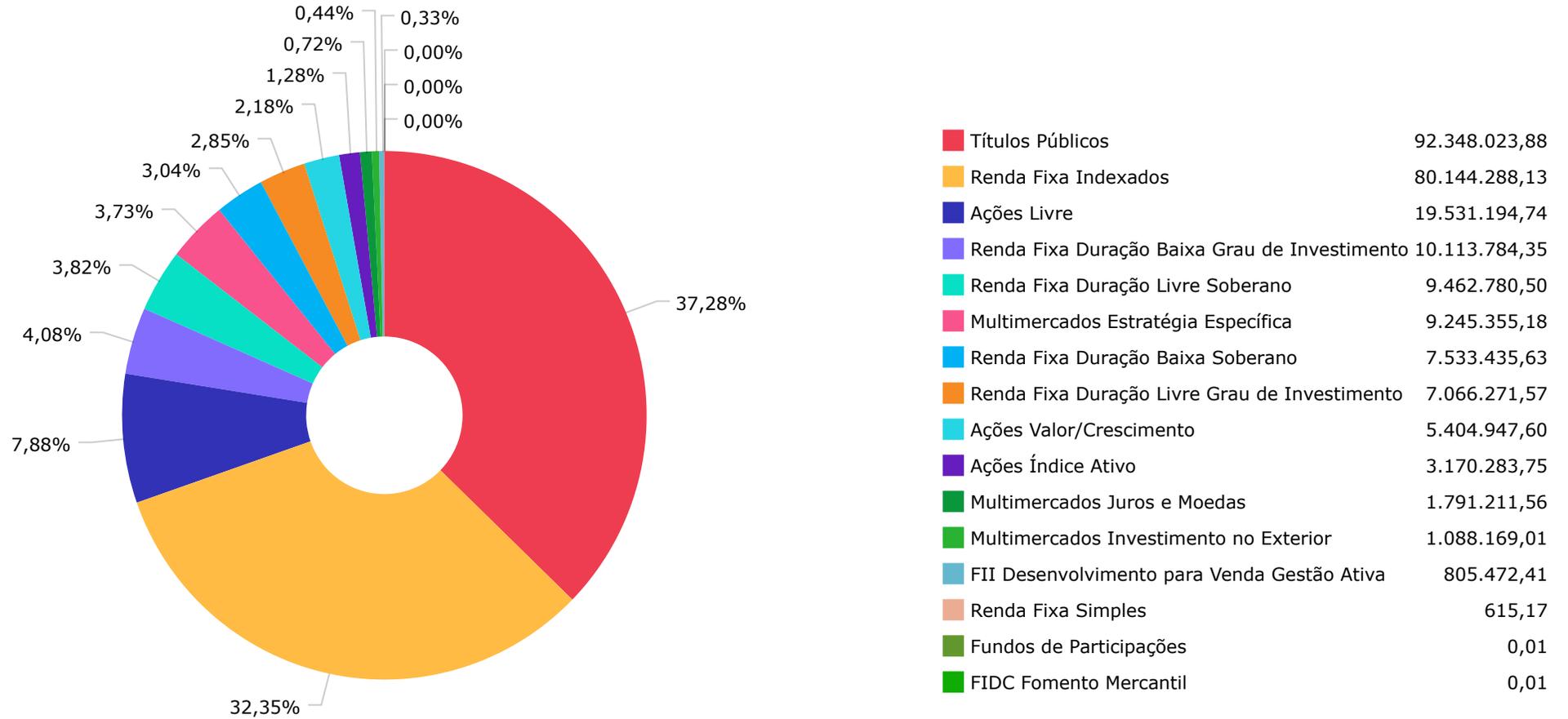
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,27	6,46	2,54	6,46	9,84	16,85	1,38	2,90
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	-7,79	-17,59	-14,94	-17,59	-5,80	31,34	13,65	28,75
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,71	-15,61	-12,77	-15,61	-9,37		11,83	24,91
BB AGRO FIC AÇÕES	-13,39	-7,62	-14,05	-7,62	-10,84		7,14	15,03
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,83	-27,83	-10,22	-27,83	-13,08	9,72	12,50	26,32
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	-0,53	-29,87	-9,04	-29,87	-19,25	3,34	11,89	25,03
HAZ FII - ATCR11								
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00	0,00	0,00	0,00				
CDI - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12		
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,95	5,91	2,99	5,91	11,12	13,61	0,36	0,76
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,03	5,54	2,90	5,54	8,98	11,54	0,01	0,02
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02	5,52	2,87	5,52	8,84	10,78	0,01	0,03
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,02	5,42	2,86	5,42	8,73	10,87	0,01	0,02
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,02	5,38	2,84	5,38	8,66	10,70	0,01	0,02
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,05	5,26	2,81	5,26	8,48	12,36	0,21	0,43
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-7,71	-17,44	-14,89	-17,44	-5,80	30,47	13,53	28,50
IBOVESPA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67		
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	-10,38	-3,54	-16,04	-3,54	-10,61	42,09	7,46	15,71
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-13,75	-8,87	-15,07	-8,87	-14,94		7,81	16,46
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-11,61	-8,53	-15,87	-8,53	-16,65	12,69	9,62	20,26
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-12,76	-7,24	-16,81	-7,24	-17,83	14,76	9,44	19,89
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	-5,33	-3,33	-9,31	-3,33	-23,10	-6,89		
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-11,11	-8,68	-13,57	-8,68	-25,55	2,22	8,32	17,52
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-10,46	-10,71	-19,62	-10,71	-32,68	-18,43	8,99	18,92

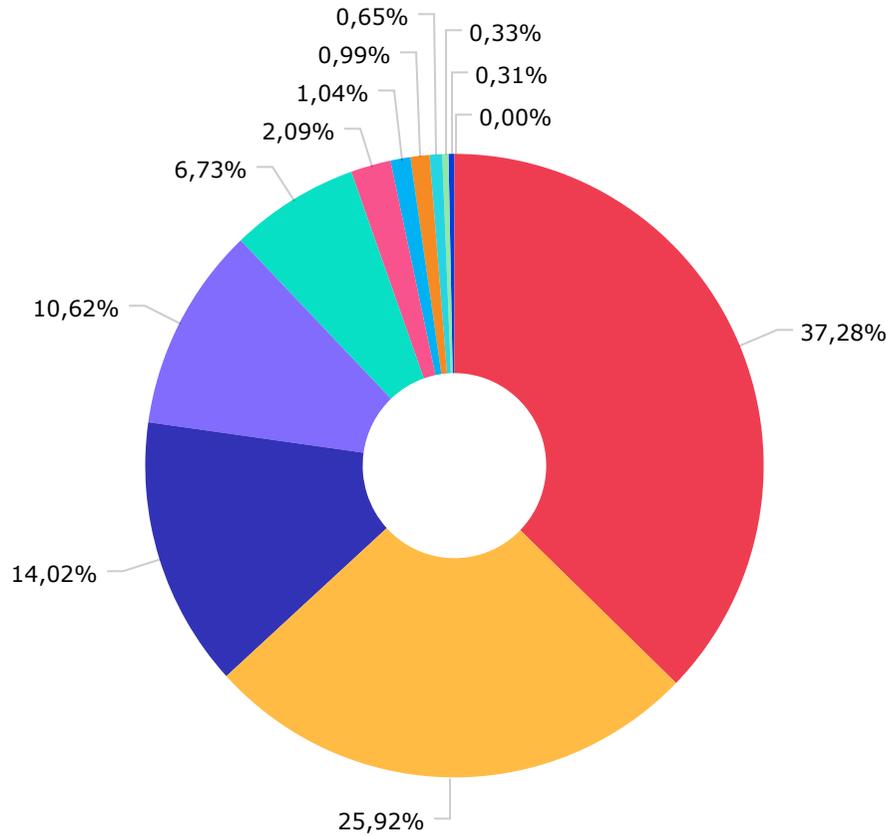
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IBX-50 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-11,67	-5,71	-18,35	-5,71	-22,70	6,28		
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-12,79	-6,95	-19,21	-6,95	-24,74	2,73	9,95	20,95
IDKA IPCA 2 ANOS - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	0,47	6,85	2,86	6,85	10,11	17,88		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,22	6,41	2,50	6,41	9,66	16,68	1,39	2,93
IMA-B - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-0,36	4,35	1,43	4,35	3,78	11,48		
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31	7,18	3,03	7,18	11,77	18,68	1,42	3,00
IMA-B 5 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	0,33	6,61	2,69	6,61	10,06	16,74		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,33	6,51	2,65	6,51	9,84	16,18	1,23	2,59
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,32	6,50	2,64	6,50	9,82	16,23	1,25	2,64
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,32	6,47	2,63	6,47	9,74	16,08	1,26	2,65
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	0,31	6,50	2,62	6,50	9,29	15,36	1,25	2,63
IPCA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	0,67	5,49	2,22	5,49	11,89	21,23		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,23	4,59	2,22	4,59	3,73	6,51	1,57	3,30
IPCA + 10,50% AO ANO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	1,51	10,80	4,80	10,89	23,63	48,02		
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP								
IRF-M 1 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	0,93	4,99	2,65	4,99	7,19	9,37		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91	4,86	2,58	4,86	6,94	8,89	0,17	0,35
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92	4,85	2,56	4,85	6,92	8,69	0,17	0,36
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-8,39	-20,58	-16,45	-20,58	-11,92	22,10		

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-7,82	-17,54	-14,99	-17,54	-5,64		13,70	28,86

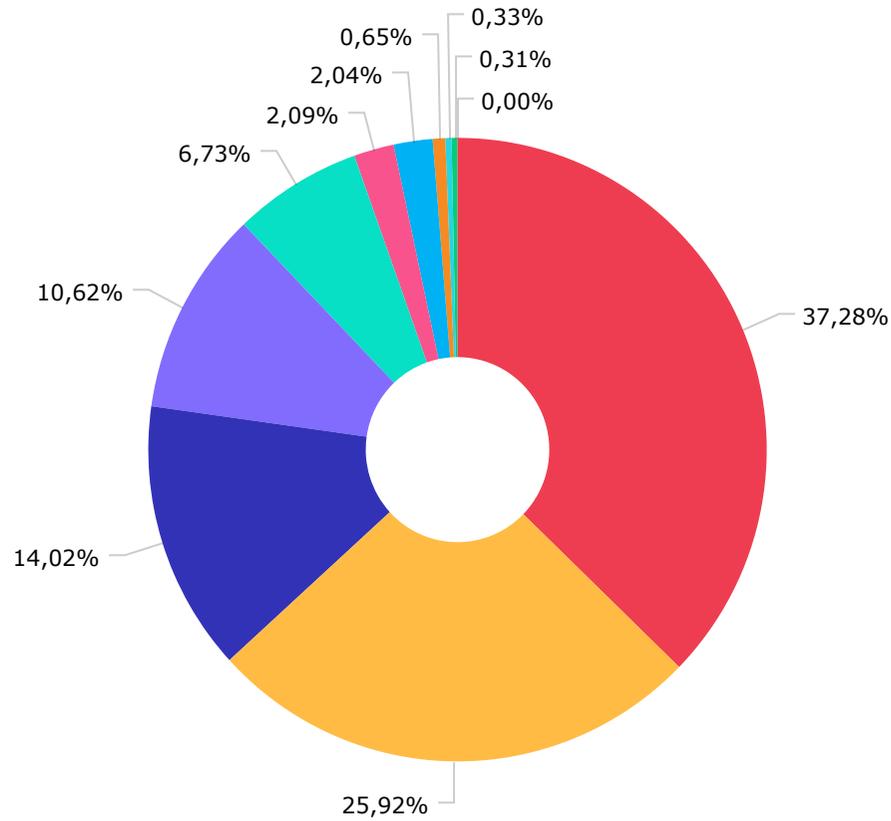


Títulos Públicos	92.348.023,88
IMA-B 5	46.240.162,49
CDI	34.189.419,41
Não definido	26.714.177,07
Ibovespa	19.689.555,95
IDKA IPCA 2 Anos	11.719.050,16
S&P 500 (Moeda Original)	5.186.129,43
IRF-M 1	5.051.780,62
IPCA	3.252.716,57
IBX-50	3.170.283,75
IMA-B	144.534,16
IPCA + 10,50% ao ano	0,01





TESOURO NACIONAL	92.348.023,88
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	64.205.603,85
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	34.740.188,71
SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...	26.317.554,82
ITAU UNIBANCO S.A.	16.678.385,91
CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ...	5.186.129,43
TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA	2.581.362,76
GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA	2.461.749,77
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	1.618.571,36
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.	805.472,41
RENDA ASSET ADMINISTRADORA DE ...	762.790,58
GENIAL GESTAO LTDA	0,02

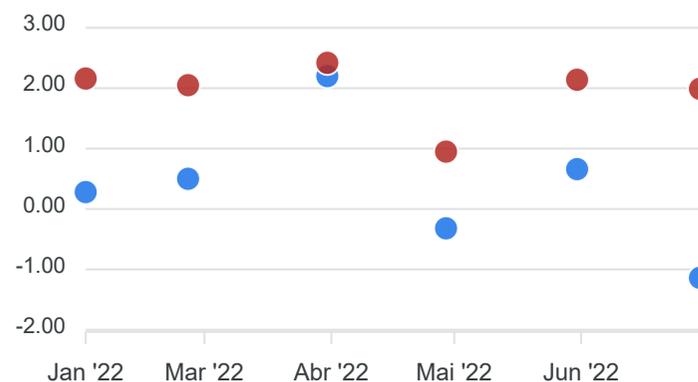


TESOURO NACIONAL	92.348.023,88
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	64.205.603,85
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	34.740.188,71
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	26.317.554,82
ITAU UNIBANCO S.A.	16.678.385,91
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	5.186.129,43
BANCO DAYCOVAL S.A.	5.043.112,53
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	1.618.571,36
RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL...	805.472,42
BFL ADMINISTRACAO DE RECURSOS ...	762.790,58
BANCO GENIAL S.A.	0,01

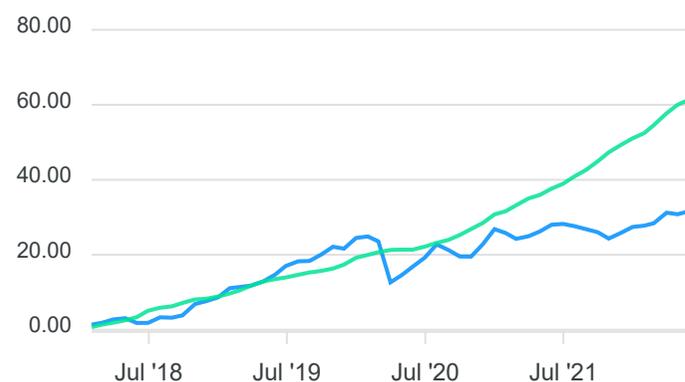
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	226.020.799,42	13.933.156,95	12.179.365,62	228.406.126,18	631.535,43	0,28% ▲	0,95%	2,16%
Fevereiro	228.406.126,18	19.931.658,05	17.449.905,42	232.030.797,92	1.142.919,11	0,50% ▲	1,38%	2,05%
Março	232.030.797,92	121.352.014,95	120.574.125,37	237.935.024,57	5.126.337,07	2,20% ▲	2,05%	2,42%
Abril	237.935.024,57	17.974.453,39	13.795.554,26	241.339.098,59	-774.825,11	-0,32% ▼	1,43%	0,95%
Mai	241.339.098,59	39.110.066,64	33.640.665,43	248.426.615,96	1.618.116,16	0,66% ▲	0,90%	2,14%
Junho	248.426.615,96	13.403.054,81	11.273.915,49	247.705.833,50	-2.849.921,78	-1,14% ▼	1,08%	1,99%
Acumulado					4.894.160,88	2,16% ▲	8,03%	

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	6.900.791,61	2,99%	4,44%
2º Trim	-2.006.630,73	-0,81%	3,44%
1º Sem	4.894.160,88	2,16%	8,03%

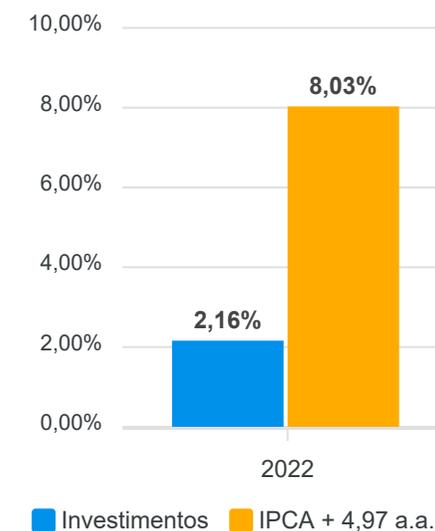
● Retorno ● Risco



● Carteira ● IPCA + 4,97 a.a.



Retorno e Meta Acumulado



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	91.447.309,41	0,00	0,00	92.348.023,88	900.714,47	0,98% ▲	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.087.823,13	0,00	0,00	17.133.294,86	45.471,73	0,27% ▲	1,38%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	19.164.871,99	0,00	0,00	19.225.756,77	60.884,78	0,32% ▲	1,26%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.189.930,26	0,00	0,00	4.228.398,51	38.468,25	0,92% ▲	0,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.534.220,54	4.518.398,53	0,00	10.113.784,35	61.165,28	0,61% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	144.085,68	0,00	0,00	144.534,16	448,48	0,31% ▲	1,42%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.245.239,13	0,00	0,00	3.252.716,57	7.477,44	0,23% ▲	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.692.818,75	0,00	0,00	11.719.050,16	26.231,41	0,22% ▲	1,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.287.474,45	0,00	0,00	9.318.455,54	30.981,09	0,33% ▲	1,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	815.957,09	0,00	0,00	823.382,11	7.425,02	0,91% ▲	0,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.393.415,07	616.916,28	0,00	6.065.529,77	55.198,42	0,92% ▲	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	7.000.000,00	0,00	0,00	7.066.271,57	66.271,57	0,95% ▲	0,36%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	608,94	0,00	0,00	615,17	6,23	1,02% ▲	0,01%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	5.012.498,55	0,00	0,00	5.028.596,66	16.098,11	0,32% ▲	1,25%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	12.627.635,79	0,00	0,00	12.667.353,52	39.717,73	0,31% ▲	1,25%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.437.534,50	8.267.740,00	11.273.915,49	7.533.435,63	102.076,62	0,55% ▲	0,01%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
	203.081.423,29	13.403.054,81	11.273.915,49	206.669.199,24	1.458.636,63	0,71%	0,52%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	6.114.773,10	0,00	0,00	5.404.947,60	-709.825,50	-11,61% ▼	9,62%
BB AGRO FIC AÇÕES	2.930.707,25	0,00	0,00	2.538.148,74	-392.558,51	-13,39% ▼	7,14%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.772.574,37	0,00	0,00	1.791.211,56	18.637,19	1,05% ▲	0,21%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.499.230,89	0,00	0,00	1.307.860,46	-191.370,43	-12,76% ▼	9,44%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.635.304,87	0,00	0,00	3.170.283,75	-465.021,12	-12,79% ▼	9,95%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.854.268,33	0,00	0,00	2.461.749,77	-392.518,56	-13,75% ▼	7,81%
HAZ FII - ATCR11	781.207,41	0,00	0,00	805.472,41	24.265,00	3,11% ▲	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6.005.052,26	0,00	0,00	5.338.096,62	-666.955,64	-11,11% ▼	8,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.046.928,00	0,00	0,00	1.832.748,16	-214.179,84	-10,46% ▼	8,99%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.646.782,89	0,00	0,00	2.440.654,39	-206.128,50	-7,79% ▼	13,65%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	805.725,31	0,00	0,00	762.790,58	-42.934,73	-5,33% ▼	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.753.795,36	0,00	0,00	1.618.571,36	-135.224,00	-7,71% ▼	13,53%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.625.833,77	0,00	0,00	5.186.129,43	-439.704,34	-7,82% ▼	13,70%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	2.880.334,08	0,00	0,00	2.581.362,76	-298.971,32	-10,38% ▼	7,46%
-	41.352.517,90	0,00	0,00	37.240.027,60	-4.112.490,30	-9,94%	9,13%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.511.158,60	0,00	0,00	2.317.666,84	-193.491,76	-7,71% ▼	11,83%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	387.563,82	0,00	0,00	390.770,81	3.206,99	0,83% ▲	12,50%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	1.093.952,35	0,00	0,00	1.088.169,01	-5.783,34	-0,53% ▼	11,89%
	3.992.674,77	0,00	0,00	3.796.606,66	-196.068,11	-4,91%	8,51%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.743.493,27	0,00	1.768.160,65	0,00	24.667,38	1,41% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.708.476,79	0,00	0,00	17.133.294,86	424.818,07	2,54% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	18.732.318,67	0,00	0,00	19.225.756,77	493.438,10	2,63% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.122.822,66	0,00	0,00	4.228.398,51	105.575,85	2,56% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.522.863,02	8.979.803,53	1.500.000,00	10.113.784,35	111.117,80	0,97% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	140.287,89	0,00	0,00	144.534,16	4.246,27	3,03% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	13.058.423,91	0,00	10.000.523,90	3.252.716,57	194.816,56	1,49% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.433.774,98	0,00	0,00	11.719.050,16	285.275,18	2,50% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.077.583,93	0,00	0,00	9.318.455,54	240.871,61	2,65% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	802.646,78	0,00	0,00	823.382,11	20.735,33	2,58% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.367.502,79	6.242.378,22	10.800.000,00	6.065.529,77	255.648,76	1,54% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,00	7.000.000,00	0,00	7.066.271,57	66.271,57	0,95% ▲
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	598,07	0,00	0,00	615,17	17,10	2,86% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	4.899.435,64	0,00	0,00	5.028.596,66	129.161,02	2,64% ▲
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	12.344.209,71	0,00	0,00	12.667.353,52	323.143,81	2,62% ▲
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.439.053,07	36.496.686,44	34.638.949,73	7.533.435,63	236.645,85	0,56% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	80.317.626,56	10.000.524,00	0,00	92.348.023,88	2.029.873,32	2,25% ▲
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%
	191.711.117,75	68.719.392,19	58.707.634,28	206.669.199,24	4.946.323,58	2,45%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	6.424.313,07	0,00	0,00	5.404.947,60	-1.019.365,47	-15,87% ▼
BB AGRO FIC AÇÕES	2.952.927,61	0,00	0,00	2.538.148,74	-414.778,87	-14,05% ▼
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	1.768.182,65	0,00	1.791.211,56	23.028,91	1,30% ▲
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.572.159,95	0,00	0,00	1.307.860,46	-264.299,49	-16,81% ▼
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.924.090,17	0,00	0,00	3.170.283,75	-753.806,42	-19,21% ▼
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	136.266,17	0,00	0,00	0,01	-136.266,16	-100,00% ▼
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.898.447,22	0,00	0,00	2.461.749,77	-436.697,45	-15,07% ▼
HAZ FII - ATCR11	783.384,16	0,00	2.500,90	805.472,41	24.589,15	3,14% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6.176.506,82	0,00	0,00	5.338.096,62	-838.410,20	-13,57% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.280.104,95	0,00	0,00	1.832.748,16	-447.356,79	-19,62% ▼
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.869.433,38	0,00	0,00	2.440.654,39	-428.778,99	-14,94% ▼
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	841.057,09	0,00	0,00	762.790,58	-78.266,51	-9,31% ▼
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.901.733,90	0,00	0,00	1.618.571,36	-283.162,54	-14,89% ▼
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6.100.431,22	0,00	0,00	5.186.129,43	-914.301,79	-14,99% ▼
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	3.074.497,75	0,00	0,00	2.581.362,76	-493.134,99	-16,04% ▼
	41.935.353,46	1.768.182,65	2.500,90	37.240.027,60	-6.461.007,61	-14,78%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.656.972,73	0,00	0,00	2.317.666,84	-339.305,89	-12,77% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	435.240,32	0,00	0,00	390.770,81	-44.469,51	-10,22% ▼
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	1.196.340,31	0,00	0,00	1.088.169,01	-108.171,30	-9,04% ▼
	4.288.553,36	0,00	0,00	3.796.606,66	-491.946,70	-11,47%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.705.398,89	0,00	1.768.160,65	0,00	62.761,76	3,68% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.094.139,23	0,00	0,00	17.133.294,86	1.039.155,63	6,46% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	18.057.010,56	0,00	0,00	19.225.756,77	1.168.746,21	6,47% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.787.502,84	0,00	5.791.765,53	0,00	4.262,69	0,07% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.032.704,28	0,00	0,00	4.228.398,51	195.694,23	4,85% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	29.609.043,19	20.910.453,68	41.206.724,74	10.113.784,35	801.012,22	1,59% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	138.794,22	0,00	3.982,87	144.534,16	9.722,81	7,01% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	12.762.948,14	0,00	10.000.523,90	3.252.716,57	490.292,33	3,84% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.012.826,09	0,00	0,00	11.719.050,16	706.224,07	6,41% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.748.792,77	0,00	0,00	9.318.455,54	569.662,77	6,51% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.045.769,32	0,00	9.015.790,98	0,00	-29.978,34	-0,33% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	785.248,98	0,00	0,00	823.382,11	38.133,13	4,86% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.642.912,68	0,00	1.613.009,47	0,00	-29.903,21	-1,82% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.639.351,24	0,00	5.615.623,36	0,00	-23.727,88	-0,42% ▼
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.419.243,57	25.388.172,34	38.489.416,58	6.065.529,77	747.530,44	1,71% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,00	7.000.000,00	0,00	7.066.271,57	66.271,57	0,95% ▲
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	583,52	0,00	0,00	615,17	31,65	5,42% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	8.260.968,88	0,00	3.679.298,62	5.028.596,66	446.926,40	5,41% ▲
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	11.894.460,74	0,00	0,00	12.667.353,52	772.892,78	6,50% ▲
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	17.868.582,35	75.207.225,43	86.175.857,57	7.533.435,63	633.485,42	0,68% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	89.882.496,33	0,00	92.348.023,88	2.465.527,55	2,74% ▲
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%
	181.506.281,50	218.388.347,78	203.360.154,27	206.669.199,24	10.134.724,23	5,16%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.908.906,18	0,00	0,00	5.404.947,60	-503.958,58	-8,53% ▼
BB AGRO FIC AÇÕES	2.747.651,23	0,00	0,00	2.538.148,74	-209.502,49	-7,62% ▼
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.198.455,02	0,00	1.233.848,91	0,00	35.393,89	2,95% ▲
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.292.726,61	0,00	1.314.025,45	0,00	21.298,84	1,65% ▲
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	1.768.182,65	0,00	1.791.211,56	23.028,91	1,30% ▲
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.410.005,02	0,00	0,00	1.307.860,46	-102.144,56	-7,24% ▼
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.406.993,08	0,00	0,00	3.170.283,75	-236.709,33	-6,95% ▼
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	137.634,03	0,00	0,00	0,01	-137.634,02	-100,00% ▼
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.773.937,18	0,00	2.461.749,77	-312.187,41	-11,25% ▼
HAZ FII - ATCR11	782.982,53	0,00	5.502,96	805.472,41	27.992,84	3,58% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.845.503,98	0,00	0,00	5.338.096,62	-507.407,36	-8,68% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4.943.525,74	0,00	3.000.000,00	1.832.748,16	-110.777,58	-2,24% ▼
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.961.548,72	0,00	0,00	2.440.654,39	-520.894,33	-17,59% ▼
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	789.103,93	0,00	0,00	762.790,58	-26.313,35	-3,33% ▼
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.960.480,23	0,00	0,00	1.618.571,36	-341.908,87	-17,44% ▼
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6.289.352,37	0,00	0,00	5.186.129,43	-1.103.222,94	-17,54% ▼
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	0,00	2.773.937,18	0,00	2.581.362,76	-192.574,42	-6,94% ▼
	39.674.868,67	7.316.057,01	5.553.377,32	37.240.027,60	-4.197.520,76	-10,13%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.746.515,28	0,00	0,00	2.317.666,84	-428.848,44	-15,61% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	541.452,78	0,00	0,00	390.770,81	-150.681,97	-27,83% ▼
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	1.551.681,19	0,00	0,00	1.088.169,01	-463.512,18	-29,87% ▼
	4.839.649,25	0,00	0,00	3.796.606,66	-1.043.042,59	-21,55%

Cenário Econômico

O primeiro semestre de 2022, foi muito desafiador para os gestores de recursos. Apesar de estar em momentos distintos, tanto o Brasil quanto as principais economias globais enfrentaram um cenário muito difícil e de alta volatilidade.

Iniciando pelo Brasil, podemos destacar dois momentos. O primeiro em que o cenário contava com perspectivas de baixo crescimento, bem próximas de zero, desemprego em patamares mais elevados e inflação anual na casa de dois dígitos. Já em um segundo momento os dados apurados se mostraram melhores que as previsões e as revisões para projeções econômicas passaram a apresentar melhor resultado para o PIB ao final de 2022. Os dados de desemprego vieram também melhores que o esperado, fechando em 9,8% no semestre, melhor resultado desde 2016 e redução das projeções da inflação para o segundo semestre, motivadas pela aprovação da PEC do teto do ICMS, que reduziu sensivelmente os preços dos combustíveis, energia e telefonia nos estados onde já foram implantadas. Some-se a isso, o benefício de ter iniciado a elevação da taxa básica de juros da economia ainda em 2021. Mas ainda persiste no mercado uma desconfiança com relação a parte fiscal, adicionando aí outro fator, que seria a aprovação da PEC das bondades, um pacote de benefícios à população vulnerável, que tem trazido para o mercado, uma série de dúvidas com relação aos gastos do governo e principalmente o respeito ao limite do teto de gastos.

Nos EUA, a grande injeção de capital realizada pelo FED, banco central americano, acabou evitando uma queda forte da economia americana durante o pico da pandemia do COVID, e provocou rapidamente a retomada da economia.

Com desemprego extremamente baixo e forte crescimento, mas com desestruturação da cadeia de produção ao redor do mundo, os gargalos produtivos se formaram e trouxeram aos EUA, um fenômeno inflacionário muito forte, fechando o primeiro semestre em 8,6% no acumulado de 12 meses, níveis mais elevados dos últimos 40 anos. Em um primeiro momento o FED, tratou a inflação com um fenômeno pontual, mas com o passar dos meses, acabou identificando como algo disseminado e persistente, sendo necessário uma intervenção mais forte por parte do FED, que viu a necessidade da elevação da taxa básica de juros em um ritmo mais forte que o esperado pelo mercado. A força em que o FED precisou agir, trouxe certas dúvidas ao mercado com relação a possível recessão na economia americana, afetando principalmente as economias em desenvolvimento.

Já na zona do EURO, a inflação que no acumulado de 12 meses ficou em 8,1%, também se fez muito presente, destacamos alguns fatores predominantes. O primeiro ponto é com relação ao conflito em solo europeu entre Rússia e Ucrânia, que provocou uma crise energética e uma forte elevação dos preços. O segundo ponto é a forte recuperação da economia europeia no primeiro semestre de 2022 e por fim a questão dos gargalos nas indústrias provocados pela escassez de matéria prima. Como este fenômeno tem se mostrado resiliente, o Banco Central europeu já deixou claro que iniciará o processo de elevação da taxa básica de juros no segundo semestre, e que fará o necessário para trazer a inflação para o centro da meta que é de 2%.

E por fim, a economia chinesa, que não sofreu muito durante o pico da pandemia, mas que por conta da política do governo chinês, de manter os casos de Covid muito próximo de zero, tem provocado rígidos lockdowns dificultando o escoamento da produção e aumentando os gargalos produtivos nas principais economias globais. Mesmo diante desses fatores a economia chinesa segue em expansão, com perspectiva de crescimento ao redor de 5% em 2022.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

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

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

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

Rentabilidade e Risco (por ativo)

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

Distribuição por Benchmarks

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

Distribuição por Classificação ANBIMA

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

Distribuição por Gestoras e Administradoras

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

Retorno da Carteira de Investimentos

A rentabilidade apresentada no período, voltou a ser impactada de forma contundente pela conjuntura econômica incerta, e a persistência do processo inflacionário ascendente, mantendo as taxas de juros reais negativas, e pressionando os mercados de Bolsa e Ativos Reais gerando alavancagem demasiada e distorcida de preços, e fazendo com que os riscos da carteira permaneçam sensíveis.

Análise dos Fundos de Investimento presentes na Carteira de Investimentos

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

Rio de Janeiro, 12 de julho de 2022.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	1.077
Patrimônio Líquido Fundo	9.717.321.383,29

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Indicador de Desempenho (CVM)	Não definido
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

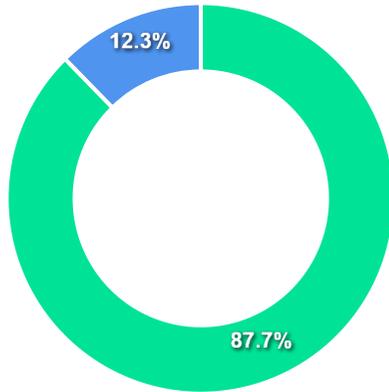
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,27%	6,46%	2,54%	6,46%	9,84%	16,85%	1,38%	2,90%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	4.888.721,36	53,82	Títulos Federa...	02/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	2.806.445,81	30,89	Títulos Federa...	02/09/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/09/2027	1.119.625,91	12,33	Operação compr...	02/09/2022
NTN-B - Venc: 15/05/2023	268.910,20	2,96	Títulos Federa...	02/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	309,74	0,00	Outros	02/09/2022
Outras Disponibilidades	200,91	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	76,74	0,00	Outros	02/09/2022
Outros Valores a receber	30,28	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,73	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	22,00	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Auditoria	3,36	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a receber / ANBID DIFER 30/09/22	0,85	0,00	Outros	02/09/2022
Outros Valores a pagar	0,34	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Outros Valores a pagar	0,05	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	0,00	0,00	Outros	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-72,06	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-85,54	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	-246,86	0,00	Outros	02/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	7.964.077,37	87.67%
Operação compromissada	1.119.625,91	12.33%
Outros	140,47	0.00%
Valores a pagar/receber	127,07	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+1

Quantidade de Cotistas
 820

Patrimônio Líquido Fundo
 6.996.220.208,06

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
 IMA-B 5

Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

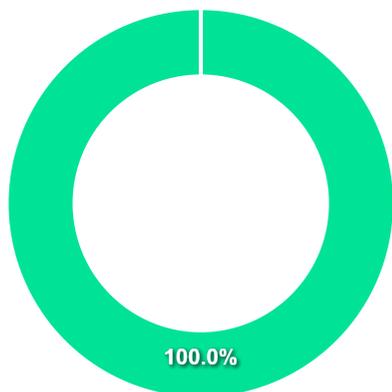
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,32%	6,47%	2,63%	6,47%	9,74%	16,08%	1,26%	2,65%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB TOP IMA-B 5 FI RENDA FIXA LP	6.457.726,20	100,00	Fundos de Inve...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,73	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	5,97	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa Anbid	1,09	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,08	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Outros Valores a receber	0,03	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-51,25	0,00	Valores a paga...	02/09/2022

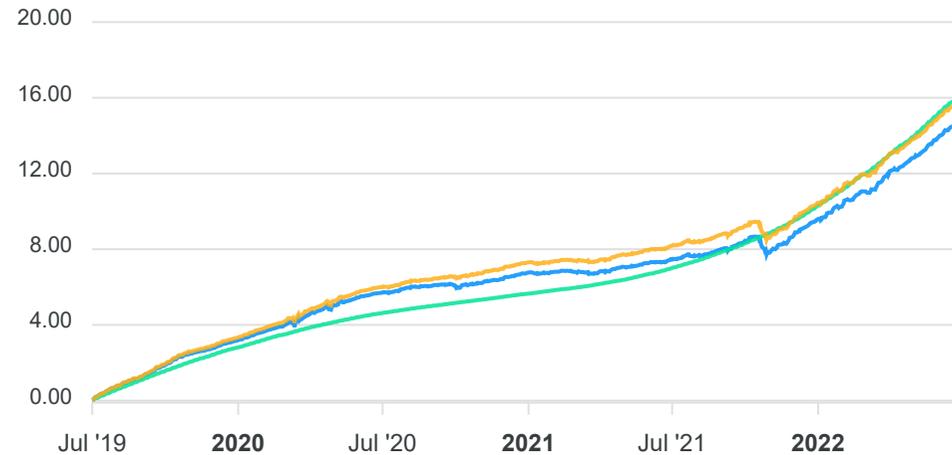
Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	6.457.726,20	100.00%
● Valores a pagar/receber	-16,35	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS
Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,10%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 1.068
Patrimônio Líquido Fundo 5.103.254.867,87

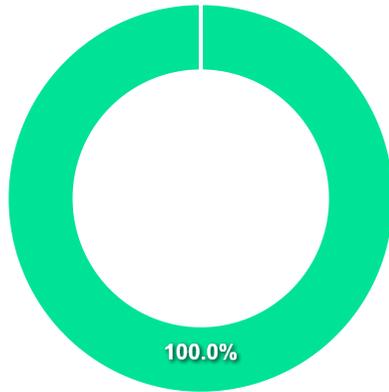
PERFIL DO FUNDO
Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Indicador de Desempenho (CVM) IRF-M 1
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que mantenham 100% de suas carteiras em Títulos Públicos Federais.

	COMPARATIVO							
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,92%	4,85%	2,56%	4,85%	6,92%	8,69%	0,17%	0,36%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		

30/06/2022



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA	5.854.252,36	100,00	Fundos de Inve...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,72	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	23,23	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	3,78	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	1,58	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a paga...	02/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	5.854.252,36	100.00%
● Valores a pagar/receber	56,35	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 165

Patrimônio Líquido Fundo
 258.295.551,92

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
 IMA-B

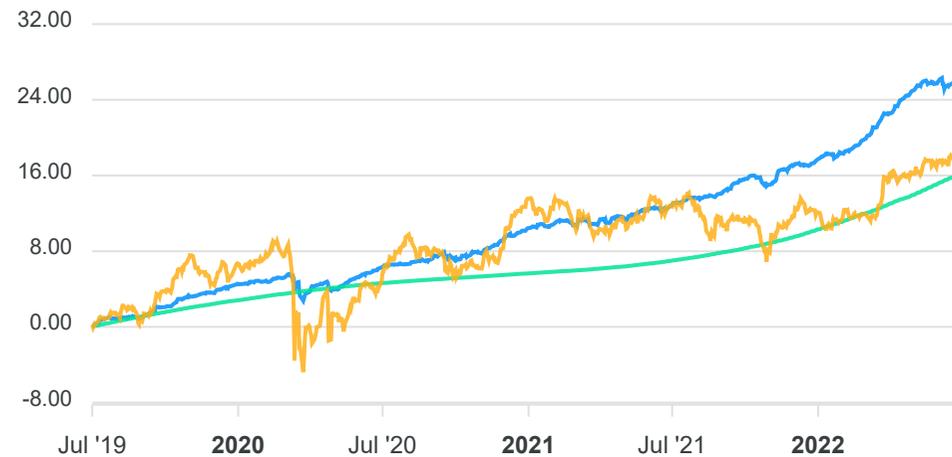
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
 Aplica seus recursos exclusivamente em títulos públicos federais ou operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais, principalmente em NTN-B.

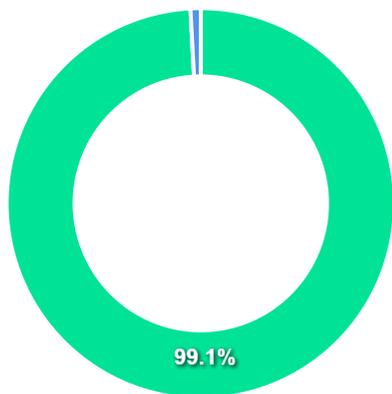
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,31%	7,18%	3,03%	7,18%	11,77%	18,68%	1,42%	3,00%
Indicador de Desempenho (CVM)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/09/2027	106.975,35	99,14	Operação compr...	02/09/2022
Outras Disponibilidades	934,93	0,87	Valores a paga...	02/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	0,00	0,00	Títulos Federa...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-0,72	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	-0,77	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-0,86	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-1,79	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-3,81	0,00	Valores a paga...	02/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Operação compromissada	106.975,35	99.14%
● Valores a pagar/receber	926,98	0.86%
● Títulos Federais	0,00	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração

0,20%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+0

Quantidade de Cotistas

868

Patrimônio Líquido Fundo

6.957.180.815,09

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)

IPCA

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento

Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA

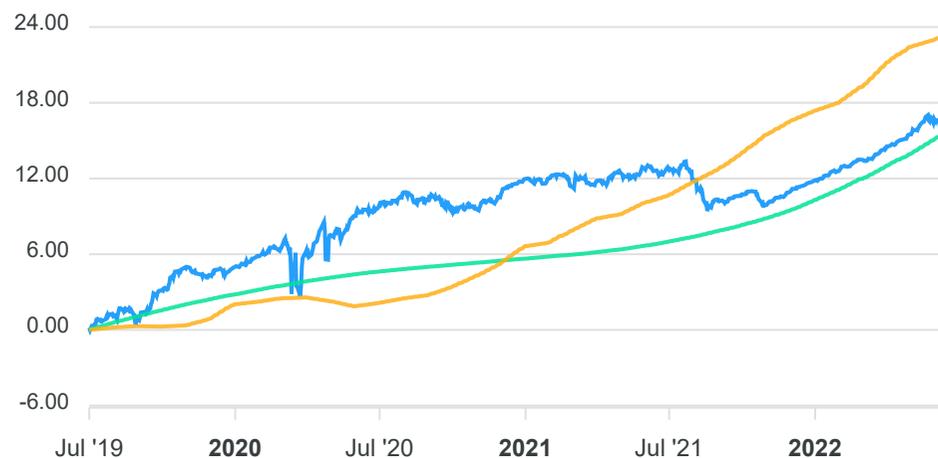
MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA, CNPJ:

10.948.555/0001-13.

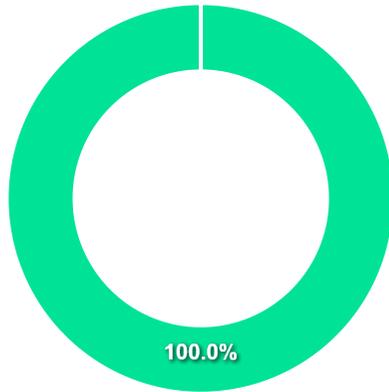
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,23%	4,59%	2,22%	4,59%	3,73%	6,51%	1,57%	3,30%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA...	5.889.220,38	100,01	Fundos de Inve...	06/09/2022
Outros Valores a receber	19,34	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a pagar	-330,33	-0,01	Valores a paga...	06/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	5.889.220,38	100.01%
● Valores a pagar/receber	-310,98	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 1.073

Patrimônio Líquido Fundo
 11.226.926.091,22

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
 IDKA IPCA 2 Anos

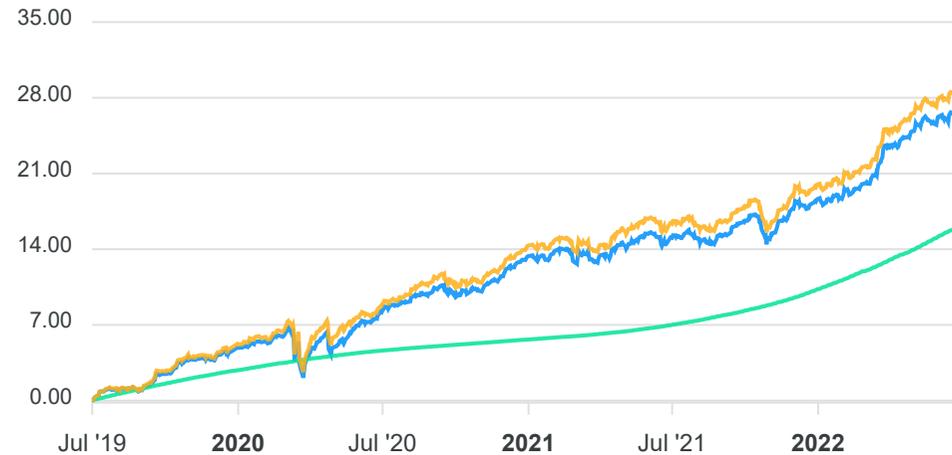
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

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

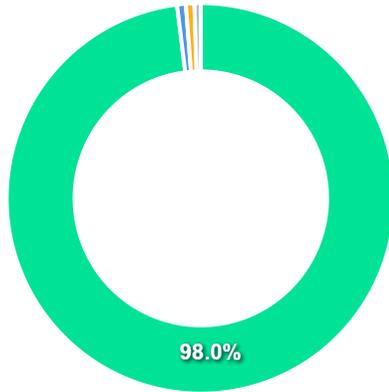
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,22%	6,41%	2,50%	6,41%	9,66%	16,68%	1,39%	2,93%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,47%	6,85%	2,86%	6,85%	10,11%	17,88%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	7.869.311,78	80,52	Títulos Federa...	08/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	1.818.657,01	18,61	Títulos Federa...	08/09/2022
Outros Valores a receber	70.166,94	0,72	Valores a paga...	08/09/2022
Vendas a termo a receber / RENDA FIXA TERMO	70.075,13	0,72	Outros	08/09/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	52.260,70	0,53	Operação compr...	08/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	30.250,67	0,31	Títulos Federa...	08/09/2022
Outras Disponibilidades	2.237,27	0,02	Valores a paga...	08/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	1.206,48	0,01	Títulos Federa...	08/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ24	100,16	0,00	Derivativos	08/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	0,00	0,00	Títulos Federa...	08/09/2022
Outros Valores a pagar	-339,76	0,00	Valores a paga...	08/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Títulos Federais	9.719.425,94	98.04%
● Valores a pagar/receber	72.064,45	0.73%
● Outros	70.075,13	0.71%
● Operação compromissada	52.260,70	0.53%
● Derivativos	100,16	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração

0,20%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+0

Quantidade de Cotistas

1.024

Patrimônio Líquido Fundo

11.084.704.335,99

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)

IMA-B 5

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Indexados

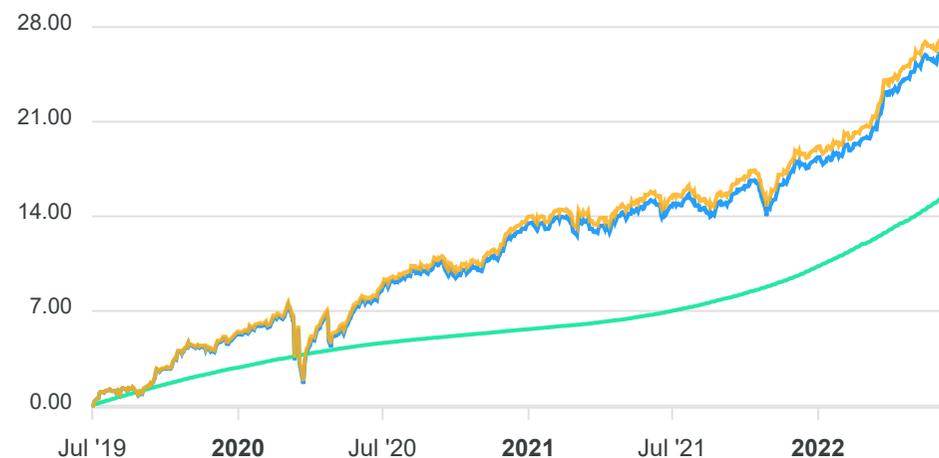
Política de Investimento

Aplica 100% dos recursos em títulos públicos federais, em operações finais e/ou compromissadas, tendo como parâmetro de rentabilidade o IMA-B 5.

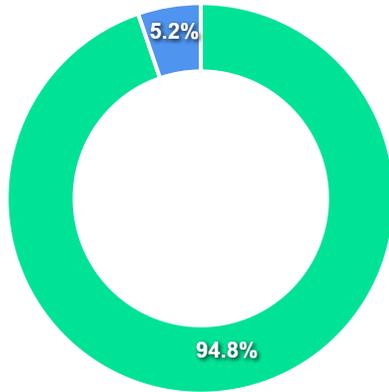
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,33%	6,51%	2,65%	6,51%	9,84%	16,18%	1,23%	2,59%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Títulos Federais	9.139.215,55	94.76%
● Operação compromissada	504.584,63	5.23%
● Valores a pagar/receber	557,82	0.01%
● Derivativos	-205,81	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	2.938.894,54	30,47	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	1.999.175,88	20,73	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.950.013,23	20,22	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	1.676.928,90	17,39	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	548.865,56	5,69	Títulos Federa...	06/09/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2023	504.584,63	5,23	Operação compr...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	12.101,65	0,13	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2026	12.041,37	0,12	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	1.194,42	0,01	Títulos Federa...	06/09/2022
Outras Disponibilidades	1.080,41	0,01	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a receber	19,34	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	0,00	0,00	Derivativos	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	0,00	0,00	Títulos Federa...	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	-205,81	0,00	Derivativos	06/09/2022
Outros Valores a pagar	-541,94	-0,01	Valores a paga...	06/09/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 1.175

Patrimônio Líquido Fundo
 5.096.804.349,76

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
 IRF-M 1

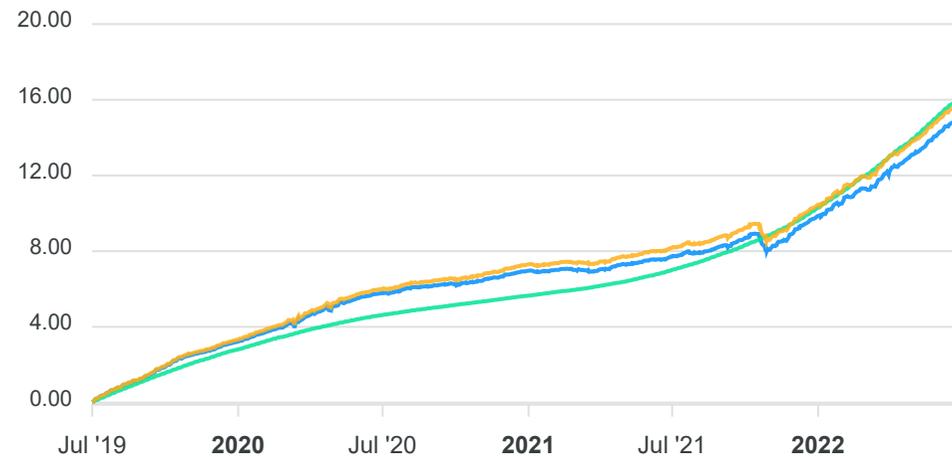
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

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

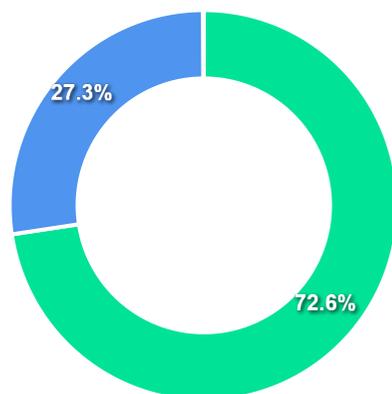
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,91%	4,86%	2,58%	4,86%	6,94%	8,89%	0,17%	0,35%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.630.640,47	72.63%
Operação compromissada	1.364.485,68	27.30%
Valores a pagar/receber	3.448,55	0.07%
Derivativos	333,48	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	1.453.165,90	29,07	Títulos Federa...	06/09/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	1.364.485,68	27,30	Operação compr...	06/09/2022
LTN - Venc.: 01/07/2023	878.950,99	17,58	Títulos Federa...	06/09/2022
LTN - Venc: 01/10/2022	634.744,47	12,70	Títulos Federa...	06/09/2022
LTN - Venc.: 01/01/2023	328.822,85	6,58	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2022	263.780,39	5,28	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	44.776,09	0,90	Títulos Federa...	06/09/2022
LTN - Venc: 01/04/2023	26.399,77	0,53	Títulos Federa...	06/09/2022
Outras Disponibilidades	3.291,61	0,07	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a receber	351,66	0,01	Valores a paga...	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	301,85	0,01	Derivativos	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF23	21,03	0,00	Derivativos	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ23	11,18	0,00	Derivativos	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV22	-0,58	0,00	Derivativos	06/09/2022
Outros Valores a pagar	-194,72	0,00	Valores a paga...	06/09/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 588

Patrimônio Líquido Fundo
 17.877.663.669,31

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
 CDI

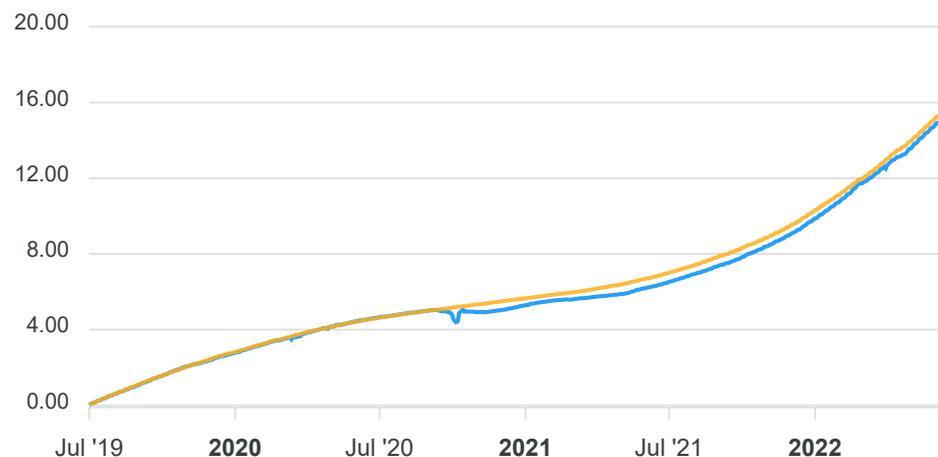
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Livre Soberano

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

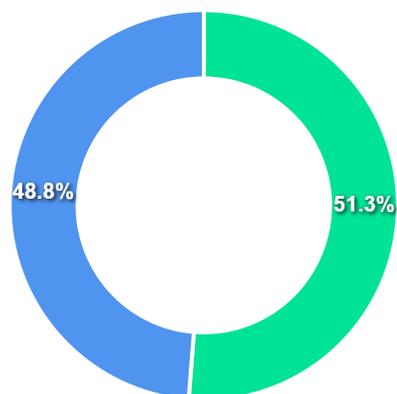
COMPARATIVO

30/06/2022

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



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	9.108.081,41	51.26%
Títulos Federais	8.662.579,48	48.76%
Valores a pagar/receber	-939,52	-0.01%
Derivativos	-2.665,04	-0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	9.108.081,41	51,26	Operação compr...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	3.098.176,60	17,44	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2027	1.450.042,31	8,16	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/03/2027	1.098.740,35	6,18	Títulos Federa...	06/09/2022
LTN - Venc: 01/07/2025	709.868,41	3,99	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2026	695.569,63	3,91	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2024	396.256,83	2,23	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/03/2024	248.147,67	1,40	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/03/2025	232.493,65	1,31	Títulos Federa...	06/09/2022
LTN - Venc.: 01/01/2026	195.620,30	1,10	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/03/2026	142.177,39	0,80	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2022	126.026,93	0,71	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/03/2028	119.878,78	0,67	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	107.353,71	0,60	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	42.226,92	0,24	Títulos Federa...	06/09/2022
Outras Disponibilidades	2.282,67	0,01	Valores a paga...	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	135,58	0,00	Derivativos	06/09/2022
Outros Valores a receber	19,87	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
LTN - Venc.: 01/07/2023	0,00	0,00	Títulos Federa...	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas - DAPFUTQ24	-81,61	0,00	Derivativos	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas - DAPFUTK25	-242,30	0,00	Derivativos	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF24	-449,18	0,00	Derivativos	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF26	-661,26	0,00	Derivativos	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTN25	-1.366,25	-0,01	Derivativos	06/09/2022
Outros Valores a pagar	-3.242,06	-0,02	Valores a paga...	06/09/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
 0,15%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 2.294

Patrimônio Líquido Fundo
 26.053.019.414,33

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
 CDI

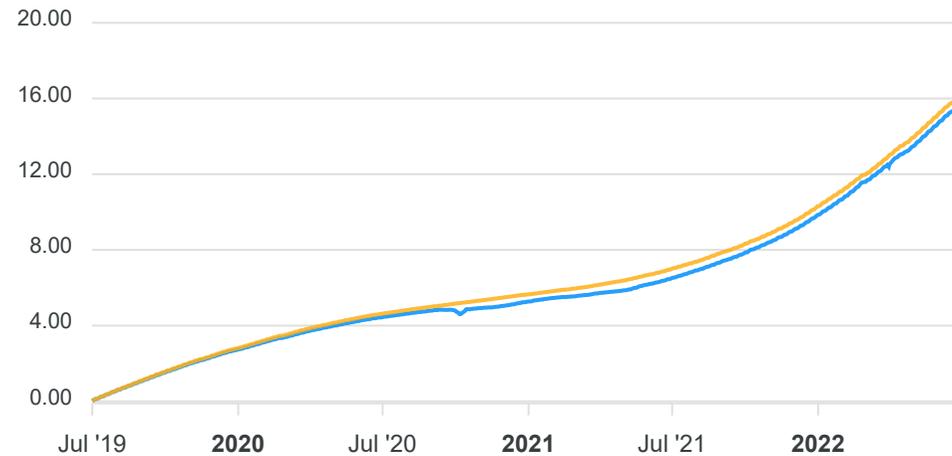
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Simples

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimentos classificados como Referenciados DI, os quais investem em ativos financeiros que buscam acompanhar a variação do CDI ou da taxa Selic.

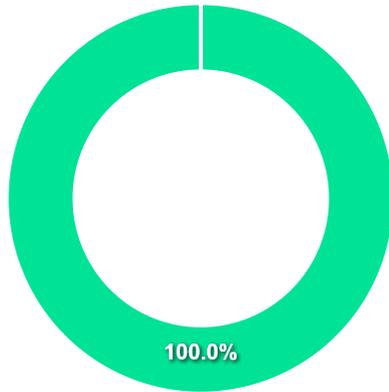
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,02%	5,42%	2,86%	5,42%	8,73%	10,87%	0,01%	0,02%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	29.375.419,17	100,01	Fundos de Inve...	07/09/2022
Outras Disponibilidades	50,07	0,00	Valores a paga...	07/09/2022
Outros Valores a receber	15,35	0,00	Valores a paga...	07/09/2022
Outros Valores a pagar	-3.956,47	-0,01	Valores a paga...	07/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	29.375.419,17	100.01%
● Valores a pagar/receber	-3.891,05	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão	SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração	0,10%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	182
Patrimônio Líquido Fundo	1.328.159.744,16

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Indicador de Desempenho (CVM)	IMA-B 5
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aloca os seus recursos em cotas de fundos da classe Renda Fixa, que tenham como principal fator de risco a variação dos índices de preços ou da taxa de juros doméstica. Pode atuar nos mercados de derivativos para fins de hedge e posicionamento.

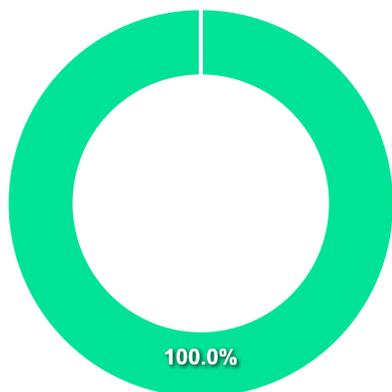
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,32%	6,50%	2,64%	6,50%	9,82%	16,23%	1,25%	2,64%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.027.694,23	100,01	Fundos de Inve...	12/09/2022
Outros Valores a receber	262,15	0,03	Valores a paga...	12/09/2022
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a paga...	12/09/2022
Outros Valores a pagar	-344,84	-0,03	Valores a paga...	12/09/2022

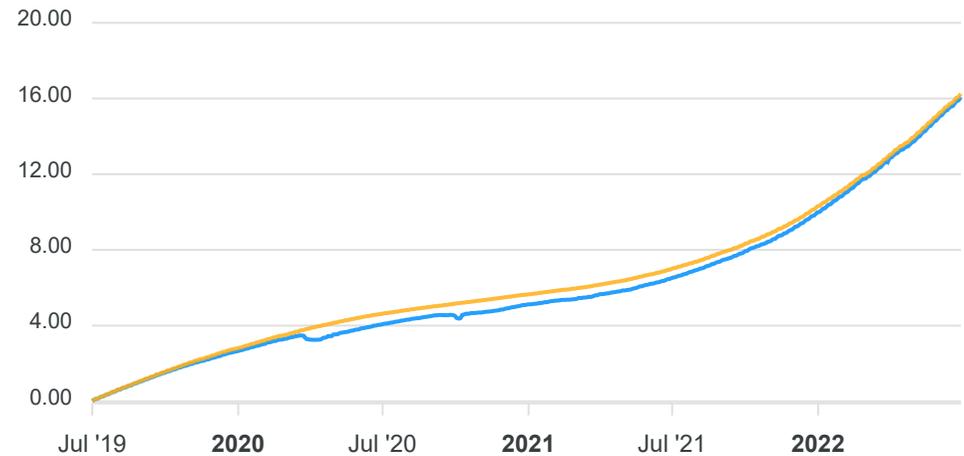
Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	1.027.694,23	100.01%
● Valores a pagar/receber	-77,69	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS
Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 974
Patrimônio Líquido Fundo 9.838.414.136,64

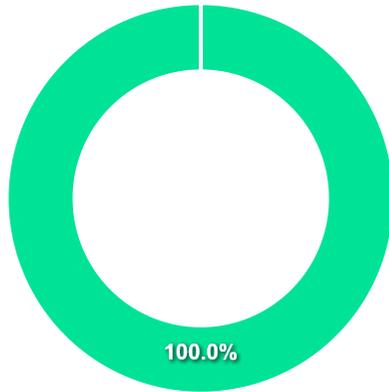
PERFIL DO FUNDO
Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Indicador de Desempenho (CVM) CDI
Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento
Política de Investimento Investe, no mínimo, 80% de sua carteira em cotas de fundo investimento cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

	COMPARATIVO							
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,03%	5,54%	2,90%	5,54%	8,98%	11,54%	0,01%	0,02%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		

30/06/2022



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L...	11.325.144,68	100,00	Fundos de Inve...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,73	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	2,37	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,33	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-89,88	0,00	Valores a paga...	02/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	11.325.144,68	100.00%
● Valores a pagar/receber	-59,41	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

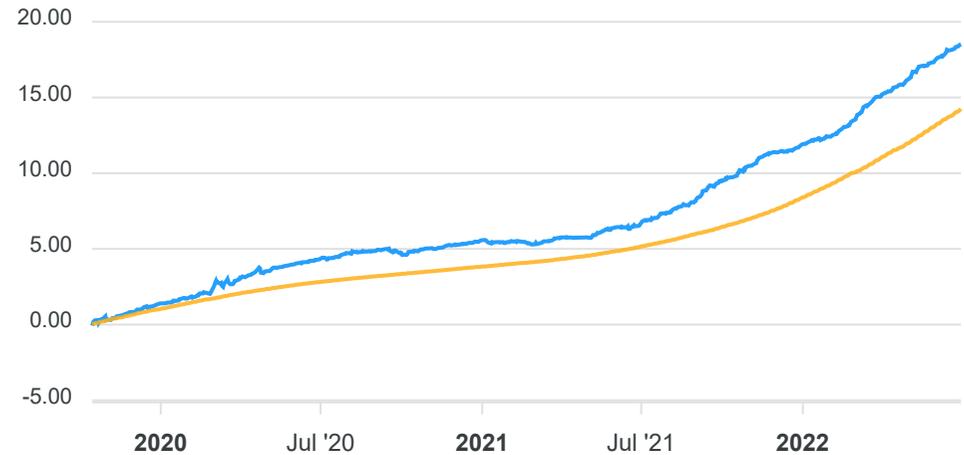
Administrador	ITAU UNIBANCO S.A.
Gestão	ITAU UNIBANCO S.A.
Taxa de Administração	0,50%
Taxa de Performance	20,00%
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	171
Patrimônio Líquido Fundo	2.482.745.591,73

PERFIL DO FUNDO

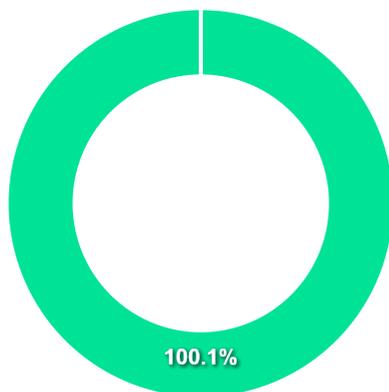
Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Indicador de Desempenho (CVM)	CDI
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento
Política de Investimento	Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa.

COMPARATIVO 📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,95%	5,91%	2,99%	5,91%	11,12%	13,61%	0,36%	0,76%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FI RENDA FIXA ...	822.886,35	38,30	Fundos de Inve...	07/09/2022
Cotas de ITAÚ DELTA INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	482.613,51	22,46	Fundos de Inve...	07/09/2022
Cotas de ITAÚ UNIBANCO FIDELIDADE W3 FI RENDA FIXA	438.253,52	20,40	Fundos de Inve...	07/09/2022
Cotas de ITAÚ LEGEND FI RENDA FIXA LP	207.869,99	9,67	Fundos de Inve...	07/09/2022
Cotas de ITAÚ INSTITUCIONAL ARTAX FI RENDA FIXA LP	197.097,56	9,17	Fundos de Inve...	07/09/2022
Cotas de ITAÚ INSTITUCIONAL LUMINA PLUS FI RENDA F...	1.000,00	0,05	Fundos de Inve...	07/09/2022
Outros Valores a receber	540,09	0,03	Valores a paga...	07/09/2022
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	259,83	0,01	Fundos de Inve...	07/09/2022
Outras Disponibilidades	69,72	0,00	Valores a paga...	07/09/2022
Outros Valores a pagar	-1.902,30	-0,09	Valores a paga...	07/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	2.149.980,76	100.06%
● Valores a pagar/receber	-1.292,49	-0.06%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão	SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração	0,30%
Taxa de Performance	20,00%
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	113
Patrimônio Líquido Fundo	743.360.830,24

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Indicador de Desempenho (CVM)	IMA-B 5
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral, atrelados à variação dos índices de preços e/ou das taxas de juros.

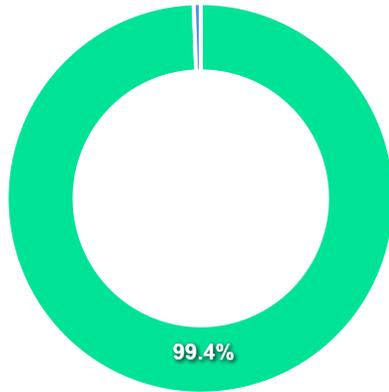
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,31%	6,50%	2,62%	6,50%	9,29%	15,36%	1,25%	2,63%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	193.232,37	29,66	Títulos Federa...	12/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	175.953,15	27,00	Títulos Federa...	12/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	129.590,93	19,89	Títulos Federa...	12/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	112.336,67	17,24	Títulos Federa...	12/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	36.785,46	5,65	Títulos Federa...	12/09/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	3.858,89	0,59	Operação compr...	12/09/2022
Outros Valores a receber	1.585,12	0,24	Valores a paga...	12/09/2022
Outras Disponibilidades	10,69	0,00	Valores a paga...	12/09/2022
Outros Valores a pagar	-1.795,58	-0,28	Valores a paga...	12/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Títulos Federais	647.898,58	99.44%
● Operação compromissada	3.858,89	0.59%
● Valores a pagar/receber	-199,76	-0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.
Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 496
Patrimônio Líquido Fundo 5.205.931.964,48

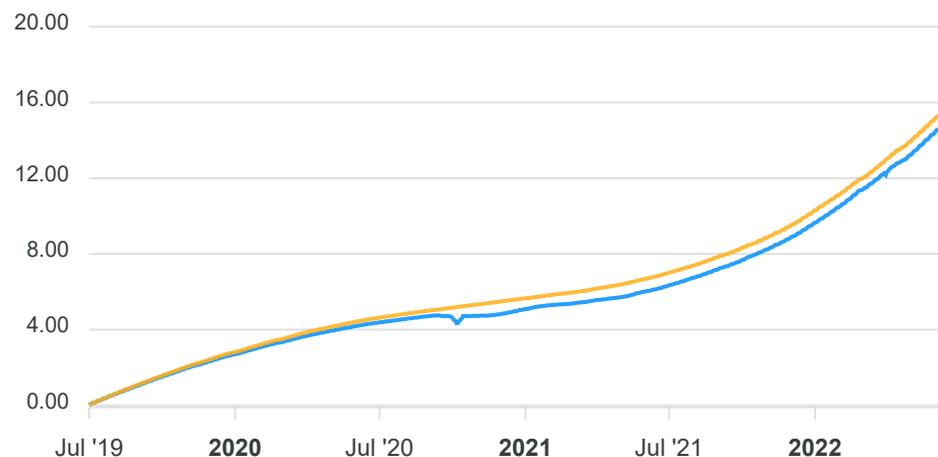
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso III, Alínea A
Indicador de Desempenho (CVM) CDI
Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Baixa Soberano
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa, os quais investem em títulos públicos federais e operações compromissadas lastreadas nestes títulos.

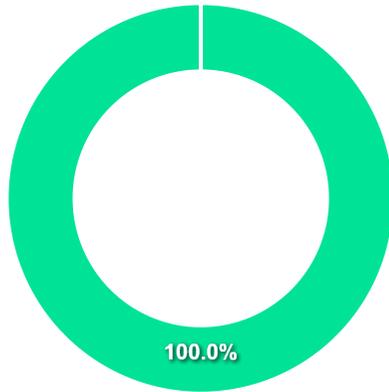
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,02%	5,38%	2,84%	5,38%	8,66%	10,70%	0,01%	0,02%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS EXCLUSIVE FIC ...	5.644.777,48	100,01	Fundos de Inve...	12/09/2022
Outros Valores a receber	38,98	0,00	Valores a paga...	12/09/2022
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a paga...	12/09/2022
Outros Valores a pagar	-766,82	-0,01	Valores a paga...	12/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	5.644.777,48	100.01%
● Valores a pagar/receber	-722,84	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BANCO GENIAL S.A.

Gestão
 GENIAL GESTAO LTDA

Taxa de Administração
 0,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 Não se aplica

Quantidade de Cotistas
 1

Patrimônio Líquido Fundo
 0,01

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso V, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
 Não definido

Classificação ANBIMA
 FIDC Fomento Mercantil

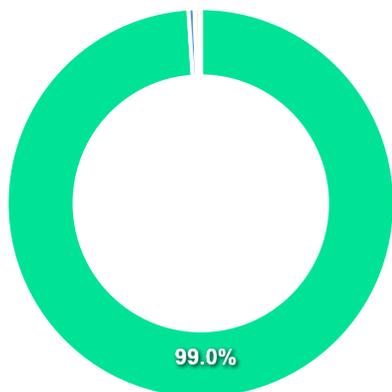
Política de Investimento
 Aplica em direitos creditórios performados oriundos dos segmentos industrial, comercial, de agronegócios (pessoa física) e de prestação de serviços.

COMPARATIVO

 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-%	-%	-%	-%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		

CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Direito Creditório	6.618,57	98.97%
● Valores a pagar/receber	34,33	0.51%
● Títulos Federais	23,91	0.36%
● Operação compromissada	10,42	0.16%
● Títulos Privados	0,00	0.00%
● Fundos de Investimento	0,00	0.00%
● Nota Promissória	0,00	0.00%
● Derivativos	0,00	0.00%
● Debêntures	0,00	0.00%
● Outros	0,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Direitos Creditórios - Multiclasse	6.618,57	999,99	Direito Credit...	11/08/2022
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	34,33	999,99	Valores a paga...	11/08/2022
Títulos Públicos Federais	23,91	999,99	Títulos Federa...	11/08/2022
Operações Compromissadas	10,42	999,99	Operação compr...	11/08/2022
Warrants, Contrato de Compra e Venda de Produtos, ...	0,00	0,00	Outros	11/08/2022
Valores a pagar - Longo Prazo (após 12 meses)	0,00	0,00	Valores a paga...	11/08/2022
Outros Valores Mobiliários	0,00	0,00	Outros	11/08/2022
Outros Ativos Financeiros de Renda Fixa	0,00	0,00	Outros	11/08/2022
Outros Ativos - Longo Prazo (após 12 meses)	0,00	0,00	Valores a paga...	11/08/2022
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	0,00	0,00	Valores a paga...	11/08/2022
Notas Promissórias Comerciais	0,00	0,00	Nota Promissór...	11/08/2022
Mercado Futuro - Ajustes Positivos	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Mercado Futuro - Ajustes Negativos	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Mercado de Opções - Posições Titulares	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Mercado de Opções - Posições Lançadas	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Mercado a Termo - Posições Vendidas	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Letras Financeiras	0,00	0,00	Títulos Privad...	11/08/2022
Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a paga...	11/08/2022
Diferencial de SWAP a Receber	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Diferencial de SWAP a Pagar	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Depósitos de Margem	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Debêntures	0,00	0,00	Debêntures	11/08/2022
Cotas de Fundos de Investimento em Direitos Credit...	0,00	0,00	Fundos de Inve...	11/08/2022
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	0,00	0,00	Fundos de Inve...	11/08/2022
Cotas de Fundos / Demais Fundos de Investimento em...	0,00	0,00	Fundos de Inve...	11/08/2022
Coberturas Prestadas	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Certificados e Recibos de Depósitos Bancários	0,00	0,00	Títulos Privad...	11/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 2,00%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+33

Quantidade de Cotistas
 2.100

Patrimônio Líquido Fundo
 986.278.946,41

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
 Ibovespa

Classificação ANBIMA
 Ações Valor/Crescimento

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimentos da classe de ações.

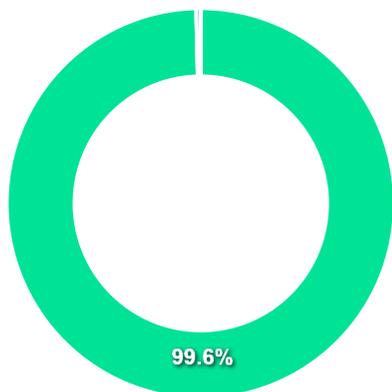
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-11,61%	-8,53%	-15,87%	-8,53%	-16,65%	12,69%	9,62%	20,26%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	1.074.855,41	99.62%
● Valores a pagar/receber	4.095,06	0.38%
● Outros	1,36	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB TOP AÇÕES VALOR FI AÇÕES	1.074.855,41	99,62	Fundos de Inve...	06/09/2022
Outros Valores a receber	9.205,00	0,85	Valores a paga...	06/09/2022
Outras Disponibilidades	4.319,99	0,40	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a receber	119,36	0,01	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a receber	100,34	0,01	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a receber	22,92	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a pagar / Auditoria	3,58	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a receber / ANBID DIFER 30/09/22	0,85	0,00	Outros	06/09/2022
Cotas de Fundos / BB TOP PRINCIPAL RENDA FIXA REFE...	0,51	0,00	Outros	06/09/2022
Outros Valores a pagar	0,00	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a pagar / IR a recolher	0,00	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a pagar / Controladoria	-9,95	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-13,86	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a pagar / Cotas a resgatar	-43,84	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a pagar / Cotas a Emitir	-100,85	-0,01	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-261,06	-0,02	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a pagar	-9.246,58	-0,86	Valores a paga...	06/09/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 1,00%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+2 du

Quantidade de Cotistas
 7.149

Patrimônio Líquido Fundo
 377.053.192,59

Patrimônio Líquido Master
 432.511.848,31

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
 Não definido

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do BB TOP
 AÇÕES AGRO FI AÇÕES, CNPJ: 40.054.367/0001-02.

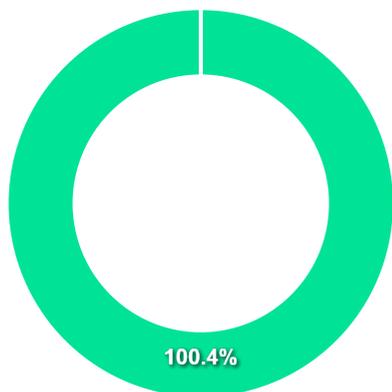
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-13,39%	-7,62%	-14,05%	-7,62%	-10,84%	-%	7,14%	15,03%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB TOP AÇÕES AGRO FI AÇÕES	417.445,25	100,01	Fundos de Inve...	02/09/2022
Outros Valores a pagar	0,14	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Outros Valores a receber	0,03	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-3,81	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-5,24	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-16,56	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Performance Negativa	-1.702,47	-0,41	Valores a paga...	02/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	417.445,25	100.42%
● Valores a pagar/receber	-1.727,91	-0.42%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	1,00%
Taxa de Performance	20,00%
Disponibilidade de Resgate	D+3
Quantidade de Cotistas	25.804
Patrimônio Líquido Fundo	1.302.667.207,42

PERFIL DO FUNDO

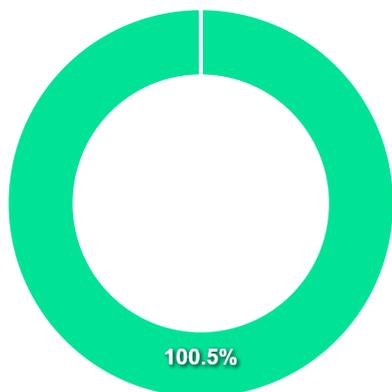
Enquadramento Resolução	Artigo 8º, Inciso I
Indicador de Desempenho (CVM)	Ibovespa
Classificação ANBIMA	Ações Livre
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento que apresentem carteira composta por ações emitidas por empresas brasileiras e seus proventos, títulos públicos federais e contratos de índices futuros.

COMPARATIVO 📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-12,76%	-7,24%	-16,81%	-7,24%	-17,83%	14,76%	9,44%	19,89%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB TOP QUANTITATIVO FI AÇÕES	1.440.537,03	100,01	Fundos de Inve...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	5,24	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Outros Valores a pagar	0,35	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-13,86	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-57,16	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Performance Negativa	-6.902,97	-0,48	Valores a paga...	02/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	1.440.537,03	100.49%
● Valores a pagar/receber	-6.968,37	-0.49%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 0,70%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+4

Quantidade de Cotistas
 93

Patrimônio Líquido Fundo
 679.415.733,50

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
 IBX-50

Classificação ANBIMA
 Ações Índice Ativo

Política de Investimento

Aplica seus recursos, preponderantemente, em ações, bônus de subscrição, cotas de fundos de investimento em ações e BDRs, selecionados com base na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.

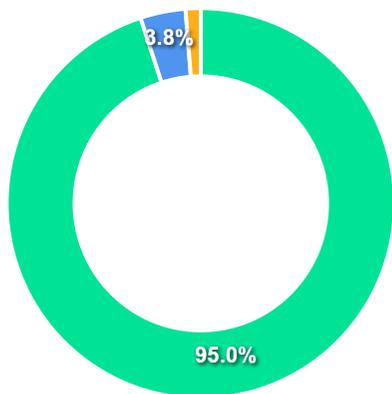
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-12,79%	-6,95%	-19,21%	-6,95%	-24,74%	2,73%	9,95%	20,95%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,67%	-5,71%	-18,35%	-5,71%	-22,70%	6,28%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Ações	659.119,64	94.97%
● Fundos de Investimento	26.159,08	3.77%
● Valores a pagar/receber	8.732,44	1.26%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
VALE ON N1 - VALE3	87.330,68	12,58	Ações	06/09/2022
BRASIL ON NM - BBAS3	48.437,73	6,98	Ações	06/09/2022
PETROBRAS PN - PETR4	46.496,28	6,70	Ações	06/09/2022
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	46.358,17	6,68	Ações	06/09/2022
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	41.490,46	5,98	Ações	06/09/2022
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	39.557,63	5,70	Ações	06/09/2022
PETROBRAS ON - PETR3	28.857,75	4,16	Ações	06/09/2022
BTGP BANCO UNT - BPAC11	26.712,32	3,85	Ações	06/09/2022
JBS ON NM - JBSS3	23.654,33	3,41	Ações	06/09/2022
Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA RE...	21.590,99	3,11	Fundos de Inve...	06/09/2022
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	20.875,67	3,01	Ações	06/09/2022
BRADESCO PN N1 - BBDC4	20.620,44	2,97	Ações	06/09/2022
TOTVS ON NM - TOTS3	20.156,30	2,90	Ações	06/09/2022
ASSAI ON NM - ASAI3	18.038,75	2,60	Ações	06/09/2022
AREZZO CO ON NM - ARZZ3	17.297,28	2,49	Ações	06/09/2022
B3 ON NM - B3SA3	14.953,27	2,15	Ações	06/09/2022
Outros Valores a receber	14.122,05	2,03	Valores a paga...	06/09/2022
AMBEV S/A ON - ABEV3	14.095,05	2,03	Ações	06/09/2022
3R PETROLEUMON NM - RRRP3	12.757,47	1,84	Ações	06/09/2022
PETZ ON NM - PETZ3	11.715,89	1,69	Ações	06/09/2022
ITAUSA PN N1 - ITSA4	9.132,29	1,32	Ações	06/09/2022
WEG ON NM - WEGE3	8.851,88	1,28	Ações	06/09/2022
LOCALIZA ON NM - RENT3	7.621,66	1,10	Ações	06/09/2022
HAPVIDA ON NM - HAPV3	6.834,35	0,98	Ações	06/09/2022
REDE D OR ON NM - RDOR3	6.532,68	0,94	Ações	06/09/2022
CBA ON NM - CBAV3	5.964,97	0,86	Ações	06/09/2022
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	5.454,94	0,79	Ações	06/09/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BANCO DAYCOVAL S.A.

Gestão
 GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA

Taxa de Administração
 1,90%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+32

Quantidade de Cotistas
 29

Patrimônio Líquido Fundo
 115.519.115,57

Patrimônio Líquido Master
 823.780.283,04

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
 Ibovespa

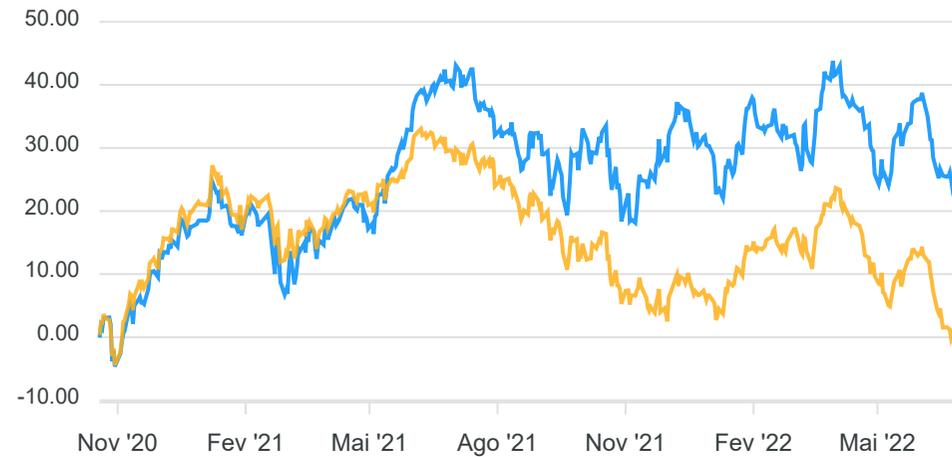
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do
 GUEPARDO INSTITUCIONAL MASTER FI AÇÕES, CNPJ:
 14.213.077/0001-54.

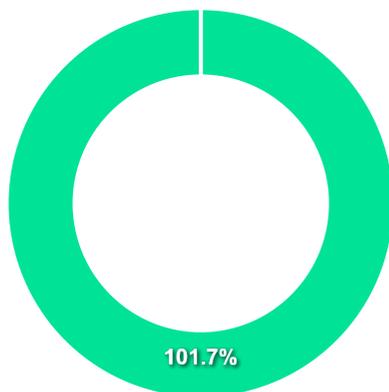
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-13,75%	-8,87%	-15,07%	-8,87%	-14,94%	-%	7,81%	16,46%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de GUEPARDO INSTITUCIONAL MASTER FI AÇÕES	147.107,88	101,67	Fundos de Inve...	05/09/2022
Outras Disponibilidades	20,22	0,01	Valores a paga...	05/09/2022
Outros Valores a receber	8,25	0,01	Valores a paga...	05/09/2022
Outros Valores a receber	0,32	0,00	Valores a paga...	05/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia e Controladoria	0,01	0,00	Valores a paga...	05/09/2022
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a paga...	05/09/2022
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a paga...	05/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-4,53	0,00	Valores a paga...	05/09/2022
Outros Valores a pagar	-4,81	0,00	Valores a paga...	05/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-6,44	0,00	Valores a paga...	05/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Gestão	-71,86	-0,05	Valores a paga...	05/09/2022
Valores a pagar / TXREBATE A PAGAR / CNPJ do emiss...	-166,49	-0,12	Outros	05/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Performance	-2.189,27	-1,51	Valores a paga...	05/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	147.107,88	101.67%
● Outros	-166,49	-0.12%
● Valores a pagar/receber	-2.248,12	-1.55%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
1,90%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+24

Quantidade de Cotistas
26.685

Patrimônio Líquido Fundo
1.911.192.204,59

Patrimônio Líquido Master
2.383.481.665,49

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do ITAÚ
DUNAMIS MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 18.138.837/0001-67.

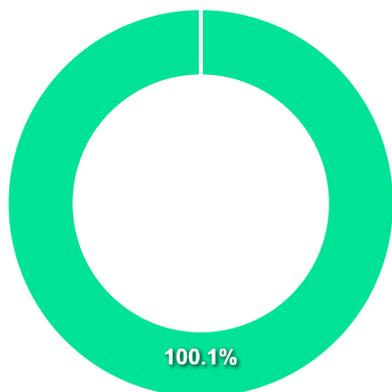
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-11,11%	-8,68%	-13,57%	-8,68%	-25,55%	2,22%	8,32%	17,52%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ DUNAMIS MASTER FI AÇÕES	2.016.662,27	99,84	Fundos de Inve...	07/09/2022
Outros Valores a receber	6.171,97	0,31	Valores a paga...	07/09/2022
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	4.772,26	0,24	Fundos de Inve...	07/09/2022
Outras Disponibilidades	70,00	0,00	Valores a paga...	07/09/2022
Outros Valores a pagar	-7.783,08	-0,39	Valores a paga...	07/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	2.021.434,53	100.08%
● Valores a pagar/receber	-1.541,12	-0.08%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
 2,50%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+24

Quantidade de Cotistas
 99

Patrimônio Líquido Fundo
 420.106.519,35

Patrimônio Líquido Master
 537.669.914,17

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
 Ibovespa

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do ITAÚ
 PHOENIX FI AÇÕES, CNPJ: 09.094.073/0001-64.

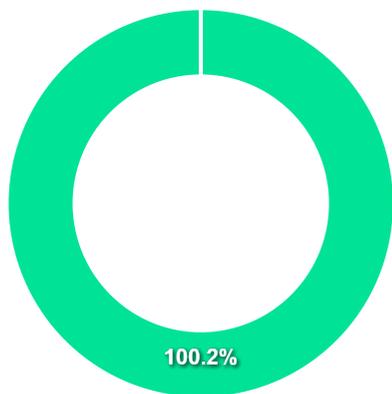
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,46%	-10,71%	-19,62%	-10,71%	-32,68%	-18,43%	8,99%	18,92%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ PHOENIX FI AÇÕES	450.920,04	99,97	Fundos de Inve...	07/09/2022
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	898,84	0,20	Fundos de Inve...	07/09/2022
Outros Valores a receber	261,01	0,06	Valores a paga...	07/09/2022
Outras Disponibilidades	70,00	0,02	Valores a paga...	07/09/2022
Outros Valores a pagar	-1.082,99	-0,24	Valores a paga...	07/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	451.818,88	100.17%
● Valores a pagar/receber	-751,98	-0.17%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BANCO DAYCOVAL S.A.

Gestão
 TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração
 2,00%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+32

Quantidade de Cotistas
 45

Patrimônio Líquido Fundo
 432.625.672,05

Patrimônio Líquido Master
 991.586.962,10

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
 Ibovespa

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do TARPON
 GT MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 27.389.566/0001-03.

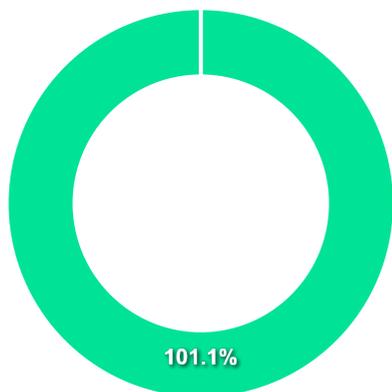
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,38%	-3,54%	-16,04%	-3,54%	-10,61%	42,09%	7,46%	15,71%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	484.801,25	101.11%
● Outros	0,01	0.00%
● Valores a pagar/receber	-5.307,91	-1.11%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de TARPON GT MASTER FI AÇÕES	484.789,10	101,11	Fundos de Inve...	08/06/2022
Outros Valores a receber	646,24	0,13	Valores a paga...	08/06/2022
Outros Valores a receber	29,41	0,01	Valores a paga...	08/06/2022
Cotas de DAYCOVAL TÍTULOS PÚBLICOS VI FI RENDA FIX...	12,14	0,00	Fundos de Inve...	08/06/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,75	0,00	Valores a paga...	08/06/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,75	0,00	Valores a paga...	08/06/2022
Outras Disponibilidades	0,43	0,00	Valores a paga...	08/06/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia e Controladoria	0,01	0,00	Valores a paga...	08/06/2022
Valores a pagar / txRebate REBATE / CNPJ do emisso...	0,01	0,00	Outros	08/06/2022
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a paga...	08/06/2022
Valores a pagar / Outras despesas provisão	-11,49	0,00	Valores a paga...	08/06/2022
Outros Valores a pagar	-12,91	0,00	Valores a paga...	08/06/2022
Valores a pagar / Taxa de Gestão	-823,31	-0,17	Valores a paga...	08/06/2022
Valores a pagar / Taxa de Performance	-5.137,79	-1,07	Valores a paga...	08/06/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.

Gestão
 SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
 1,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+8

Quantidade de Cotistas
 9.775

Patrimônio Líquido Fundo
 1.171.391.227,03

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 9º, Inciso II

Indicador de Desempenho (CVM)
 Não definido

Classificação ANBIMA
 Multimercados Investimento no Exterior

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do
 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR INVESTIMENTO NO
 EXTERIOR FI MULTIMERCADO, CNPJ: 41.687.249/0001-02.

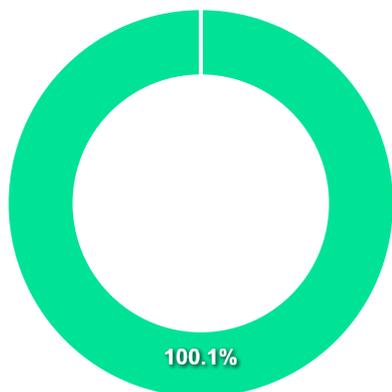
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,53%	-29,87%	-9,04%	-29,87%	-19,25%	3,34%	11,89%	25,03%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR INVESTIME...	1.098.646,51	99,77	Fundos de Inve...	12/09/2022
Outros Valores a receber	5.467,63	0,50	Valores a paga...	12/09/2022
Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS HIPER FIC REND...	3.554,18	0,32	Fundos de Inve...	12/09/2022
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a paga...	12/09/2022
Outros Valores a pagar	-6.471,96	-0,59	Valores a paga...	12/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	1.102.200,68	100.09%
● Valores a pagar/receber	-999,32	-0.09%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 1,00%

Taxa de Performance
 10,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+2 du

Quantidade de Cotistas
 34.606

Patrimônio Líquido Fundo
 535.702.587,54

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 9º, Inciso III

Indicador de Desempenho (CVM)
 Não definido

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do BB TOP
 AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BDR NÍVEL I,
 CNPJ: 39.272.928/0001-60.

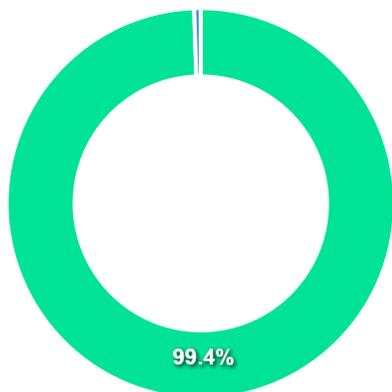
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-7,71%	-15,61%	-12,77%	-15,61%	-9,37%	-%	11,83%	24,91%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	469.732,76	99.44%
● Valores a pagar/receber	2.643,88	0.56%
● Outros	0,61	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI ...	456.582,75	96,66	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L...	13.150,00	2,78	Fundos de Inve...	06/09/2022
Outros Valores a receber	3.302,92	0,70	Valores a paga...	06/09/2022
Outras Disponibilidades	2.673,84	0,57	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a receber	22,92	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a receber / ANBID DIFER 30/09/22	0,75	0,00	Outros	06/09/2022
Valores a pagar / IR a recolher	0,16	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a receber	0,01	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,01	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a pagar	0,00	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a pagar / Auditoria	-3,57	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a pagar / Controladoria	-4,61	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-7,28	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-56,89	-0,01	Valores a paga...	06/09/2022
Valores a pagar / Cotas a resgatar	-3.283,64	-0,70	Valores a paga...	06/09/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,70%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
522

Patrimônio Líquido Fundo
2.225.410.384,30

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos em recibos de ações de empresas estrangeiras negociados no Brasil, baseando-se na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.

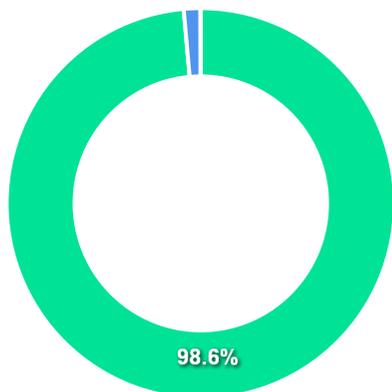
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,83%	-27,83%	-10,22%	-27,83%	-13,08%	9,72%	12,50%	26,32%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Brazilian Depository Receipts	2.220.150,78	98.59%
● Fundos de Investimento	30.815,69	1.37%
● Valores a pagar/receber	764,36	0.03%
● Outros	202,19	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
APPLE DRN - AAPL34	206.029,33	9,15	Brazilian Depo...	08/09/2022
MICROSOFT DRN - MSFT34	155.879,17	6,92	Brazilian Depo...	08/09/2022
AMAZON DRN - AMZO34	102.797,64	4,56	Brazilian Depo...	08/09/2022
TESLA INC DRN - TSLA34	68.710,93	3,05	Brazilian Depo...	08/09/2022
ALPHABET DRN C - GOGL35	55.315,93	2,46	Brazilian Depo...	08/09/2022
ALPHABET DRN A - GOGL34	49.610,13	2,20	Brazilian Depo...	08/09/2022
UNITEDHEALTH DRN - UNHH34	38.829,50	1,72	Brazilian Depo...	08/09/2022
TAIWANSMFAC DRN - TSMC34	34.512,42	1,53	Brazilian Depo...	08/09/2022
EXXON MOBIL CORPORATIO - EXXO34	32.353,19	1,44	Brazilian Depo...	08/09/2022
Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA RE...	30.815,69	1,37	Fundos de Inve...	08/09/2022
NVIDIA CORP DRN - NVDC34	30.250,04	1,34	Brazilian Depo...	08/09/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - M1TA34	30.065,60	1,34	Brazilian Depo...	08/09/2022
WALMART INC - WALM34	29.002,33	1,29	Brazilian Depo...	08/09/2022
JPMORGAN DRN - JPMC34	26.680,03	1,18	Brazilian Depo...	08/09/2022
PG DRN - PGC034	26.392,88	1,17	Brazilian Depo...	08/09/2022
MASTERCARD DRN - MSCD34	25.109,56	1,11	Brazilian Depo...	08/09/2022
CHEVRON DRN - CHVX34	24.642,53	1,09	Brazilian Depo...	08/09/2022
THE HOME DEPOT, INC - HOME34	23.790,80	1,06	Brazilian Depo...	08/09/2022
ELI LILLY AND COMPAN - LILY34	22.803,95	1,01	Brazilian Depo...	08/09/2022
BANK OF AMERICA CORPORATIO - BOAC34	21.691,93	0,96	Brazilian Depo...	08/09/2022
COCA COLA DRN - COCA34	21.452,25	0,95	Brazilian Depo...	08/09/2022
ALIBABAGR DRN - BABA34	20.558,71	0,91	Brazilian Depo...	08/09/2022
PFIZER DRN - PFIZ34	20.435,95	0,91	Brazilian Depo...	08/09/2022
TOYOTA MOTOR CORP - TMCO34	19.421,82	0,86	Brazilian Depo...	08/09/2022
ABBVIE DRN - ABBV34	18.824,62	0,84	Brazilian Depo...	08/09/2022
COSTCO DRN - COWC34	18.462,48	0,82	Brazilian Depo...	08/09/2022
MERCK DRN - MRCK34	17.141,10	0,76	Brazilian Depo...	08/09/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 0,50%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+1 du

Quantidade de Cotistas
 222.952

Patrimônio Líquido Fundo
 20.583.570.437,89

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 10º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
 CDI

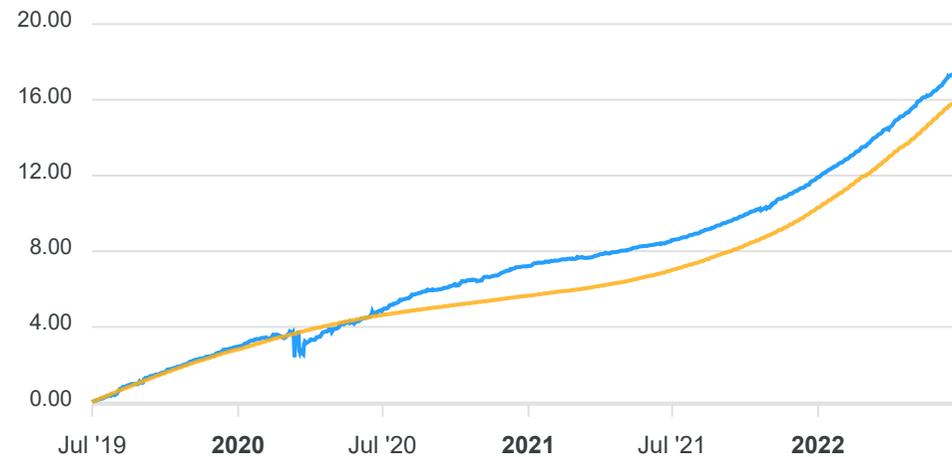
Classificação ANBIMA
 Multimercados Juros e Moedas

Política de Investimento
 Aplica em fundos que apliquem nos seguintes ativos: títulos públicos e privados, operações compromissadas, e com derivativos, fundos, fundos em direitos creditórios e excluídas operações sujeitas a risco do mercado acionário.

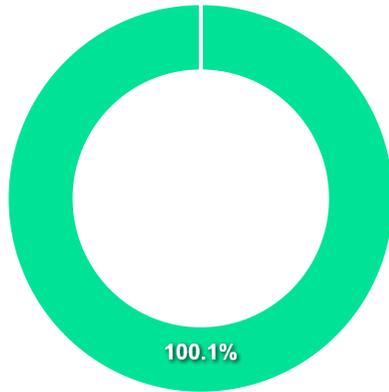
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,05%	5,26%	2,81%	5,26%	8,48%	12,36%	0,21%	0,43%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB TOP JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	19.298.084,00	100,00	Fundos de Inve...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,72	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	2,37	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Outros Valores a pagar	0,39	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-382,89	0,00	Valores a paga...	02/09/2022
Valores a pagar / Taxa de Performance Negativa	-22.373,83	-0,12	Valores a paga...	02/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	19.298.084,00	100.12%
● Valores a pagar/receber	-22.726,19	-0.12%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
 1,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+1

Quantidade de Cotistas
 1.008

Patrimônio Líquido Fundo
 1.374.157.964,02

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 10º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
 Não definido

Classificação ANBIMA
 Multimercados Estratégia Específica

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento de diversas classes, os quais investem, principalmente, em ativos que tenham como principal fator de risco a variação do preço do índice S&P 500.

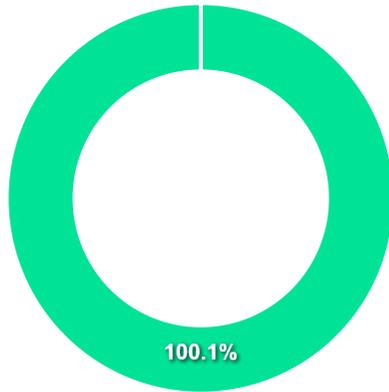
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-7,79%	-17,59%	-14,94%	-17,59%	-5,80%	31,34%	13,65%	28,75%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ INDEX S&P500® FI MULTIMERCADO	1.342.435,59	99,54	Fundos de Inve...	07/09/2022
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	7.185,08	0,53	Fundos de Inve...	07/09/2022
Outros Valores a receber	118,49	0,01	Valores a paga...	07/09/2022
Outras Disponibilidades	70,00	0,01	Valores a paga...	07/09/2022
Outros Valores a pagar	-1.167,99	-0,09	Valores a paga...	07/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	1.349.620,67	100.07%
● Valores a pagar/receber	-979,49	-0.07%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

Gestão
 SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

Taxa de Administração
 1,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+2

Quantidade de Cotistas
 150

Patrimônio Líquido Fundo
 948.117.020,14

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 10º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
 CDI

Classificação ANBIMA
 Multimercados Estratégia Específica

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em instrumentos representativos do Índice S&P 500 e em ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro e de capitais.

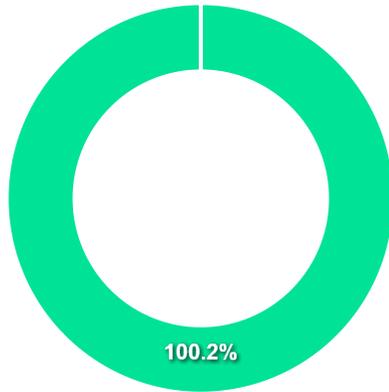
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-7,71%	-17,44%	-14,89%	-17,44%	-5,80%	30,47%	13,53%	28,50%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de SAFRA S&P REAIS RP FI MULTIMERCADO	819.576,10	100,19	Fundos de Inve...	09/09/2022
Outros Valores a receber	1.339,35	0,16	Valores a paga...	09/09/2022
Outras Disponibilidades	5,00	0,00	Valores a paga...	09/09/2022
Outros Valores a pagar	-2.930,32	-0,36	Valores a paga...	09/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	819.576,10	100.19%
● Valores a pagar/receber	-1.585,97	-0.19%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.
Gestão	CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS DO SICREDI - CONFEDERACAO SICREDI
Taxa de Administração	0,30%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1 du
Quantidade de Cotistas	5.324
Patrimônio Líquido Fundo	220.468.259,67

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 10º, Inciso I
Indicador de Desempenho (CVM)	S&P 500 (Moeda Original)
Classificação ANBIMA	Multimercados Estratégia Específica
Política de Investimento	Aplica seus recursos em ativos de diferentes naturezas, riscos e características, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial.

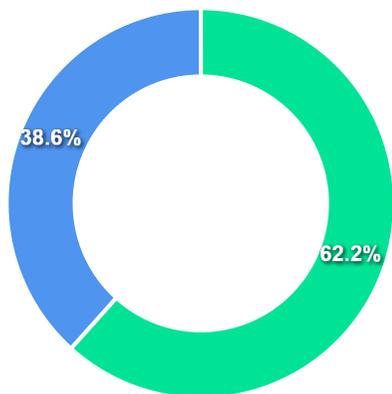
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-7,82%	-17,54%	-14,99%	-17,54%	-5,64%	-%	13,70%	28,86%
Indicador de Desempenho (CVM)	-8,39%	-20,58%	-16,45%	-20,58%	-11,92%	22,10%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/05/203...	135.241,61	62,16	Operação compr...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/03/2026	26.110,04	12,00	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2027	19.497,25	8,96	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	19.062,44	8,76	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/03/2028	9.710,19	4,46	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2028	4.694,04	2,16	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	1.936,04	0,89	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/03/2027	1.561,19	0,72	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/03/2025	1.256,20	0,58	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2022	242,03	0,11	Títulos Federa...	06/09/2022
Outros Valores a receber	8,60	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Outras Disponibilidades	3,82	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / FUT WSP/U22	-35,86	-0,02	Outros	06/09/2022
Outros Valores a pagar	-194,30	-0,09	Valores a paga...	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / FUT ISP/U22	-1.521,06	-0,70	Outros	06/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	135.241,61	62.16%
Títulos Federais	84.069,43	38.64%
Valores a pagar/receber	-181,87	-0.08%
Outros	-1.556,92	-0.72%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
RJI CORRETORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS
LTDA

Gestão
GENIAL GESTAO LTDA

Taxa de Administração
0,30%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
Não se aplica

Quantidade de Cotistas
Não informado

Patrimônio Líquido Fundo
Não informado

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 10º, Inciso II

Indicador de Desempenho (CVM)
IPCA + 10,50% ao ano

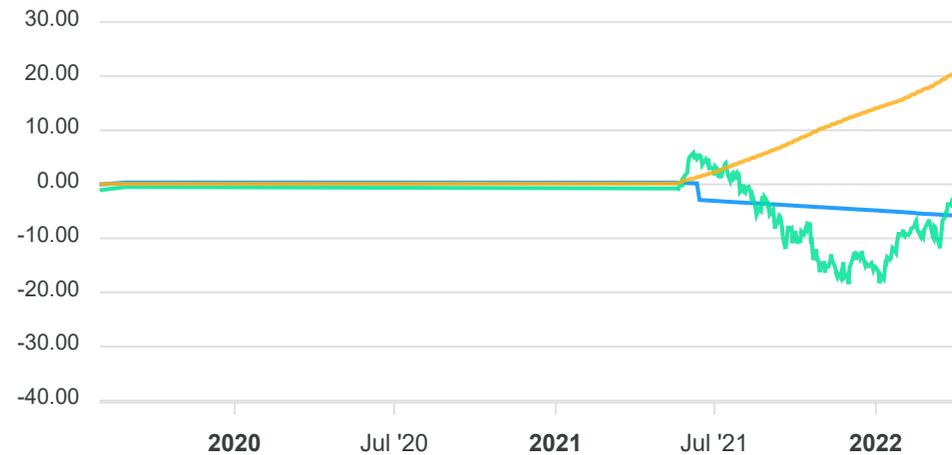
Classificação ANBIMA
Fundos de Participações

Política de Investimento
Investe em ações, Títulos e Valores Mobiliários, conversíveis ou permutáveis em ações, de modo participar do processo decisório da empresa no setor de Geração de Energia.

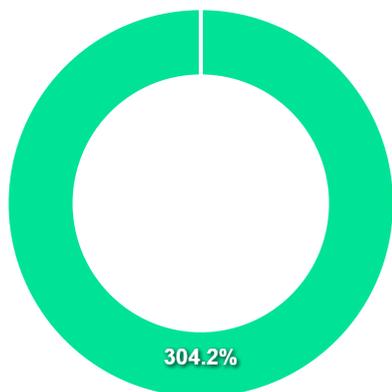
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-%	-%	-%	-%	-%	-%	-%	-%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,51%	10,80%	4,80%	10,89%	23,63%	48,02%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Outros Valores a pagar	23.010,67	-339,14	Valores a paga...	11/07/2022
Ação de Companhia Fechada - STIG ENERGIA E PROJETO...	0,00	0,00	Ações	11/07/2022
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a paga...	11/07/2022
Outros Valores a receber	-2.368,37	34,91	Valores a paga...	11/07/2022
Ação de Companhia Fechada - GREEN OIL PARTICIPAÇÃO...	-13.857,34	204,24	Ações	11/07/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Valores a pagar/receber	20.642,30	304.24%
Ações	-13.857,34	-204.24%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
RJI CORRETORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS
LTDA

Gestão
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.

Taxa de Administração
1,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
Não se aplica

Quantidade de Cotistas
Não informado

Patrimônio Líquido Fundo
Não informado

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 11º

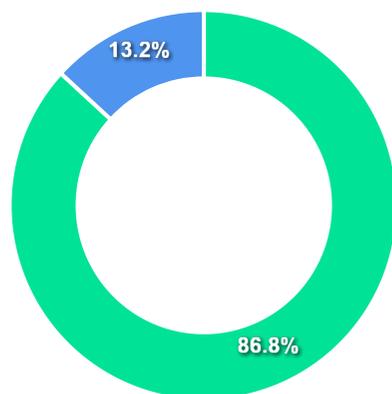
Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

Classificação ANBIMA
FII Desenvolvimento para Venda Gestão Ativa

Política de Investimento
Investir em empreendimentos imobiliários, assim como em cotas de FIP e de sociedades de propósitos específicos. Parcela do patrimônio não aplicada em imóveis está limitada a 25%. Imóveis residenciais não poderão integrar o patrimônio.

COMPARATIVO
 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-%	-%	-%	-%	-%	-%	-%	-%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		

CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	1.858,89	86.82%
● Valores a pagar/receber	282,10	13.18%
● Imóveis	0,00	0.00%
● Outros	0,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de VANQUISH RF ATIVO FI RENDA FIXA	859,75	1,15	Fundos de Inve...	01/06/2022
Cotas de VANQUISH JURO REAL IMA-B FI RENDA FIXA	677,95	0,91	Fundos de Inve...	01/06/2022
Disponibilidades - Títulos Públicos	495,99	0,66	Valores a paga...	01/06/2022
Cotas de BTG PACTUAL TESOURO GERAL FI RENDA FIXA R...	321,19	0,43	Fundos de Inve...	01/06/2022
Outras Disponibilidades	1,00	0,00	Valores a paga...	01/06/2022
Imóveis para Renda (acabado) GALPÃO INDUSTRIAL/C...	0,00	0,00	Imóveis	01/06/2022
Imóveis para Renda (acabado) TERRENO E GALPÃO CO...	0,00	0,00	Imóveis	01/06/2022
Imóveis para Renda (acabado) SALA COMERCIAL NA A ...	0,00	0,00	Imóveis	01/06/2022
Imóveis para Renda (acabado) RUA RODRIGO S ILVA, ...	0,00	0,00	Imóveis	01/06/2022
Imóveis para Renda (acabado) LOJA SITUAD A NA RUA...	0,00	0,00	Imóveis	01/06/2022
Imóveis para Renda (acabado) LOJA COMERCIAL SITU...	0,00	0,00	Imóveis	01/06/2022
Imóveis para Renda (acabado) GALPÃO INDUSTRIAL/PR...	0,00	0,00	Imóveis	01/06/2022
Imóveis para Renda (acabado) GALPÃO INDUSTRIAL /...	0,00	0,00	Imóveis	01/06/2022
Imóveis para Renda (acabado) GALPÃO COMERCIAL/IN...	0,00	0,00	Imóveis	01/06/2022
Imóveis para Renda (acabado) ESCRITÓRIO SITUADO N...	0,00	0,00	Imóveis	01/06/2022
Imóveis para Renda (acabado) AV. RIO BRANCO , 115...	0,00	0,00	Imóveis	01/06/2022
Disponibilidades / Fundos de Renda Fixa	0,00	0,00	Outros	01/06/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-72,60	-0,10	Valores a paga...	01/06/2022
Outros Valores a pagar	-142,28	-0,19	Valores a paga...	01/06/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BFL ADMINISTRACAO DE RECURSOS LTDA

Gestão
 RENDA ASSET ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração
 3,00%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+31 ou D+1800

Quantidade de Cotistas
 7

Patrimônio Líquido Fundo
 9.134.772,31

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Não Enquadrado - RV

Indicador de Desempenho (CVM)
 Ibovespa

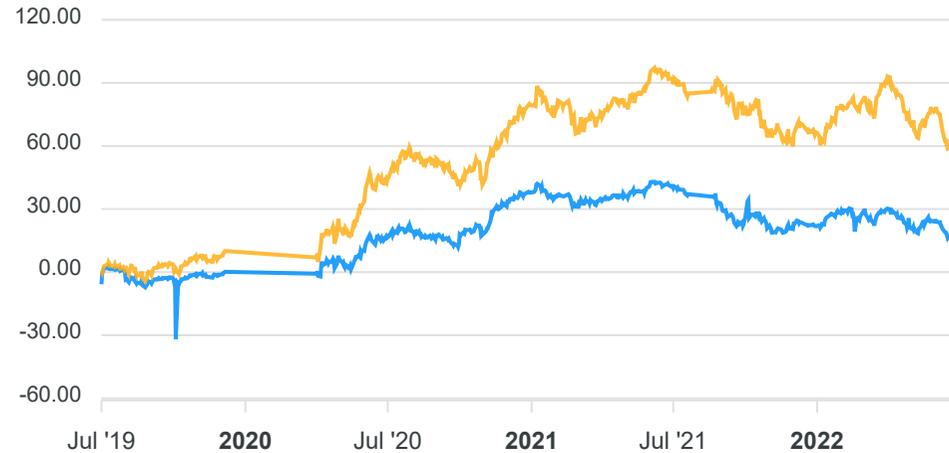
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, principalmente, no mercado acionário.

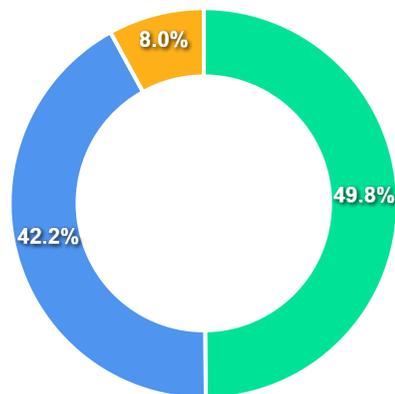
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-5,33%	-3,33%	-9,31%	-3,33%	-23,10%	-6,89%	-%	-%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Ações	4.864,10	49.84%
● Fundos de Investimento	4.116,03	42.17%
● Valores a pagar/receber	779,49	7.99%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de RENDA FI AÇÕES	1.318,22	13,51	Fundos de Inve...	04/09/2022
PETROBRAS PN - PETR4	1.163,05	11,92	Ações	04/09/2022
Cotas de ÁQUILLA FII - AQLL11	1.040,71	10,66	Fundos de Inve...	04/09/2022
VALE ON N1 - VALE3	973,95	9,98	Ações	04/09/2022
ITAUSA PN N1 - ITSA4	960,75	9,84	Ações	04/09/2022
Outras Disponibilidades	834,17	8,55	Valores a paga...	04/09/2022
Cotas de MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI REND...	754,07	7,73	Fundos de Inve...	04/09/2022
BRADESCO ON N1 - BBDC3	696,96	7,14	Ações	04/09/2022
Cotas de SÃO DOMINGOS FII - FISD11	572,52	5,87	Fundos de Inve...	04/09/2022
AMBEV S/A ON - ABEV3	534,45	5,48	Ações	04/09/2022
Cotas de BFL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	430,50	4,41	Fundos de Inve...	04/09/2022
B3 ON NM - B3SA3	237,00	2,43	Ações	04/09/2022
USIMINAS PNA N1 - USIM5	160,40	1,64	Ações	04/09/2022
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	88,52	0,91	Ações	04/09/2022
AMERICANAS ON NM - AMER3	49,02	0,50	Ações	04/09/2022
Outros Valores a receber	5,52	0,06	Valores a paga...	04/09/2022
Outros Valores a pagar	-60,20	-0,62	Valores a paga...	04/09/2022

