

2022

Relatório

Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2022

Junho

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.407.134,29	3,59%	9.717.321.383,29	0,04%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.977.264,92	2,09%	6.996.220.208,06	0,03%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	386.115,47	0,41%	5.103.254.867,87	0,01%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	150.527,83	0,16%	3.520.668.596,00	0,00%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.999.829,05	2,11%	2.872.769.394,76	0,07%	7º I b
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	318.114,09	0,34%	794.285.280,96	0,04%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.588.648,15	6,95%	11.084.704.335,99	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.496.442,00	19,51%	1.212.673.784,01	1,53%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.450.101,18	4,69%	4.111.516.095,57	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	196.629,26	0,21%	5.096.804.349,76	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.410.833,46	10,98%	1.835.852.466,18	0,57%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.789.108,47	10,33%	664.050.646,23	1,47%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.586.965,32	4,84%	236.289.379,07	1,94%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.704.623,52	1,80%	142.319.131,43	1,20%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA	4.861.418,26	5,13%	65.755.285,95	7,39%	7º I b
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.836.494,87	8,27%	786.311.506,32	1,00%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.013.818,90	4,23%	12.613.402.228,26	0,03%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	8.377.991,98	8,84%	2.202.359.178,53	0,38%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	118.059,63	0,12%	2.406.329.548,15	0,00%	7º III a
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	201.894,67	0,21%	46.966.294,28	0,43%	7º V a
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	454,16	0,00%	216.576,81	0,21%	7º V a
PREMIUM FIDC SÊNIOR	242.274,83	0,26%	31.453.422,65	0,77%	7º V a
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	4.669.744,29	4,93%	679.415.733,50	0,69%	8º I

Investimentos

\$ 94.784.488,60

Disponibilidades Financeiras

\$ 103.218,35

Total Carteira

\$ 94.887.706,95

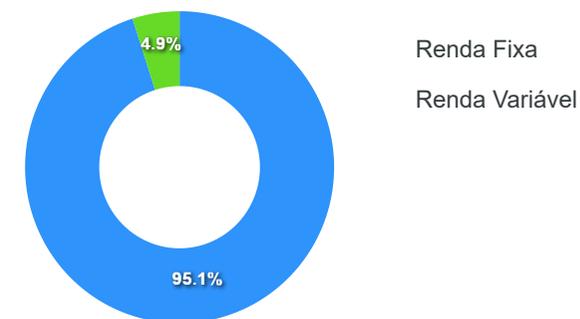
Governança (Pró Gestão)
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	73,14%	25.460.733,33
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	21,47%	36.524.327,78
7° V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	0,47%	4.294.600,77
8° I - Fundos de Ações	30,00%	4,93%	23.765.602,29

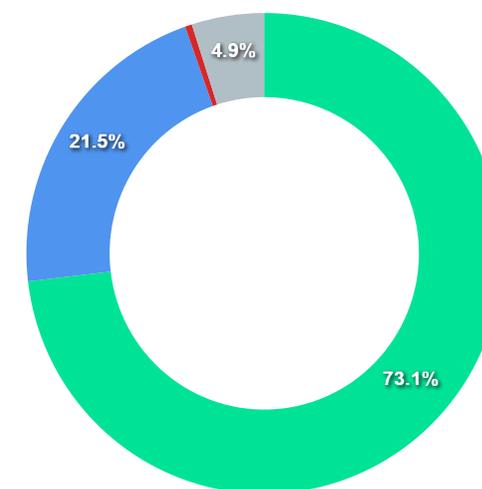
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos

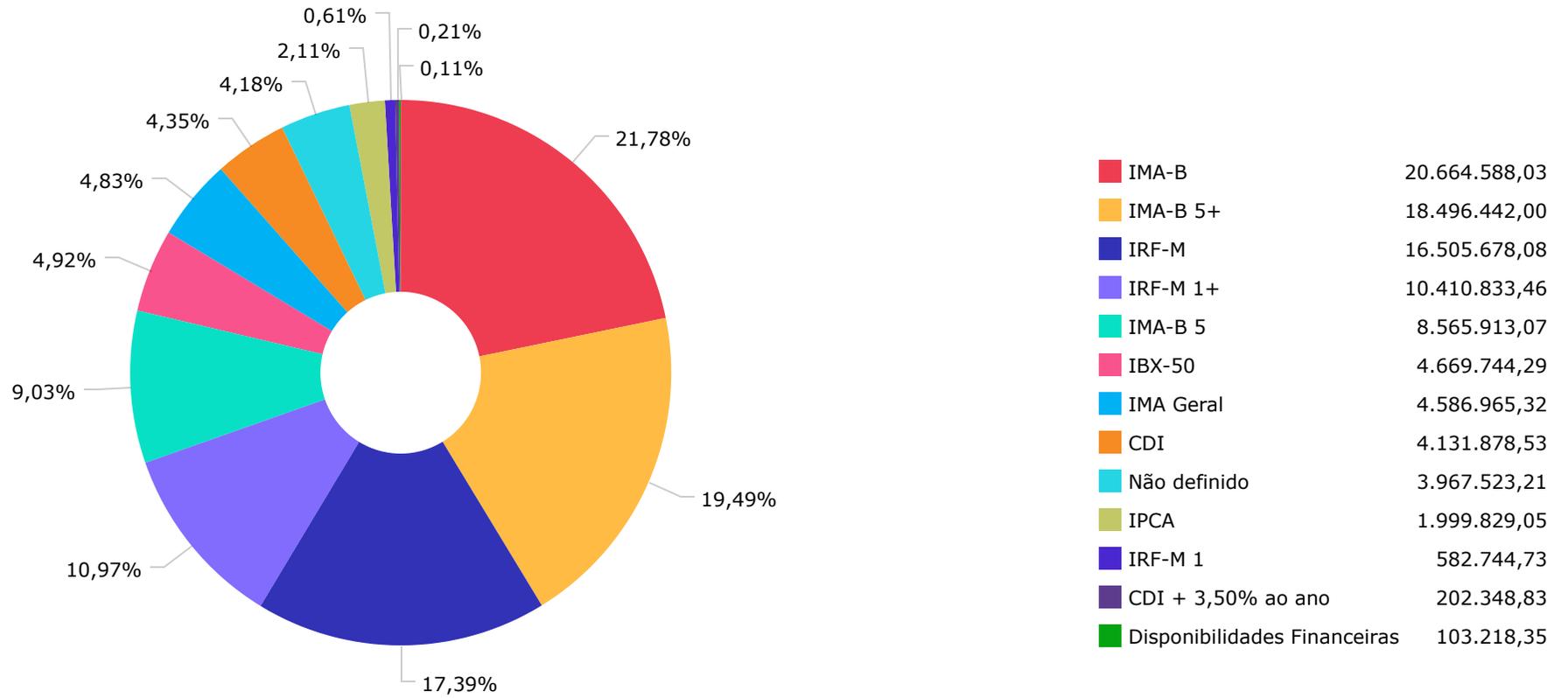


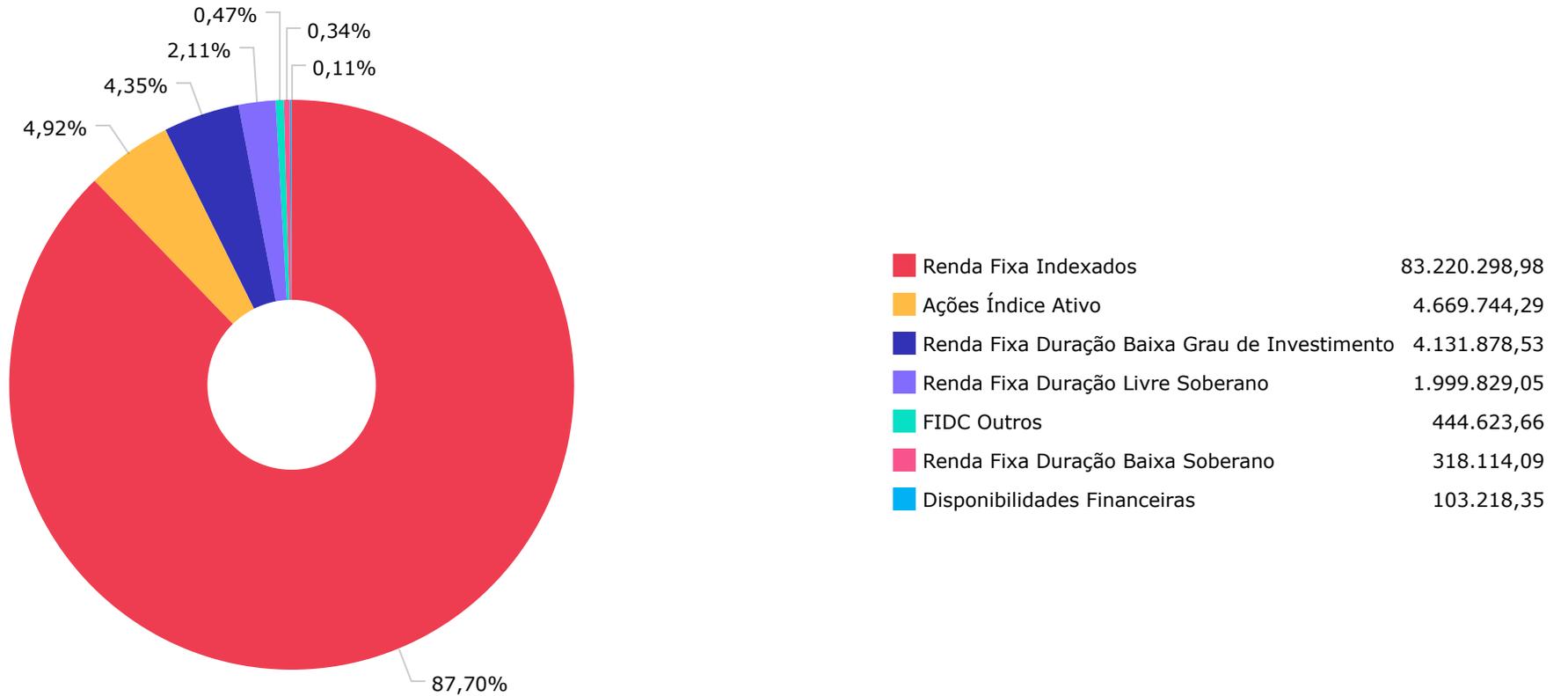
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	10,00%	100,00%	94.784.488,60
7° I b - FI 100% Títulos TN	73,14%	0,00%	29,00%	100,00%	25.460.733,33
7° III a - FI Referenciados RF	21,47%	0,00%	20,00%	60,00%	36.524.327,78
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,47%	0,00%	1,00%	5,00%	4.294.600,77

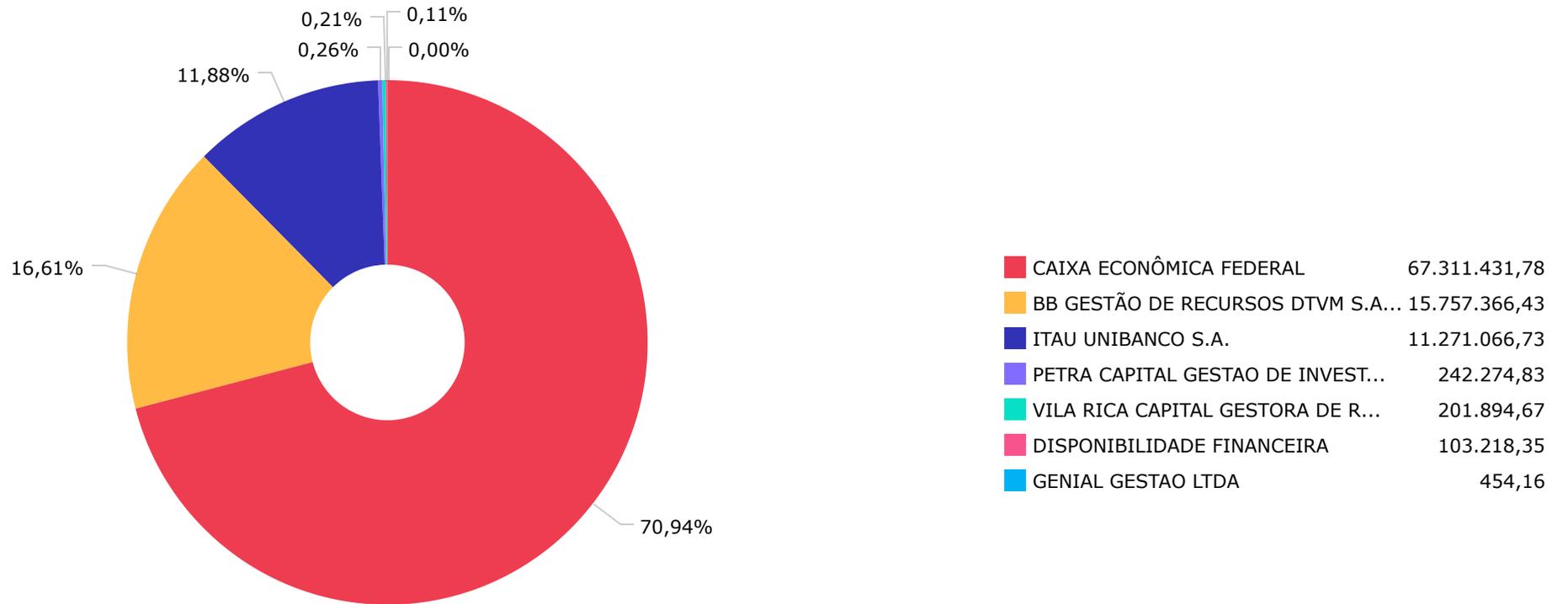
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8° I - Fundos de Ações	4,93%	0,00%	29,00%	30,00%	23.765.602,29
9° III - Ações - BDR Nível I	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	9.478.448,86
10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	9.478.448,86

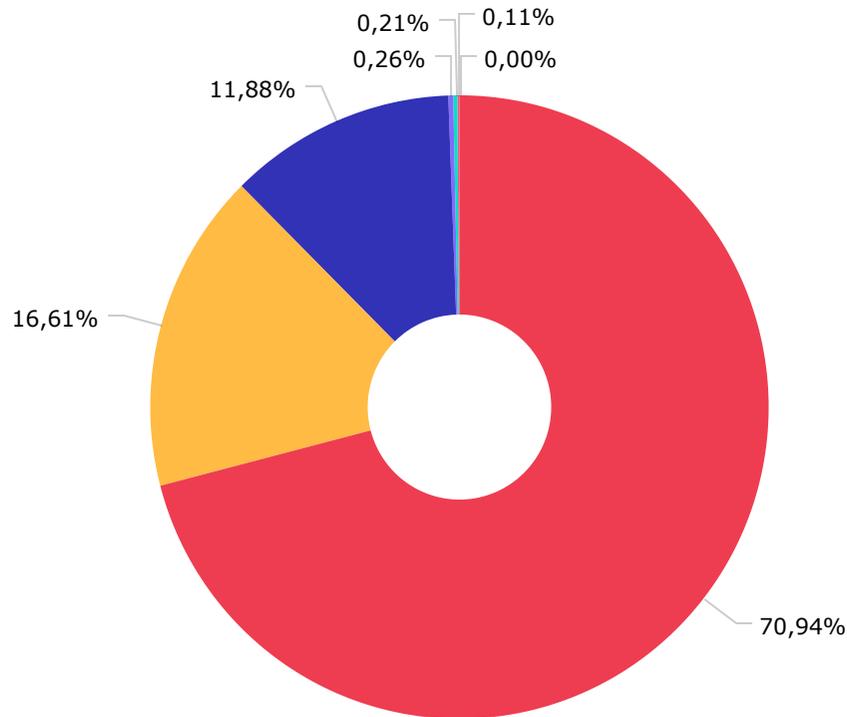
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,27	6,46	2,54	6,46	9,84	16,85	1,38	2,90
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,88	4,59	2,50	4,59	7,12	8,63	0,01	0,02
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,59	-59,09	-59,01	-59,09	-59,79	-62,76	0,18	0,37
CDI - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12		
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1,10	5,89	3,06	5,89	9,64	12,36	0,07	0,14
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,06	5,60	2,97	5,60	9,19	11,59	0,04	0,09
CDI + 3,50% AO ANO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
	1,30	7,20	3,80	7,23	12,46	19,03		
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,42	28,37	-0,23	28,37	-4,15	1.016,88		
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-1,95	-79,62	-79,71	-79,62	-89,15	-75,69		
IBX-50 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
	-11,67	-5,71	-18,35	-5,71	-22,70	6,28		
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-12,79	-6,95	-19,21	-6,95	-24,74	2,73	9,95	20,95
IMA GERAL - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
	0,43	4,49	1,90	4,49	5,34	9,08		
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,38	4,23	1,37	4,23	3,56	10,93	2,04	4,29
IMA-B - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
	-0,36	4,35	1,43	4,35	3,78	11,48		
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,41	4,26	1,36	4,26	3,58	10,95	2,09	4,39
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,38	4,25	1,39	4,25	3,52	10,96	2,05	4,32
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,36	4,21	1,40	4,21	3,50	10,92	2,06	4,34
IMA-B 5 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
	0,33	6,61	2,69	6,61	10,06	16,74		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,33	6,51	2,65	6,51	9,84	16,18	1,23	2,59
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,32	6,47	2,63	6,47	9,74	16,08	1,26	2,65

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B 5+ - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-1,10	2,03	0,12	2,03	-2,16	6,18		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,10	1,95	0,07	1,95	-2,61	5,50	3,18	6,70
IPCA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	0,67	5,49	2,22	5,49	11,89	21,23		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33	7,12	3,08	7,12	10,31	16,86	1,37	2,89
IRF-M - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	0,37	2,19	0,83	2,19	1,76	1,90		
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,93	4,93	2,61	4,93	7,03	8,93	0,17	0,35
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,34	2,15	0,76	2,15	1,63	1,54	1,76	3,70
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,34	2,11	0,81	2,11	1,51	1,42	1,76	3,71
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA	0,35	2,06	0,75	2,06	1,50	1,43	1,75	3,69
IRF-M 1 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	0,93	4,99	2,65	4,99	7,19	9,37		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91	4,86	2,58	4,86	6,94	8,89	0,17	0,35
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92	4,85	2,56	4,85	6,92	8,69	0,17	0,36
IRF-M 1+ - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	0,09	0,73	-0,06	0,73	-1,02	-2,10		
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04	0,62	-0,11	0,62	-1,34	-2,63	2,55	5,38







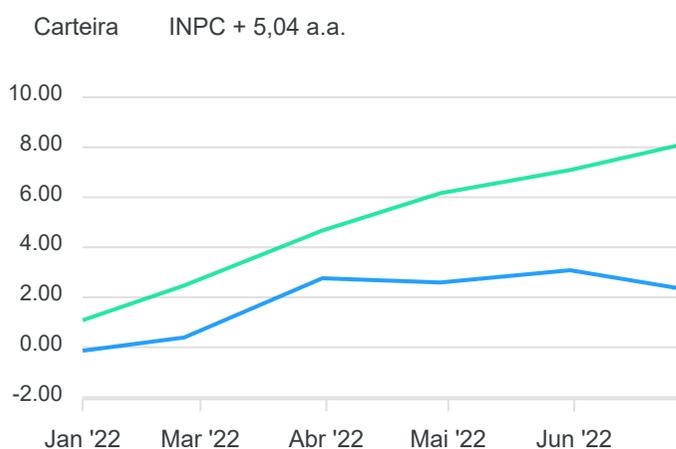
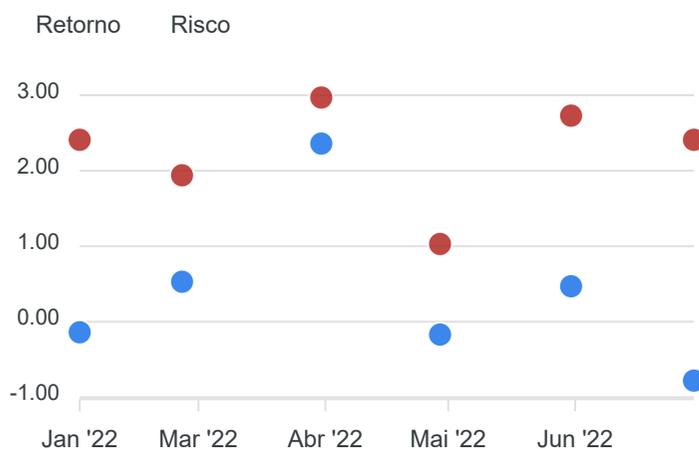


CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	67.311.431,78
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	15.757.366,43
ITAU UNIBANCO S.A.	11.271.066,73
FINAXIS CORRETORA DE TITULOS E...	242.274,83
BRL TRUST DISTRIBUIDORA DE TIT...	201.894,67
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	103.218,35
GENIAL INVESTIMENTOS CORRETORA...	454,16

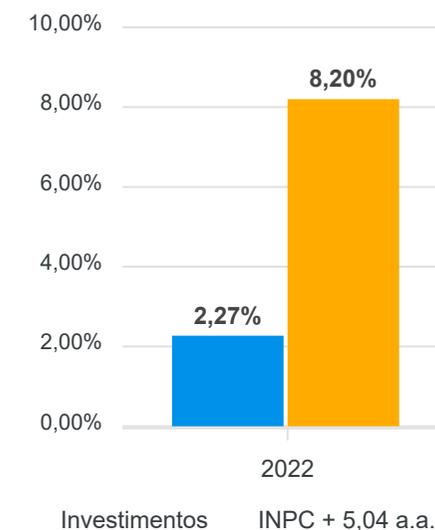
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	98.864.498,91	632.000,00	0,00	99.357.886,86	-138.612,05	-0,14% ▼	1,08%	2,41%
Fevereiro	99.357.886,86	2.373,12	0,00	99.891.458,12	531.198,14	0,53% ▲	1,38%	1,94%
Março	99.891.458,12	625.326,78	502.000,00	102.373.551,60	2.358.766,70	2,36% ▲	2,15%	2,97%
Abril	102.373.551,60	637.308,69	1.117.000,00	101.722.527,37	-171.332,92	-0,17% ▼	1,42%	1,03%
Mai	101.722.527,37	663.493,00	566.000,00	102.302.909,38	482.889,01	0,47% ▲	0,88%	2,73%
Junho	102.302.909,38	2.965.493,91	9.683.000,00	94.784.488,60	-800.914,69	-0,78% ▼	1,03%	2,41%

Retorno Acumulado			
Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	2.751.352,79	2,76%	4,67%
2º Trim	-489.358,60	-0,48%	3,37%
1º Sem	2.261.994,19	2,27%	8,20%

Acumulado 2.261.994,19 2,27% ▲ 8,20%



Retorno e Meta Acumulado



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.398.091,76	0,00	0,00	3.407.134,29	9.042,53	0,27% ▲	1,38%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.971.003,25	0,00	0,00	1.977.264,92	6.261,67	0,32% ▲	1,26%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.868.460,16	0,00	0,00	7.836.494,87	-31.965,29	-0,41% ▼	2,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	382.602,75	0,00	0,00	386.115,47	3.512,72	0,92% ▲	0,17%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.136.206,44	0,00	2.000.000,00	150.527,83	14.321,39	0,67% ▲	1,76%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	315.027,07	326,78	0,00	318.114,09	2.760,24	0,88% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.690.056,99	965.167,13	683.000,00	4.013.818,90	41.594,78	0,89% ▲	0,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.566.742,87	0,00	0,00	6.588.648,15	21.905,28	0,33% ▲	1,23%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.702.135,64	0,00	0,00	18.496.442,00	-205.693,64	-1,10% ▼	3,18%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.467.004,32	0,00	0,00	4.450.101,18	-16.903,14	-0,38% ▼	2,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	194.856,12	0,00	0,00	196.629,26	1.773,14	0,91% ▲	0,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.392.571,87	0,00	7.000.000,00	10.410.833,46	18.261,59	0,10% ▲	2,55%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.755.529,75	0,00	0,00	9.789.108,47	33.578,72	0,34% ▲	1,76%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	8.408.010,39	0,00	0,00	8.377.991,98	-30.018,41	-0,36% ▼	2,06%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	201.041,94	0,00	0,00	201.894,67	852,73	0,42% ▲	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	116.780,49	0,00	0,00	118.059,63	1.279,14	1,10% ▲	0,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.604.498,60	0,00	0,00	4.586.965,32	-17.533,28	-0,38% ▼	2,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.688.944,30	0,00	0,00	1.704.623,52	15.679,22	0,93% ▲	0,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA	4.844.451,11	0,00	0,00	4.861.418,26	16.967,15	0,35% ▲	1,75%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	463,21	0,00	0,00	454,16	-9,05	-1,95% ▼	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	243.722,22	0,00	0,00	242.274,83	-1.447,39	-0,59% ▼	0,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.000.000,00	0,00	1.999.829,05	-170,95	-0,01% ▼	1,37%
	96.948.201,25	2.965.493,91	9.683.000,00	90.114.744,31	-115.950,85	-0,12%	2,02%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	5.354.708,13	0,00	0,00	4.669.744,29	-684.963,84	-12,79% ▼	9,95%
-	5.354.708,13	0,00	0,00	4.669.744,29	-684.963,84	-12,79%	9,95%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.322.654,79	0,00	0,00	3.407.134,29	84.479,50	2,54% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.926.517,48	0,00	0,00	1.977.264,92	50.747,44	2,63% ▲
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.731.000,09	0,00	0,00	7.836.494,87	105.494,78	1,36% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	376.474,83	0,00	0,00	386.115,47	9.640,64	2,56% ▲
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.126.171,87	0,00	2.000.000,00	150.527,83	24.355,96	1,15% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.000.000,00	0,00	1.999.829,05	-170,95	-0,01% ▼
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	309.387,66	980,34	0,00	318.114,09	7.746,09	2,50% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.999.537,59	2.265.315,26	2.366.000,00	4.013.818,90	114.966,05	1,84% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.418.339,00	0,00	0,00	6.588.648,15	170.309,15	2,65% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.483.543,63	0,00	0,00	18.496.442,00	12.898,37	0,07% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.389.093,12	0,00	0,00	4.450.101,18	61.008,06	1,39% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	191.677,52	0,00	0,00	196.629,26	4.951,74	2,58% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.419.630,76	0,00	7.000.000,00	10.410.833,46	-8.797,30	-0,05% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.715.157,91	0,00	0,00	9.789.108,47	73.950,56	0,76% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	8.262.605,35	0,00	0,00	8.377.991,98	115.386,63	1,40% ▲
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	202.359,50	0,00	0,00	201.894,67	-464,83	-0,23% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	114.553,22	0,00	0,00	118.059,63	3.506,41	3,06% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.524.948,86	0,00	0,00	4.586.965,32	62.016,46	1,37% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.661.224,92	0,00	0,00	1.704.623,52	43.398,60	2,61% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA	4.825.232,52	0,00	0,00	4.861.418,26	36.185,74	0,75% ▲
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.238,77	0,00	0,00	454,16	-1.784,61	-79,71% ▼
PREMIUM FIDC SÊNIOR	591.120,99	0,00	0,00	242.274,83	-348.846,16	-59,01% ▼
	96.593.470,38	4.266.295,60	11.366.000,00	90.114.744,31	620.978,33	0,64%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	5.780.081,22	0,00	0,00	4.669.744,29	-1.110.336,93	-19,21% ▼
	5.780.081,22	0,00	0,00	4.669.744,29	-1.110.336,93	-19,21%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.200.487,36	0,00	0,00	3.407.134,29	206.646,93	6,46% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.837.074,07	20.000,00	0,00	1.977.264,92	120.190,85	6,47% ▲
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.516.359,41	0,00	0,00	7.836.494,87	320.135,46	4,26% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	368.245,68	0,00	0,00	386.115,47	17.869,79	4,85% ▲
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.099.135,87	0,00	2.000.000,00	150.527,83	51.391,96	2,45% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.000.000,00	0,00	1.999.829,05	-170,95	-0,01% ▼
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	300.519,36	3.680,24	0,00	318.114,09	13.914,49	4,57% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.170.428,40	3.502.315,26	2.868.000,00	4.013.818,90	209.075,24	3,13% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.185.866,00	0,00	0,00	6.588.648,15	402.782,15	6,51% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.143.163,22	0,00	0,00	18.496.442,00	353.278,78	1,95% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.268.637,74	0,00	0,00	4.450.101,18	181.463,44	4,25% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	187.522,81	0,00	0,00	196.629,26	9.106,45	4,86% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.293.661,62	0,00	7.000.000,00	10.410.833,46	117.171,84	0,68% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.583.222,47	0,00	0,00	9.789.108,47	205.886,00	2,15% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	8.039.770,27	0,00	0,00	8.377.991,98	338.221,71	4,21% ▲
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	157.275,86	0,00	0,00	201.894,67	44.618,81	28,37% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	111.488,52	0,00	0,00	118.059,63	6.571,11	5,89% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.400.647,79	0,00	0,00	4.586.965,32	186.317,53	4,23% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.624.605,11	0,00	0,00	1.704.623,52	80.018,41	4,93% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M FIC RENDA FIXA	4.763.462,63	0,00	0,00	4.861.418,26	97.955,63	2,06% ▲
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.228,11	0,00	0,00	454,16	-1.773,95	-79,62% ▼
PREMIUM FIDC SÊNIOR	592.285,73	0,00	0,00	242.274,83	-350.010,90	-59,09% ▼
	93.846.088,03	5.525.995,50	11.868.000,00	90.114.744,31	2.610.660,78	2,78%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	5.018.410,88	0,00	0,00	4.669.744,29	-348.666,59	-6,95% ▼
	5.018.410,88	0,00	0,00	4.669.744,29	-348.666,59	-6,95%

Cenário Econômico

O primeiro semestre de 2022, foi muito desafiador para os gestores de recursos. Apesar de estar em momentos distintos, tanto o Brasil quanto as principais economias globais enfrentaram um cenário muito difícil e de alta volatilidade.

Iniciando pelo Brasil, podemos destacar dois momentos. O primeiro em que o cenário contava com perspectivas de baixo crescimento, bem próximas de zero, desemprego em patamares mais elevados e inflação anual na casa de dois dígitos. Já em um segundo momento os dados apurados se mostraram melhores que as previsões e as revisões para projeções econômicas passaram a apresentar melhor resultado para o PIB ao final de 2022. Os dados de desemprego vieram também melhores que o esperado, fechando em 9,8% no semestre, melhor resultado desde 2016 e redução das projeções da inflação para o segundo semestre, motivadas pela aprovação da PEC do teto do ICMS, que reduziu sensivelmente os preços dos combustíveis, energia e telefonia nos estados onde já foram implantadas. Some-se a isso, o benefício de ter iniciado a elevação da taxa básica de juros da economia ainda em 2021. Mas ainda persiste no mercado uma desconfiança com relação a parte fiscal, adicionando aí outro fator, que seria a aprovação da PEC das bondades, um pacote de benefícios à população vulnerável, que tem trazido para o mercado, uma série de dúvidas com relação aos gastos do governo e principalmente o respeito ao limite do teto de gastos.

Nos EUA, a grande injeção de capital realizada pelo FED, banco central americano, acabou evitando uma queda forte da economia americana durante o pico da pandemia do COVID, e provocou rapidamente a retomada da economia.

Com desemprego extremamente baixo e forte crescimento, mas com desestruturação da cadeia de produção ao redor do mundo, os gargalos produtivos se formaram e trouxeram aos EUA, um fenômeno inflacionário muito forte, fechando o primeiro semestre em 8,6% no acumulado de 12 meses, níveis mais elevados dos últimos 40 anos. Em um primeiro momento o FED, tratou a inflação com um fenômeno pontual, mas com o passar dos meses, acabou identificando como algo disseminado e persistente, sendo necessário uma intervenção mais forte por parte do FED, que viu a necessidade da elevação da taxa básica de juros em um ritmo mais forte que o esperado pelo mercado. A força em que o FED precisou agir, trouxe certas dúvidas ao mercado com relação a possível recessão na economia americana, afetando principalmente as economias em desenvolvimento.

Já na zona do EURO, a inflação que no acumulado de 12 meses ficou em 8,1%, também se fez muito presente, destacamos alguns fatores predominantes. O primeiro ponto é com relação ao conflito em solo europeu entre Rússia e Ucrânia, que provocou uma crise energética e uma forte elevação dos preços. O segundo ponto é a forte recuperação da economia europeia no primeiro semestre de 2022 e por fim a questão dos gargalos nas indústrias provocados pela escassez de matéria prima. Como este fenômeno tem se mostrado resiliente, o Banco Central europeu já deixou claro que iniciará o processo de elevação da taxa básica de juros no segundo semestre, e que fará o necessário para trazer a inflação para o centro da meta que é de 2%.

E por fim, a economia chinesa, que não sofreu muito durante o pico da pandemia, mas que por conta da política do governo chinês, de manter os casos de Covid muito próximo de zero, tem provocado rígidos lockdowns dificultando o escoamento da produção e aumentando os gargalos produtivos nas principais economias globais. Mesmo diante desses fatores a economia chinesa segue em expansão, com perspectiva de crescimento ao redor de 5% em 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, voltou a ser impactada de forma contundente pela conjuntura econômica incerta, e a persistência do processo inflacionário ascendente, mantendo as taxas de juros reais negativas, e pressionando os mercados de Bolsa e Ativos Reais gerando alavancagem demasiada e distorcida de preços, e fazendo com que os riscos da carteira permaneçam sensíveis.

Análise dos Fundos de Investimento presentes na Carteira de Investimentos

A carteira na parcela referente a fundos de investimentos, como se pode ver nas lâminas individuais de cada fundo, 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, 12 de julho de 2022.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+1
Quantidade de Cotistas 1.077
Patrimônio Líquido Fundo 9.717.321.383,29

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Indicador de Desempenho (CVM) Não definido
Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados
Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

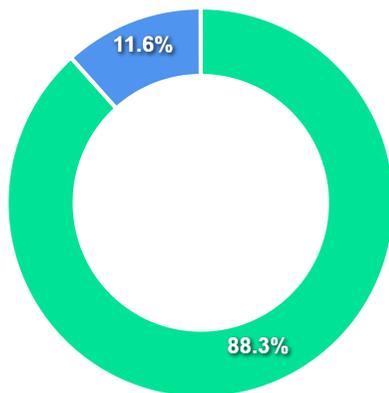
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,27%	6,46%	2,54%	6,46%	9,84%	16,85%	1,38%	2,90%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	8.405.814,94	88.34%
Operação compromissada	1.107.092,81	11.64%
Outros	1.910,95	0.02%
Valores a pagar/receber	359,17	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	5.197.279,95	54,62	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	2.370.430,91	24,91	Títulos Federa...	05/08/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2025	1.107.092,81	11,64	Operação compr...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	838.104,08	8,81	Títulos Federa...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	1.055,76	0,01	Outros	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	442,44	0,00	Outros	05/08/2022
Outras Disponibilidades	423,12	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	375,60	0,00	Outros	05/08/2022
Outros Valores a receber	38,68	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	37,15	0,00	Outros	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,73	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	21,56	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Auditoria	2,88	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	0,34	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	0,08	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-75,42	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-79,80	0,00	Valores a paga...	05/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
820

Patrimônio Líquido Fundo
6.996.220.208,06

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IMA-B 5

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

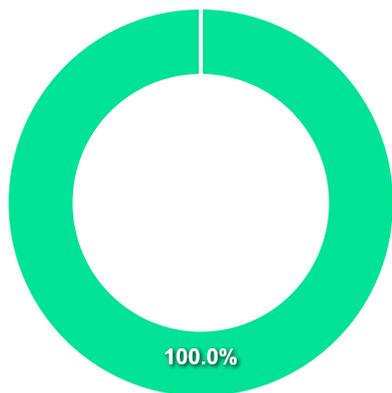
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,32%	6,47%	2,63%	6,47%	9,74%	16,08%	1,26%	2,65%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB TOP IMA-B 5 FI RENDA FIXA LP	6.564.909,20	100,00	Fundos de Inve...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,80	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	5,46	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa Anbid	2,18	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Outros Valores a pagar	0,15	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-52,10	0,00	Valores a paga...	03/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	6.564.909,20	100.00%
Valores a pagar/receber	-16,47	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,10%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
1.068

Patrimônio Líquido Fundo
5.103.254.867,87

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IRF-M 1

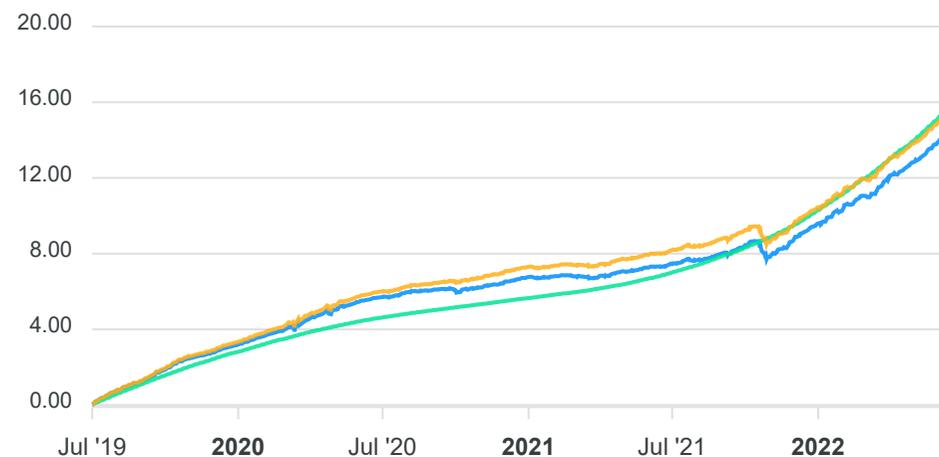
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

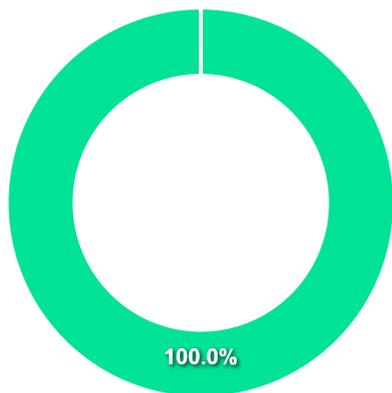
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,92%	4,85%	2,56%	4,85%	6,92%	8,69%	0,17%	0,36%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA	4.977.720,49	100,00	Fundos de Inve...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	19,75	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	3,26	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa Anbid	1,09	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,11	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-27,72	0,00	Valores a paga...	03/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	4.977.720,49	100.00%
Valores a pagar/receber	-3,52	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
453

Patrimônio Líquido Fundo
3.520.668.596,00

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IRF-M

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

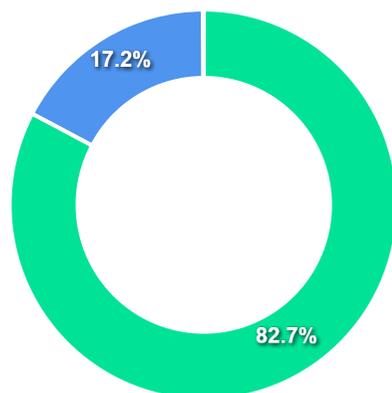
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,34%	2,11%	0,81%	2,11%	1,51%	1,42%	1,76%	3,71%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,37%	2,19%	0,83%	2,19%	1,76%	1,90%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	2.348.095,04	82.74%
Operação compromissada	487.442,99	17.18%
Derivativos	1.941,14	0.07%
Valores a pagar/receber	448,17	0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/202...	487.442,99	17,18	Operação compr...	05/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	388.428,88	13,69	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc: 01/01/2024	358.266,31	12,62	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2023	335.852,65	11,83	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	286.037,46	10,08	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2027	216.293,27	7,62	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2029	117.148,04	4,13	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc: 01/10/2022	83.079,79	2,93	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc: 01/07/2025	74.140,59	2,61	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2024	59.716,65	2,10	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc: 01/03/2025	59.667,49	2,10	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	59.603,85	2,10	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc: 01/03/2026	59.527,83	2,10	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2026	59.482,62	2,10	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/01/2023	56.793,86	2,00	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc: 01/04/2024	27.916,10	0,98	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-F - Venc: 01/01/2031	26.010,66	0,92	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc: 01/01/2025	22.427,92	0,79	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-F - Venc: 01/01/2033	14.978,73	0,53	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/01/2026	13.260,57	0,47	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc: 01/04/2023	12.217,57	0,43	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	9.445,56	0,33	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2024	3.957,49	0,14	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/10/2024	3.841,14	0,14	Títulos Federa...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	464,50	0,02	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	438,70	0,02	Derivativos	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF31	417,15	0,01	Derivativos	05/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,15%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
241

Patrimônio Líquido Fundo
2.872.769.394,76

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IPCA

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

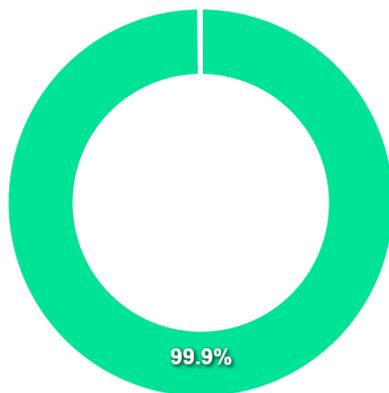
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,33%	7,12%	3,08%	7,12%	10,31%	16,86%	1,37%	2,89%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc: 15/05/2023	3.063.886,40	99,87	Títulos Federa...	05/08/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2025	4.060,87	0,13	Operação compr...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	88,04	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a receber	34,38	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	13,91	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	5,82	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	2,21	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Auditoria	1,44	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-18,22	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-24,51	0,00	Valores a paga...	05/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.063.886,40	99.86%
Operação compromissada	4.060,87	0.13%
Valores a pagar/receber	103,06	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,80%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
317

Patrimônio Líquido Fundo
794.285.280,96

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

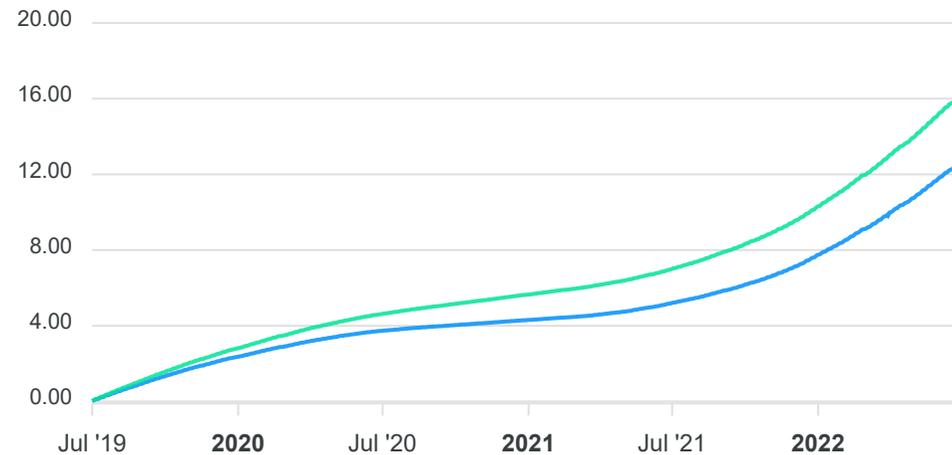
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

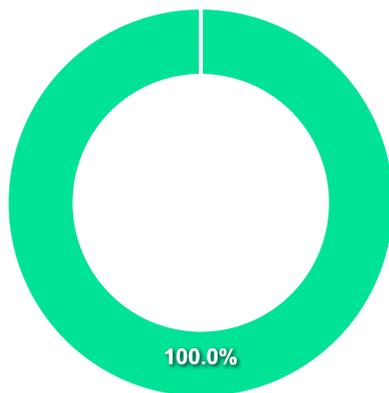
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,88%	4,59%	2,50%	4,59%	7,12%	8,63%	0,01%	0,02%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de CAIXA MASTER LIQUIDEZ FI RENDA FIXA CURTO...	757.024,63	100,02	Fundos de Inve...	05/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	21,37	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	1,73	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	1,29	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Ajustes Quantidades Patrimônio D...	0,00	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-4,05	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-12,05	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-21,60	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	-122,42	-0,02	Valores a paga...	05/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	757.024,63	100.02%
Valores a pagar/receber	-135,75	-0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
1.024

Patrimônio Líquido Fundo
11.084.704.335,99

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IMA-B 5

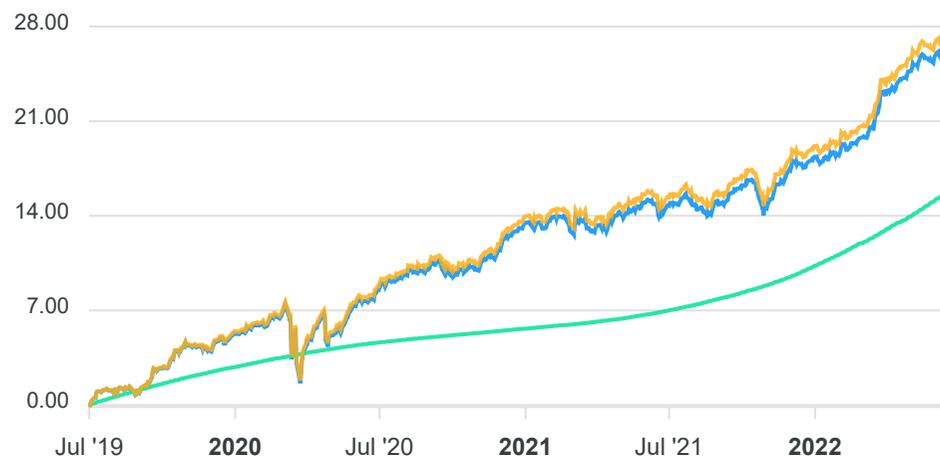
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

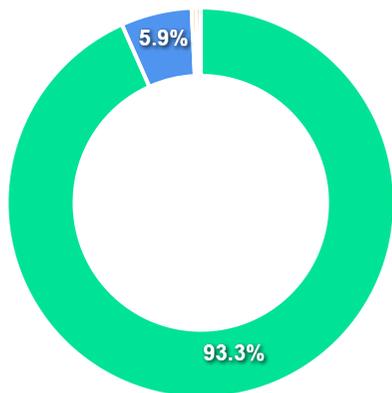
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,33%	6,51%	2,65%	6,51%	9,84%	16,18%	1,23%	2,59%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	9.804.998,56	93.34%
Operação compromissada	620.114,96	5.90%
Valores a pagar/receber	40.271,00	0.38%
Outros	39.012,64	0.37%
Derivativos	408,70	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	2.575.573,73	24,70	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	2.040.519,57	19,57	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.719.098,89	16,49	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	1.653.290,80	15,86	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	1.383.161,34	13,27	Títulos Federa...	09/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2023	620.114,96	5,95	Operação compr...	09/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	408.316,92	3,92	Títulos Federa...	09/08/2022
Outros Valores a receber	39.015,06	0,37	Valores a paga...	09/08/2022
Vendas a termo a receber / RENDA FIXA TERMO	39.012,64	0,37	Outros	09/08/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	11.960,63	0,11	Títulos Federa...	09/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2026	11.896,52	0,11	Títulos Federa...	09/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	1.180,16	0,01	Títulos Federa...	09/08/2022
Outras Disponibilidades	1.135,11	0,01	Valores a paga...	09/08/2022
Outros Valores a receber	408,70	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	368,88	0,00	Derivativos	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	44,75	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	39,82	0,00	Derivativos	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,72	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	25,56	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	24,04	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,84	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Permanência	0,04	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a pagar / Ajustes Quantidades Patrimônio D...	0,00	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-62,22	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Outros Valores a pagar	-352,60	0,00	Valores a paga...	09/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
272

Patrimônio Líquido Fundo
1.212.673.784,01

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IMA-B 5+

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

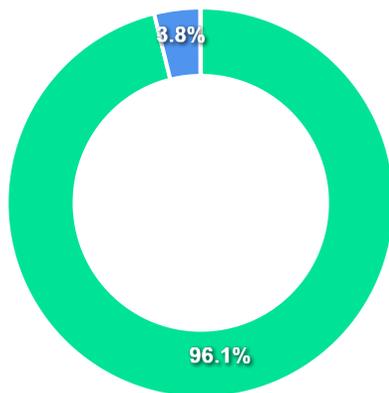
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,10%	1,95%	0,07%	1,95%	-2,61%	5,50%	3,18%	6,70%
Indicador de Desempenho (CVM)	-1,10%	2,03%	0,12%	2,03%	-2,16%	6,18%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.111.518,24	96.12%
Operação compromissada	44.266,38	3.83%
Valores a pagar/receber	373,16	0.03%
Derivativos	174,73	0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	247.478,13	21,41	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	166.562,59	14,41	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	164.256,42	14,21	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	159.839,03	13,83	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	148.139,48	12,81	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	117.686,72	10,18	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	66.065,83	5,71	Títulos Federa...	08/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	44.266,38	3,83	Operação compr...	08/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	25.033,62	2,17	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc: 15/08/2032	11.562,25	1,00	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc: 15/08/2060	4.894,16	0,42	Títulos Federa...	08/08/2022
Outras Disponibilidades	221,44	0,02	Valores a paga...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ28	174,73	0,02	Derivativos	08/08/2022
Outros Valores a receber	174,73	0,02	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	24,04	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	4,90	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,46	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	3,42	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Permanência	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Ajustes Quantidades Patrimônio D...	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-6,90	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-13,86	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a pagar	-39,07	0,00	Valores a paga...	08/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
798

Patrimônio Líquido Fundo
4.111.516.095,57

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento

Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

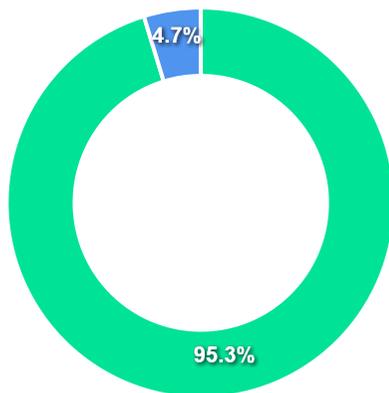
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,38%	4,25%	1,39%	4,25%	3,52%	10,96%	2,05%	4,32%
Indicador de Desempenho (CVM)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.701.011,09	95.26%
Operação compromissada	183.725,71	4.73%
Valores a pagar/receber	384,76	0.01%
Derivativos	65,61	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	486.347,59	12,52	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	403.068,14	10,37	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	354.957,98	9,14	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	342.818,34	8,82	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	283.142,91	7,29	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	275.554,42	7,09	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	270.294,36	6,96	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	267.614,52	6,89	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	260.908,78	6,72	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	241.142,42	6,21	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	207.363,07	5,34	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	186.515,16	4,80	Títulos Federa...	08/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	183.725,71	4,73	Operação compr...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	81.364,78	2,09	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	20.792,56	0,54	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2022	11.961,60	0,31	Títulos Federa...	08/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	5.996,24	0,15	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	1.168,24	0,03	Títulos Federa...	08/08/2022
Outras Disponibilidades	437,26	0,01	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a receber	65,61	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	52,70	0,00	Derivativos	08/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	24,04	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	16,51	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	12,91	0,00	Derivativos	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	11,73	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,84	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Permanência	0,01	0,00	Valores a paga...	08/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
1.175

Patrimônio Líquido Fundo
5.096.804.349,76

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IRF-M 1

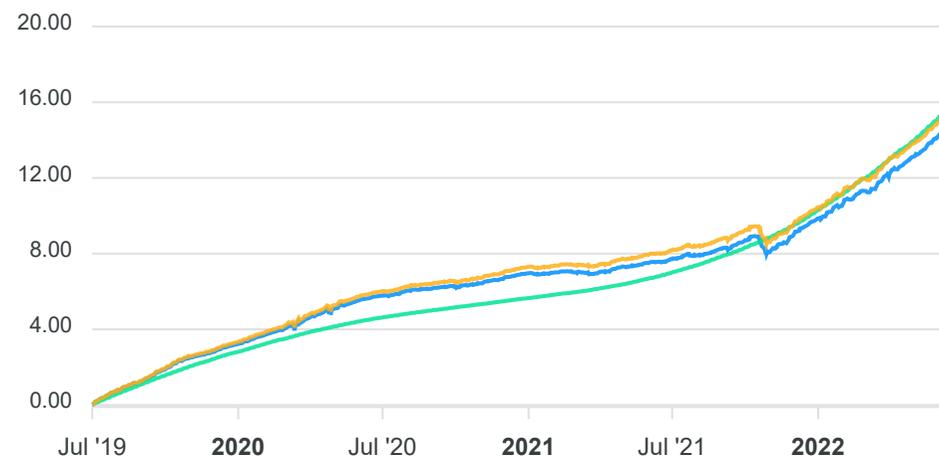
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

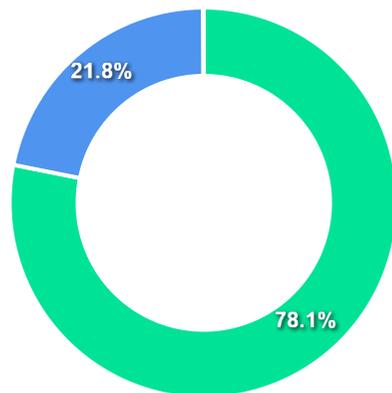
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,91%	4,86%	2,58%	4,86%	6,94%	8,89%	0,17%	0,35%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.957.547,23	78.12%
Operação compromissada	1.104.493,40	21.80%
Valores a pagar/receber	3.277,16	0.06%
Derivativos	625,97	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	1.523.075,72	30,07	Títulos Federa...	08/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2023	1.104.493,40	21,81	Operação compr...	08/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2023	986.689,16	19,48	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc: 01/10/2022	693.765,14	13,70	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc.: 01/01/2023	412.702,06	8,15	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2022	260.726,93	5,15	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	44.254,32	0,87	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc: 01/04/2023	36.333,89	0,72	Títulos Federa...	08/08/2022
Outras Disponibilidades	2.822,36	0,06	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a receber	625,41	0,01	Valores a paga...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	488,32	0,01	Derivativos	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF23	96,70	0,00	Derivativos	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ23	35,46	0,00	Derivativos	08/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	24,04	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	21,81	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	14,91	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV22	5,49	0,00	Derivativos	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,84	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Permanência	0,12	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Ajustes Quantidades Patrimônio D...	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN22	0,00	0,00	Derivativos	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-27,72	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-31,29	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a pagar	-177,32	0,00	Valores a paga...	08/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
206

Patrimônio Líquido Fundo
1.835.852.466,18

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IRF-M 1+

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento

Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

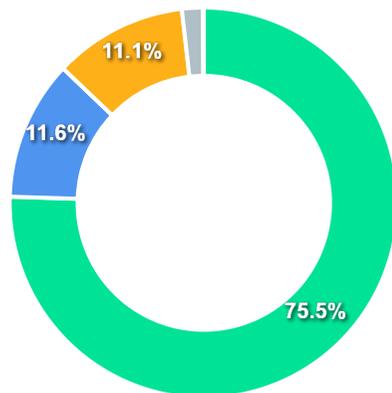
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,04%	0,62%	-0,11%	0,62%	-1,34%	-2,63%	2,55%	5,38%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,09%	0,73%	-0,06%	0,73%	-1,02%	-2,10%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	739.729,64	75.50%
Valores a pagar/receber	113.529,98	11.59%
Outros	108.675,88	11.09%
Operação compromissada	16.883,96	1.72%
Derivativos	892,31	0.09%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
LTN - Venc: 01/01/2024	137.496,42	18,06	Títulos Federa...	09/08/2022
Outros Valores a receber	108.678,26	14,27	Valores a paga...	09/08/2022
Vendas a termo a receber / RENDA FIXA TERMO	108.675,88	14,27	Outros	09/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2027	101.320,59	13,31	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	99.835,68	13,11	Títulos Federa...	09/08/2022
LTN - Venc: 01/07/2025	83.319,90	10,94	Títulos Federa...	09/08/2022
LTN - Venc: 01/01/2025	69.152,75	9,08	Títulos Federa...	09/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2024	68.464,65	8,99	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2029	62.111,57	8,16	Títulos Federa...	09/08/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	53.822,83	7,07	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-F - Venc: 01/01/2031	33.640,46	4,42	Títulos Federa...	09/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2022	26.315,51	3,46	Títulos Federa...	09/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/04/2023	16.883,96	2,22	Operação compr...	09/08/2022
NTN-F - Venc: 01/01/2033	4.249,29	0,56	Títulos Federa...	09/08/2022
Outras Disponibilidades	4.013,22	0,53	Valores a paga...	09/08/2022
Outros Valores a receber	887,84	0,12	Valores a paga...	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF24	279,44	0,04	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ24	170,19	0,02	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF29	91,58	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF27	87,57	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	74,25	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF31	60,40	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	54,14	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF33	38,42	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN25	36,33	0,00	Derivativos	09/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	21,37	0,00	Valores a paga...	09/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	2,38	0,00	Valores a paga...	09/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
249

Patrimônio Líquido Fundo
664.050.646,23

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IRF-M

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento

Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

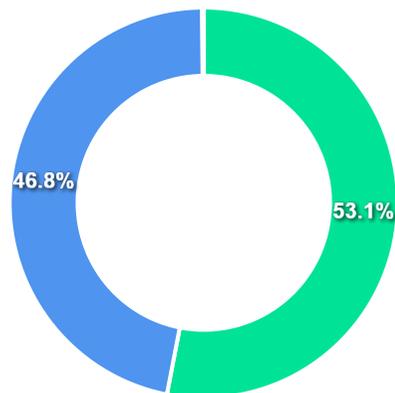
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,34%	2,15%	0,76%	2,15%	1,63%	1,54%	1,76%	3,70%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,37%	2,19%	0,83%	2,19%	1,76%	1,90%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	880.106,89	53.05%
Operação compromissada	776.196,51	46.79%
Valores a pagar/receber	1.358,16	0.08%
Derivativos	1.316,84	0.08%
Outros	-2,38	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2023	776.196,51	46,83	Operação compr...	09/08/2022
LTN - Venc: 01/01/2024	150.455,95	9,08	Títulos Federa...	09/08/2022
LFT - Venc: 01/03/2024	147.614,92	8,91	Títulos Federa...	09/08/2022
Compras a termo a receber / RENDA FIXA TERMO	108.675,88	6,56	Outros	09/08/2022
LFT - Venc: 01/03/2026	87.505,92	5,28	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	78.825,57	4,76	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2027	73.825,05	4,45	Títulos Federa...	09/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2023	58.772,39	3,55	Títulos Federa...	09/08/2022
LTN - Venc: 01/07/2025	52.957,56	3,19	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2029	50.417,32	3,04	Títulos Federa...	09/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2024	45.511,19	2,75	Títulos Federa...	09/08/2022
LTN - Venc: 01/01/2025	39.248,86	2,37	Títulos Federa...	09/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	35.869,22	2,16	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	27.802,57	1,68	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-F - Venc: 01/01/2031	27.051,09	1,63	Títulos Federa...	09/08/2022
NTN-F - Venc: 01/01/2033	4.249,29	0,26	Títulos Federa...	09/08/2022
Outros Valores a receber	1.315,87	0,08	Valores a paga...	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF24	200,22	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	182,29	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF27	165,10	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ24	154,45	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF29	126,51	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN25	123,52	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	97,54	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	96,53	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF31	85,48	0,01	Derivativos	09/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF23	48,12	0,00	Derivativos	09/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
0,18%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
40

Patrimônio Líquido Fundo
236.289.379,07

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IMA Geral

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento

Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

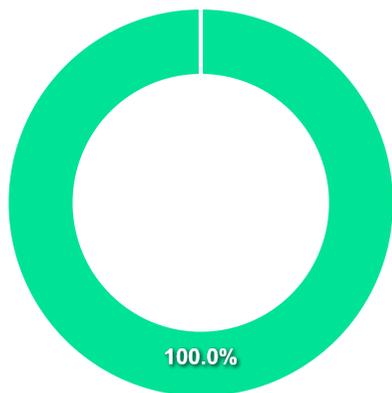
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,38%	4,23%	1,37%	4,23%	3,56%	10,93%	2,04%	4,29%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,43%	4,49%	1,90%	4,49%	5,34%	9,08%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ IMA-B FI RENDA FIXA	232.209,52	99,78	Fundos de Inve...	05/08/2022
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	472,10	0,20	Fundos de Inve...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	70,00	0,03	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a receber	10,10	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	-41,47	-0,02	Valores a paga...	05/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	232.681,63	99.98%
Valores a pagar/receber	38,63	0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
0,18%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
59

Patrimônio Líquido Fundo
142.319.131,43

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IRF-M

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

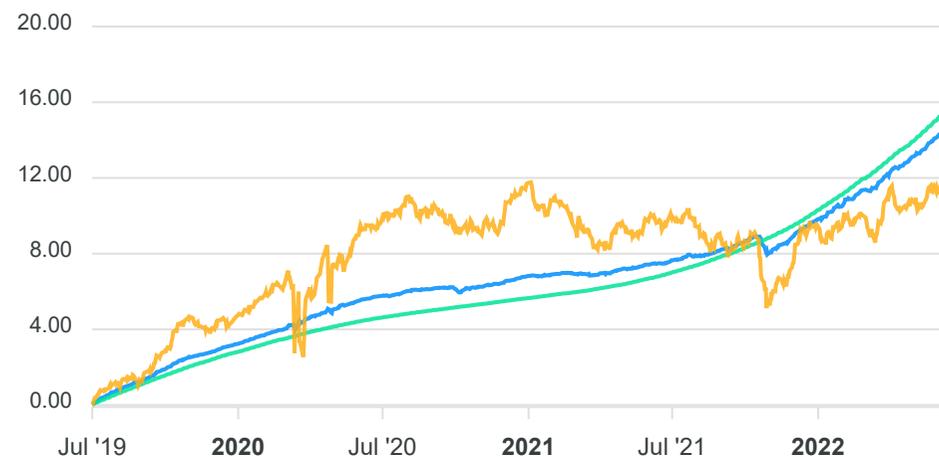
Política de Investimento

Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

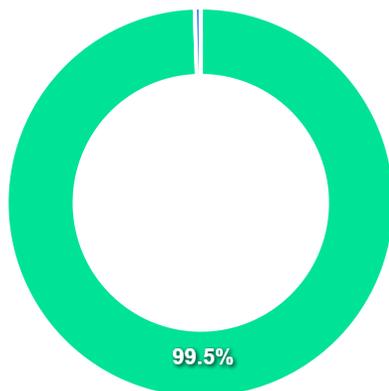
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,93%	4,93%	2,61%	4,93%	7,03%	8,93%	0,17%	0,35%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,37%	2,19%	0,83%	2,19%	1,76%	1,90%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
LTN - Venc.: 01/07/2023	45.737,62	32,05	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/01/2023	34.076,32	23,88	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	28.789,35	20,17	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/10/2022	17.593,37	12,33	Títulos Federa...	05/08/2022
LFT - Venc.: 01/03/2028	12.656,41	8,87	Títulos Federa...	05/08/2022
LTN - Venc.: 01/04/2023	2.748,40	1,93	Títulos Federa...	05/08/2022
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/202...	719,89	0,50	Operação compr...	05/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	418,47	0,29	Títulos Federa...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	50,98	0,04	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a receber	6,74	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1	1,33	0,00	Derivativos	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1	-0,40	0,00	Derivativos	05/08/2022
Outros Valores a pagar	-78,66	-0,06	Valores a paga...	05/08/2022

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	142.019,94	99.51%
Operação compromissada	719,89	0.50%
Derivativos	0,93	0.00%
Valores a pagar/receber	-20,94	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
0,18%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
42

Patrimônio Líquido Fundo
65.755.285,95

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IRF-M

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento

Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

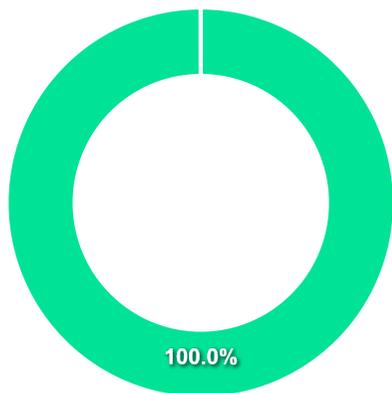
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,35%	2,06%	0,75%	2,06%	1,50%	1,43%	1,75%	3,69%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,37%	2,19%	0,83%	2,19%	1,76%	1,90%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ PRÉ FI RENDA FIXA LP	67.693,66	99,77	Fundos de Inve...	05/08/2022
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	133,40	0,20	Fundos de Inve...	05/08/2022
Outras Disponibilidades	29,54	0,04	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a receber	4,21	0,01	Valores a paga...	05/08/2022
Outros Valores a pagar	-14,13	-0,02	Valores a paga...	05/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	67.827,06	99.97%
Valores a pagar/receber	19,63	0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,30%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
228

Patrimônio Líquido Fundo
786.311.506,32

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

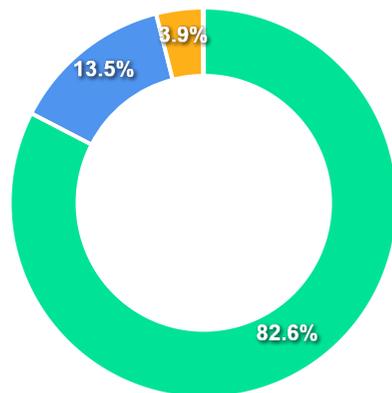
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,41%	4,26%	1,36%	4,26%	3,58%	10,95%	2,09%	4,39%
Indicador de Desempenho (CVM)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	633.392,58	82.58%
Operação compromissada	103.224,66	13.46%
Debêntures	29.621,68	3.86%
Valores a pagar/receber	507,59	0.07%
Outros	216,22	0.03%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2025	103.224,66	13,46	Operação compr...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	74.850,92	9,76	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	66.315,71	8,65	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	61.854,94	8,06	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	55.975,01	7,30	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	52.362,97	6,83	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	51.128,34	6,67	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	49.672,60	6,48	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	49.085,32	6,40	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	45.746,50	5,96	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	42.255,00	5,51	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	35.282,75	4,60	Títulos Federa...	05/08/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	34.698,27	4,52	Títulos Federa...	05/08/2022
Debênture Simples - TAEE33	13.715,93	1,79	Debêntures	05/08/2022
NTN-B - Venc: 15/05/2027	8.070,30	1,05	Títulos Federa...	05/08/2022
Debênture simples - ERDV17	6.415,43	0,84	Debêntures	05/08/2022
NTN-B - Venc: 15/08/2032	6.093,95	0,79	Títulos Federa...	05/08/2022
Debênture simples - PETR45	5.909,88	0,77	Debêntures	05/08/2022
Debênture Simples - CCRDD1	2.571,31	0,34	Debêntures	05/08/2022
Debêntures - MOVIDA PARTICIPAÇÕES S.A. (21.314.559...	1.009,14	0,13	Debêntures	05/08/2022
Outras Disponibilidades	497,33	0,06	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	83,85	0,01	Outros	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	58,66	0,01	Outros	05/08/2022
Outros Valores a receber	34,38	0,00	Valores a paga...	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	29,54	0,00	Outros	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	17,47	0,00	Outros	05/08/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	14,68	0,00	Outros	05/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
948

Patrimônio Líquido Fundo
12.613.402.228,26

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
CDI

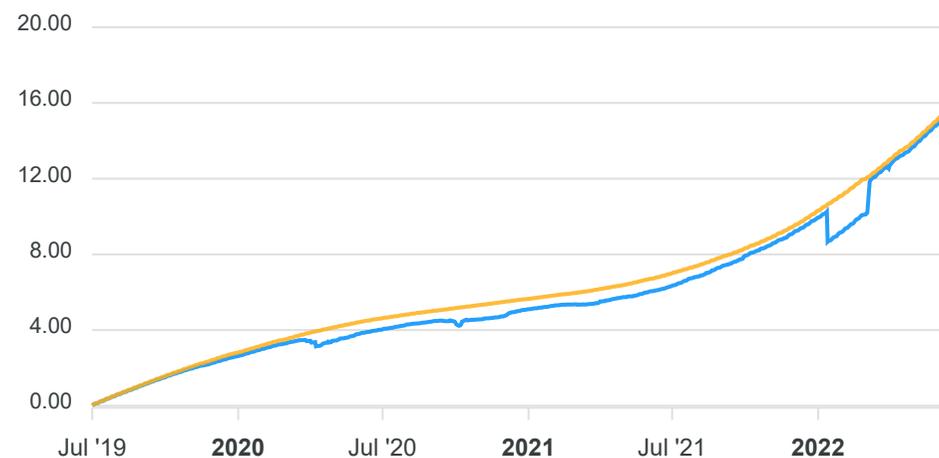
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

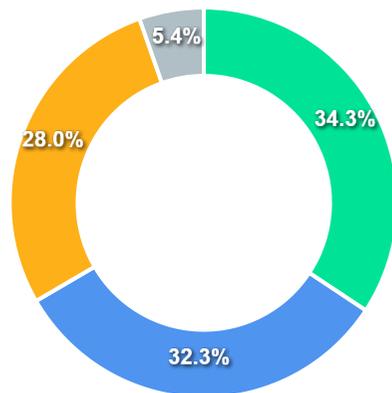
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,06%	5,60%	2,97%	5,60%	9,19%	11,59%	0,04%	0,09%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	4.442.753,56	34.29%
Títulos Privados	4.186.944,48	32.32%
Títulos Federais	3.627.899,43	28.00%
Debêntures	696.629,78	5.38%
Valores a pagar/receber	562,56	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/05/202...	4.442.753,56	34,29	Operação compr...	08/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	793.331,42	6,12	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	771.460,51	5,96	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc: 01/03/2024	749.668,67	5,79	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2027	617.513,49	4,77	Títulos Federa...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	409.073,12	3,16	Títulos Privad...	08/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2024	233.742,93	1,80	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc.: 01/03/2027	178.545,72	1,38	Títulos Federa...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90...	156.094,41	1,20	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/000...	155.360,19	1,20	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/000...	153.417,20	1,18	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. (...)	145.273,93	1,12	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90...	125.149,36	0,97	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.1...	124.603,46	0,96	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. (...)	110.564,46	0,85	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	109.586,38	0,85	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/000...	104.423,22	0,81	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	102.747,22	0,79	Títulos Privad...	08/08/2022
LFT - Venc.: 01/09/2022	94.496,62	0,73	Títulos Federa...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.1...	90.581,53	0,70	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.1...	84.910,20	0,66	Títulos Privad...	08/08/2022
CDB/ RDB - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-...	81.763,36	0,63	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/00...	73.469,34	0,57	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/000...	67.730,11	0,52	Títulos Privad...	08/08/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	67.590,77	0,52	Títulos Federa...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	67.428,03	0,52	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO S.A. (60.701.190/...	60.350,38	0,47	Títulos Privad...	08/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
262

Patrimônio Líquido Fundo
2.202.359.178,53

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

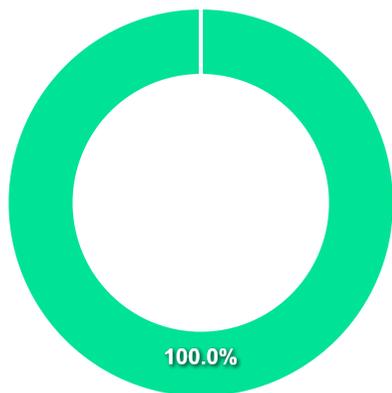
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,36%	4,21%	1,40%	4,21%	3,50%	10,92%	2,06%	4,34%
Indicador de Desempenho (CVM)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de CAIXA MASTER BRASIL FI RENDA FIXA REFEREN...	2.105.540,25	100,00	Fundos de Inve...	08/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	24,04	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	4,48	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,46	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Ajustes Quantidades Patrimônio D...	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-12,59	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-14,02	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a pagar	-71,34	0,00	Valores a paga...	08/08/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	2.105.540,25	100.00%
Valores a pagar/receber	-64,97	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
0,18%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
282

Patrimônio Líquido Fundo
2.406.329.548,15

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
CDI

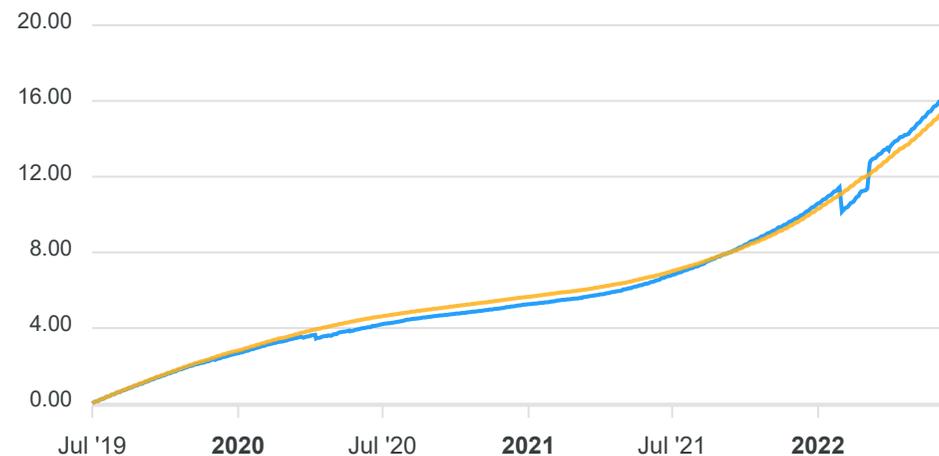
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

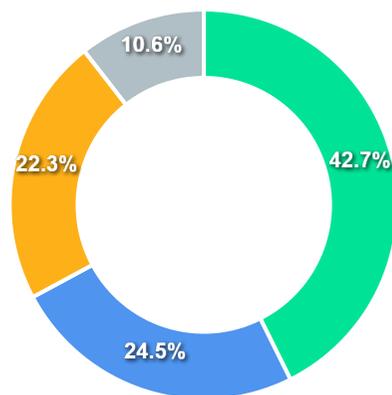
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,10%	5,89%	3,06%	5,89%	9,64%	12,36%	0,07%	0,14%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.176.079,18	42.65%
Títulos Privados	676.729,37	24.54%
Operação compromissada	614.635,74	22.29%
Debêntures	291.130,79	10.56%
Valores a pagar/receber	-372,18	-0.01%
Derivativos	-736,47	-0.03%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
LFT - Venc.: 01/09/2027	703.655,50	25,52	Títulos Federa...	08/08/2022
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/08/202...	312.354,59	11,33	Operação compr...	08/08/2022
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/202...	302.281,15	10,96	Operação compr...	08/08/2022
LFT - Venc: 01/03/2028	155.337,28	5,63	Títulos Federa...	08/08/2022
LFT - Venc.: 01/03/2027	119.105,70	4,32	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc: 01/07/2025	112.473,39	4,08	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc.: 01/07/2024	84.061,14	3,05	Títulos Federa...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	56.555,97	2,05	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	54.449,26	1,97	Títulos Privad...	08/08/2022
Debênture Simples - NTSD12	45.367,11	1,65	Debêntures	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	43.591,57	1,58	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/000...	38.675,77	1,40	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/000...	38.665,82	1,40	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/000...	38.642,01	1,40	Títulos Privad...	08/08/2022
Debêntures - TELEFÔNICA BRASIL S.A. (02.558.157/00...	30.656,70	1,11	Debêntures	08/08/2022
Debênture Simples - BSA313	29.981,85	1,09	Debêntures	08/08/2022
Debênture Simples - LORTA8	27.610,80	1,00	Debêntures	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	23.848,89	0,86	Títulos Privad...	08/08/2022
Debênture Simples - ELET22	19.418,68	0,70	Debêntures	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.1...	18.543,66	0,67	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.1...	18.342,40	0,67	Títulos Privad...	08/08/2022
CDB/ RDB - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-...	16.759,76	0,61	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/00...	13.283,41	0,48	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/00...	13.231,13	0,48	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	13.223,69	0,48	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	12.799,91	0,46	Títulos Privad...	08/08/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	11.598,82	0,42	Títulos Privad...	08/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BRL TRUST DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES
MOBILIARIOS S.A.

Gestão
VILA RICA CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração
0,39%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
Não se aplica

Quantidade de Cotistas
47

Patrimônio Líquido Fundo
46.966.294,28

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso V, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
CDI + 3,50% ao ano

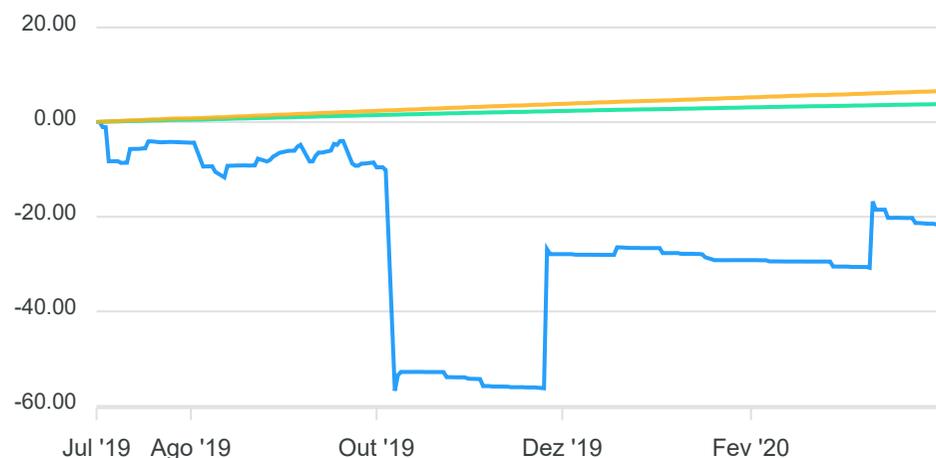
Classificação ANBIMA
FIDC Outros

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

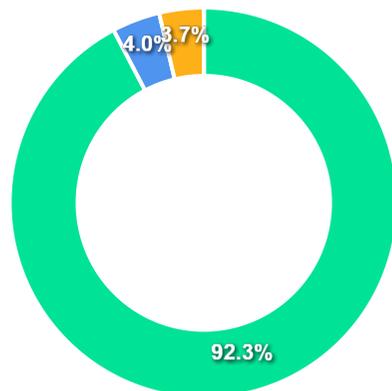
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,42%	28,37%	-0,23%	28,37%	-4,15%	1.016,88%	-%	-%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,30%	7,20%	3,80%	7,23%	12,46%	19,03%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Direito Creditório	261.471,10	92.30%
Valores a pagar/receber	11.317,09	4.00%
Fundos de Investimento	10.484,52	3.70%
Derivativos	0,00	0.00%
Nota Promissória	0,00	0.00%
Outros	0,00	0.00%
Títulos Privados	0,00	0.00%
Debêntures	0,00	0.00%
Operação compromissada	0,00	0.00%
Títulos Federais	0,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Direitos Creditórios - Multiclasse	261.471,10	999,99	Direito Credit...	03/08/2022
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	11.170,03	50,97	Valores a paga...	03/08/2022
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	10.484,52	47,84	Fundos de Inve...	03/08/2022
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	147,06	0,67	Valores a paga...	03/08/2022
Warrants, Contrato de Compra e Venda de Produtos, ...	0,00	0,00	Outros	03/08/2022
Valores a pagar - Longo Prazo (após 12 meses)	0,00	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Títulos Públicos Federais	0,00	0,00	Títulos Federa...	03/08/2022
Outros Valores Mobiliários	0,00	0,00	Outros	03/08/2022
Outros Ativos Financeiros de Renda Fixa	0,00	0,00	Outros	03/08/2022
Outros Ativos - Longo Prazo (após 12 meses)	0,00	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Operações Compromissadas	0,00	0,00	Operação compr...	03/08/2022
Notas Promissórias Comerciais	0,00	0,00	Nota Promissór...	03/08/2022
Mercado Futuro - Ajustes Positivos	0,00	0,00	Derivativos	03/08/2022
Mercado Futuro - Ajustes Negativos	0,00	0,00	Derivativos	03/08/2022
Mercado de Opções - Posições Titulares	0,00	0,00	Derivativos	03/08/2022
Mercado de Opções - Posições Lançadas	0,00	0,00	Derivativos	03/08/2022
Mercado a Termo - Posições Vendidas	0,00	0,00	Derivativos	03/08/2022
Letras Financeiras	0,00	0,00	Títulos Privad...	03/08/2022
Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a paga...	03/08/2022
Diferencial de SWAP a Receber	0,00	0,00	Derivativos	03/08/2022
Diferencial de SWAP a Pagar	0,00	0,00	Derivativos	03/08/2022
Depósitos de Margem	0,00	0,00	Derivativos	03/08/2022
Debêntures	0,00	0,00	Debêntures	03/08/2022
Cotas de Fundos de Investimento em Direitos Credit...	0,00	0,00	Fundos de Inve...	03/08/2022
Cotas de Fundos / Demais Fundos de Investimento em...	0,00	0,00	Fundos de Inve...	03/08/2022
Coberturas Prestadas	0,00	0,00	Derivativos	03/08/2022
Certificados e Recibos de Depósitos Bancários	0,00	0,00	Títulos Privad...	03/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
GENIAL INVESTIMENTOS CORRETORA DE VALORES
MOBILIARIOS S.A.

Gestão
GENIAL GESTAO LTDA

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
Não se aplica

Quantidade de Cotistas
42

Patrimônio Líquido Fundo
216.576,81

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso V, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
CDI + 3,50% ao ano

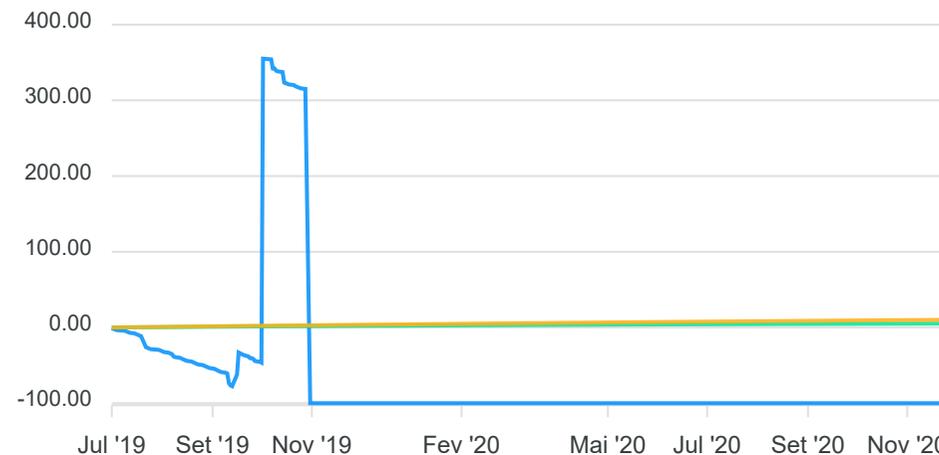
Classificação ANBIMA
FIDC Outros

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

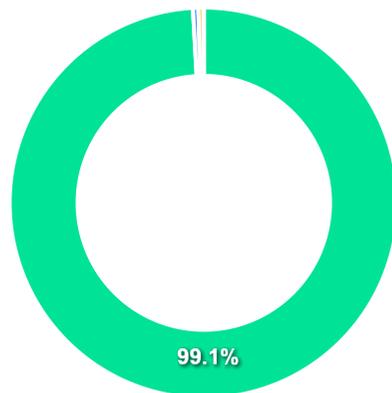
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,95%	-79,62%	-79,71%	-79,62%	-89,15%	-75,69%	-%	-%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,30%	7,20%	3,80%	7,23%	12,46%	19,03%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Direito Creditório	200.115,31	99.10%
Títulos Federais	919,91	0.46%
Valores a pagar/receber	803,90	0.40%
Operação compromissada	94,62	0.05%
Derivativos	0,00	0.00%
Debêntures	0,00	0.00%
Outros	0,00	0.00%
Títulos Privados	0,00	0.00%
Fundos de Investimento	0,00	0.00%
Nota Promissória	0,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Direitos Creditórios - Multiclasse	200.115,31	999,99	Direito Credit...	11/08/2022
Títulos Públicos Federais	919,91	410,59	Títulos Federa...	11/08/2022
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	797,19	355,82	Valores a paga...	11/08/2022
Operações Compromissadas	94,62	42,23	Operação compr...	11/08/2022
Disponibilidades	6,71	2,99	Valores a paga...	11/08/2022
Warrants, Contrato de Compra e Venda de Produtos, ...	0,00	0,00	Outros	11/08/2022
Valores a pagar - Longo Prazo (após 12 meses)	0,00	0,00	Valores a paga...	11/08/2022
Outros Valores Mobiliários	0,00	0,00	Outros	11/08/2022
Outros Ativos Financeiros de Renda Fixa	0,00	0,00	Outros	11/08/2022
Outros Ativos - Longo Prazo (após 12 meses)	0,00	0,00	Valores a paga...	11/08/2022
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	0,00	0,00	Valores a paga...	11/08/2022
Notas Promissórias Comerciais	0,00	0,00	Nota Promissór...	11/08/2022
Mercado Futuro - Ajustes Positivos	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Mercado Futuro - Ajustes Negativos	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Mercado de Opções - Posições Titulares	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Mercado de Opções - Posições Lançadas	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Mercado a Termo - Posições Vendidas	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Letras Financeiras	0,00	0,00	Títulos Privad...	11/08/2022
Diferencial de SWAP a Receber	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Diferencial de SWAP a Pagar	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Depósitos de Margem	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Debêntures	0,00	0,00	Debêntures	11/08/2022
Cotas de Fundos de Investimento em Direitos Credit...	0,00	0,00	Fundos de Inve...	11/08/2022
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	0,00	0,00	Fundos de Inve...	11/08/2022
Cotas de Fundos / Demais Fundos de Investimento em...	0,00	0,00	Fundos de Inve...	11/08/2022
Coberturas Prestadas	0,00	0,00	Derivativos	11/08/2022
Certificados e Recibos de Depósitos Bancários	0,00	0,00	Títulos Privad...	11/08/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
FINAXIS CORRETORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS
S.A

Gestão
PETRA CAPITAL GESTAO DE INVESTIMENTOS LTDA

Taxa de Administração
0,25%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
Não se aplica

Quantidade de Cotistas
98

Patrimônio Líquido Fundo
31.453.422,65

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso V, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

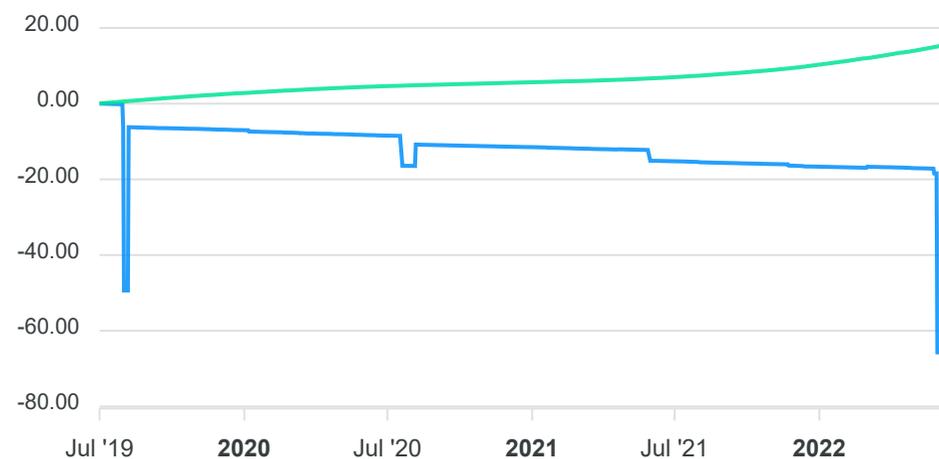
Classificação ANBIMA
FIDC Outros

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

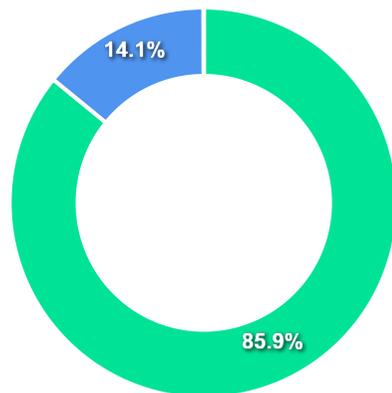
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,59%	-59,09%	-59,01%	-59,09%	-59,79%	-62,76%	0,18%	0,37%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Direito Creditório	333.451,92	85.88%
Valores a pagar/receber	54.671,14	14.08%
Títulos Federais	113,58	0.03%
Fundos de Investimento	32,23	0.01%
Títulos Privados	0,00	0.00%
Debêntures	0,00	0.00%
Operação compromissada	0,00	0.00%
Derivativos	0,00	0.00%
Nota Promissória	0,00	0.00%
Outros	0,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Direitos Creditórios	333.451,92	999,99	Direito Credit...	13/07/2022
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	42.989,38	136,68	Valores a paga...	13/07/2022
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	11.649,77	37,04	Valores a paga...	13/07/2022
Títulos Públicos Federais	113,58	0,36	Títulos Federa...	13/07/2022
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	32,23	0,10	Fundos de Inve...	13/07/2022
Valores a pagar - Longo Prazo (após 12 meses)	32,00	0,10	Valores a paga...	13/07/2022
Mercado a Termo - Posições Vendidas	0,00	0,00	Derivativos	13/07/2022
Warrants, Contrato de Compra e Venda de Produtos, ...	0,00	0,00	Outros	13/07/2022
Mercado de Opções - Posições Lançadas	0,00	0,00	Derivativos	13/07/2022
Mercado de Opções - Posições Titulares	0,00	0,00	Derivativos	13/07/2022
Mercado Futuro - Ajustes Negativos	0,00	0,00	Derivativos	13/07/2022
Mercado Futuro - Ajustes Positivos	0,00	0,00	Derivativos	13/07/2022
Notas Promissórias Comerciais	0,00	0,00	Nota Promissór...	13/07/2022
Operações Compromissadas	0,00	0,00	Operação compr...	13/07/2022
Outros Ativos - Longo Prazo (após 12 meses)	0,00	0,00	Valores a paga...	13/07/2022
Outros Ativos Financeiros de Renda Fixa	0,00	0,00	Outros	13/07/2022
Outros Valores Mobiliários	0,00	0,00	Outros	13/07/2022
Letras Financeiras	0,00	0,00	Títulos Privad...	13/07/2022
Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a paga...	13/07/2022
Diferencial de SWAP a Receber	0,00	0,00	Derivativos	13/07/2022
Diferencial de SWAP a Pagar	0,00	0,00	Derivativos	13/07/2022
Depósitos de Margem	0,00	0,00	Derivativos	13/07/2022
Debêntures	0,00	0,00	Debêntures	13/07/2022
Cotas de Fundos de Investimento em Direitos Credit...	0,00	0,00	Fundos de Inve...	13/07/2022
Cotas de Fundos / Demais Fundos de Investimento em...	0,00	0,00	Fundos de Inve...	13/07/2022
Coberturas Prestadas	0,00	0,00	Derivativos	13/07/2022
Certificados e Recibos de Depósitos Bancários	0,00	0,00	Títulos Privad...	13/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,70%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
93

Patrimônio Líquido Fundo
679.415.733,50

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
IBX-50

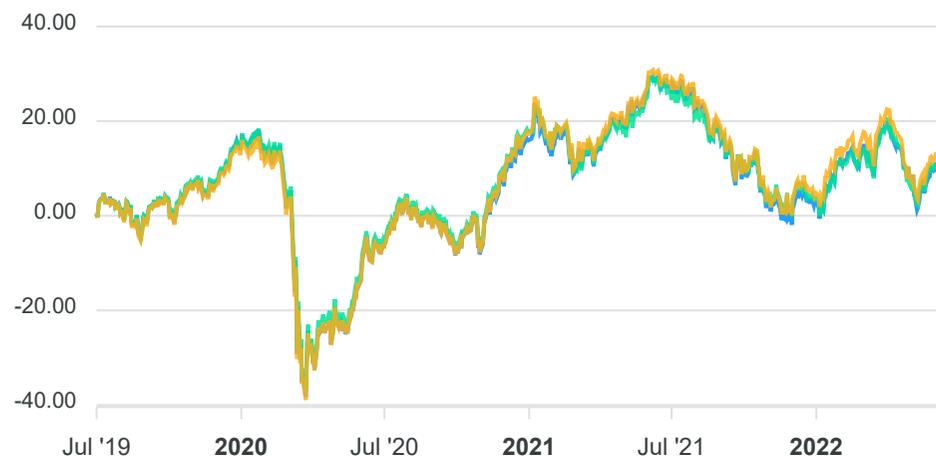
Classificação ANBIMA
Ações Índice Ativo

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

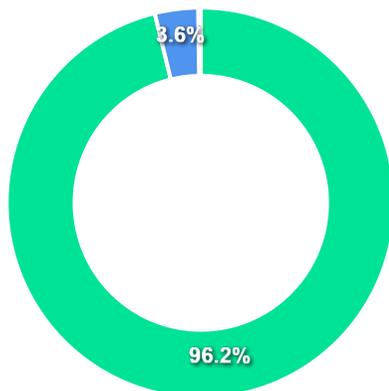
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-12,79%	-6,95%	-19,21%	-6,95%	-24,74%	2,73%	9,95%	20,95%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,67%	-5,71%	-18,35%	-5,71%	-22,70%	6,28%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	654.421,47	96.18%
Fundos de Investimento	24.464,70	3.60%
Valores a pagar/receber	1.515,02	0.22%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
VALE ON N1 - VALE3	71.344,76	10,49	Ações	08/08/2022
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	44.975,60	6,61	Ações	08/08/2022
BRASIL ON NM - BBAS3	38.684,12	5,69	Ações	08/08/2022
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	35.401,39	5,20	Ações	08/08/2022
PETROBRAS PN - PETR4	33.665,96	4,95	Ações	08/08/2022
JBS ON NM - JBSS3	31.387,53	4,61	Ações	08/08/2022
PETROBRAS ON - PETR3	29.393,25	4,32	Ações	08/08/2022
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	28.402,25	4,17	Ações	08/08/2022
ELETRORAS ON N1 - ELET3	27.783,63	4,08	Ações	08/08/2022
GERDAU PN N1 - GGBR4	22.430,28	3,30	Ações	08/08/2022
BTGP BANCO UNT - BPAC11	21.563,46	3,17	Ações	08/08/2022
Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA RE...	20.208,31	2,97	Fundos de Inve...	08/08/2022
ASSAI ON NM - ASAI3	19.562,07	2,88	Ações	08/08/2022
BRADERSCO PN N1 - BBDC4	19.418,34	2,85	Ações	08/08/2022
CBA ON NM - CBAV3	19.310,63	2,84	Ações	08/08/2022
TOTVS ON NM - TOTS3	18.973,22	2,79	Ações	08/08/2022
3R PETROLEUMON NM - RRRP3	18.670,18	2,74	Ações	08/08/2022
AREZZO CO ON NM - ARZZ3	17.674,20	2,60	Ações	08/08/2022
B3 ON NM - B3SA3	14.334,70	2,11	Ações	08/08/2022
PETRORIO ON NM - PRIO3	14.328,55	2,11	Ações	08/08/2022
AMBEV S/A ON - ABEV3	14.108,18	2,07	Ações	08/08/2022
PETZ ON NM - PETZ3	13.025,41	1,91	Ações	08/08/2022
WEG ON NM - WEGE3	8.989,57	1,32	Ações	08/08/2022
ITAUSA PN N1 - ITSA4	8.823,86	1,30	Ações	08/08/2022
LOCALIZA ON NM - RENT3	7.397,99	1,09	Ações	08/08/2022
REDE D OR ON NM - RDOR3	6.500,67	0,96	Ações	08/08/2022
HAPVIDA ON NM - HAPV3	5.923,98	0,87	Ações	08/08/2022