

2022

Relatório Mensal

Agosto

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	101.629.689,63	39,94%	0,00		7º I a
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.087.830,83	6,72%	9.083.863.850,50	0,19%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	19.226.353,33	7,56%	6.457.640.882,23	0,30%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.813.922,81	1,50%	5.854.200.005,45	0,07%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	147.460,82	0,06%	107.902.331,92	0,14%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.315.945,33	0,91%	5.888.909.396,66	0,04%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.672.069,48	4,59%	9.773.675.955,20	0,12%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.324.820,13	3,66%	9.644.358.000,69	0,10%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	841.948,14	0,33%	4.998.574.700,28	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.380.279,01	2,51%	17.769.721.367,05	0,04%	7º I b
ITAU SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	628,67	0,00%	29.371.528.121,28	0,00%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	5.027.908,87	1,98%	1.027.616.539,87	0,49%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.115.453,98	1,22%	11.325.025.814,75	0,03%	7º III a
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	7.189.986,51	2,83%	2.148.688.260,54	0,33%	7º III a
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	12.664.941,62	4,98%	651.557.708,00	1,94%	7º III a
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.049.908,62	2,77%	5.644.054.636,13	0,12%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1.934.229,43	0,76%	373.142.715,21	0,52%	7º III a
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,01	0,00%	0,00		7º V a
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.898.492,99	2,32%	1.078.944.666,25	0,55%	8º I
BB AGRO FIC AÇÕES	2.803.740,38	1,10%	479.549.208,53	0,58%	8º I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.438.702,99	0,57%	1.440.461.207,87	0,10%	8º I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.520.057,76	1,38%	694.011.148,61	0,51%	8º I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.938.014,11	1,15%	1.027.515.233,21	0,29%	8º I
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	6.028.621,87	2,37%	2.519.361.673,21	0,24%	8º I
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.091.059,67	0,82%	574.800.031,73	0,36%	8º I
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	3.118.306,53	1,23%	1.218.110.415,23	0,26%	8º I
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.125.536,39	0,44%	1.101.201.361,13	0,10%	9º II

Investimentos

\$ 254.464.332,57

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 254.464.332,57

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

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.374.027,45	0,93%	472.377.045,70	0,50%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	405.047,75	0,16%	2.252.028.422,82	0,02%	9º III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.822.952,38	0,72%	19.297.671.408,68	0,01%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.600.759,47	1,02%	1.348.641.178,12	0,19%	10º I
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.724.122,84	0,68%	817.990.132,61	0,21%	10º I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.529.571,77	2,17%	217.572.243,99	2,54%	10º I
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	0,01	0,00%	0,00		10º II
HAZ FII - ATCR11	806.973,06	0,32%	0,00		11º
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	814.967,93	0,32%	9.759.620,32	8,35%	NE

Investimentos

\$ 254.464.332,57

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 254.464.332,57

Governança (Pró Gestão)

AV 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	4.092,383820	1.235.899,91
NTN-B - 15/05/2035	16/03/2022	Curva - Taxa: 5,8950%	478	4.076,848792	1.948.733,72
NTN-B - 15/05/2035	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,3810%	909	4.259,142574	3.871.560,60
NTN-B - 15/05/2035	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,7110%	224	4.140,871817	927.555,29
NTN-B - 15/05/2035	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,0286%	232	4.031,203003	935.239,10
NTN-B - 15/08/2040	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8480%	619	4.047,316779	2.505.289,09
NTN-B - 15/08/2040	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,4110%	1.182	4.242,454014	5.014.580,64
NTN-B - 15/08/2040	30/03/2022	Curva - Taxa: 5,4660%	586	4.217,179367	2.471.267,11
NTN-B - 15/08/2040	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,7210%	295	4.102,710114	1.210.299,48
NTN-B - 15/08/2040	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,0481%	297	3.962,153589	1.176.759,62
NTN-B - 15/05/2045	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8500%	1.053	4.115,640775	4.333.769,74
NTN-B - 15/05/2045	16/03/2022	Curva - Taxa: 5,9410%	1.059	4.071,342756	4.311.551,98
NTN-B - 15/05/2045	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,5010%	2.031	4.292,365097	8.717.793,51
NTN-B - 15/05/2045	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,8200%	508	4.130,402818	2.098.244,63
NTN-B - 15/05/2045	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,1386%	529	3.977,577624	2.104.138,56
NTN-B - 15/08/2050	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8500%	1.320	4.064,552375	5.365.209,14
NTN-B - 15/08/2050	16/03/2022	Curva - Taxa: 5,9410%	1.328	4.015,850320	5.333.049,22
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,5210%	2.535	4.248,431769	10.769.774,53
NTN-B - 15/08/2050	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,8200%	637	4.080,804892	2.599.472,72
NTN-B - 15/08/2050	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,1622%	650	3.901,174937	2.535.763,71
NTN-B - 15/05/2055	08/03/2022	Curva - Taxa: 5,8400%	1.573	4.134,909918	6.504.213,30
NTN-B - 15/05/2055	29/03/2022	Curva - Taxa: 5,5200%	3.010	4.325,912671	13.020.997,14
NTN-B - 15/05/2055	30/03/2022	Curva - Taxa: 5,5810%	1.486	4.288,416925	6.372.587,55
NTN-B - 15/05/2055	09/05/2022	Curva - Taxa: 5,8200%	754	4.146,445241	3.126.419,71
NTN-B - 15/05/2055	08/07/2022	Curva - Taxa: 6,1660%	794	3.954,055079	3.139.519,73

Investimentos

\$ 254.464.332,57

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 254.464.332,57

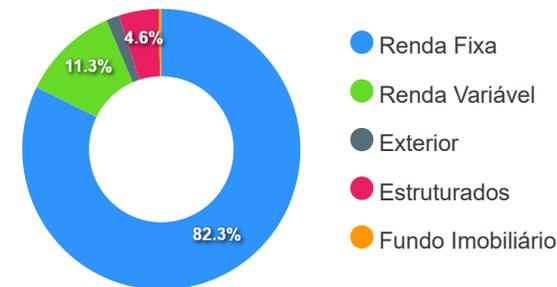
Governança (Pró Gestão)
 NIVEL 2 01/06/2024

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Utilizado	Utilizado	Livre
7° I a - Títulos TN SELIC	100,00%	39,94%	101.629.689,63	60,06%	152.834.642,94
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	29,80%	75.839.167,42	70,20%	178.625.165,15
7° III a - FI Referenciados RF	70,00%	12,56%	31.954.520,16	57,44%	146.170.512,64
7° V a - FIDC Cota Sênior	10,00%	0,00%	0,01	10,00%	25.446.433,25
8° I - Fundos de Ações	40,00%	10,94%	27.836.996,30	29,06%	73.948.736,73
9° II - Constituídos no Brasil	10,00%	0,44%	1.125.536,39	9,56%	24.320.896,87
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,09%	2.779.075,20	8,91%	22.667.358,06
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	4,59%	11.677.406,46	5,41%	13.769.026,80
10° II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	0,00%	0,01	5,00%	12.723.216,62
11° - Fundos Imobiliários	10,00%	0,32%	806.973,06	9,68%	24.639.460,20
Não Enquadrado	0,00%	0,32%	814.967,93	-0,32%	-814.967,93

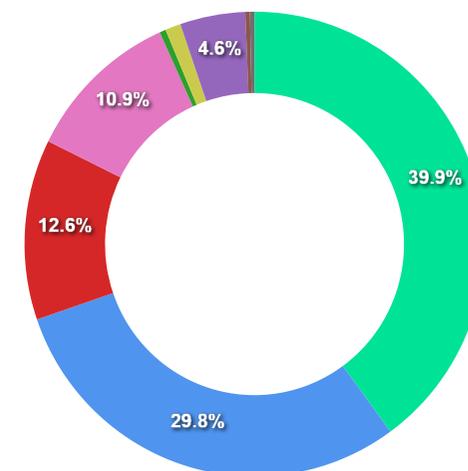
Governança (Pró Gestão)

NIVEL 2 01/06/2024

Segmentos



Artigos



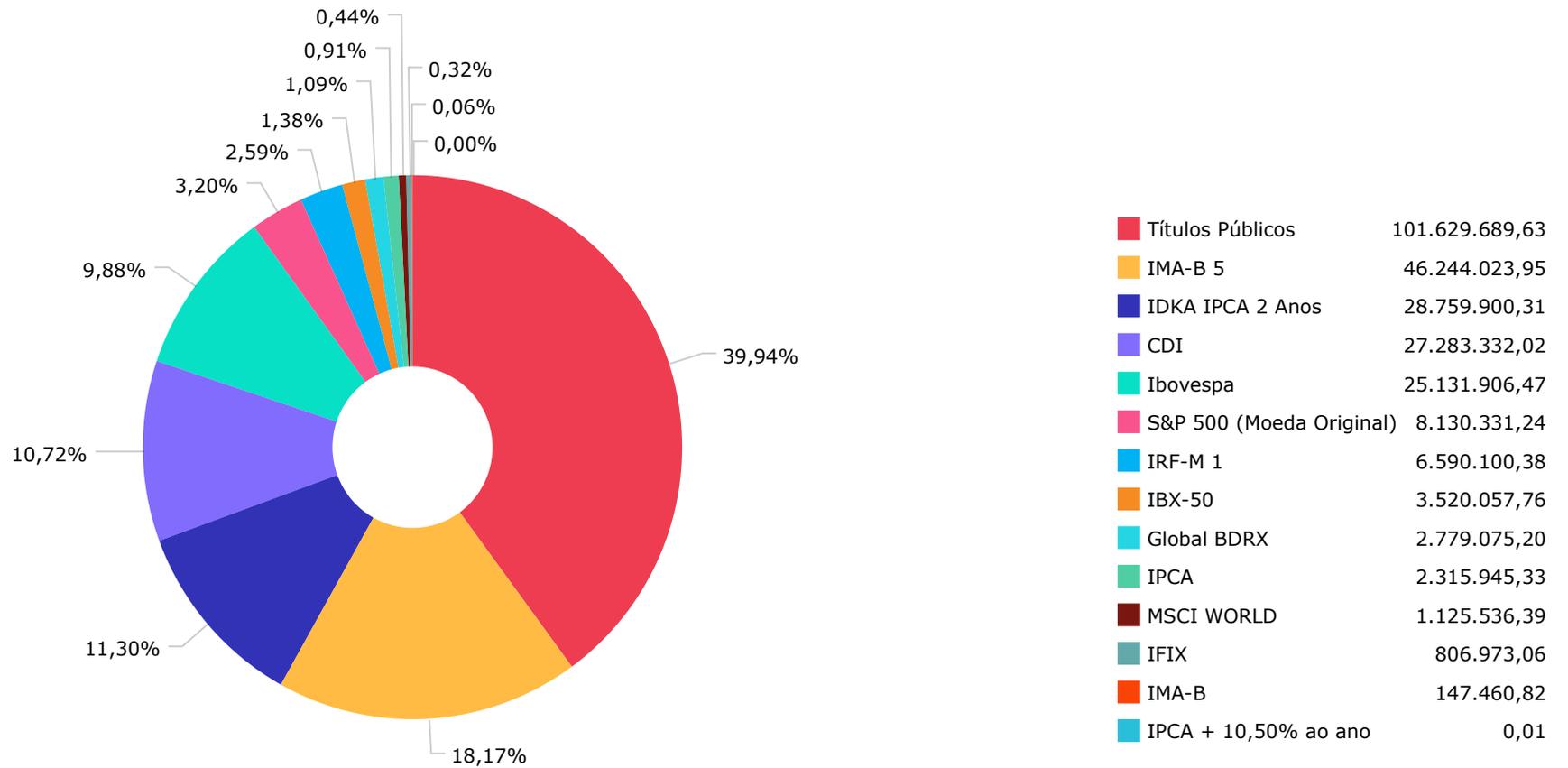
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	39,94%	0,00%	69,22%	80,00%	101.941.776,43
7° I b - FI 100% Títulos TN	29,80%	0,00%	0,00%	50,00%	51.392.998,87
7° III a - FI Referenciados RF	12,56%	0,00%	3,49%	50,00%	95.277.646,13
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	50.892.866,51
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	0,50%	1.272.321,65
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.723.216,63

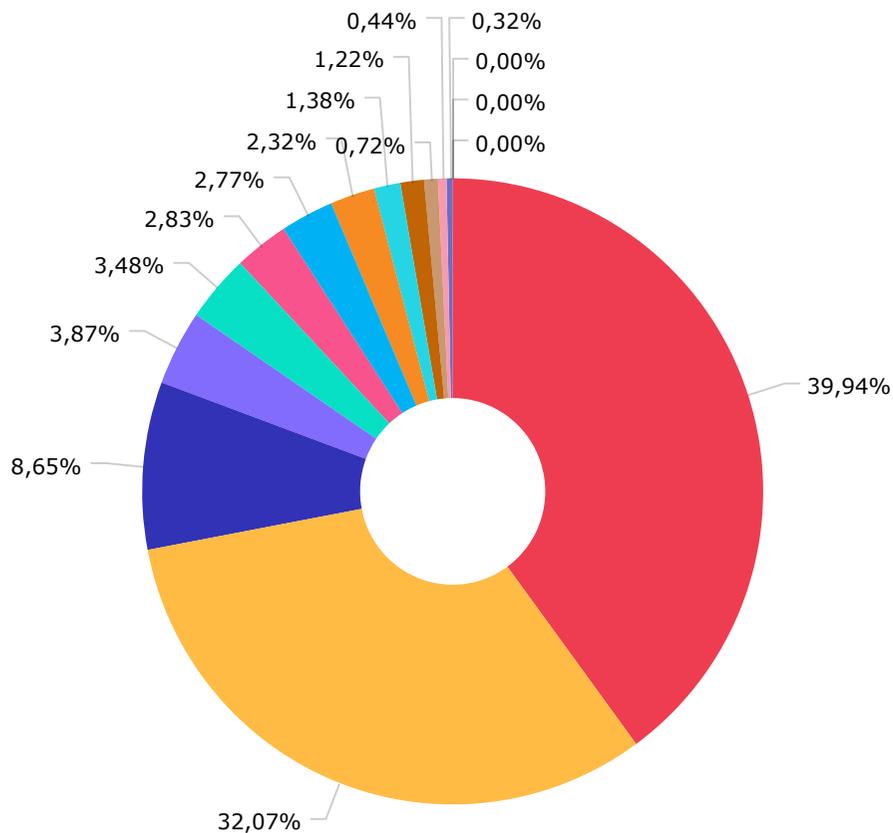
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8° I - Fundos de Ações	10,94%	0,00%	7,29%	20,00%	23.055.870,21
8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	50.892.866,51
9° II - Constituídos no Brasil	0,44%	0,00%	5,00%	10,00%	24.320.896,87
9° III - Ações - BDR Nível I	1,09%	0,00%	5,00%	10,00%	22.667.358,06
10° I - Fundos Multimercados	4,59%	0,00%	10,00%	10,00%	13.769.026,80
10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	0,07%	178.125,02
11° - Fundos Imobiliários	0,32%	0,00%	0,00%	0,37%	134.544,97
Não Enquadrado	0,32%	0,00%	0,00%	0,00%	-814.967,93

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18		
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,90	7,77	2,71	6,34	11,51	15,01	0,33	0,70
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,18	7,90	3,28	6,21	10,49	13,56	0,01	0,02
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,17	7,85	3,25	6,07	10,37	12,85	0,03	0,06
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,16	7,74	3,24	6,07	10,23	12,93	0,01	0,03
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17	7,70	3,24	6,05	10,17	12,78	0,01	0,03
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,99	7,13	2,84	5,63	9,58	13,15	0,24	0,51
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-3,18	-12,06	-1,69	-5,19	-5,33	23,18	8,90	18,73
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1								
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	-3,05	-24,45	5,20	-10,08	-15,31	0,66		
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,37	-13,56	-5,46	-8,16	-10,16		8,53	17,97
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,92	-25,19	4,51	-10,76	-16,57	-3,06	10,67	22,47
IBOVESPA - BENCHMARK	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22		
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	10,14	16,52	8,26	9,52	16,64	61,12	9,61	20,24
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11,23	8,76	2,93	7,67	7,92		9,27	19,53
BB AGRO FIC AÇÕES	6,95	2,04	-4,33	2,26	4,87		7,31	15,39
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	2,10	3,28	1,15	-0,56	-4,86	0,28	6,14	12,94
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,73	2,04	-4,04	-3,86	-5,07	16,50	9,10	19,17
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,77	-0,18	-3,54	-3,37	-5,17	19,86	9,11	19,19
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6,54	3,13	0,39	3,02	-11,29	7,56	7,56	15,92
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7,53	1,88	2,16	-2,77	-19,37	-8,44	9,76	20,56
IBX-50 - BENCHMARK	6,33	4,81	-1,81	-4,31	-7,38	13,10		
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	6,24	3,32	-3,17	-5,26	-9,52	8,97	8,71	18,34

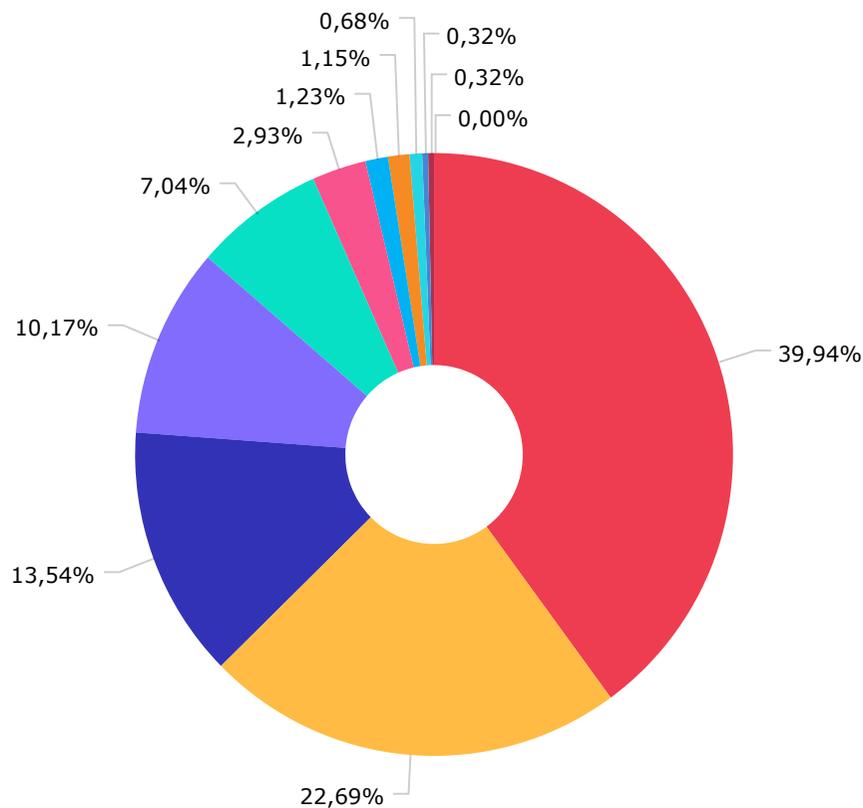
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	-0,36	6,28	-0,07	4,90	9,42	14,98		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,04	6,17	0,00	4,95	9,27	14,82	1,44	3,02
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,11	5,99	-0,18	4,77	9,08	14,35	1,43	3,02
IMA-B - BENCHMARK	1,10	4,57	-0,15	4,78	5,54	8,99		
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19	9,35	2,34	7,52	12,78	20,13	0,06	0,13
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,00	6,62	0,35	5,38	9,88	15,12		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,05	6,58	0,40	5,38	9,75	14,69	1,30	2,74
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	-0,01	6,48	0,31	5,28	9,66	14,64	1,31	2,77
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,01	6,48	0,32	5,28	9,60	14,55	1,32	2,78
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	-0,01	6,48	0,30	5,25	9,34	13,65	1,31	2,76
IPCA - BENCHMARK	-0,36	4,39	-0,37	2,79	8,73	19,25		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,47	6,96	2,51	5,40	8,49	8,48	0,58	1,23
IPCA + 10,50% AO ANO - BENCHMARK	0,55	11,58	2,14	8,06	20,14	45,61		
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP								
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,23	7,40	3,25	5,94	9,04	11,48		
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1,24	7,55	3,28	5,92	9,40	11,41	0,09	0,19
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,21	7,22	3,19	5,80	8,80	10,97	0,11	0,24
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,20	7,22	3,20	5,79	8,79	10,79	0,11	0,24
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	-4,24	-17,02	-4,29	-9,80	-12,55	12,99		
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-3,19	-12,08	-1,71	-5,18	-5,19		9,02	18,99
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-3,21	-12,18	-1,74	-5,21	-5,32	23,81	8,98	18,92

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
MSCI WORLD - BENCHMARK	-4,51	-24,55	3,10	-11,16	-15,78	1,28		
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	-3,13	-27,46	2,89	-12,41	-21,63	-6,02	9,85	20,74
IFIX - BENCHMARK	5,76	6,11	5,52	8,58	8,23	6,98		
HAZ FII - ATCR11								

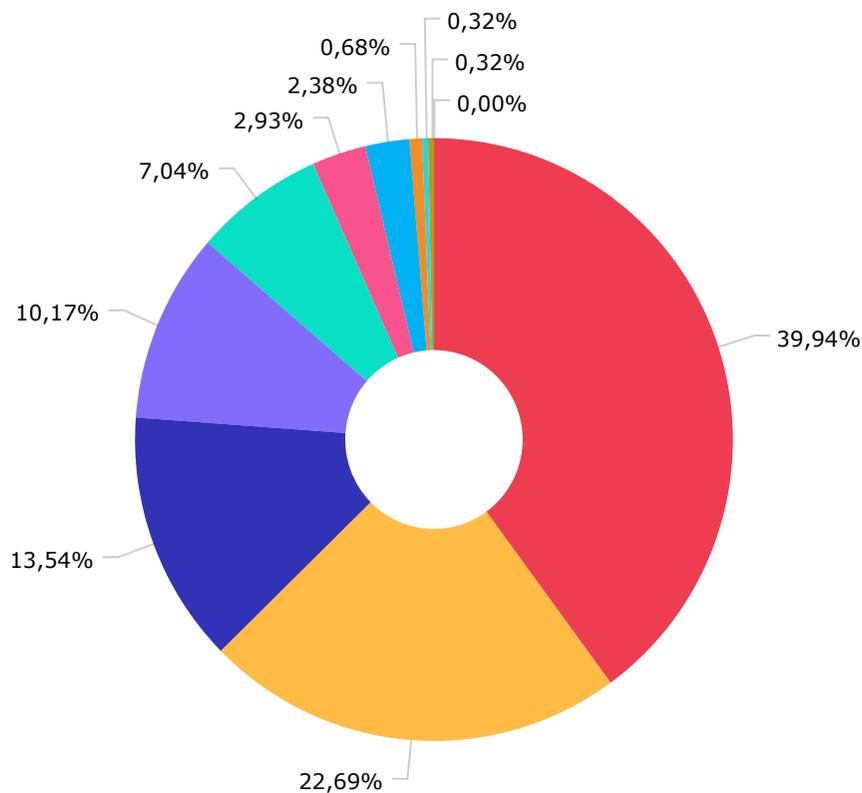




Títulos Públicos	101.629.689,63
Renda Fixa Indexados	81.594.024,64
Ações Livre	22.012.488,68
Multimercados Estratégia Específica	9.854.454,08
Renda Fixa Duração Livre Soberano	8.843.685,16
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	7.189.986,51
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	7.049.908,62
Ações Valor/Crescimento	5.898.492,99
Ações Índice Ativo	3.520.057,76
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	3.115.453,98
Multimercados Juros e Moedas	1.822.952,38
Multimercados Investimento no Exterior	1.125.536,39
FII Desenvolvimento para Venda Gestão Ativa	806.973,06
Renda Fixa Simples	628,67
Fundos de Participações	0,01
FIDC Fomento Mercantil	0,01



TESOURO NACIONAL	101.629.689,63
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	57.728.937,96
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	34.460.167,60
SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...	25.868.295,50
ITAU UNIBANCO S.A.	17.911.056,19
CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ...	7.463.801,20
TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA	3.118.306,53
GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA	2.938.014,11
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	1.724.122,84
RENDA ASSET ADMINISTRADORA DE ...	814.967,93
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.	806.973,06
GENIAL GESTAO LTDA	0,02



TESOURO NACIONAL	101.629.689,63
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	57.728.937,96
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	34.460.167,60
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	25.868.295,50
ITAU UNIBANCO S.A.	17.911.056,19
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	7.463.801,20
BANCO DAYCOVAL S.A.	6.056.320,64
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	1.724.122,84
BFL ADMINISTRACAO DE RECURSOS ...	814.967,93
RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL...	806.973,07
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%
Agosto	253.069.138,44	11.677.106,99	10.884.146,29	254.464.332,57	602.233,43	8.774.574,86	0,24% ▲	3,75%	0,08%	7,82%	47,95%	1,88%

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

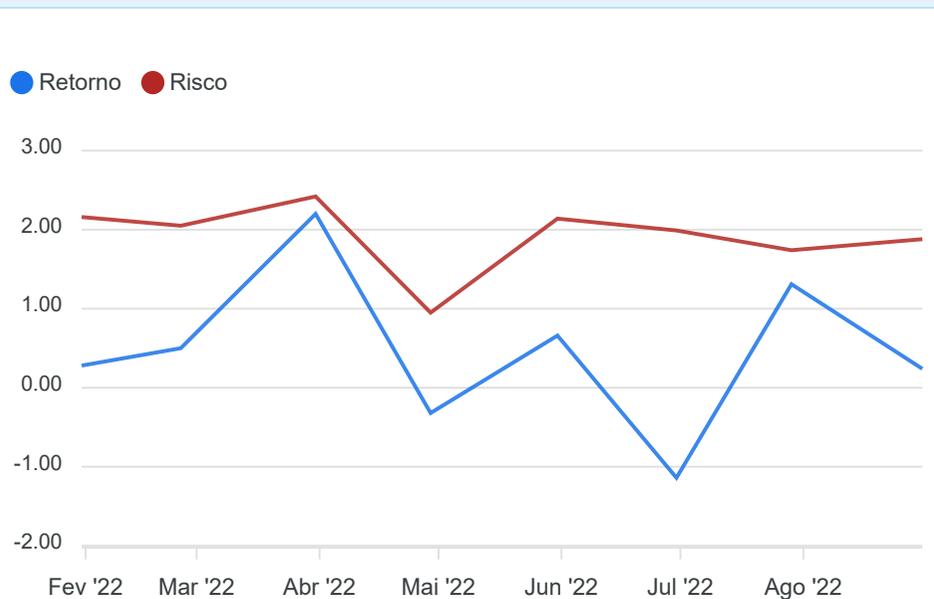
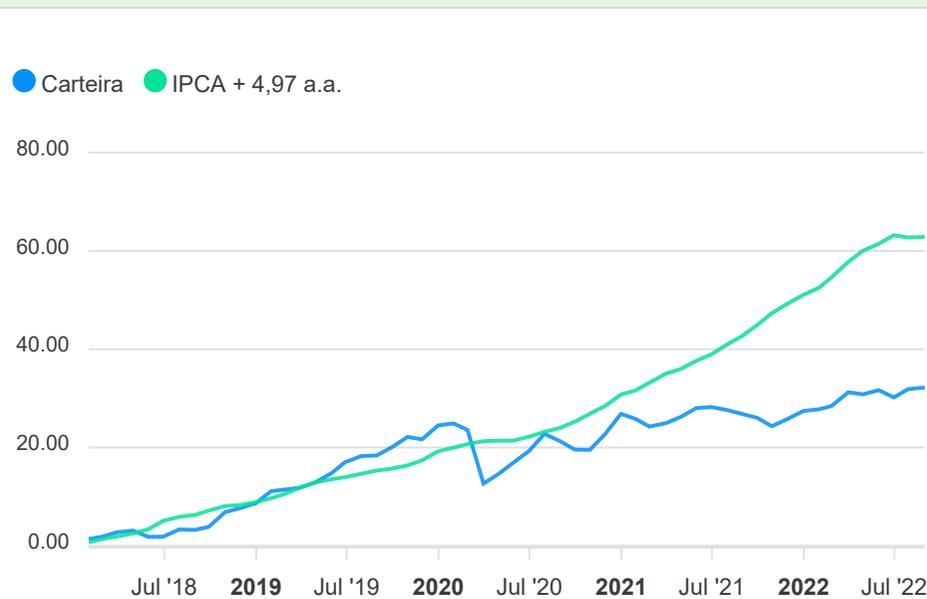


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	102.781.698,89	0,00	0,00	101.629.689,63	-1.152.009,26	-1,12% ▼	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.095.448,58	0,00	0,00	17.087.830,83	-7.617,75	-0,04% ▼	1,44%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	19.225.177,81	0,00	0,00	19.226.353,33	1.175,52	0,01% ▲	1,32%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.768.539,42	0,00	0,00	3.813.922,81	45.383,39	1,20% ▲	0,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	7.421.787,59	242.405,50	4.596.734,54	3.115.453,98	47.995,43	0,63% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	145.724,68	0,00	0,00	147.460,82	1.736,14	1,19% ▲	0,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.282.335,40	0,00	0,00	2.315.945,33	33.609,93	1,47% ▲	0,58%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.684.776,79	0,00	0,00	11.672.069,48	-12.707,31	-0,11% ▼	1,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.320.382,64	0,00	0,00	9.324.820,13	4.437,49	0,05% ▲	1,30%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	831.876,65	0,00	0,00	841.948,14	10.071,49	1,21% ▲	0,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.040.448,73	1.967.051,75	1.700.010,45	6.380.279,01	72.788,98	0,91% ▲	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	7.125.891,73	0,00	0,00	7.189.986,51	64.094,78	0,90% ▲	0,33%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	621,46	0,00	0,00	628,67	7,21	1,16% ▲	0,01%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	5.028.229,72	0,00	0,00	5.027.908,87	-320,85	-0,01% ▼	1,31%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	12.666.290,35	0,00	0,00	12.664.941,62	-1.348,73	-0,01% ▼	1,31%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.019.211,41	7.555.015,20	4.587.401,30	7.049.908,62	63.083,31	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%	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,00	1.912.634,54	0,00	1.934.229,43	21.594,89	1,13% ▲	0,09%
	209.438.441,86	11.677.106,99	10.884.146,29	209.423.377,22	-808.025,34	-0,38%	0,51%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.630.138,36	0,00	0,00	5.898.492,99	268.354,63	4,77% ▲	9,11%
BB AGRO FIC AÇÕES	2.621.464,47	0,00	0,00	2.803.740,38	182.275,91	6,95% ▲	7,31%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.805.133,37	0,00	0,00	1.822.952,38	17.819,01	0,99% ▲	0,24%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.360.765,62	0,00	0,00	1.438.702,99	77.937,37	5,73% ▲	9,10%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.313.272,47	0,00	0,00	3.520.057,76	206.785,29	6,24% ▲	8,71%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.641.497,81	0,00	0,00	2.938.014,11	296.516,30	11,23% ▲	9,27%
HAZ FII - ATCR11	805.807,73	0,00	0,00	806.973,06	1.165,33	0,14% ▲	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.658.653,11	0,00	0,00	6.028.621,87	369.968,76	6,54% ▲	7,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.944.714,87	0,00	0,00	2.091.059,67	146.344,80	7,53% ▲	9,76%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.686.925,45	0,00	0,00	2.600.759,47	-86.165,98	-3,21% ▼	8,98%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	798.168,96	0,00	0,00	814.967,93	16.798,97	2,10% ▲	6,14%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.780.778,33	0,00	0,00	1.724.122,84	-56.655,49	-3,18% ▼	8,90%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.711.896,39	0,00	0,00	5.529.571,77	-182.324,62	-3,19% ▼	9,02%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	2.831.094,38	0,00	0,00	3.118.306,53	287.212,15	10,14% ▲	9,61%
-	39.590.311,33	0,00	0,00	41.136.343,76	1.546.032,43	3,91%	8,15%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.456.906,08	0,00	0,00	2.374.027,45	-82.878,63	-3,37% ▼	8,53%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	421.551,99	0,00	0,00	405.047,75	-16.504,24	-3,92% ▼	10,67%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	1.161.927,18	0,00	0,00	1.125.536,39	-36.390,79	-3,13% ▼	9,85%
	4.040.385,25	0,00	0,00	3.904.611,59	-135.773,66	-3,36%	6,29%

Cenário Econômico

Assim como julho, o mês de agosto também foi positivo para os investimentos. Logo no início do mês as carteiras apresentaram forte retorno positivo, mas diminuíram sua intensidade na segunda quinzena do mês. O grande destaque de rentabilidade neste mês foram os ativos ligados ao principal índice de renda variável local (IBOVESPA), que avançou 6,16% e com isso retornou para campo positivo no acumulado de 2022.

A inflação segue como o principal ponto de atenção mundo a fora, com os números ainda seguindo elevados em perspectiva histórica e com pouco sinal de trégua. Por aqui o Brasil vive um momento diferente registrando deflação de 0,68% no IPCA de julho, reflexo exclusivo do impacto da redução dos preços dos combustíveis e energia, já que nos demais seguimentos, acompanhados pelo IBGE, para a apuração da inflação (IPCA), ainda seguem apresentando valores elevados. A redução dos preços dos combustíveis foi tão forte que há expectativas de que o seu impacto será observado nos números da inflação nos meses de agosto e setembro, onde também são esperados registros de deflação e as expectativas de mercados já estão considerando um IPCA acumulado em 2022 inferior a 7%, segundo o boletim FOCUS divulgado no dia 05/09.

A inflação persistente, ainda tem forçado os bancos centrais globais a manter o indicativo de elevação de taxa de juros com objetivo de colocar o pé no freio na economia global e por consequência trazer os números da inflação para dentro das suas respectivas metas. O grande exemplo disso veio no discurso de Jerome Powell, presidente do FED, banco central americano, no simpósio de Jackson Hole onde confirmou as expectativas para seu discurso, traçando um tom mais contracionistas para a economia americana dizendo que fará o necessário para trazer a inflação para a meta, não sendo descartada uma nova elevação de 0,75% na taxa de juros, o que é considerado pelo mercado como algo extremamente agressivo.

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 demonstram 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, demonstra 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 buscam replicar indexadores adequados e em conformidade com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Distribuição por Classificação ANBIMA

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos 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

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira 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 consolidada da carteira no período continua demonstrando recuperação face o aumento das taxas de juros visando à contenção do processo inflacionário, combinado com o crescimento do fluxo de capital estrangeiro para a Bolsa, que vem impactando de forma favorável o desempenho das Bolsas.

Retorno dos Fundos de Investimentos

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2022, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 16 de setembro de 2022.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP