

2022

Relatório Mensal

Julho

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, Ítem 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
TÍTULOS PÚBLICOS	102.781.698,89	40,61%	0,00		7º I a
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.095.448,58	6,76%	9.515.072.681,60	0,18%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	19.225.177,81	7,60%	6.564.821.510,69	0,29%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.768.539,42	1,49%	4.977.668.769,91	0,08%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	145.724,68	0,06%	260.423.123,57	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.282.335,40	0,90%	6.217.671.822,00	0,04%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.684.776,79	4,62%	10.530.457.571,28	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.320.382,64	3,68%	10.426.166.067,57	0,09%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	831.876,65	0,33%	5.065.234.429,28	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.040.448,73	2,39%	17.603.375.022,43	0,03%	7º I b
ITAU SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	621,46	0,00%	27.656.938.250,87	0,00%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	5.028.229,72	1,99%	1.121.658.731,38	0,45%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	7.421.787,59	2,93%	10.247.937.610,00	0,07%	7º III a
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	7.125.891,73	2,82%	2.570.604.364,13	0,28%	7º III a
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	12.666.290,35	5,01%	693.203.660,92	1,83%	7º III a
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.019.211,41	1,59%	5.329.731.645,95	0,08%	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	5.630.138,36	2,22%	1.028.283.715,44	0,55%	8º I
BB AGRO FIC AÇÕES	2.621.464,47	1,04%	454.547.332,55	0,58%	8º I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.360.765,62	0,54%	1.372.384.612,53	0,10%	8º I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.313.272,47	1,31%	680.392.016,51	0,49%	8º I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.641.497,81	1,04%	927.513.548,57	0,28%	8º I
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	5.658.653,11	2,24%	2.427.382.604,51	0,23%	8º I
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.944.714,87	0,77%	553.337.313,47	0,35%	8º I
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	2.831.094,38	1,12%	1.085.261.572,86	0,26%	8º I
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.161.927,18	0,46%	1.161.561.395,32	0,10%	9º II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.456.906,08	0,97%	513.986.694,29	0,48%	9º III

Investimentos

\$ 253.069.138,44

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 253.069.138,44

Governança (Pró Gestão)
 NÍVEL 2 01/06/2024

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	421.551,99	0,17%	2.340.707.282,75	0,02%	9º III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.805.133,37	0,71%	20.361.441.454,37	0,01%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.686.925,45	1,06%	1.437.147.092,41	0,19%	10º I
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.780.778,33	0,70%	877.251.347,58	0,20%	10º I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.711.896,39	2,26%	233.881.327,21	2,44%	10º I
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	0,01	0,00%	0,00		10º II
HAZ FII - ATCR11	805.807,73	0,32%	0,00		11º
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	798.168,96	0,32%	9.558.444,88	8,35%	NE

Investimentos

\$ 253.069.138,44

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 253.069.138,44

Governança (Pró Gestão)
 NIVEL 2 01/06/2024

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/05/2035	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8500%	302	4.093,546643	1.236.251,09
NTN-B - 15/05/2035	16/03/2022	Curva - Taxa: 5,8950%	478	4.077,850630	1.949.212,60
NTN-B - 15/05/2035	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,3810%	909	4.262,077507	3.874.228,45
NTN-B - 15/05/2035	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,7110%	224	4.142,547860	927.930,72
NTN-B - 15/05/2035	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,0286%	232	4.031,727148	935.360,70
NTN-B - 15/08/2040	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8480%	619	4.166,016150	2.578.764,00
NTN-B - 15/08/2040	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,4110%	1.182	4.362,830130	5.156.865,21
NTN-B - 15/08/2040	30/03/2022	Curva - Taxa: 5,4660%	586	4.337,337062	2.541.679,52
NTN-B - 15/08/2040	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,7210%	295	4.221,876899	1.245.453,69
NTN-B - 15/08/2040	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,0481%	297	4.080,134483	1.211.799,94
NTN-B - 15/05/2045	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8500%	1.053	4.116,811659	4.335.002,68
NTN-B - 15/05/2045	16/03/2022	Curva - Taxa: 5,9410%	1.059	4.072,178860	4.312.437,41
NTN-B - 15/05/2045	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,5010%	2.031	4.294,876516	8.722.894,20
NTN-B - 15/05/2045	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,8200%	508	4.131,682615	2.098.894,77
NTN-B - 15/05/2045	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,1386%	529	3.977,719788	2.104.213,77
NTN-B - 15/08/2050	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8500%	1.320	4.183,246690	5.521.885,63
NTN-B - 15/08/2050	16/03/2022	Curva - Taxa: 5,9410%	1.328	4.134,209602	5.490.230,35
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,5210%	2.535	4.368,402255	11.073.899,72
NTN-B - 15/08/2050	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,8200%	637	4.199,612315	2.675.153,04
NTN-B - 15/08/2050	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,1622%	650	4.018,757410	2.612.192,32
NTN-B - 15/05/2055	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8400%	1.573	4.136,122778	6.506.121,13
NTN-B - 15/05/2055	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,5200%	3.010	4.328,373036	13.028.402,84
NTN-B - 15/05/2055	30/03/2022	Curva - Taxa: 5,5810%	1.486	4.290,631657	6.375.878,64
NTN-B - 15/05/2055	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,8200%	754	4.147,729378	3.127.387,95
NTN-B - 15/05/2055	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,1660%	794	3.954,104024	3.139.558,60

Investimentos

\$ 253.069.138,44

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 253.069.138,44

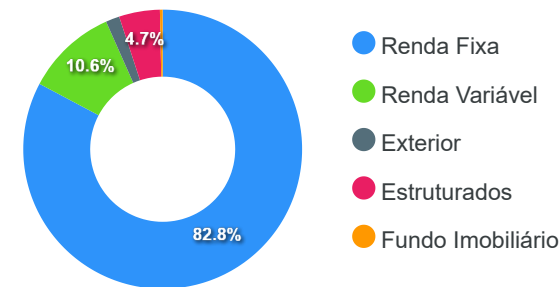
Governança (Pró Gestão)
 NIVEL 2 01/06/2024

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Utilizado	Utilizado	Livre
7° I a - Títulos TN SELIC	100,00%	40,61%	102.781.698,89	59,39%	150.287.439,55
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	29,80%	75.423.561,88	70,20%	177.645.576,56
7° III a - FI Referenciados RF	70,00%	12,34%	31.233.181,08	57,66%	145.915.215,83
7° V a - FIDC Cota Sênior	10,00%	0,00%	0,01	10,00%	25.306.913,83
8° I - Fundos de Ações	40,00%	10,27%	26.001.601,09	29,73%	75.226.054,29
9° II - Constituídos no Brasil	10,00%	0,46%	1.161.927,18	9,54%	24.144.986,66
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,14%	2.878.458,07	8,86%	22.428.455,77
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	4,74%	11.984.733,54	5,26%	13.322.180,30
10° II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	0,00%	0,01	5,00%	12.653.456,91
11° - Fundos Imobiliários	10,00%	0,32%	805.807,73	9,68%	24.501.106,11
Não Enquadrado	0,00%	0,32%	798.168,96	-0,32%	-798.168,96

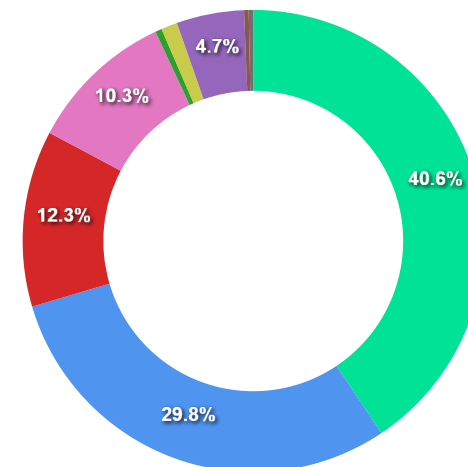
Governança (Pró Gestão)

NIVEL 2 01/06/2024

Segmentos



Artigos



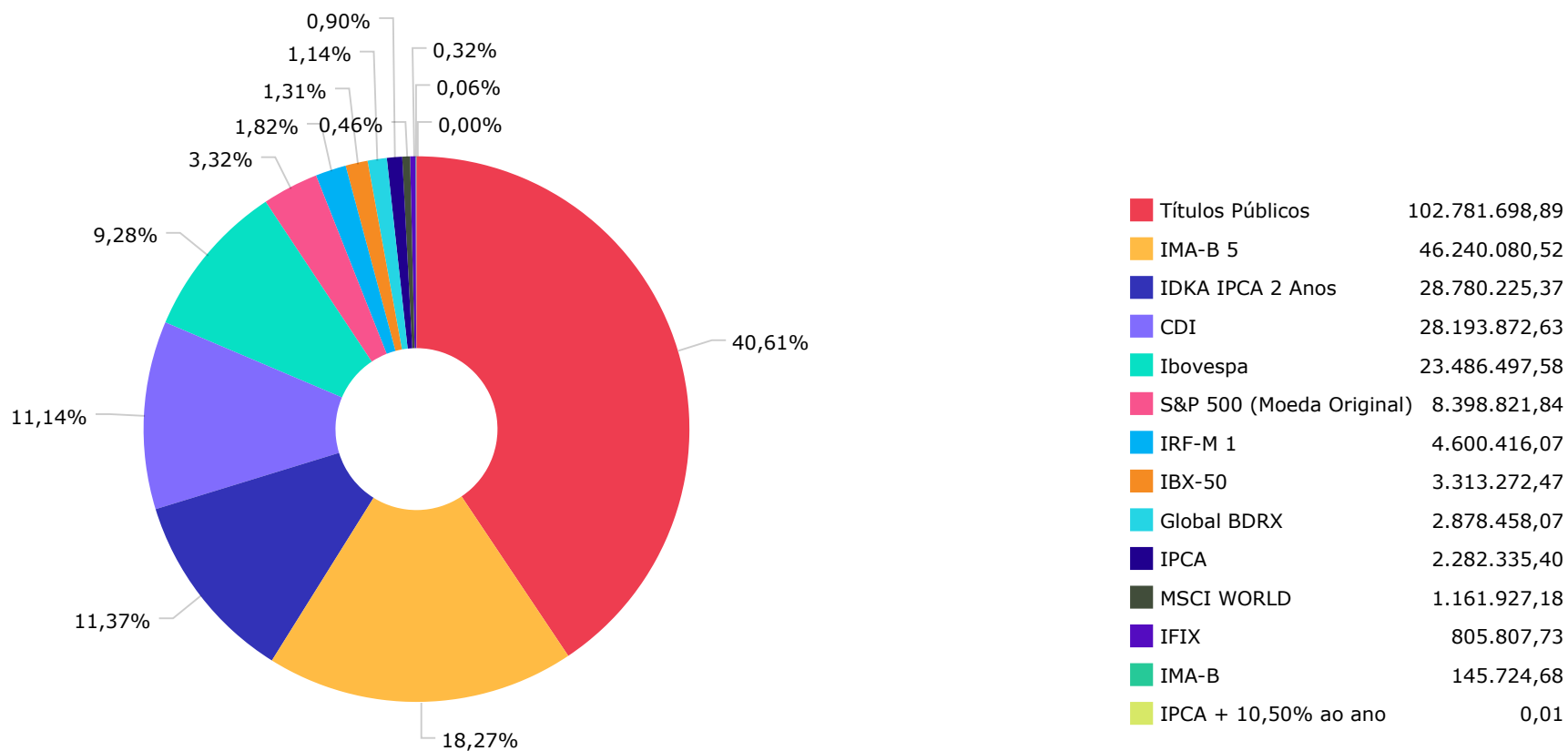
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	40,61%	0,00%	69,22%	80,00%	99.673.611,86
7° I b - FI 100% Títulos TN	29,80%	0,00%	0,00%	50,00%	51.111.007,34
7° III a - FI Referenciados RF	12,34%	0,00%	3,49%	50,00%	95.301.388,14
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	50.613.827,69
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	0,50%	1.265.345,68
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.653.456,92

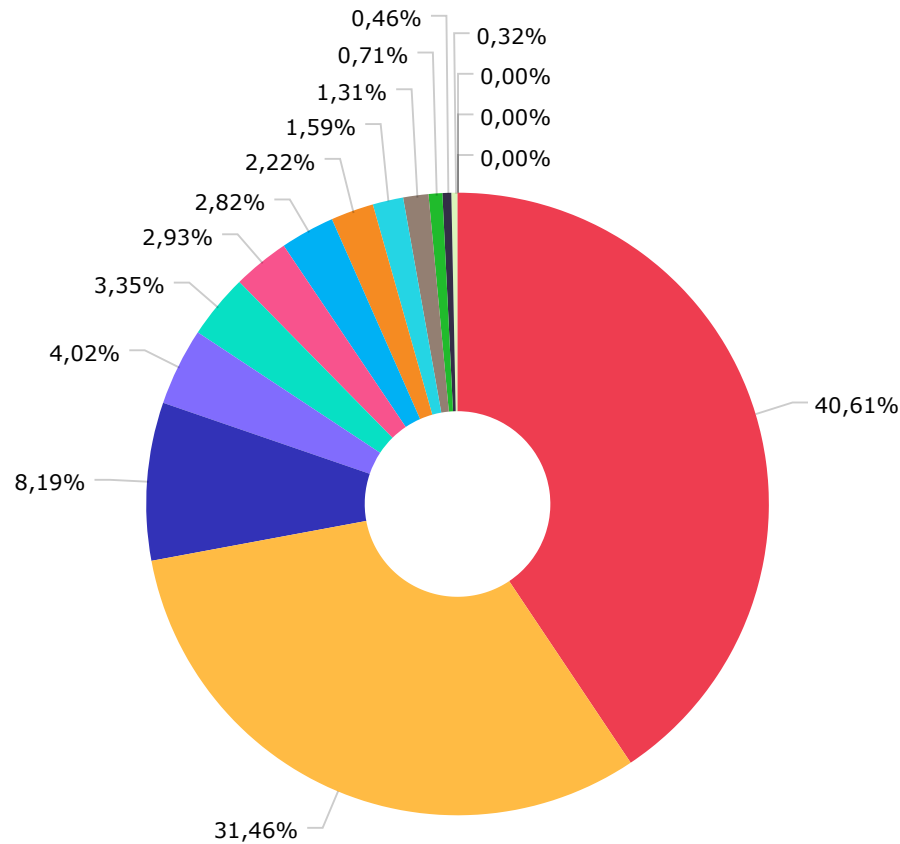
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8° I - Fundos de Ações	10,27%	0,00%	7,29%	20,00%	24.612.226,60
8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	50.613.827,69
9° II - Constituídos no Brasil	0,46%	0,00%	5,00%	10,00%	24.144.986,66
9° III - Ações - BDR Nível I	1,14%	0,00%	5,00%	10,00%	22.428.455,77
10° I - Fundos Multimercados	4,74%	0,00%	10,00%	10,00%	13.322.180,30
10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	0,07%	177.148,39
11° - Fundos Imobiliários	0,32%	0,00%	0,00%	0,37%	130.548,08
Não Enquadrado	0,32%	0,00%	0,00%	0,00%	-798.168,96

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05		
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,84	6,81	2,92	6,32	11,29	14,13	0,21	0,44
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,04	6,64	3,16	5,81	9,68	12,43	0,01	0,03
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02	6,60	3,15	5,76	9,53	11,70	0,02	0,03
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,02	6,50	3,12	5,71	9,42	11,80	0,01	0,02
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,02	6,45	3,11	5,66	9,35	11,63	0,00	0,01
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,78	6,08	2,74	5,34	8,97	12,52	0,34	0,72
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	10,02	-9,17	2,51	-4,20	1,03	35,96	8,87	18,67
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 1	0,00	0,00	0,00	0,00				
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	7,65	-22,08	3,82	-13,58	-10,66	19,00		
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,01	-10,54	-0,49	-6,91	-5,18		7,93	16,70
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,88	-22,14	3,94	-13,74	-11,05	16,19	11,49	24,21
IBOVESPA - BENCHMARK	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25		
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	9,67	5,79	-1,62	4,39	-0,85	42,47	11,76	24,77
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7,30	-2,22	1,23	-7,66	-3,46		9,26	19,50
BB AGRO FIC AÇÕES	3,28	-4,59	-7,77	-4,87	-5,32		7,37	15,53
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,17	-4,72	-4,39	-8,10	-11,12	10,34	6,78	14,28
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4,05	-3,49	-5,89	-9,37	-12,06	8,74	7,97	16,78
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6,01	-3,20	-2,21	-4,48	-18,57	0,76	7,73	16,29
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	6,11	-5,25	-4,98	-9,90	-28,09	-18,19	8,20	17,27
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	4,64	1,15	1,50	-3,72		-5,27		
IBX-50 - BENCHMARK	4,54	-1,43	-4,61	-8,44	-15,95	2,74		
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	4,51	-2,75	-7,77	-9,87	-18,28	-0,77	7,87	16,57

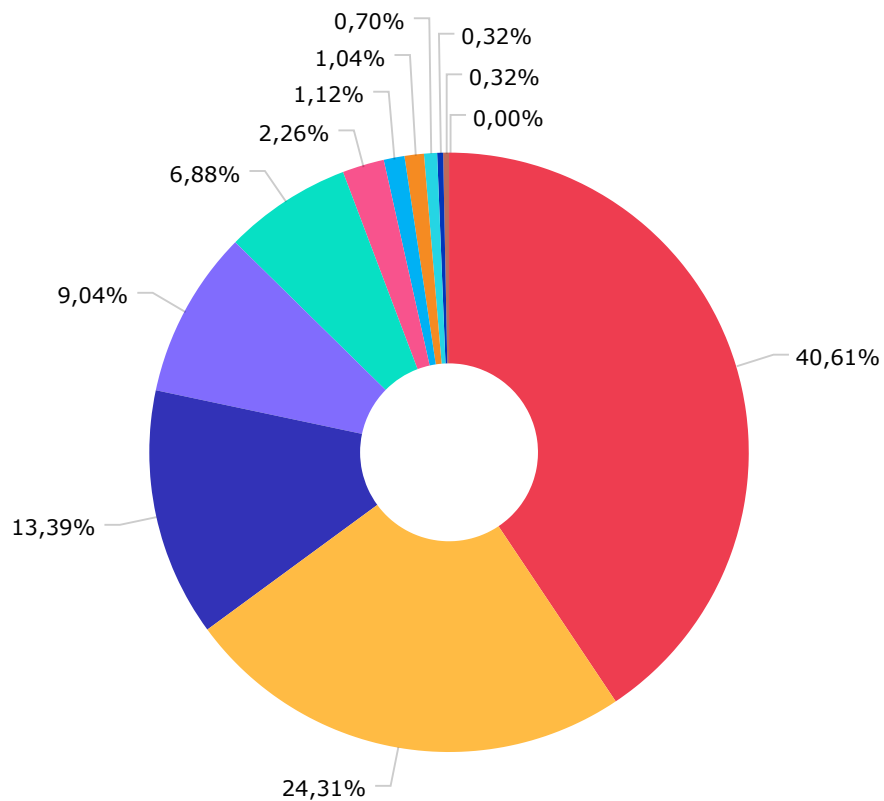
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	-0,17	6,66	1,15	6,61	10,11	16,59		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,22	6,22	0,82	6,21	9,51	15,66	1,40	2,96
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29	6,10	0,78	6,08	9,41	15,38	1,48	3,12
IMA-B - BENCHMARK	-0,88	3,43	-0,28	4,20	3,25	5,86		
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82	8,06	1,79	7,45	11,96	19,27	0,77	1,63
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,01	6,62	1,13	6,50	10,04	15,61		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02	6,53	1,12	6,44	9,84	15,08	1,21	2,55
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	-0,01	6,49	1,07	6,39	9,81	15,10	1,23	2,59
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	6,47	1,09	6,39	9,71	14,96	1,22	2,56
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	-0,01	6,49	1,06	6,35	9,38	14,07	1,23	2,59
IPCA - BENCHMARK	-0,68	4,77	0,46	4,21	10,07	19,97		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,79	5,41	2,09	4,71	5,36	6,31	0,99	2,08
IPCA + 10,50% AO ANO - BENCHMARK	0,15	10,96	2,99	9,54	21,63	46,49		
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP								
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,05	6,09	2,96	5,43	8,11	10,26		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03	5,94	2,90	5,30	7,87	9,75	0,25	0,52
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04	5,95	2,91	5,30	7,86	9,57	0,25	0,53
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	9,11	-13,34	-0,04	-8,53	-6,03	26,27		
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10,14	-9,18	2,51	-4,12	1,26		8,97	18,88
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	10,09	-9,27	2,48	-4,21	1,10	36,82	8,94	18,83

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
MSCI WORLD - BENCHMARK	6,84	-20,99	3,62	-13,05	-9,35	18,81		
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	6,78	-25,12	1,09	-14,37	-18,03	8,51	9,11	19,18
IFIX - BENCHMARK	0,66	0,33	0,04	1,34	-0,36	2,96		
HAZ FII - ATCR11								

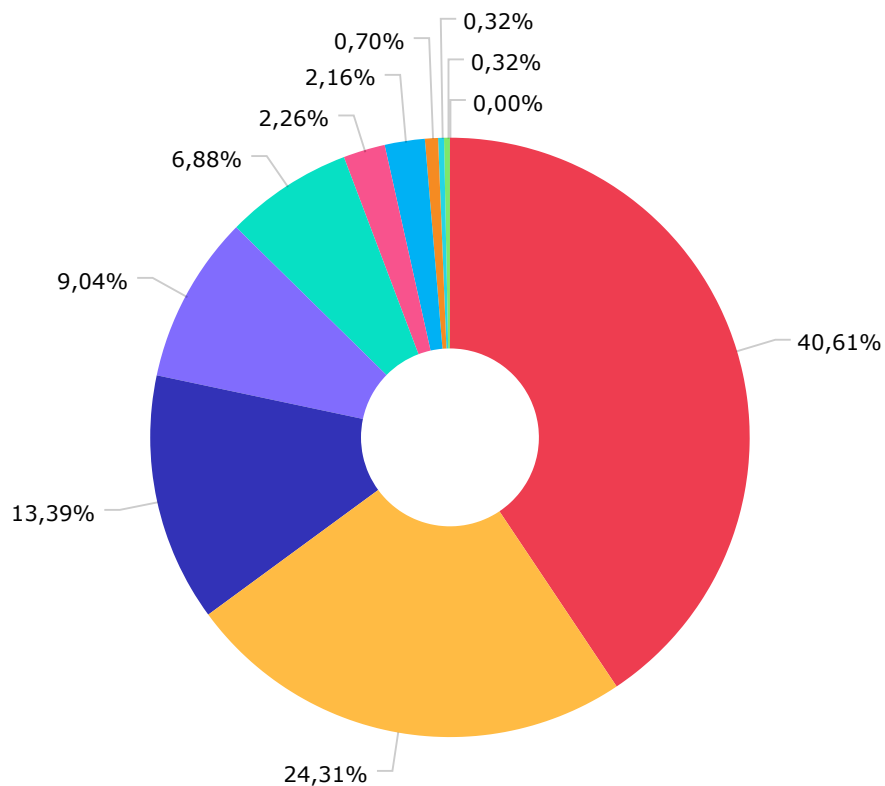




Títulos Públicos	102.781.698,89
Renda Fixa Indexados	79.620.721,96
Ações Livre	20.734.817,29
Multimercados Estratégia Específica	10.179.600,17
Renda Fixa Duração Livre Soberano	8.468.508,81
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	7.421.787,59
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	7.125.891,73
Ações Valor/Crescimento	5.630.138,36
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	4.019.211,41
Ações Índice Ativo	3.313.272,47
Multimercados Juros e Moedas	1.805.133,37
Multimercados Investimento no Exterior	1.161.927,18
FII Desenvolvimento para Venda Gestão Ativa	805.807,73
Renda Fixa Simples	621,46
Fundos de Participações	0,01
FIDC Fomento Mercantil	0,01



TESOURO NACIONAL	102.781.698,89
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	61.531.085,98
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	33.894.644,67
SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...	22.875.658,66
ITAU UNIBANCO S.A.	17.416.806,62
CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ...	5.711.896,39
TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA	2.831.094,38
GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA	2.641.497,81
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	1.780.778,33
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.	805.807,73
RENDA ASSET ADMINISTRADORA DE ...	798.168,96
GENIAL GESTAO LTDA	0,02



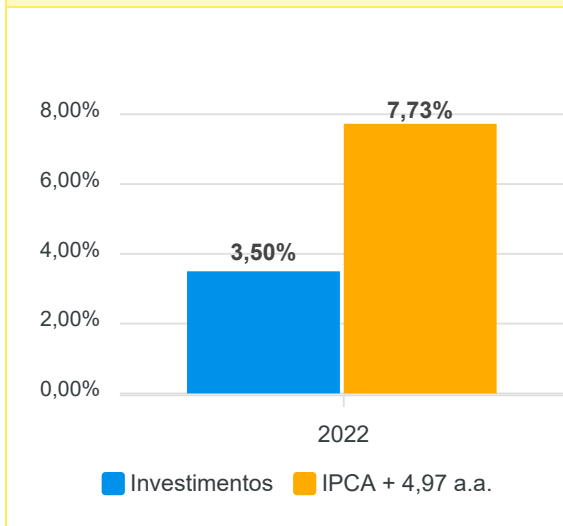
TESOURO NACIONAL	102.781.698,89
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	61.531.085,98
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	33.894.644,67
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	22.875.658,66
ITAU UNIBANCO S.A.	17.416.806,62
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	5.711.896,39
BANCO DAYCOVAL S.A.	5.472.592,19
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	1.780.778,33
RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL...	805.807,74
BFL ADMINISTRACAO DE RECURSOS ...	798.168,96
BANCO GENIAL S.A.	0,01

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	226.020.799,42	13.933.156,95	12.179.365,62	228.406.126,18	631.535,43	631.535,43	0,28% ▲	0,28%	0,95%	0,95%	29,47%	2,16%
Fevereiro	228.406.126,18	19.931.658,05	17.449.905,42	232.030.797,92	1.142.919,11	1.774.454,54	0,50% ▲	0,77%	1,38%	2,34%	32,91%	2,05%
Março	232.030.797,92	121.352.014,95	120.574.125,37	237.935.024,57	5.126.337,07	6.900.791,61	2,20% ▲	2,99%	2,05%	4,44%	67,34%	2,42%
Abril	237.935.024,57	17.974.453,39	13.795.554,26	241.339.098,59	-774.825,11	6.125.966,50	-0,32% ▼	2,66%	1,43%	5,93%	44,86%	0,95%
Mai	241.339.098,59	39.110.066,64	33.640.665,43	248.426.615,96	1.618.116,16	7.744.082,66	0,66% ▲	3,34%	0,90%	6,88%	48,55%	2,14%
Junho	248.426.615,96	13.403.054,81	11.273.915,49	247.705.833,50	-2.849.921,78	4.894.160,88	-1,14% ▼	2,16%	1,08%	8,03%	26,90%	1,99%
Julho	247.705.833,50	25.350.603,51	23.265.479,12	253.069.138,44	3.278.180,55	8.172.341,43	1,31% ▲	3,50%	-0,28%	7,73%	45,28%	1,74%

Retorno Acumulado (Períodos)

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%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado



Gráficos

Gráfico Risco x Retorno

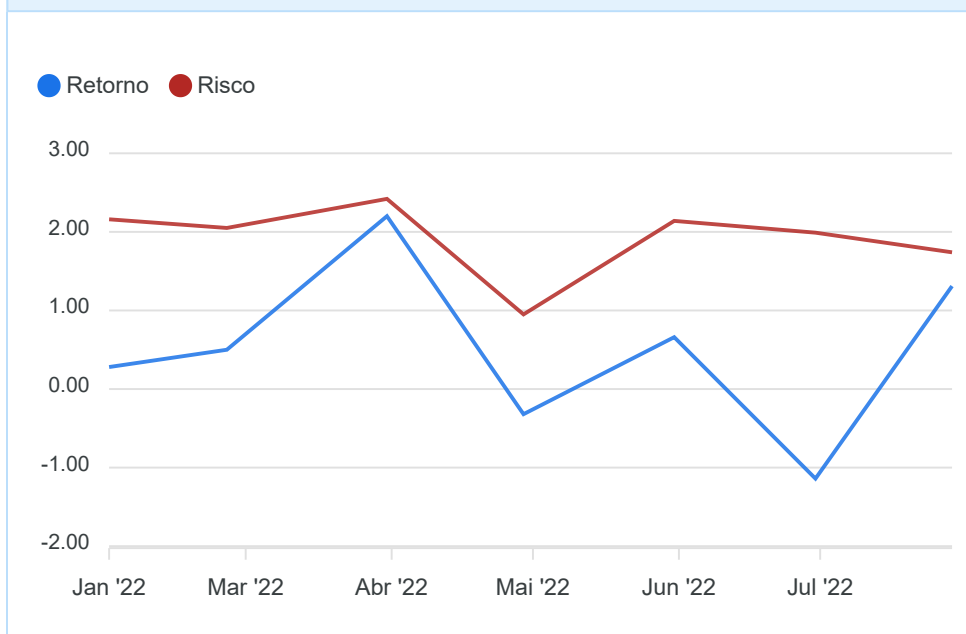
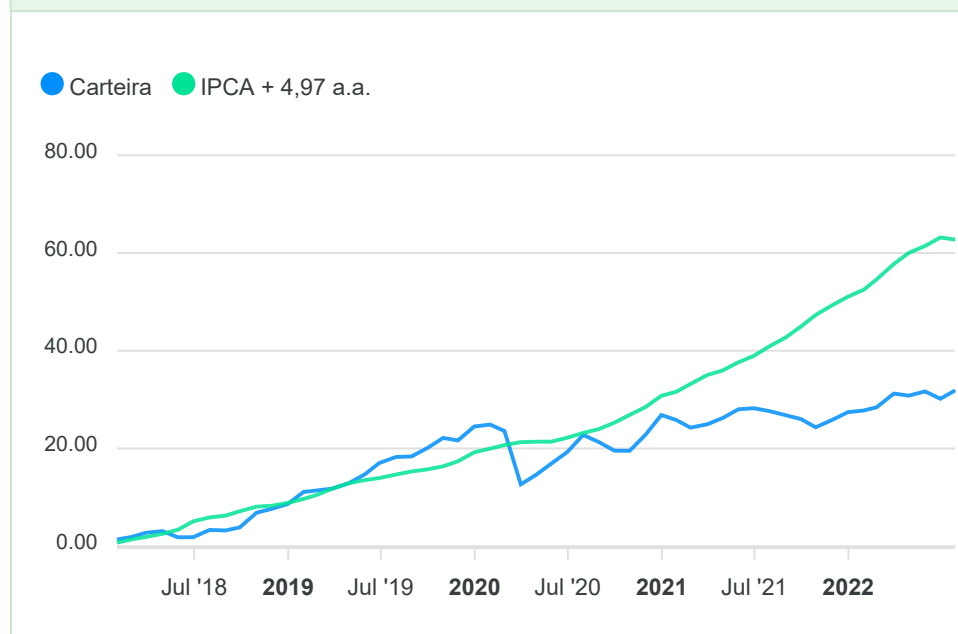


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	92.348.023,88	9.987.874,27	0,00	102.781.698,89	445.800,74	0,44% ▲	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.133.294,86	0,00	0,00	17.095.448,58	-37.846,28	-0,22% ▼	1,40%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	19.225.756,77	0,00	0,00	19.225.177,81	-578,96	0,00% ▼	1,22%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.228.398,51	0,00	500.000,00	3.768.539,42	40.140,91	0,95% ▲	0,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	10.113.784,35	6.549.964,99	9.315.000,00	7.421.787,59	73.038,25	0,44% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	144.534,16	0,00	0,00	145.724,68	1.190,52	0,82% ▲	0,77%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.252.716,57	0,00	987.874,26	2.282.335,40	17.493,09	0,54% ▲	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.719.050,16	0,00	0,00	11.684.776,79	-34.273,37	-0,29% ▼	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.318.455,54	0,00	0,00	9.320.382,64	1.927,10	0,02% ▲	1,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	823.382,11	0,00	0,00	831.876,65	8.494,54	1,03% ▲	0,25%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.065.529,77	1.925.450,75	2.000.000,00	6.040.448,73	49.468,21	0,62% ▲	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	7.066.271,57	0,00	0,00	7.125.891,73	59.620,16	0,84% ▲	0,21%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	615,17	0,00	0,00	621,46	6,29	1,02% ▲	0,01%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	5.028.596,66	0,00	0,00	5.028.229,72	-366,94	-0,01% ▼	1,23%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	12.667.353,52	0,00	0,00	12.666.290,35	-1.063,17	-0,01% ▼	1,23%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.533.435,63	6.887.313,50	10.462.604,86	4.019.211,41	61.067,14	0,42% ▲	0,00%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
	206.669.199,24	25.350.603,51	23.265.479,12	209.438.441,86	684.118,23	0,33%	0,49%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.404.947,60	0,00	0,00	5.630.138,36	225.190,76	4,17% ▲	6,78%
BB AGRO FIC AÇÕES	2.538.148,74	0,00	0,00	2.621.464,47	83.315,73	3,28% ▲	7,37%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.791.211,56	0,00	0,00	1.805.133,37	13.921,81	0,78% ▲	0,34%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.307.860,46	0,00	0,00	1.360.765,62	52.905,16	4,05% ▲	7,97%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.170.283,75	0,00	0,00	3.313.272,47	142.988,72	4,51% ▲	7,87%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.461.749,77	0,00	0,00	2.641.497,81	179.748,04	7,30% ▲	9,26%
HAZ FII - ATCR11	805.472,41	0,00	0,00	805.807,73	335,32	0,04% ▲	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.338.096,62	0,00	0,00	5.658.653,11	320.556,49	6,01% ▲	7,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.832.748,16	0,00	0,00	1.944.714,87	111.966,71	6,11% ▲	8,20%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.440.654,39	0,00	0,00	2.686.925,45	246.271,06	10,09% ▲	8,94%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	762.790,58	0,00	0,00	798.168,96	35.378,38	4,64% ▲	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.618.571,36	0,00	0,00	1.780.778,33	162.206,97	10,02% ▲	8,87%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.186.129,43	0,00	0,00	5.711.896,39	525.766,96	10,14% ▲	8,97%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	2.581.362,76	0,00	0,00	2.831.094,38	249.731,62	9,67% ▲	11,76%
-	37.240.027,60	0,00	0,00	39.590.311,33	2.350.283,73	6,31%	7,67%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.317.666,84	0,00	0,00	2.456.906,08	139.239,24	6,01% ▲	7,93%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	390.770,81	0,00	0,00	421.551,99	30.781,18	7,88% ▲	11,49%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	1.088.169,01	0,00	0,00	1.161.927,18	73.758,17	6,78% ▲	9,11%
	3.796.606,66	0,00	0,00	4.040.385,25	243.778,59	6,42%	6,02%

Cenário Econômico

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

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

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

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

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

Rentabilidade e Risco (por ativo)

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

Distribuição por Benchmarks

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

Distribuição por Classificação ANBIMA

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

Distribuição por Gestoras e Administradoras

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

Retorno da Carteira de Investimentos

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

Retorno dos Fundos de Investimentos

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

Rio de Janeiro, 16 de agosto de 2022.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP