

2022

Relatório Mensal

Julho

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	8.298.638,00	13,28%	0,00		7º I a
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.612.220,69	4,18%	9.515.072.681,60	0,03%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.146.791,40	5,04%	749.544.414,58	0,42%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.897.945,05	4,64%	5.189.858.068,29	0,06%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.581.632,99	2,53%	3.068.003.584,32	0,05%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	741.665,09	1,19%	614.679.551,73	0,12%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.056.268,33	3,29%	1.977.841.853,65	0,10%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.714.005,73	9,15%	10.426.166.067,57	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	342.947,37	0,55%	1.657.612.299,94	0,02%	7º I b
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	1.801.970,68	2,88%	817.539.930,04	0,22%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.047,67	0,02%	3.157.315.937,43	0,00%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	767.822,57	1,23%	10.247.937.610,00	0,01%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1.565.387,50	2,51%	1.265.147.070,67	0,12%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.735.269,41	4,38%	5.194.423.550,27	0,05%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4.360.341,45	6,98%	2.105.457.404,21	0,21%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.319.061,45	2,11%	2.186.258.657,96	0,06%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	988.108,47	1,58%	425.709.970,04	0,23%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	835.451,18	1,34%	1.538.685.373,47	0,05%	8º I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.656.758,22	2,65%	1.028.283.715,44	0,16%	8º I
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.940.813,13	3,11%	839.233.210,18	0,23%	8º I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	823.296,48	1,32%	320.605.139,88	0,26%	8º I
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	340.546,86	0,55%	674.542.913,01	0,05%	8º I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.156.849,08	1,85%	978.721.458,42	0,12%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6.112.597,45	9,78%	481.284.828,56	1,27%	8º I
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.210.890,47	1,94%	908.139.368,81	0,13%	8º I
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.165.307,38	1,87%	655.001.608,72	0,18%	8º I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	177.171,74	0,28%	913.956.760,51	0,02%	8º I

Investimentos

\$ 62.479.082,71

Disponibilidades Financeiras

\$ 821.531,15

Total Carteira

\$ 63.300.613,86

Governança (Pró Gestão)
 NIVEL 2 15/02/2025

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	467.062,55	0,75%	298.363.730,99	0,16%	8º I
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	238.430,84	0,38%	108.205.585,11	0,22%	8º I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	898.024,56	1,44%	822.210.804,20	0,11%	9º III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	622.781,95	1,00%	464.904.422,68	0,13%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.887.976,97	6,22%	2.340.707.282,75	0,17%	9º III

Investimentos


\$ 62.479.082,71

Disponibilidades Financeiras

\$ 821.531,15

Total Carteira

\$ 63.300.613,86

Governança (Pró Gestão) NIVEL 2 15/02/2025

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	09/11/2021	Curva - Taxa: 5,2500%	250	4.287,618405	1.071.904,60
NTN-B - 15/08/2040	09/11/2021	Curva - Taxa: 5,2800%	250	4.424,414464	1.106.103,62
NTN-B - 15/08/2040	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,4900%	240	4.326,276514	1.038.306,36
NTN-B - 15/05/2045	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6000%	200	4.243,224753	848.644,95
NTN-B - 15/05/2045	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6000%	25	4.243,224753	106.080,62
NTN-B - 15/08/2050	05/11/2021	Curva - Taxa: 5,2400%	240	4.536,897247	1.088.855,34
NTN-B - 15/08/2050	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6000%	240	4.322,784968	1.037.468,39
NTN-B - 15/08/2050	15/07/2022	Curva - Taxa: 6,3200%	508	3.939,516058	2.001.274,16

Investimentos


\$ 62.479.082,71

Disponibilidades Financeiras

\$ 821.531,15

Total Carteira

\$ 63.300.613,86

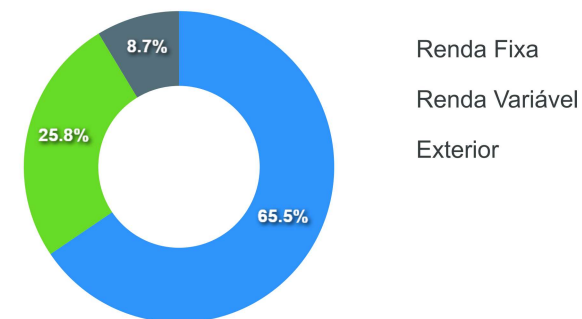
Governança (Pró Gestão)
 NIVEL 2 15/02/2025

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	13,11% 8.298.638,00	86,89% 55.001.975,86
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	33,01% 20.895.447,33	66,99% 42.405.166,53
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	18,56% 11.751.038,52	51,44% 32.559.391,18
8º I - Fundos de Ações	40,00%	25,47% 16.125.175,38	14,53% 9.195.070,16
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	8,54% 5.408.783,48	1,46% 921.277,91

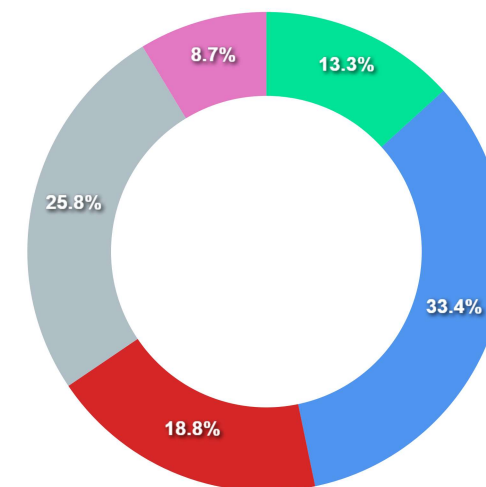
Governança (Pró Gestão)

🔗 NIVEL 2 15/02/2025

Segmentos



Artigos

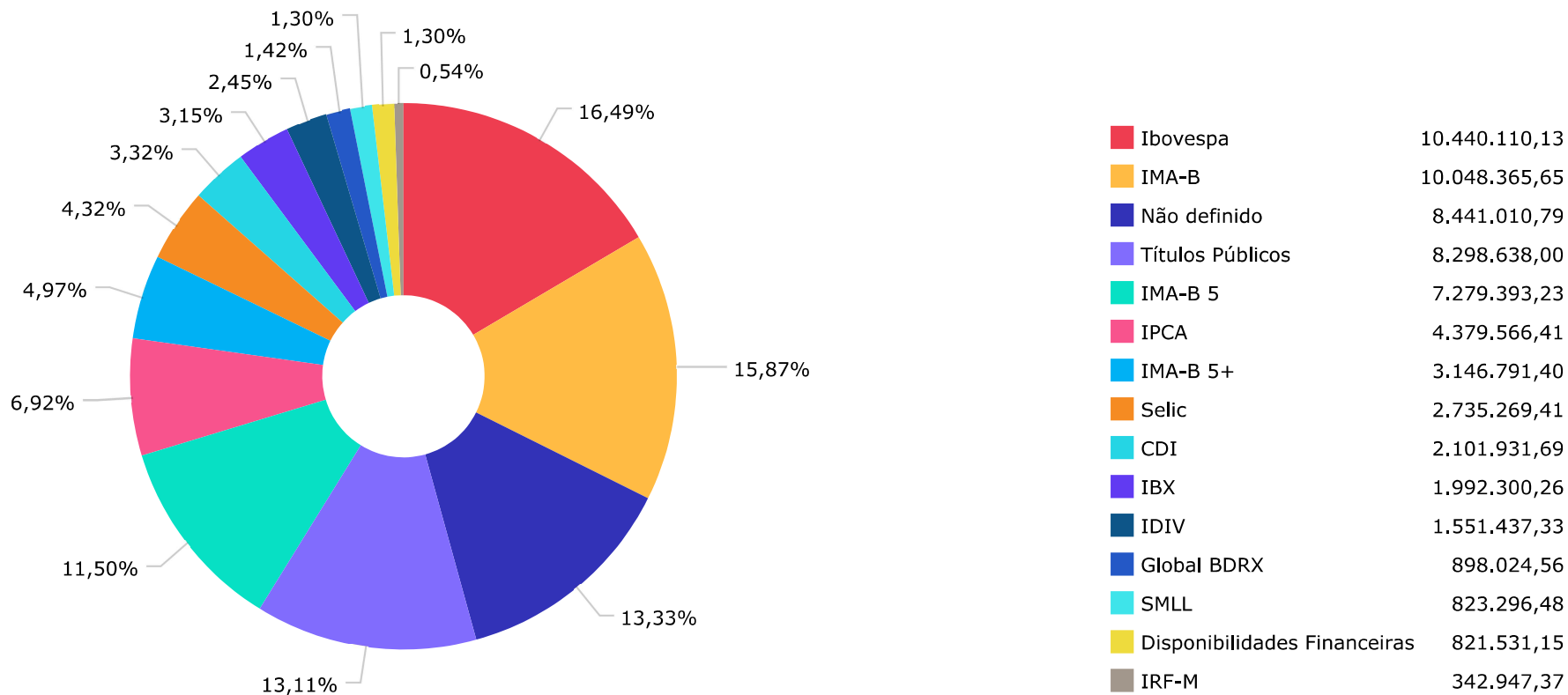


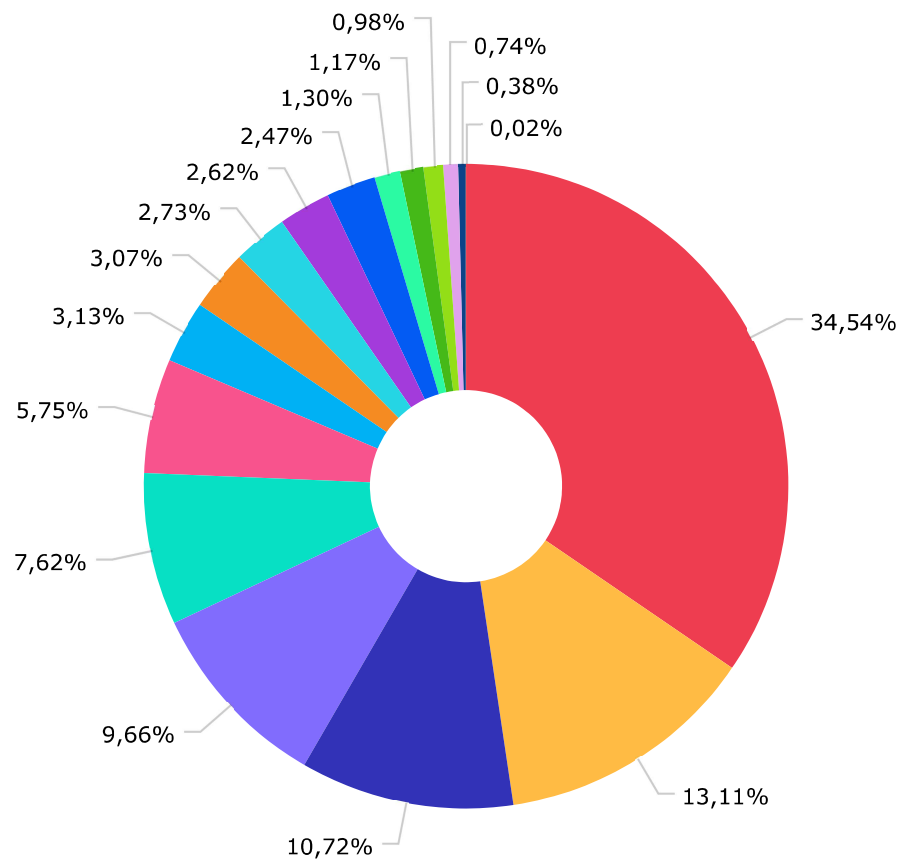
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	13,11%	0,00%	5,00%	100,00%	55.001.975,86	8° I - Fundos de Ações	25,47%	0,00%	29,00%	30,00%	2.865.008,78
7° I b - FI 100% Títulos TN	33,01%	0,00%	30,00%	100,00%	42.405.166,53	9° III - Ações - BDR Nivel I	8,54%	0,00%	10,00%	10,00%	921.277,91
7° III a - FI Referenciados RF	18,56%	0,00%	25,00%	60,00%	26.229.329,80	10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	6.330.061,39

	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	-0,22	6,22	0,82	6,21	9,51	15,66	1,40	2,96
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,88	-22,14	3,94	-13,74	-11,05	16,19	11,49	24,21
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	4,42	-2,68	-5,19	-8,79	-17,73	-1,62	8,11	17,09
CDI - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,04	6,80	3,24	5,95	10,06	13,17	0,02	0,04
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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95	5,87	2,86	5,18	8,24	9,65	0,00	0,01
GLOBAL BDRX - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	7,65	-22,08	3,82	-13,58	-10,66	19,00		
	7,74	-21,75	3,70	-12,46	-9,00	16,47	9,83	20,69
IBOVESPA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25		
	20,67	43,67	22,06	25,28	85,21	126,44	17,92	37,74
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,17	-4,72	-4,39	-8,10	-11,12	10,34	6,78	14,28
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	4,88	2,53	-3,68	-6,34	-14,00	-2,76	7,69	16,19
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	4,63	-1,46	-4,21	-7,84	-15,24	0,04	7,60	16,00
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,85	-1,18	-4,55	-7,53	-17,73	-12,32	7,76	16,34
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	5,15	-4,88	-3,88	-9,82	-20,06	-9,58	8,15	17,16
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12,38	-22,83	-3,06	-16,51	-35,91	-16,58	12,96	27,30
IBX - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4,40	-1,57	-4,69	-7,90	-16,32	1,03		
	3,78	-8,64	-8,63	-10,99	-23,76	-12,16	6,00	12,64
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	5,81	-7,79	-8,94	-11,31	-24,18	-10,73	10,84	22,83
IDIV - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
	1,98	6,66	-2,58	-0,76	-0,49	13,65		

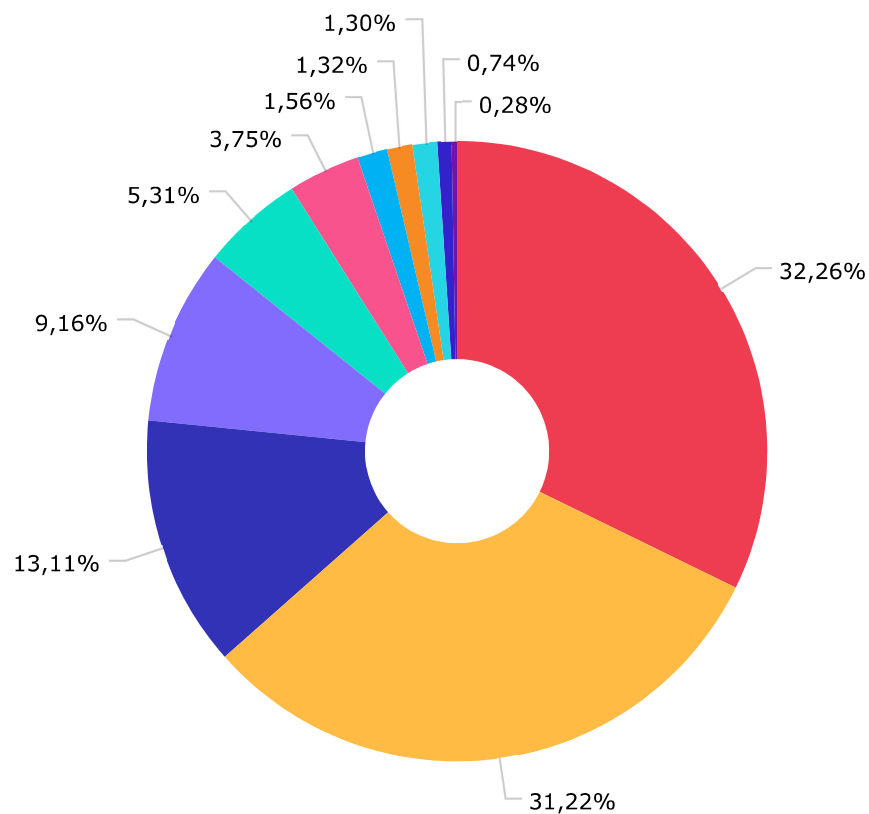
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,67	4,37	-1,42	-2,39	-5,30	8,05	7,15	15,06
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	3,36	4,73	-3,06	-3,75	-6,73	7,17	6,40	13,48
IMA-B - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-0,88	3,43	-0,28	4,20	3,25	5,86		
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	-0,90	3,29	-0,35	4,07	3,00	5,30	2,43	5,13
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,89	3,27	-0,26	4,07	2,97	5,30	2,49	5,25
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,89	3,29	-0,29	4,09	2,96	5,30	2,40	5,05
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,87	3,25	-0,30	4,01	2,76	4,86	2,46	5,18
IMA-B 5 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	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
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	-0,01	6,30	1,01	6,22	9,48	14,02	1,25	2,63
IMA-B 5+ - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-1,84	0,16	-1,79	1,79	-3,22	-2,89		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,86	-0,04	-1,86	1,62	-3,54	-3,55	3,92	8,26
IPCA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-0,68	4,77	0,46	4,21	10,07	19,97		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48	7,39	1,49	6,98	11,07	17,28	0,80	1,69
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08	7,21	0,92	7,11	10,41	15,65	0,76	1,61
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,33		0,77	5,85			1,51	3,18
IRF-M - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	1,15	3,36	2,11	3,45	3,42	1,97		
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,12	3,29	2,07	3,37	3,25	1,57	1,47	3,10
SELIC - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08	6,85	3,29	6,03	10,11	12,91	0,01	0,02

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
SMLL - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	5,16	-15,55	-13,62	-18,34	-32,57	-19,00		
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	4,33	-15,74	-14,89	-19,23	-34,45	-22,85	11,03	23,24

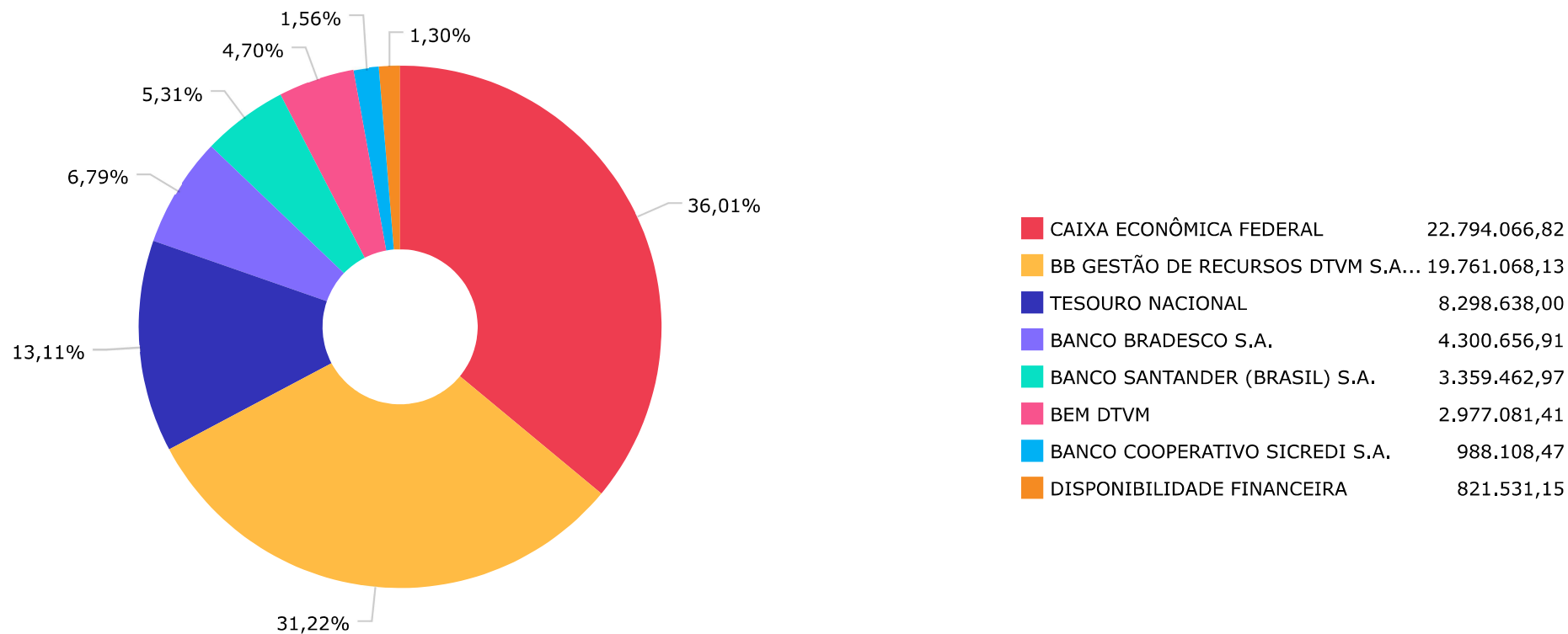




Renda Fixa Indexados	21.864.330,84
Títulos Públicos	8.298.638,00
Ações Livre	6.786.760,09
Ações Indexados	6.112.597,45
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	4.822.153,43
Renda Fixa Duração Livre Soberano	3.637.901,32
Ações Small Caps	1.980.145,56
Ações Sustentabilidade/Governança	1.940.813,13
Ações Dividendos	1.728.609,07
Ações Valor/Crescimento	1.656.758,22
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	1.565.387,50
Disponibilidades Financeiras	821.531,15
Não classificado	741.665,09
Ações Setoriais	622.781,95
Ações Índice Ativo	467.062,55
Fundos de Mono Ação	238.430,84
Renda Fixa Simples	15.047,67



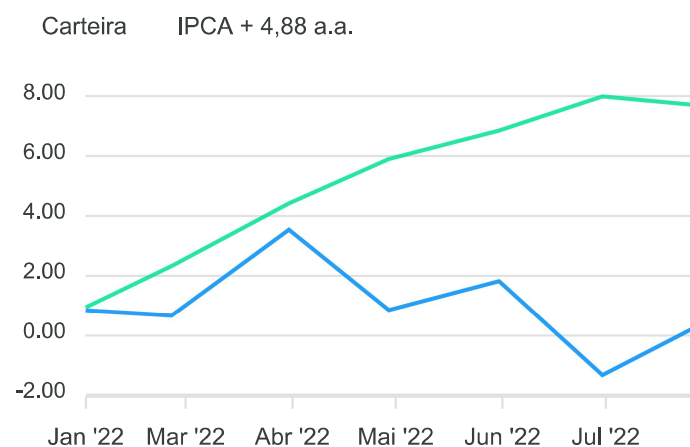
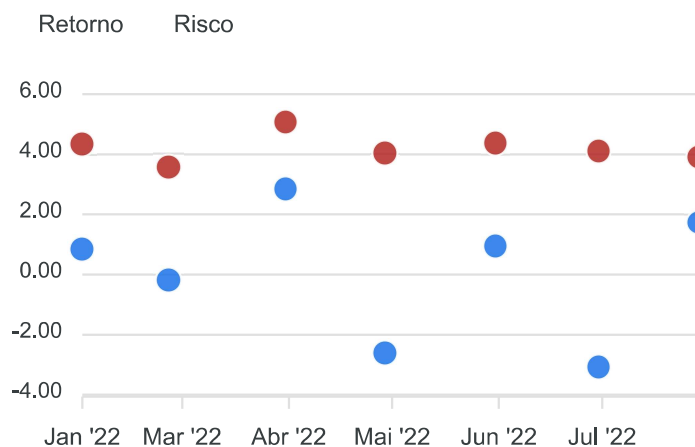
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.417.868,97
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	19.761.068,13
TESOURO NACIONAL	8.298.638,00
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	5.798.052,85
SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...	3.359.462,97
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU...	2.376.197,85
CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ...	988.108,47
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	835.451,18
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	821.531,15
PLURAL INVESTIMENTOS GESTAO DE...	467.062,55
ICATU VANGUARDA GESTAO DE RECU...	177.171,74



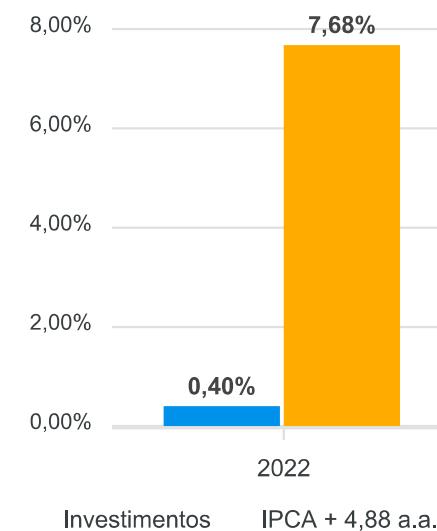
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	62.114.937,77	8.554.304,33	8.815.127,90	62.373.218,56	519.104,36	0,84% ▲	0,94%	4,35%
Fevereiro	62.373.218,56	463.775,23	486.085,73	62.246.769,53	-104.138,53	-0,17% ▼	1,37%	3,57%
Março	62.246.769,53	8.057.797,66	7.951.996,59	64.130.288,56	1.777.717,96	2,85% ▲	2,04%	5,07%
Abril	64.130.288,56	4.966.643,67	4.888.405,02	62.540.709,09	-1.667.818,12	-2,60% ▼	1,42%	4,03%
Mai	62.540.709,09	503.567,79	383.165,85	63.264.375,96	603.264,93	0,96% ▲	0,89%	4,37%
Junho	63.264.375,96	4.018.147,82	3.780.174,80	61.547.407,21	-1.954.941,77	-3,08% ▼	1,07%	4,11%
Julho	61.547.407,21	2.508.743,08	2.647.458,82	62.479.082,71	1.070.391,24	1,74% ▲	-0,28%	3,92%

Retorno Acumulado			
Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	2.192.683,79	3,54%	4,42%
2º Trim	-3.019.494,96	-4,69%	3,42%
1º Sem	-826.811,17	-1,32%	7,99%

Acumulado 243.580,07 0,40% ▲ 7,68%



Retorno e Meta Acumulado



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	6.269.395,38	2.002.717,83	0,00	8.298.638,00	26.524,79	0,32% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	630.712,00	0,00	629.387,76	0,00	-1.324,24	-0,21% ▼	0,88%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	206.773,93	506.025,25	700.000,00	15.047,67	2.248,49	0,32% ▲	0,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.618.003,68	0,00	0,00	2.612.220,69	-5.782,99	-0,22% ▼	1,40%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.206.278,26	0,00	0,00	3.146.791,40	-59.486,86	-1,86% ▼	3,92%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.923.836,83	0,00	0,00	2.897.945,05	-25.891,78	-0,89% ▼	2,40%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	428.617,86	0,00	428.502,14	0,00	-115,72	-0,03% ▼	1,48%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	972.103,72	0,00	213.299,54	767.822,57	9.018,39	0,93% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.580.402,86	0,00	0,00	1.581.632,99	1.230,13	0,08% ▲	0,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	738.118,66	0,00	0,00	741.665,09	3.546,43	0,48% ▲	0,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.063.043,19	0,00	0,00	2.056.268,33	-6.774,86	-0,33% ▼	1,51%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1.565.580,27	0,00	0,00	1.565.387,50	-192,77	-0,01% ▼	1,25%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.706.112,93	0,00	0,00	2.735.269,41	29.156,48	1,08% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	557.467,75	0,00	556.269,38	0,00	-1.198,37	-0,21% ▼	0,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.712.824,29	0,00	0,00	5.714.005,73	1.181,44	0,02% ▲	1,21%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	339.143,58	0,00	0,00	342.947,37	3.803,79	1,12% ▲	1,47%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4.399.710,90	0,00	0,00	4.360.341,45	-39.369,45	-0,89% ▼	2,49%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	1.818.301,70	0,00	0,00	1.801.970,68	-16.331,02	-0,90% ▼	2,43%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.424.697,70	0,00	120.000,00	1.319.061,45	14.363,75	1,01% ▲	0,02%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	996.767,02	0,00	0,00	988.108,47	-8.658,55	-0,87% ▼	2,46%
	41.157.892,51	2.508.743,08	2.647.458,82	40.945.123,85	-74.052,92	-0,18%	1,34%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	805.044,81	0,00	0,00	835.451,18	30.406,37	3,78% ▲	6,00%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.590.492,24	0,00	0,00	1.656.758,22	66.265,98	4,17% ▲	6,78%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.858.712,50	0,00	0,00	1.940.813,13	82.100,63	4,42% ▲	8,11%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	789.101,15	0,00	0,00	823.296,48	34.195,33	4,33% ▲	11,03%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	325.344,21	0,00	0,00	340.546,86	15.202,65	4,67% ▲	7,15%
BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.093.355,76	0,00	0,00	1.156.849,08	63.493,32	5,81% ▲	10,84%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	5.842.024,78	0,00	0,00	6.112.597,45	270.572,67	4,63% ▲	7,60%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.171.507,09	0,00	0,00	1.210.890,47	39.383,38	3,36% ▲	6,40%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.111.066,92	0,00	0,00	1.165.307,38	54.240,46	4,88% ▲	7,69%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	170.598,34	0,00	0,00	177.171,74	6.573,40	3,85% ▲	7,76%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	442.901,16	0,00	0,00	467.062,55	24.161,39	5,46% ▲	8,15%
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	197.592,06	0,00	0,00	238.430,84	40.838,78	20,67% ▲	17,92%
-	15.397.741,02	0,00	0,00	16.125.175,38	727.434,36	4,72%	7,98%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	833.535,45	0,00	0,00	898.024,56	64.489,11	7,74% ▲	9,83%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	554.156,30	0,00	0,00	622.781,95	68.625,65	12,38% ▲	12,96%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.604.081,93	0,00	0,00	3.887.976,97	283.895,04	7,88% ▲	11,49%
	4.991.773,68	0,00	0,00	5.408.783,48	417.009,80	8,35%	3,12%

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