

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2022



Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	983.358,92	1,89%	523	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	6.827.229,30	13,10%	1.071	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.306.264,93	2,51%	815	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.160.421,61	9,90%	577	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	4.581.367,72	8,79%	318	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	2.321.472,26	4,45%	103	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	463 dias	6.078.488,40	11,66%	270	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.866.947,06	7,42%	1.063	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	881.817,98	1,69%	872	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.434.990,92	6,59%	168	0,46%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.292.219,86	4,40%	350	2,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	3.390.765,08	6,50%	1.023	3,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	D+1	Não há	2.288.228,65	4,39%	265	0,61%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	2.282.067,09	4,38%	788	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	270.936,04	0,52%	98	0,87%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.157.164,73	2,22%	5.365	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	558.168,46	1,07%	91	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	1.098.412,80	2,11%	167	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.053.341,96	2,02%	127	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.301.384,58	4,41%	599	1,64%	Artigo 8º, Inciso I

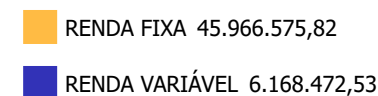
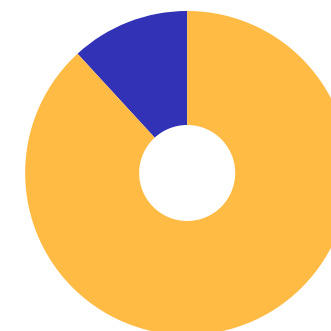


Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			52.135.048,35				

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

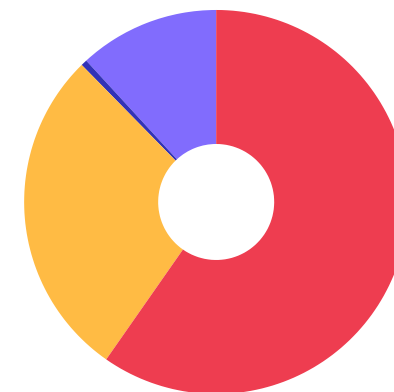
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,14%	59,24%	30.884.802,64
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	31.125.550,20	59,70%	15,22%	20,14%	59,24%	-240.747,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	14.570.089,58	27,95%	6,95%	9,27%	50,00%	11.497.434,60
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	9,27%	20,00%	10.427.009,67
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	270.936,04	0,52%	0,00%	1,39%	1,39%	453.741,13
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,30%	5,00%	2.606.752,42
Total Renda Fixa	100,00%	45.966.575,82	88,17%	22,17%	64,51%	194,87%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	6.168.472,53	11,83%	15,00%	19,66%	20,00%	4.258.537,14
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,34%	20,00%	10.427.009,67
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	4,50%	6,00%	10,00%	5.213.504,84
Total Renda Variável	30,00%	6.168.472,53	11,83%	19,50%	30,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	3,38%	4,50%	10,00%	5.213.504,84
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	3,38%	4,50%	10,00%	



■ 7º I b
 ■ 7º III a
 ■ 7º V a
 ■ 8º I

Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2022)

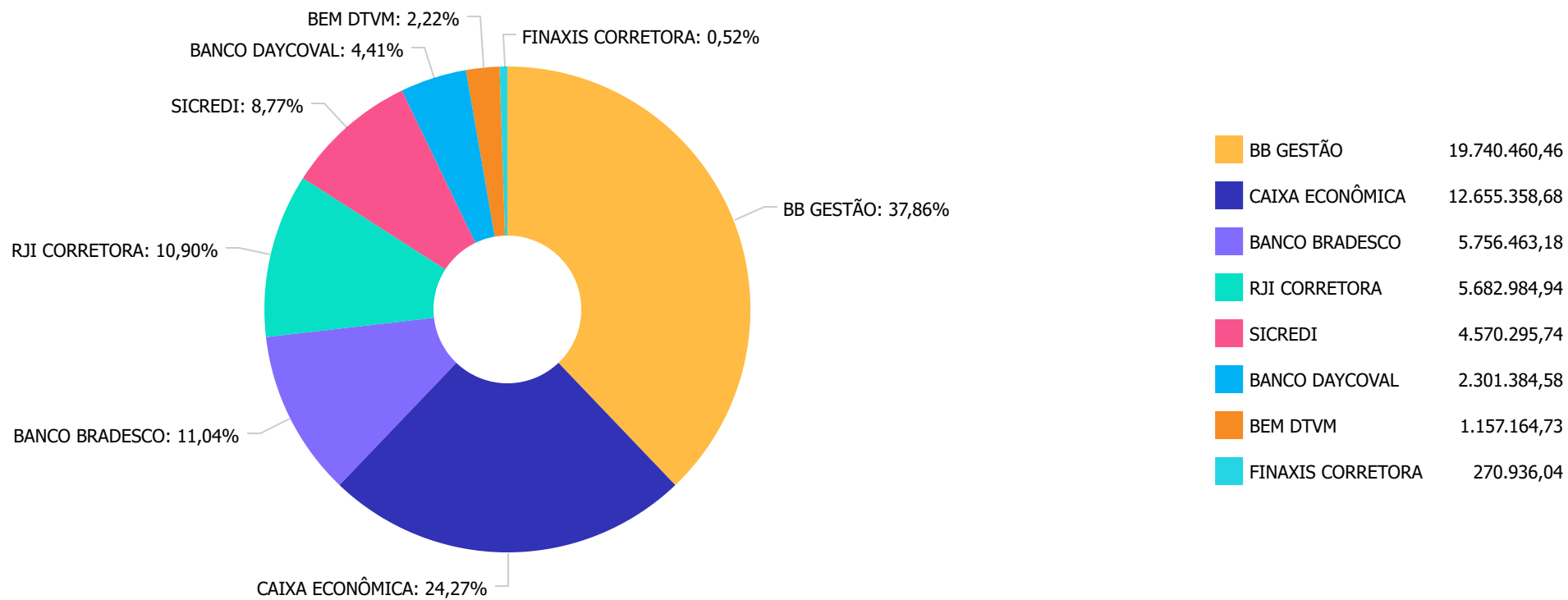
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	19.740.460,46	37,86	-
CAIXA DTVM	11.602.016,72	22,25	0,04
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	5.756.463,18	11,04	0,00
INFINITY ASSET MANAGEMENT	5.682.984,94	10,90	0,59
SICREDI	4.570.295,74	8,77	0,01
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	2.301.384,58	4,41	0,02
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.157.164,73	2,22	0,00
VINCI PARTNERS	1.053.341,96	2,02	0,00
PETRA CAPITAL	270.936,04	0,52	0,00

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

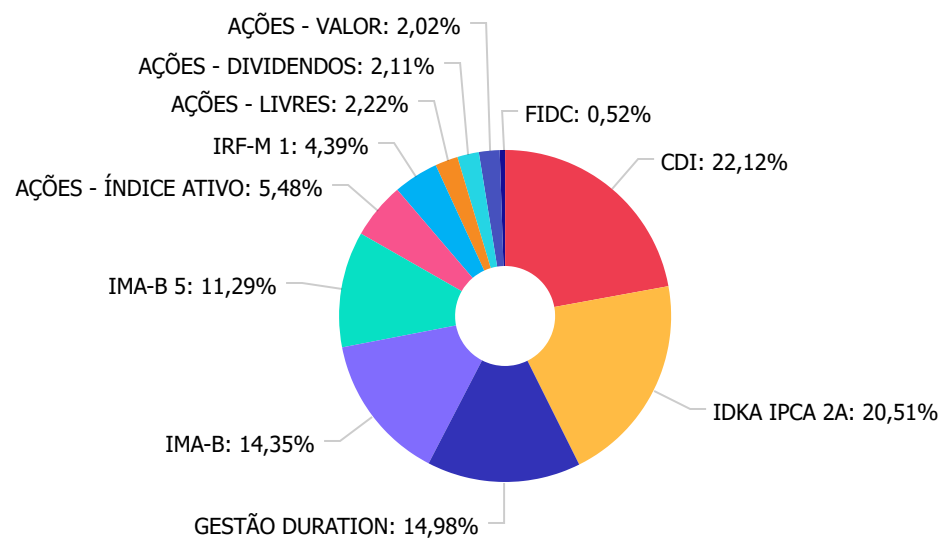
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	59,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	31.125.550,20	59,70	15,22	59,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	14.570.089,58	27,95	6,95	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	270.936,04	0,52	0,00	1,39
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	6.168.472,53	11,83	15,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	3,38	10,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	4,50	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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



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

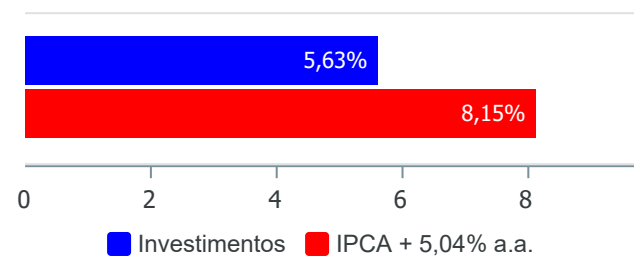


■ CDI	11.534.593,33	■ IDKA IPCA 2A	10.694.176,36	■ GESTÃO DURATION	7.809.114,92	■ IMA-B	7.481.893,87
■ IMA-B 5	5.887.632,65	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.859.553,04	■ IRF-M 1	2.288.228,65	■ AÇÕES - LIVRES	1.157.164,73
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	1.098.412,80	■ AÇÕES - VALOR	1.053.341,96	■ FIDC	270.936,04		

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	48.663.972,76	1.373.940,79	676.133,61	49.916.294,63	554.514,69	554.514,69	1,12%	1,12%	0,95%	0,95%	117,90%	1,94%
Fevereiro	49.916.294,63	6.814.576,99	7.195.769,13	49.962.796,16	427.693,67	982.208,36	0,86%	1,99%	1,39%	2,35%	84,63%	1,64%
Março	49.962.796,16	1.337.167,14	1.286.680,12	51.348.541,07	1.335.257,89	2.317.466,25	2,67%	4,71%	2,06%	4,46%	105,74%	2,39%
Abril	51.348.541,07	839.478,81	707.119,35	51.448.190,05	-32.710,48	2.284.755,77	-0,06%	4,65%	1,44%	5,96%	78,01%	1,92%
Mai	51.448.190,05	1.287.184,11	1.208.445,36	51.498.380,69	-28.548,11	2.256.207,66	-0,06%	4,59%	0,90%	6,91%	66,38%	3,14%
Junho	51.498.380,69	12.532.150,47	12.607.482,30	50.935.810,68	-487.238,18	1.768.969,48	-0,95%	3,60%	1,08%	8,07%	44,59%	1,94%
Julho	50.935.810,68	3.774.501,10	3.524.208,28	51.532.393,43	346.289,93	2.115.259,41	0,68%	4,30%	-0,27%	7,78%	55,29%	1,83%
Agosto	51.532.393,43	1.172.052,94	1.226.742,70	52.135.048,35	657.344,68	2.772.604,09	1,28%	5,63%	0,35%	8,15%	69,04%	2,11%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

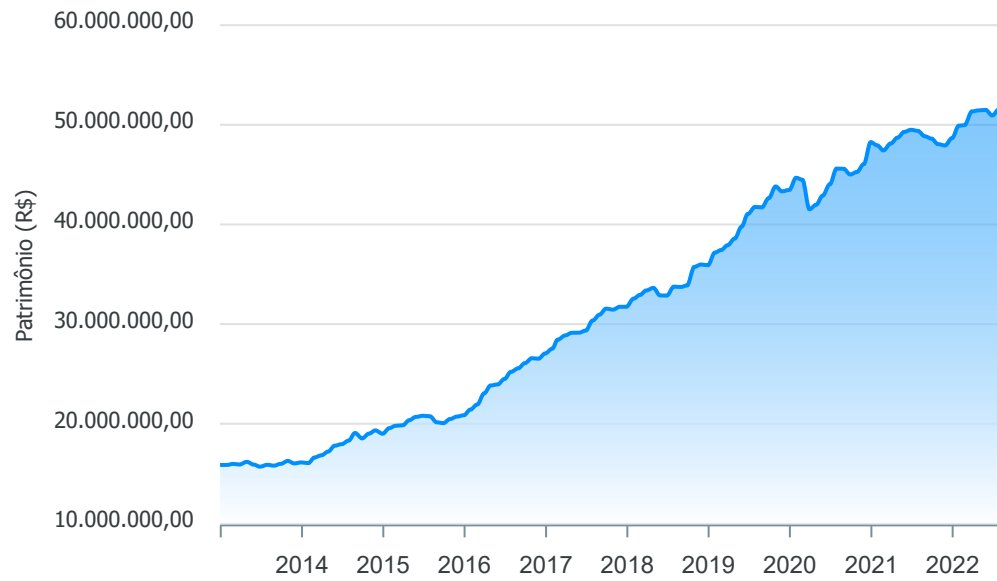




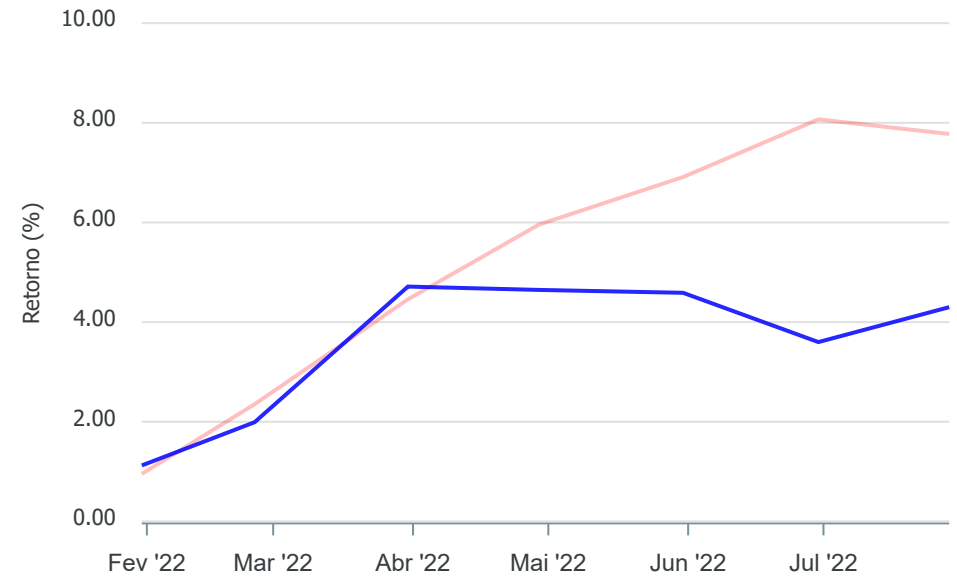
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	2.240.298,16	0,00	0,00	2.292.219,86	51.921,70	2,32%	2,32%	0,48%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	3.317.151,41	0,00	0,00	3.390.765,08	73.613,67	2,22%	2,22%	0,51%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.390.422,76	0,00	0,00	3.434.990,92	44.568,16	1,31%	1,31%	1,41%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	2.260.178,94	0,00	0,00	2.288.228,65	28.049,71	1,24%	1,24%	0,09%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFEREN...	2.255.698,91	0,00	0,00	2.282.067,09	26.368,18	1,17%	1,17%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	972.200,21	0,00	0,00	983.358,92	11.158,71	1,15%	1,15%	1,07%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	2.296.691,98	0,00	0,00	2.321.472,26	24.780,28	1,08%	1,08%	3,20%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.105.484,06	0,00	0,00	5.160.421,61	54.937,55	1,08%	1,08%	3,18%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	924.263,27	1.172.052,94	1.226.742,70	881.817,98	12.244,47	0,58%	1,08%	0,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.306.185,06	0,00	0,00	1.306.264,93	79,87	0,01%	0,01%	1,32%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.830.272,87	0,00	0,00	6.827.229,30	-3.043,57	-0,04%	-0,04%	1,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.871.156,98	0,00	0,00	3.866.947,06	-4.209,92	-0,11%	-0,11%	1,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.587.847,74	0,00	0,00	4.581.367,72	-6.480,02	-0,14%	-0,14%	0,55%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.087.134,75	0,00	0,00	6.078.488,40	-8.646,35	-0,14%	-0,14%	0,55%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	272.824,87	0,00	0,00	270.936,04	-1.888,83	-0,69%	-0,69%	0,19%
Total Renda Fixa	45.717.811,97	1.172.052,94	1.226.742,70	45.966.575,82	303.453,61	0,66%		1,21%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	2.145.124,90	0,00	0,00	2.301.384,58	156.259,68	7,28%	7,28%	9,67%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.083.137,01	0,00	0,00	1.157.164,73	74.027,72	6,83%	6,83%	9,06%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	525.378,94	0,00	0,00	558.168,46	32.789,52	6,24%	6,24%	8,71%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.000.231,45	0,00	0,00	1.053.341,96	53.110,51	5,31%	5,31%	8,61%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.060.709,16	0,00	0,00	1.098.412,80	37.703,64	3,55%	3,55%	6,78%
Total Renda Variável	5.814.581,46	0,00	0,00	6.168.472,53	353.891,07	6,09%		8,77%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.