

# Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2022

**Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2022)**

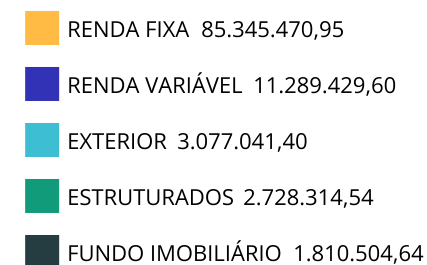
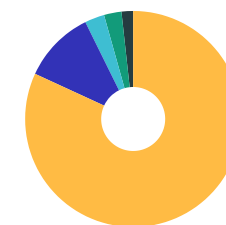
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	13.468.758,29	12,92%	523	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	3.112.684,53	2,99%	1.071	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	4.675.565,77	4,48%	103	0,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.752.849,43	7,44%	814	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	8.828.614,30	8,47%	1.063	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.056.720,38	6,77%	1.006	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.446.237,53	1,39%	776	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.117.998,71	2,99%	1.172	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.264.124,09	2,17%	225	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.138.718,45	2,05%	1.015	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.123.745,30	3,96%	168	0,56%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.569.422,39	4,38%	164	0,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	16.198.439,20	15,54%	287	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.749.512,97	4,56%	973	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	175.612,58	0,17%	26	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	182.149,78	0,17%	31	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	5.872,30	0,01%	28	1,10%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	665.519,50	0,64%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	812.925,45	0,78%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	983.527,69	0,94%	4.250	0,06%	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
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.880.019,87	1,80%	25.205	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	885.522,73	0,85%	302	2,42%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.904.881,00	2,79%	155	0,57%	Artigo 8º, Inciso I
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	2.302.481,51	2,21%	68	2,56%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	2.332.996,80	2,24%	2.928	0,68%	Artigo 8º, Inciso I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.018.889,58	0,98%	21.654	0,21%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.058.151,82	1,97%	518	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.728.314,52	2,62%	51.036	0,11%	Artigo 10º, Inciso I
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%	5	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.810.504,64	1,74%		4,79%	Artigo 11º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>104.250.761,13</b>				

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

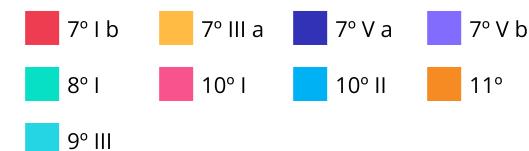
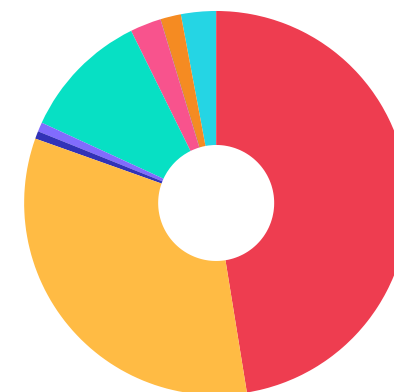
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,89%	59,24%	61.758.150,89
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	49.459.428,94	47,44%	13,79%	17,89%	59,24%	12.298.721,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	34.401.724,76	33,00%	12,62%	16,82%	50,00%	17.723.655,81
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	16,82%	20,00%	20.850.152,23
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	671.391,80	0,64%	0,00%	2,09%	2,09%	1.507.449,11
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	812.925,45	0,78%	0,00%	2,78%	5,00%	4.399.612,61
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>85.345.470,95</b>	<b>81,87%</b>	<b>26,41%</b>	<b>74,29%</b>	<b>195,57%</b>	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	11.289.429,60	10,83%	11,21%	12,70%	20,00%	9.560.722,63
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,24%	20,00%	20.850.152,23
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.728.314,53	2,62%	2,09%	2,78%	10,00%	7.696.761,58
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-0,01
Artigo 11º	5,00%	1.810.504,64	1,74%	0,00%	1,99%	1,99%	264.085,51
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>15.828.248,78</b>	<b>15,18%</b>	<b>13,30%</b>	<b>19,71%</b>	<b>51,99%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.077.041,40	2,95%	3,75%	5,00%	10,00%	7.348.034,71
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>3.077.041,40</b>	<b>2,95%</b>	<b>3,75%</b>	<b>5,00%</b>	<b>10,00%</b>	



**Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2022)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	35.010.085,14	33,58	0,12
BRANCO ASSET MANAGEMENT	33.357.576,39	32,00	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	26.611.509,33	25,53	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	4.112.986,15	3,95	-
SOMMA INVESTIMENTOS	2.332.996,80	2,24	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	983.527,69	0,94	0,00
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	812.925,45	0,78	0,03
PETRA CAPITAL	665.519,50	0,64	0,01
GENIAL GESTÃO LTDA	188.022,09	0,18	-
RJI CORRETORA DE VALORES	175.612,58	0,17	0,03
ÍNDIGO DTVM	0,01	0,00	-

**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 '	49.459.428,94	47,44	13,79	59,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	34.401.724,76	33,00	12,62	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	671.391,80	0,64	0,00	2,09
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	812.925,45	0,78	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	11.289.429,60	10,83	11,21	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	3.077.041,40	2,95	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.728.314,53	2,62	2,09	10,00
Artigo 11º	1.810.504,64	1,74	0,00	1,99

**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)

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)</b>	1,49%	10,24%	4,17%	8,03%	14,06%	21,22%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-18,93%	146,87%	3.888.945.300,00%	415,20%	70,43%	-30,87%	-	149.409.799,25%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	-0,36%	6,28%	-0,07%	4,90%	9,42%	14,98%	-	-
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%	0,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,05%	6,17%	0,00%	4,95%	9,27%	14,82%	1,44%	0,04%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	1,23%	7,40%	3,25%	5,94%	9,04%	11,48%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,21%	7,22%	3,19%	5,81%	8,80%	10,97%	0,11%	0,02%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%	0,04%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,12%	2,39%	-0,13%	1,92%	2,16%	-21,16%	0,26%	0,02%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	-0,02%	6,28%	0,24%	5,11%	9,37%	13,52%	1,33%	0,04%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-3,18%	-7,78%	-3,13%	-1,70%	-8,24%	-69,58%	5,13%	0,07%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	1,10%	4,57%	-0,15%	4,78%	5,54%	8,99%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,20%	4,52%	-0,12%	4,77%	5,40%	8,57%	3,19%	0,06%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,08%	4,33%	-0,23%	4,59%	5,17%	8,22%	3,20%	0,06%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	4,36%	-0,31%	4,58%	5,25%	8,33%	3,21%	0,06%

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2022 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	1,17%	7,74%	3,25%	6,16%	10,20%	13,18%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,18%	7,90%	3,28%	6,21%	10,49%	13,56%	0,01%	0,01%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,68%	3,84%	1,92%	3,51%	4,21%	3,53%	0,05%	0,02%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,69%	-59,53%	-1,65%	-59,40%	-60,01%	-62,13%	0,19%	0,58%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,19%	7,93%	3,29%	6,21%	10,55%	13,60%	0,01%	0,01%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,21%	8,15%	3,40%	6,43%	10,90%	14,08%	0,01%	0,01%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	-0,36%	4,39%	-0,37%	2,79%	8,73%	19,25%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,15%	6,17%	2,27%	5,26%	7,77%	9,67%	1,07%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,32%	5,81%	1,99%	4,85%	7,25%	7,74%	1,41%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,47%	6,96%	2,51%	5,40%	8,49%	8,48%	0,58%	0,02%



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2022 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	1,17%	7,74%	3,25%	6,16%	10,20%	13,18%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,96%	8,30%	2,55%	5,90%	9,20%	12,59%	0,90%	0,03%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-3,05%	-24,45%	5,20%	-10,08%	-15,31%	0,66%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,92%	-25,19%	4,51%	-10,76%	-16,57%	-3,06%	10,67%	0,21%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	6,16%	4,48%	-1,64%	-3,20%	-7,79%	10,22%	-	-
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	8,60%	9,65%	2,54%	4,73%	-8,09%	6,00%	9,52%	0,25%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	5,73%	2,04%	-4,04%	-3,86%	-5,07%	16,50%	9,10%	0,21%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	6,87%	1,36%	-3,69%	-4,60%	-11,49%	2,81%	9,70%	0,23%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	5,77%	5,42%	-1,96%	-3,86%	-12,04%	-10,85%	9,25%	0,23%
<b>IDIV (Benchmark)</b>	4,27%	11,21%	-2,58%	5,93%	4,28%	24,51%	-	-
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,24%	10,39%	-2,82%	5,26%	3,16%	22,06%	7,07%	0,19%
<b>IFIX (Benchmark)</b>	5,76%	6,11%	5,52%	8,58%	8,23%	6,98%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-3,74%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	-0,36%	4,39%	-0,37%	2,79%	8,73%	19,25%	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1,77%	12,70%	4,67%	9,35%	20,05%	49,51%	0,61%	0,00%

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2022 - RENDA VARIÁVEL**

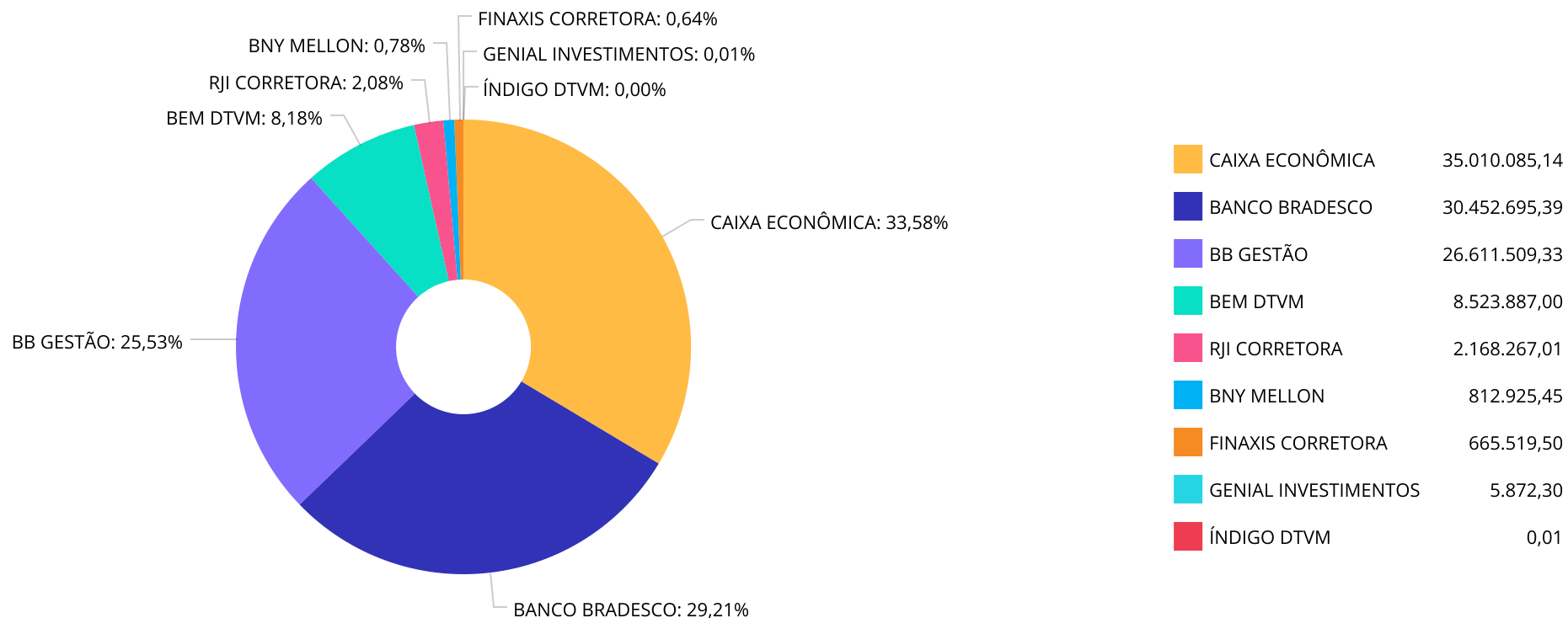
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,38%	10,23%	1,74%	7,14%	17,97%	40,34%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>SMLL (Benchmark)</b>	10,90%	-6,34%	-2,42%	-4,48%	-22,25%	-9,05%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,97%	-3,19%	-2,30%	-4,27%	-14,90%	-3,83%	8,25%	0,18%



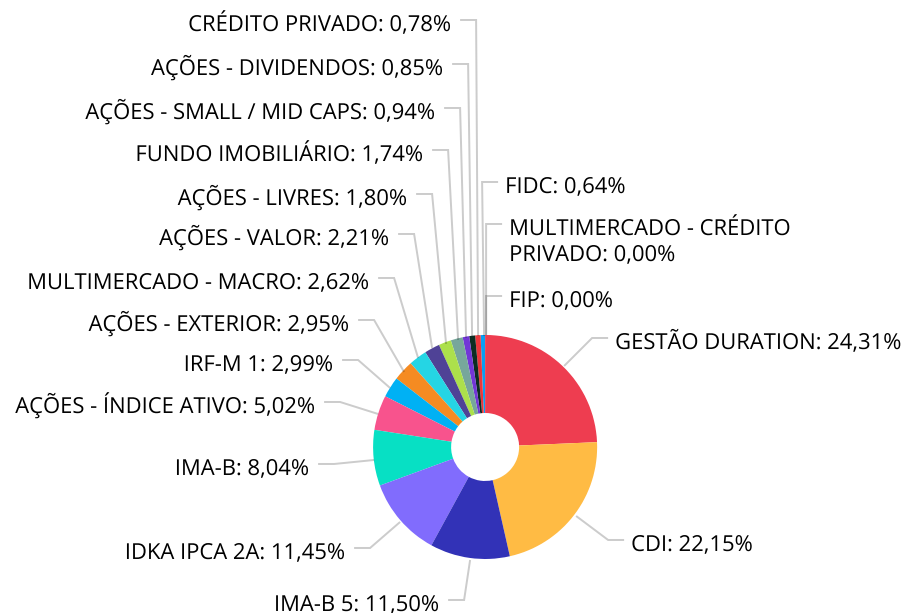
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,05%	-24,45%	5,20%	-10,08%	-15,31%	0,66%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,92%	-25,19%	4,51%	-10,76%	-16,57%	-3,06%	10,67%	21,118%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,59%	-19,29%	7,38%	-6,77%	-31,92%	-20,27%	11,32%	23,674%

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



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

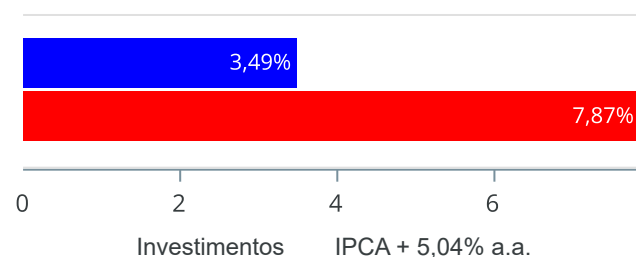


■ GESTÃO DURATION	25.345.353,02	■ CDI	23.086.670,62	■ IMA-B 5	11.983.905,13
■ IDKA IPCA 2A	11.941.298,83	■ IMA-B	8.385.927,39	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.237.877,80
■ IRF-M 1	3.117.998,71	■ AÇÕES - EXTERIOR	3.077.041,40	■ MULTIMERCADO - MACRO	2.728.314,52
■ AÇÕES - VALOR	2.302.481,51	■ AÇÕES - LIVRES	1.880.019,87	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.810.504,64
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	983.527,69	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	885.522,73	■ CRÉDITO PRIVADO	812.925,45
■ FIDC	671.391,80	■ MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	0,01	■ FIP	0,01

**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	77.145.329,80	7.549.952,44	4.815.604,25	80.195.550,11	315.872,12	315.872,12	0,40%	0,40%	0,95%	0,95%	41,50%	2,25%
Fevereiro	80.195.550,11	9.051.068,55	6.340.202,99	83.137.310,44	230.894,77	546.766,89	0,28%	0,68%	1,39%	2,35%	28,71%	2,30%
Março	83.137.310,44	26.759.470,35	26.414.543,17	84.916.029,27	1.433.791,65	1.980.558,54	1,72%	2,40%	2,06%	4,46%	53,94%	2,37%
Abril	84.916.029,27	2.559.701,46	2.468.773,99	84.787.400,67	-219.556,07	1.761.002,47	-0,26%	2,14%	1,44%	5,96%	35,92%	1,92%
Mai	84.787.400,67	7.482.145,98	6.462.716,01	85.682.329,09	-124.501,55	1.636.500,92	-0,15%	1,99%	0,90%	6,91%	28,81%	2,93%
Junho	85.682.329,09	2.449.492,23	3.186.480,56	84.016.481,07	-928.859,69	707.641,23	-1,08%	0,89%	1,08%	8,07%	10,98%	2,11%
Julho	84.016.481,07	13.033.058,45	8.890.324,61	89.129.356,87	970.141,96	1.677.783,19	1,10%	2,00%	-0,27%	7,78%	25,67%	1,95%
Agosto	89.129.356,87	2.375.489,84	0,00	92.840.849,23	1.336.002,52	3.013.785,71	1,46%	3,49%	0,09%	7,87%	44,28%	2,16%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



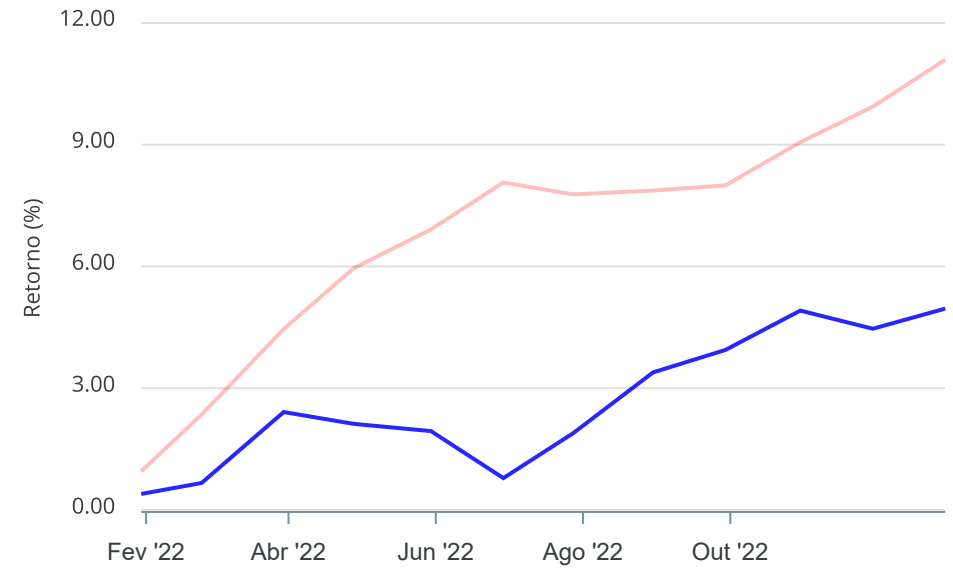
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.640.336,94	0,00	0,00	7.752.849,43	112.512,49	1,47%	1,47%	0,58%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.070.240,71	0,00	0,00	4.123.745,30	53.504,59	1,31%	1,31%	1,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.080.700,79	0,00	0,00	3.117.998,71	37.297,92	1,21%	1,21%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.429.142,20	0,00	0,00	1.446.237,53	17.095,33	1,20%	1,20%	3,19%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.693.786,60	0,00	0,00	4.749.512,97	55.726,37	1,19%	1,19%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.113.706,84	0,00	0,00	2.138.718,45	25.011,61	1,18%	1,18%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	13.315.920,92	0,00	0,00	13.468.758,29	152.837,37	1,15%	1,15%	1,07%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	4.625.656,99	0,00	0,00	4.675.565,77	49.908,78	1,08%	1,08%	3,20%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.240.489,23	0,00	0,00	2.264.124,09	23.634,86	1,05%	1,05%	3,21%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	13.657.746,31	2.375.489,84	0,00	16.198.439,20	165.203,05	1,03%	1,21%	0,01%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	807.398,83	0,00	0,00	812.925,45	5.526,62	0,68%	0,68%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.053.362,24	0,00	0,00	7.056.720,38	3.358,14	0,05%	0,05%	1,30%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	4.570.343,04	0,00	0,00	4.569.422,39	-920,65	-0,02%	-0,02%	1,33%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.114.072,16	0,00	0,00	3.112.684,53	-1.387,63	-0,04%	-0,04%	1,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.940.547,40	0,00	102.253,57	8.828.614,30	-9.679,53	-0,11%	-0,11%	1,43%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	175.824,18	0,00	0,00	175.612,58	-211,60	-0,12%	-0,12%	0,26%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	670.159,18	0,00	0,00	665.519,50	-4.639,68	-0,69%	-0,69%	0,19%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	188.139,32	0,00	0,00	182.149,78	-5.989,54	-3,18%	-3,18%	5,13%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	7.243,28	0,00	0,00	5.872,30	-1.370,98	-18,93%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>82.394.817,16</b>	<b>2.375.489,84</b>	<b>102.253,57</b>	<b>85.345.470,95</b>	<b>677.417,52</b>	<b>0,80%</b>		<b>1,00%</b>



**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
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	2.674.917,59	0,00	0,00	2.904.881,00	229.963,41	8,60%	8,60%	9,52%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	2.183.091,44	0,00	0,00	2.332.996,80	149.905,36	6,87%	6,87%	9,70%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	928.090,46	0,00	0,00	983.527,69	55.437,23	5,97%	5,97%	8,25%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2.176.819,56	0,00	0,00	2.302.481,51	125.661,95	5,77%	5,77%	9,25%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.778.175,50	0,00	0,00	1.880.019,87	101.844,37	5,73%	5,73%	9,10%
BRADESCO H DIVIDENDOS FI AÇÕES	849.529,02	0,00	0,00	885.522,73	35.993,71	4,24%	4,24%	7,07%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.675.910,04	0,00	0,00	2.728.314,52	52.404,48	1,96%	1,96%	0,90%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	1,77%	0,61%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.814.941,56	0,00	0,00	1.810.504,64	-4.436,92	-0,24%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>15.081.475,19</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>15.828.248,78</b>	<b>746.773,59</b>	<b>4,95%</b>		<b>6,67%</b>

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	974.166,25	0,00	0,00	1.018.889,58	44.723,33	4,59%	4,59%	11,32%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.142.014,08	0,00	0,00	2.058.151,82	-83.862,26	-3,92%	-3,92%	10,67%
<b>Total Exterior</b>	<b>3.116.180,33</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>3.077.041,40</b>	<b>-39.138,93</b>	<b>-1,26%</b>		<b>10,88%</b>

## 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 CRÉDITO & MERCADO GESTÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.. As informações aqui contidas, tem por somente, 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 o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

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

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 (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º 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 MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, 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.



