

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
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	513.084,63	2,37%	683.904.751,85	0,08%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.139.457,19	14,52%	6.957.180.815,09	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.853.383,44	17,82%	11.226.926.091,22	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.116.210,92	14,41%	11.084.704.335,99	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.402.652,72	6,49%	4.111.516.095,57	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.265.080,91	19,72%	5.096.804.349,76	0,08%	7º I b
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.065.181,51	4,93%	1.046.398.584,04	0,10%	7º III a
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	974.719,75	4,51%	60.686.172,43	1,61%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	523.671,39	2,42%	643.233.782,30	0,08%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	775.843,11	3,59%	468.102.681,74	0,17%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	658.434,00	3,04%	228.591.211,08	0,29%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	288.371,95	1,33%	2.225.410.384,30	0,01%	9º III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.051.778,14	4,86%	2.072.988.175,00	0,05%	10º I

Investimentos

\$ 21.627.869,66

Disponibilidades Financeiras

\$ 124,55

Total Carteira

\$ 21.627.994,21

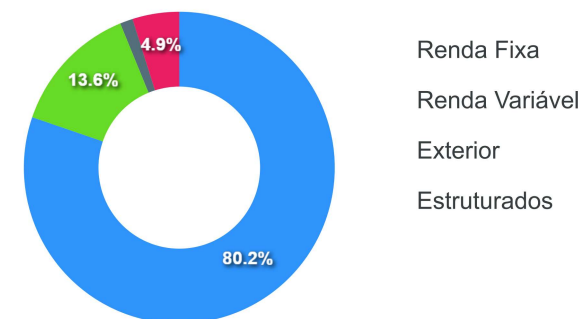
Governança (Pró Gestão)
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	75,35%	16.289.869,81 24,65%
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	4,93%	1.065.181,51 55,07%
8° I - Fundos de Ações	30,00%	13,57%	2.932.668,25 16,43%
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,33%	288.371,95 8,67%
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	4,87%	1.051.778,14 5,13%

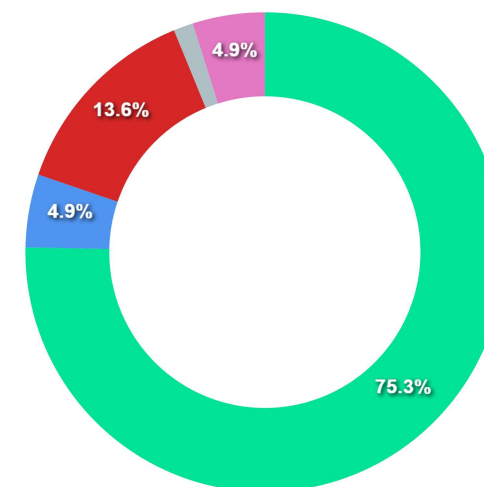
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos

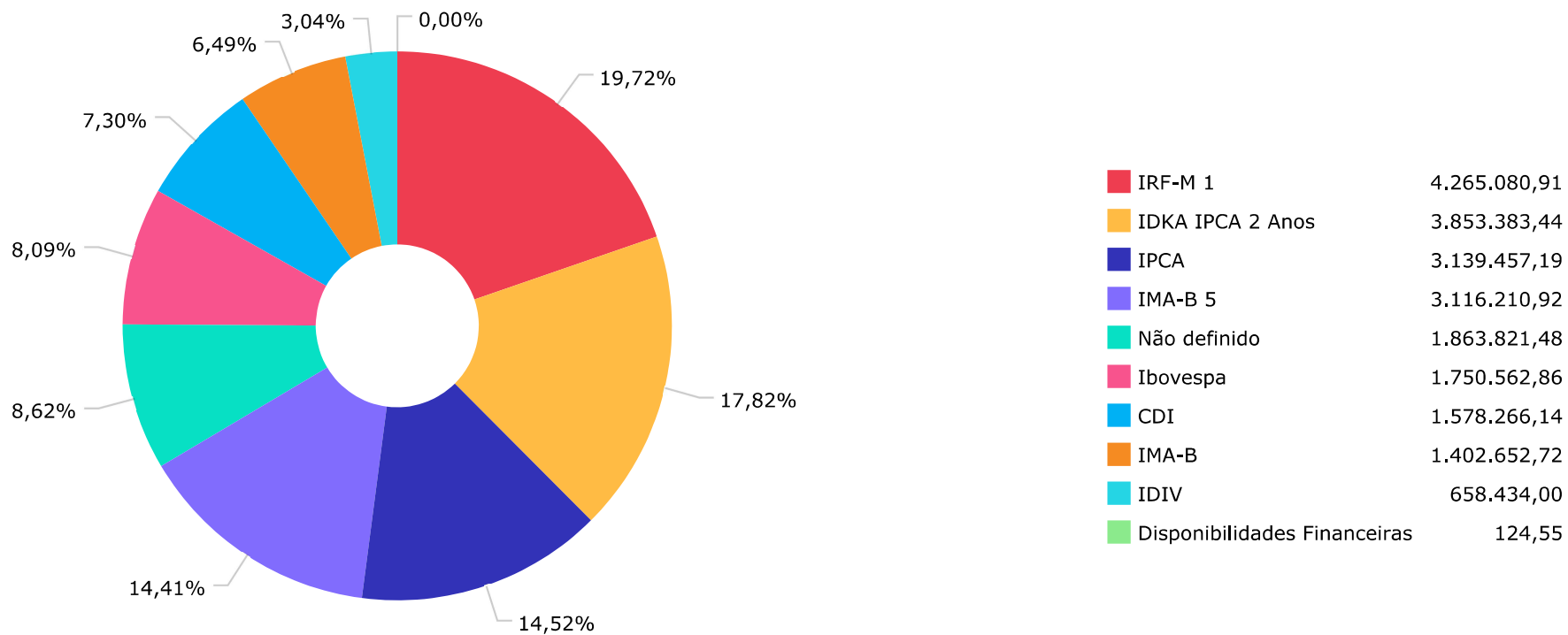


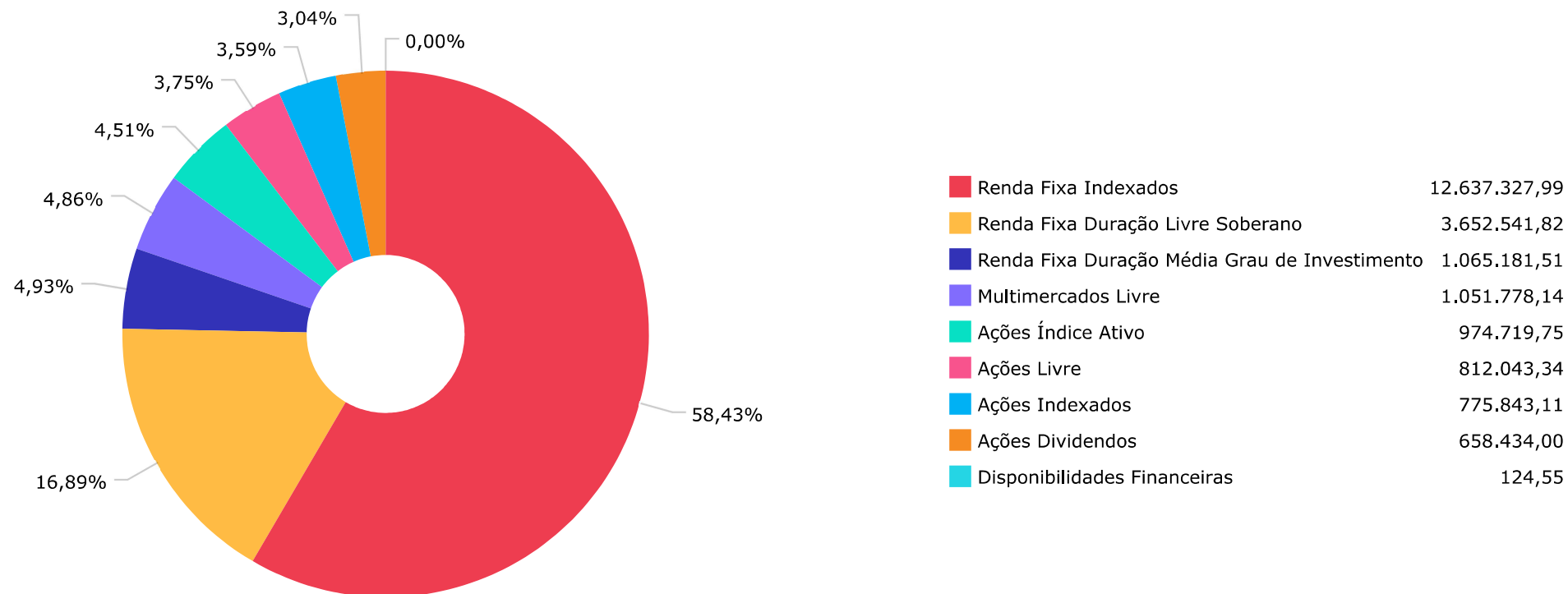
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	10,00%	100,00%	21.617.928,99
7° I b - FI 100% Títulos TN	75,35%	0,00%	40,00%	100,00%	5.328.059,18
7° III a - FI Referenciados RF	4,93%	0,00%	13,00%	60,00%	11.905.575,88

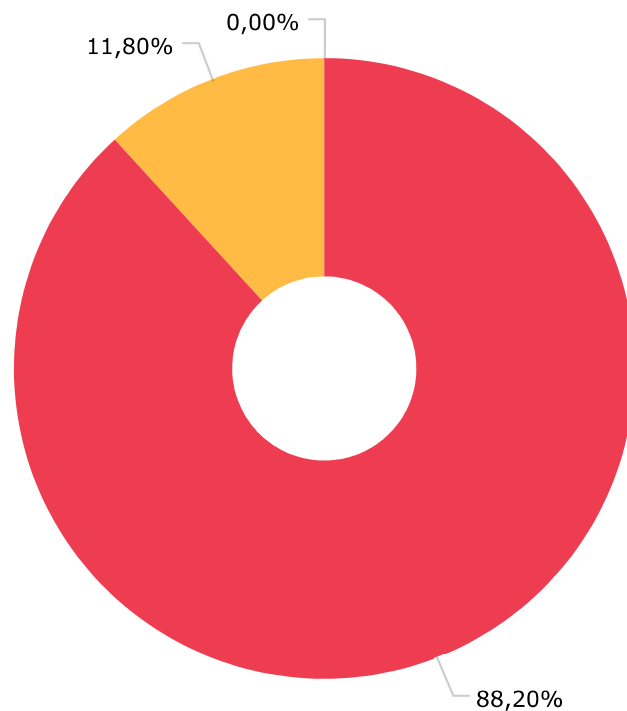
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8° I - Fundos de Ações	13,57%	0,00%	20,00%	30,00%	3.552.710,45
9° III - Ações - BDR Nivel I	1,33%	0,00%	10,00%	10,00%	1.873.420,95
10° I - Fundos Multimercados	4,87%	0,00%	7,00%	10,00%	1.110.014,76

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-7,78	-17,57	-14,98	-17,57	-5,74	30,65	13,68	28,82
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,83	-27,83	-10,22	-27,83	-13,08	9,72	12,50	26,32
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-10,49	-8,08	-16,17	-8,08	-27,94	-7,88	7,94	16,71
CDI - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	1,04	5,46	2,85	5,46	8,81	10,57	0,02	0,03
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,00	5,40	2,81	5,40	8,73	10,66	0,29	0,61
IBOVESPA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	-10,32	-0,89	-14,86	-0,89	-10,71	8,96	8,36	17,60
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-11,26	-5,82	-17,59	-5,82	-22,15	3,40	8,71	18,35
IDIV - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-8,31	4,05	-9,45	4,05	-7,36	11,21	7,00	14,75
IDKA IPCA 2 ANOS - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,22	6,41	2,50	6,41	9,66	16,68	1,39	2,93
IMA-B - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
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
IMA-B 5 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
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
IPCA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,23	4,59	2,22	4,59	3,73	6,51	1,57	3,30

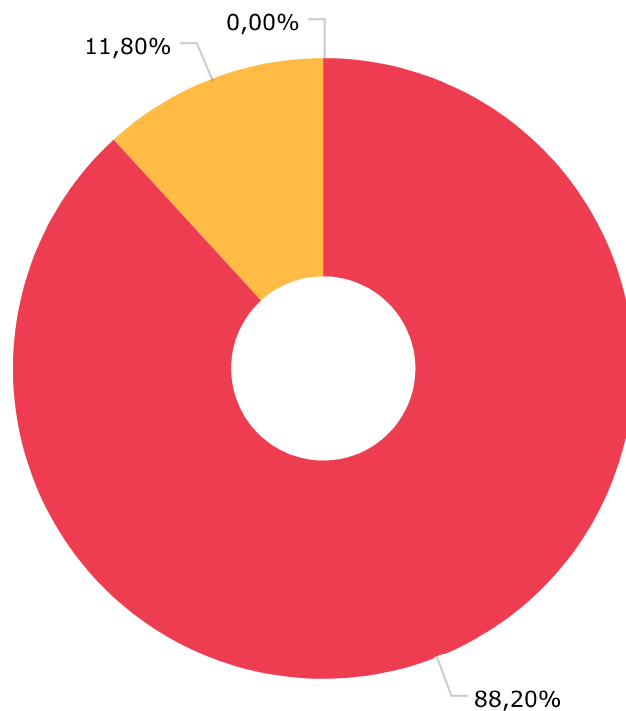
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IRF-M 1 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	0,93	4,99	2,65	4,99	7,19	9,37		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91	4,86	2,58	4,86	6,94	8,89	0,17	0,35







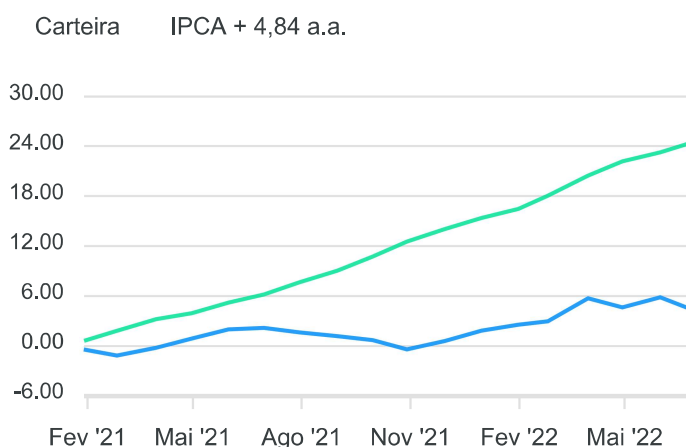
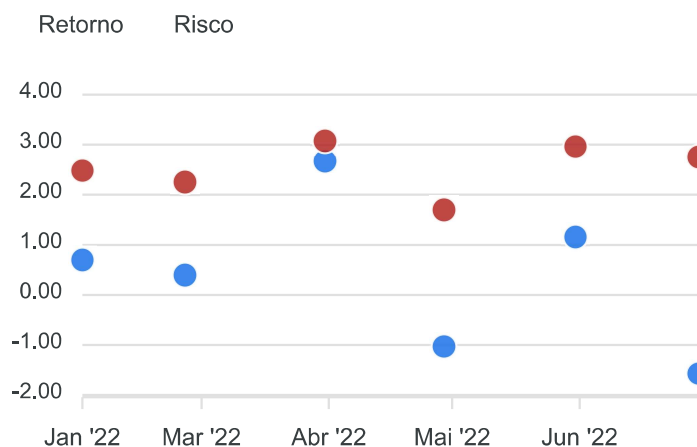
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	19.074.883,77
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	2.552.985,89
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	124,55



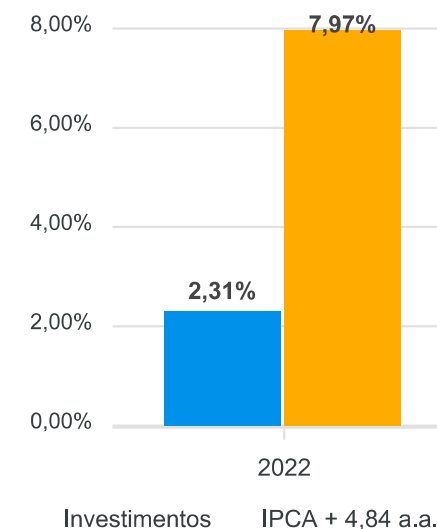
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	19.074.883,77
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S...	2.552.985,89
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	124,55

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	20.624.221,33	292.887,44	230.000,00	20.831.353,76	144.244,99	0,70% ▲	0,94%	2,48%
Fevereiro	20.831.353,76	0,00	266.000,00	20.649.100,59	83.746,83	0,40% ▲	1,37%	2,25%
Março	20.649.100,59	0,00	0,00	21.201.991,06	552.890,47	2,68% ▲	2,04%	3,08%
Abril	21.201.991,06	835.000,00	250.000,00	21.562.204,01	-224.787,05	-1,03% ▼	1,42%	1,69%
Mai	21.562.204,01	0,00	255.000,00	21.558.182,98	250.978,97	1,16% ▲	0,89%	2,96%
Junho	21.558.182,98	654.808,29	241.000,00	21.627.869,66	-344.121,61	-1,57% ▼	1,07%	2,76%
Acumulado					462.952,60	2,31% ▲	7,97%	

Retorno Acumulado			
Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	780.882,29	3,81%	4,41%
2º Trim	-317.929,69	-1,45%	3,41%
1º Sem	462.952,60	2,31%	7,97%



Retorno e Meta Acumulado



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.054.667,77	0,00	0,00	1.065.181,51	10.513,74	1,00% ▲	0,29%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	507.783,08	0,00	0,00	513.084,63	5.301,55	1,04% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.132.240,11	0,00	0,00	3.139.457,19	7.217,08	0,23% ▲	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.844.758,20	0,00	0,00	3.853.383,44	8.625,24	0,22% ▲	1,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.105.850,45	0,00	0,00	3.116.210,92	10.360,47	0,33% ▲	1,23%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.407.980,52	0,00	0,00	1.402.652,72	-5.327,80	-0,38% ▼	2,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.814.104,51	654.808,29	241.000,00	4.265.080,91	37.168,11	0,83% ▲	0,17%
	16.867.384,64	654.808,29	241.000,00	17.355.051,32	73.858,39	0,43%	1,04%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	1.086.880,35	0,00	0,00	974.719,75	-112.160,60	-10,32% ▼	8,36%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	585.020,31	0,00	0,00	523.671,39	-61.348,92	-10,49% ▼	7,94%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	874.274,94	0,00	0,00	775.843,11	-98.431,83	-11,26% ▼	8,71%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	718.105,39	0,00	0,00	658.434,00	-59.671,39	-8,31% ▼	7,00%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.140.512,02	0,00	0,00	1.051.778,14	-88.733,88	-7,78% ▼	13,68%
-	4.404.793,01	0,00	0,00	3.984.446,39	-420.346,62	-9,54%	9,55%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	286.005,33	0,00	0,00	288.371,95	2.366,62	0,83% ▲	12,50%
	286.005,33	0,00	0,00	288.371,95	2.366,62	0,83%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.036.030,39	0,00	0,00	1.065.181,51	29.151,12	2,81% ▲
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,00	500.000,00	0,00	513.084,63	13.084,63	2,62% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.071.253,11	0,00	0,00	3.139.457,19	68.204,08	2,22% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.759.581,07	0,00	0,00	3.853.383,44	93.802,37	2,50% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.035.660,36	0,00	0,00	3.116.210,92	80.550,56	2,65% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.383.423,25	0,00	0,00	1.402.652,72	19.229,47	1,39% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.919.675,23	989.808,29	746.000,00	4.265.080,91	101.597,39	2,07% ▲
	16.205.623,41	1.489.808,29	746.000,00	17.355.051,32	405.619,62	2,39%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	1.144.840,73	0,00	0,00	974.719,75	-170.120,98	-14,86% ▼
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	624.651,23	0,00	0,00	523.671,39	-100.979,84	-16,17% ▼
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	941.499,56	0,00	0,00	775.843,11	-165.656,45	-17,59% ▼
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	727.113,67	0,00	0,00	658.434,00	-68.679,67	-9,45% ▼
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.237.073,94	0,00	0,00	1.051.778,14	-185.295,80	-14,98% ▼
	4.675.179,13	0,00	0,00	3.984.446,39	-690.732,74	-14,77%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	321.188,52	0,00	0,00	288.371,95	-32.816,57	-10,22% ▼
	321.188,52	0,00	0,00	288.371,95	-32.816,57	-10,22%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.010.647,36	0,00	0,00	1.065.181,51	54.534,15	5,40% ▲
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,00	500.000,00	0,00	513.084,63	13.084,63	2,62% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.001.759,22	0,00	0,00	3.139.457,19	137.697,97	4,59% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.621.167,31	0,00	0,00	3.853.383,44	232.216,13	6,41% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.925.708,41	0,00	0,00	3.116.210,92	190.502,51	6,51% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.345.456,24	0,00	0,00	1.402.652,72	57.196,48	4,25% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.034.140,68	1.282.695,73	1.242.000,00	4.265.080,91	190.244,50	3,58% ▲
	15.938.879,22	1.782.695,73	1.242.000,00	17.355.051,32	875.476,37	5,31%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	983.506,43	0,00	0,00	974.719,75	-8.786,68	-0,89% ▼
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	569.699,66	0,00	0,00	523.671,39	-46.028,27	-8,08% ▼
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	823.765,05	0,00	0,00	775.843,11	-47.921,94	-5,82% ▼
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	632.813,09	0,00	0,00	658.434,00	25.620,91	4,05% ▲
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.275.989,17	0,00	0,00	1.051.778,14	-224.211,03	-17,57% ▼
	4.285.773,40	0,00	0,00	3.984.446,39	-301.327,01	-7,03%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	399.568,71	0,00	0,00	288.371,95	-111.196,76	-27,83% ▼
	399.568,71	0,00	0,00	288.371,95	-111.196,76	-27,83%

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, mantem 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
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S.A

Gestão
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
156

Patrimônio Líquido Fundo
683.904.751,85

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
CDI

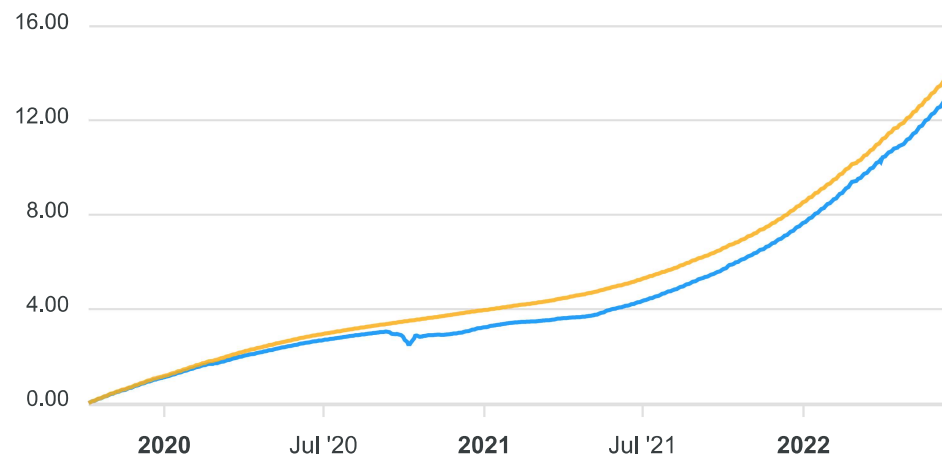
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos relacionados à variação da taxa de juros doméstica ou índice de preços, ou ambos, com o prazo da carteira superior a 365 dias.

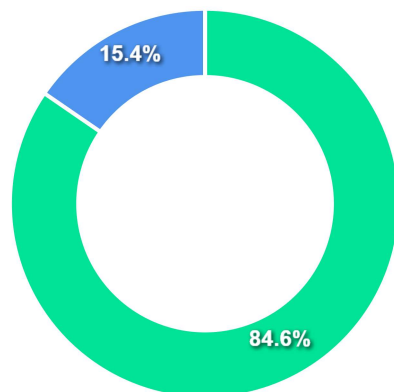
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,04%	5,46%	2,85%	5,46%	8,81%	10,57%	0,02%	0,03%
Indicador de Desempenho (CVM)	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
LFT - Venc: 01/03/2026	146.225,83	16,92	Títulos Federa...	09/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	145.019,30	16,78	Títulos Federa...	09/09/2022
LFT - Venc.: 01/03/2027	115.047,57	13,31	Títulos Federa...	09/09/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2026	107.064,49	12,39	Operação compr...	09/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2024	92.699,29	10,72	Títulos Federa...	09/09/2022
LFT - Venc: 01/03/2024	72.639,50	8,40	Títulos Federa...	09/09/2022
LFT - Venc: 01/03/2025	72.497,24	8,39	Títulos Federa...	09/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	43.597,26	5,04	Títulos Federa...	09/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2027	28.567,95	3,31	Títulos Federa...	09/09/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2024	26.135,12	3,02	Operação compr...	09/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2026	14.991,50	1,73	Títulos Federa...	09/09/2022
Outros Valores a receber	24,38	0,00	Valores a paga...	09/09/2022
Outras Disponibilidades	9,38	0,00	Valores a paga...	09/09/2022
Outros Valores a pagar	-159,74	-0,02	Valores a paga...	09/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	731.285,45	84.60%
Operação compromissada	133.199,61	15.41%
Valores a pagar/receber	-125,99	-0.01%

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
868

Patrimônio Líquido Fundo
6.957.180.815,09

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IPCA

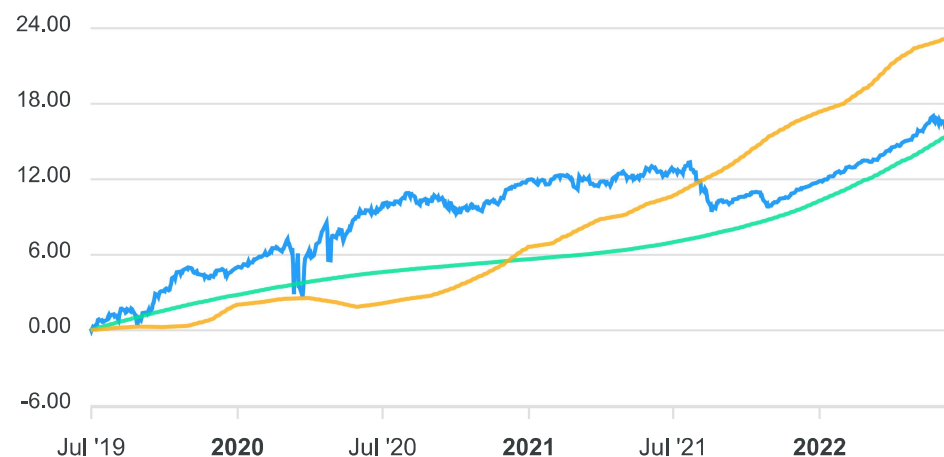
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA
MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA, CNPJ:
10.948.555/0001-13.

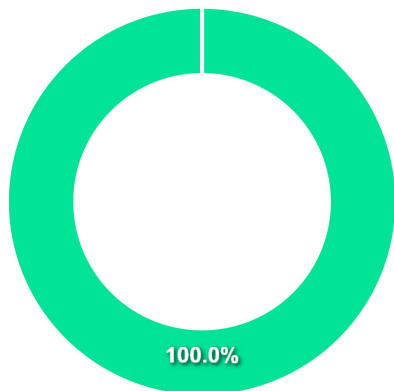
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,23%	4,59%	2,22%	4,59%	3,73%	6,51%	1,57%	3,30%
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
Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA...	5.889.220,38	100,01	Fundos de Inve...	06/09/2022
Outros Valores a receber	19,34	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a pagar	-330,33	-0,01	Valores a paga...	06/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.889.220,38	100.01%
Valores a pagar/receber	-310,98	-0.01%

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
1.073

Patrimônio Líquido Fundo
11.226.926.091,22

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IDKA IPCA 2 Anos

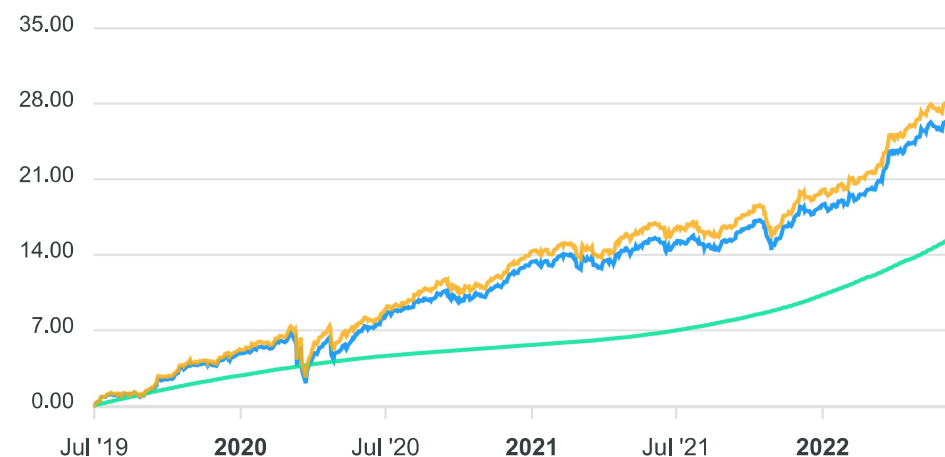
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em títulos públicos federais indexados a taxas pré e pós-fixadas e/ou índices de preços.

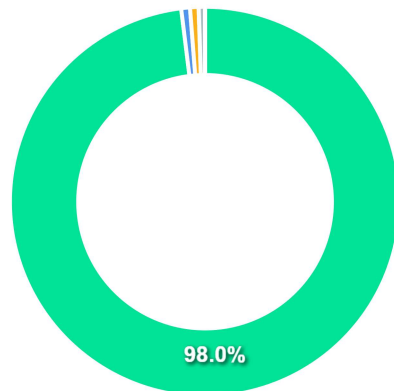
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,22%	6,41%	2,50%	6,41%	9,66%	16,68%	1,39%	2,93%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,47%	6,85%	2,86%	6,85%	10,11%	17,88%		
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.: 15/08/2024	7.869.311,78	80,52	Títulos Federa...	08/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	1.818.657,01	18,61	Títulos Federa...	08/09/2022
Outros Valores a receber	70.166,94	0,72	Valores a paga...	08/09/2022
Vendas a termo a receber / RENDA FIXA TERMO	70.075,13	0,72	Outros	08/09/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	52.260,70	0,53	Operação compr...	08/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	30.250,67	0,31	Títulos Federa...	08/09/2022
Outras Disponibilidades	2.237,27	0,02	Valores a paga...	08/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	1.206,48	0,01	Títulos Federa...	08/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ24	100,16	0,00	Derivativos	08/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	0,00	0,00	Títulos Federa...	08/09/2022
Outros Valores a pagar	-339,76	0,00	Valores a paga...	08/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	9.719.425,94	98.04%
Valores a pagar/receber	72.064,45	0.73%
Outros	70.075,13	0.71%
Operação compromissada	52.260,70	0.53%
Derivativos	100,16	0.00%

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

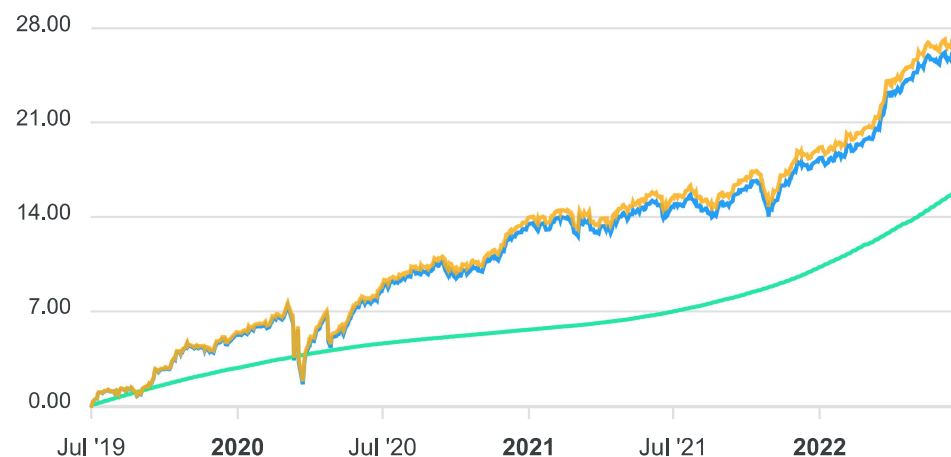
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
 Aplica 100% dos recursos em títulos públicos federais, em operações finais e/ou compromissadas, tendo como parâmetro de rentabilidade o IMA-B 5.

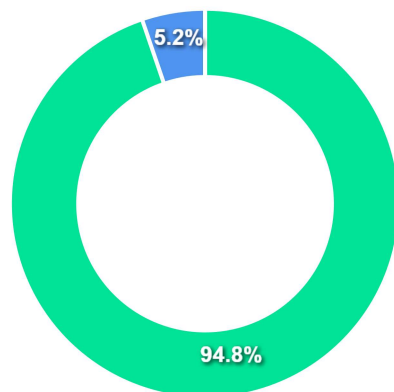
COMPARATIVO

📅 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



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	2.938.894,54	30,47	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	1.999.175,88	20,73	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.950.013,23	20,22	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	1.676.928,90	17,39	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	548.865,56	5,69	Títulos Federa...	06/09/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2023	504.584,63	5,23	Operação compr...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	12.101,65	0,13	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2026	12.041,37	0,12	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	1.194,42	0,01	Títulos Federa...	06/09/2022
Outras Disponibilidades	1.080,41	0,01	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a receber	19,34	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	0,00	0,00	Derivativos	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	0,00	0,00	Títulos Federa...	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	-205,81	0,00	Derivativos	06/09/2022
Outros Valores a pagar	-541,94	-0,01	Valores a paga...	06/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	9.139.215,55	94.76%
Operação compromissada	504.584,63	5.23%
Valores a pagar/receber	557,82	0.01%
Derivativos	-205,81	-0.00%

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 100% dos seus recursos em títulos do Tesouro Nacional em operações finais e/ou compromissadas tendo como parâmetro de rentabilidade o subíndice IMA-B.

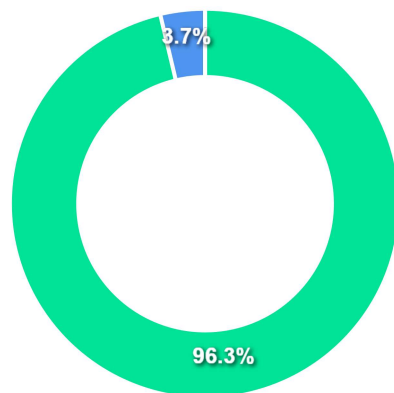
COMPARATIVO

📅 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	3.703.778,83	96.31%
Operação compromissada	142.193,43	3.70%
Derivativos	-29,40	-0.00%
Valores a pagar/receber	-146,42	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	521.067,07	13,55	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	438.265,16	11,40	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	360.829,53	9,38	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	314.347,65	8,17	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	309.999,82	8,06	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	299.920,27	7,80	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	299.593,43	7,79	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	290.503,32	7,55	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	272.588,44	7,09	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	219.761,54	5,71	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	189.134,57	4,92	Títulos Federa...	06/09/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	142.193,43	3,70	Operação compr...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	100.029,37	2,60	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	50.269,99	1,31	Títulos Federa...	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	24.184,65	0,63	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2022	12.101,68	0,31	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	1.182,35	0,03	Títulos Federa...	06/09/2022
Outros Valores a receber	19,34	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Outras Disponibilidades	10,84	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	0,00	0,00	Derivativos	06/09/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	0,00	0,00	Títulos Federa...	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	-29,40	0,00	Derivativos	06/09/2022
Outros Valores a pagar	-176,61	0,00	Valores a paga...	06/09/2022

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

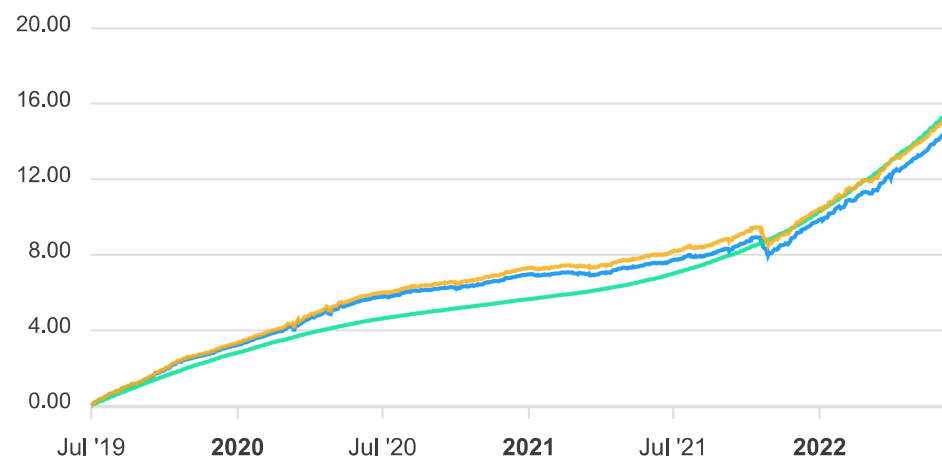
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
 Investe seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas e/ou pós-fixadas SELIC/CDI.

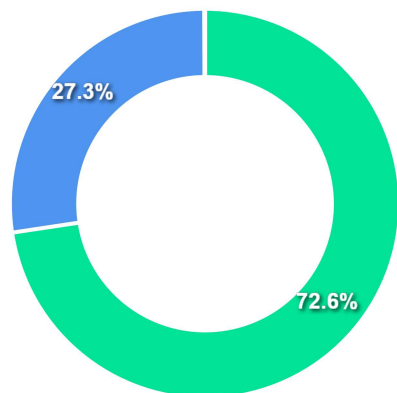
COMPARATIVO

📅 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	3.630.640,47	72.63%
Operação compromissada	1.364.485,68	27.30%
Valores a pagar/receber	3.448,55	0.07%
Derivativos	333,48	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	1.453.165,90	29,07	Títulos Federa...	06/09/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	1.364.485,68	27,30	Operação compr...	06/09/2022
LTN - Venc.: 01/07/2023	878.950,99	17,58	Títulos Federa...	06/09/2022
LTN - Venc: 01/10/2022	634.744,47	12,70	Títulos Federa...	06/09/2022
LTN - Venc.: 01/01/2023	328.822,85	6,58	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2022	263.780,39	5,28	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	44.776,09	0,90	Títulos Federa...	06/09/2022
LTN - Venc: 01/04/2023	26.399,77	0,53	Títulos Federa...	06/09/2022
Outras Disponibilidades	3.291,61	0,07	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a receber	351,66	0,01	Valores a paga...	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	301,85	0,01	Derivativos	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF23	21,03	0,00	Derivativos	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ23	11,18	0,00	Derivativos	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV22	-0,58	0,00	Derivativos	06/09/2022
Outros Valores a pagar	-194,72	0,00	Valores a paga...	06/09/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S.A

Gestão
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA

Taxa de Administração
0,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
3.417

Patrimônio Líquido Fundo
1.030.136.859,07

Patrimônio Líquido Master
1.046.398.584,04

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
CDI

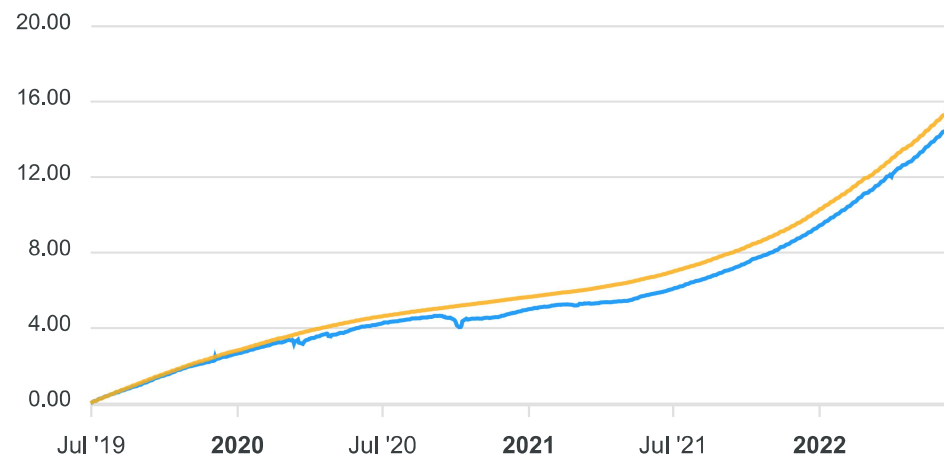
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Média Grau de Investimento

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do BNB
MASTER 60 FI RENDA FIXA LP, CNPJ: 18.179.553/0001-19.

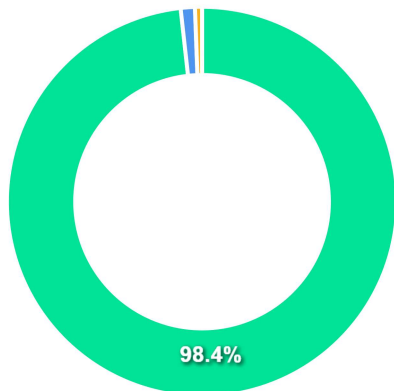
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,00%	5,40%	2,81%	5,40%	8,73%	10,66%	0,29%	0,61%
Indicador de Desempenho (CVM)	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 Fundos / BNB MASTER 60 FUNDO DE INVESTIME...	1.076.607,39	98,37	Outros	09/09/2022
LFT - Venc: 01/03/2024	12.906,97	1,18	Títulos Federa...	09/09/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2026	6.384,43	0,58	Operação compr...	09/09/2022
Outros Valores a receber	520,30	0,05	Valores a paga...	09/09/2022
Outras Disponibilidades	9,07	0,00	Valores a paga...	09/09/2022
Outros Valores a pagar	-1.937,80	-0,18	Valores a paga...	09/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Outros	1.076.607,39	98.37%
Títulos Federais	12.906,97	1.18%
Operação compromissada	6.384,43	0.58%
Valores a pagar/receber	-1.408,42	-0.13%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S.A

Gestão
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
781

Patrimônio Líquido Fundo
60.686.172,43

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Índice Ativo

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos no mercado de ações.

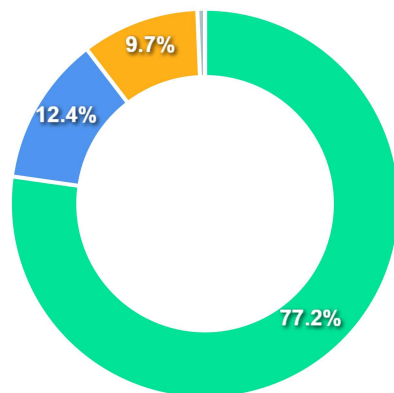
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,32%	-0,89%	-14,86%	-0,89%	-10,71%	8,96%	8,36%	17,60%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	53.871,38	77.24%
Fundos de Investimento	8.627,30	12.37%
Operação compromissada	6.799,63	9.75%
Valores a pagar/receber	444,65	0.64%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	7.395,22	10,60	Ações	09/09/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2026	6.799,63	9,75	Operação compr...	09/09/2022
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	6.568,88	9,42	Ações	09/09/2022
PETROBRAS PN - PETR4	5.566,03	7,98	Ações	09/09/2022
VALE ON N1 - VALE3	5.501,85	7,89	Ações	09/09/2022
Cotas de ISHARES IBOVESP A FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	5.247,26	7,52	Fundos de Inve...	09/09/2022
BRADERCO PN N1 - BBDC4	4.870,88	6,98	Ações	09/09/2022
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	3.767,14	5,40	Ações	09/09/2022
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	3.107,13	4,46	Ações	09/09/2022
Cotas de ISHARES BM&FBOVESP A SMALL CAP FUNDO DE ÍN...	2.702,04	3,87	Fundos de Inve...	09/09/2022
JBS ON NM - JBSS3	2.586,17	3,71	Ações	09/09/2022
B3 ON NM - B3SA3	2.571,30	3,69	Ações	09/09/2022
GERDAU PN N1 - GGBR4	2.352,99	3,37	Ações	09/09/2022
WEG ON NM - WEGE3	1.731,35	2,48	Ações	09/09/2022
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	1.586,11	2,27	Ações	09/09/2022
TOTVS ON NM - TOTS3	1.555,98	2,23	Ações	09/09/2022
SANEPAR UNT N2 - SAPR11	1.440,19	2,06	Ações	09/09/2022
MARFRIG ON NM - MRFG3	1.133,53	1,63	Ações	09/09/2022
Outros Valores a receber	1.116,05	1,60	Valores a paga...	09/09/2022
CEMIG PN N1 - CMIG4	951,97	1,36	Ações	09/09/2022
CCR SA ON NM - CCRO3	803,96	1,15	Ações	09/09/2022
Cotas de ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	678,00	0,97	Fundos de Inve...	09/09/2022
AMERICANAS ON NM - AMER3	380,72	0,55	Ações	09/09/2022
Outras Disponibilidades	9,57	0,01	Valores a paga...	09/09/2022
Outros Valores a pagar	-680,97	-0,98	Valores a paga...	09/09/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+25

Quantidade de Cotistas
1.588

Patrimônio Líquido Fundo
643.233.782,30

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

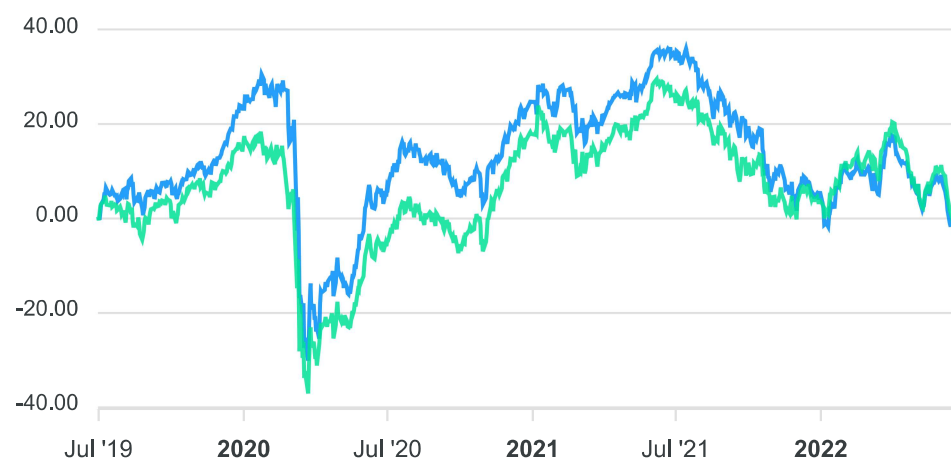
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento de ações geridos por gestores distintos.

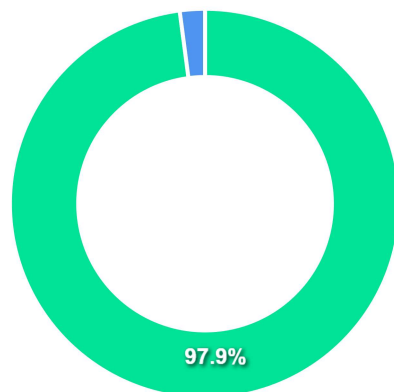
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,49%	-8,08%	-16,17%	-8,08%	-27,94%	-7,88%	7,94%	16,71%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	685.354,09	97.92%
Valores a pagar/receber	14.584,62	2.08%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de NAVI INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	71.733,38	10,47	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de MILES CAIXA VIRTUS FIC AÇÕES	58.845,09	8,59	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FI AÇÕES	56.210,64	8,21	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	55.363,61	8,08	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	54.633,62	7,98	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	52.517,37	7,67	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de OCEANA SELECTION 30 E FIC AÇÕES	49.147,80	7,18	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	46.167,26	6,74	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de TRUXT C VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	42.984,63	6,28	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de MOAT CAIXA AÇÕES FIC AÇÕES	36.171,63	5,28	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de LEBLON AÇÕES II INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	34.112,33	4,98	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	33.035,47	4,82	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	31.679,87	4,63	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de BRASIL CAPITAL 30 FIC AÇÕES	30.698,83	4,48	Fundos de Inve...	06/09/2022
Cotas de TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	25.525,86	3,73	Fundos de Inve...	06/09/2022
Outros Valores a receber	15.563,39	2,27	Valores a paga...	06/09/2022
Cotas de CAIXA MASTER TPF FI RENDA FIXA LP	6.526,69	0,95	Fundos de Inve...	06/09/2022
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a pagar	-978,77	-0,14	Valores a paga...	06/09/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
100

Patrimônio Líquido Fundo
468.102.681,74

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em ativos financeiros de renda variável.

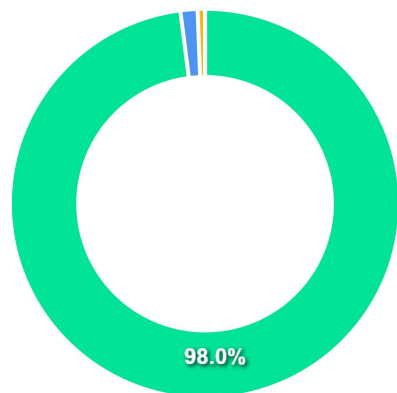
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-11,26%	-5,82%	-17,59%	-5,82%	-22,15%	3,40%	8,71%	18,35%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	500.575,67	97.97%
Valores a pagar/receber	7.252,94	1.42%
Fundos de Investimento	3.116,47	0.61%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
VALE ON N1 - VALE3	61.729,14	12,08	Ações	06/09/2022
PETROBRAS PN - PETR4	38.533,34	7,54	Ações	06/09/2022
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	31.335,56	6,13	Ações	06/09/2022
PETROBRAS ON - PETR3	25.546,01	5,00	Ações	06/09/2022
BRADESCO PN N1 - BBDC4	24.860,22	4,87	Ações	06/09/2022
B3 ON NM - B3SA3	18.017,79	3,53	Ações	06/09/2022
AMBEV S/A ON - ABEV3	16.985,66	3,32	Ações	06/09/2022
BRASIL ON NM - BBAS3	15.041,00	2,94	Ações	06/09/2022
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	11.543,36	2,26	Ações	06/09/2022
LOCALIZA ON NM - RENT3	11.362,33	2,22	Ações	06/09/2022
Outros Valores a receber	11.194,37	2,19	Valores a paga...	06/09/2022
ITAUSA PN N1 - ITSA4	11.016,91	2,16	Ações	06/09/2022
WEG ON NM - WEGE3	10.666,91	2,09	Ações	06/09/2022
JBS ON NM - JBSS3	9.698,95	1,90	Ações	06/09/2022
BTGP BANCO UNT - BPAC11	8.411,23	1,65	Ações	06/09/2022
HAPVIDA ON NM - HAPV3	8.235,36	1,61	Ações	06/09/2022
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	8.168,85	1,60	Ações	06/09/2022
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	6.756,62	1,32	Ações	06/09/2022
LOJAS RENNEN ON NM - LREN3	6.574,01	1,29	Ações	06/09/2022
REDE D OR ON NM - RDOR3	6.532,68	1,28	Ações	06/09/2022
GERDAU PN N1 - GGBR4	6.499,45	1,27	Ações	06/09/2022
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	6.241,17	1,22	Ações	06/09/2022
ENEVA ON NM - ENEV3	6.130,25	1,20	Ações	06/09/2022
BRADESCO ON N1 - BBDC3	6.100,27	1,19	Ações	06/09/2022
COSAN ON NM - CSAN3	5.940,77	1,16	Ações	06/09/2022
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	5.919,16	1,16	Ações	06/09/2022
PETRRORIO ON NM - PRIO3	5.817,03	1,14	Ações	06/09/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
3.270

Patrimônio Líquido Fundo
228.591.211,08

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
IDIV

Classificação ANBIMA
Ações Dividendos

Política de Investimento
Aplica seus recursos em ações de empresas que possuam a política e/ou potencial de distribuição de dividendos e/ou juros sobre o capital.

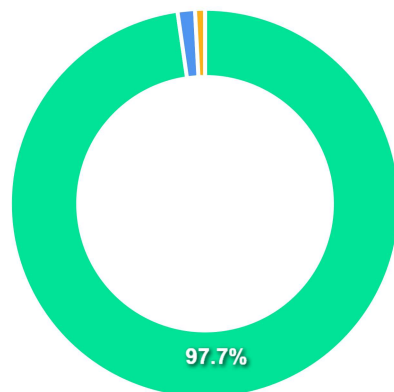
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-8,31%	4,05%	-9,45%	4,05%	-7,36%	11,21%	7,00%	14,75%
Indicador de Desempenho (CVM)	-8,38%	4,58%	-9,43%	4,58%	-4,10%	18,72%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	235.325,66	97.73%
Valores a pagar/receber	3.475,39	1.44%
Outros	1.988,21	0.83%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	29.616,45	12,30	Ações	06/09/2022
VALE ON N1 - VALE3	14.157,75	5,88	Ações	06/09/2022
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	12.377,28	5,14	Ações	06/09/2022
BRASIL ON NM - BBAS3	12.135,96	5,04	Ações	06/09/2022
TELEF BRASIL ON - VIVT3	11.535,66	4,79	Ações	06/09/2022
CEMIG PN N1 - CMIG4	11.199,05	4,65	Ações	06/09/2022
PETROBRAS ON - PETR3	10.894,53	4,52	Ações	06/09/2022
ITAUSA PN N1 - ITSA4	10.495,28	4,36	Ações	06/09/2022
BRADESCO ON N1 - BBDC3	9.755,86	4,05	Ações	06/09/2022
BRADESCO PN N1 - BBDC4	8.977,75	3,73	Ações	06/09/2022
B3 ON NM - B3SA3	8.772,56	3,64	Ações	06/09/2022
ELETROBRAS PNB N1 - ELET6	7.582,57	3,15	Ações	06/09/2022
COPEL PNB N1 - CPLE6	7.090,58	2,94	Ações	06/09/2022
SANTANDER BR UNT N2 - SANB11	6.943,07	2,88	Ações	06/09/2022
ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	6.736,12	2,80	Ações	06/09/2022
TRAN PAULIST PN N1 - TRPL4	6.150,92	2,55	Ações	06/09/2022
TAESA UNT N2 - TAEE11	5.935,23	2,47	Ações	06/09/2022
SID NACIONAL ON - CSNA3	5.776,68	2,40	Ações	06/09/2022
Outros Valores a receber	5.115,05	2,12	Valores a paga...	06/09/2022
CEMIG ON N1 - CMIG3	4.312,08	1,79	Ações	06/09/2022
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	4.276,83	1,78	Ações	06/09/2022
BRADESPAR PN N1 - BRAP4	3.587,03	1,49	Ações	06/09/2022
ENERGIAS BR ON NM - ENBR3	3.414,85	1,42	Ações	06/09/2022
UNIPAR PNB - UNIP6	3.294,35	1,37	Ações	06/09/2022
MINERVA ON NM - BEEF3	2.621,87	1,09	Ações	06/09/2022
CYRELA REALT ON NM - CYRE3	2.598,36	1,08	Ações	06/09/2022
ALUPAR UNT N2 - ALUP11	2.597,49	1,08	Ações	06/09/2022

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
522

Patrimônio Líquido Fundo
2.225.410.384,30

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos em recibos de ações de empresas estrangeiras negociados no Brasil, baseando-se na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.

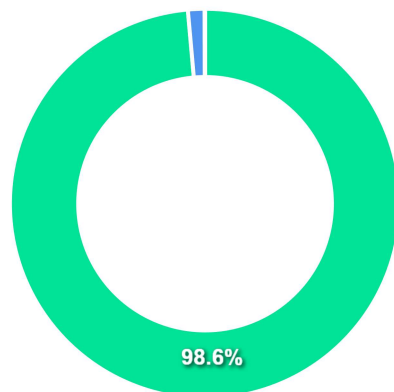
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,83%	-27,83%	-10,22%	-27,83%	-13,08%	9,72%	12,50%	26,32%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Brazilian Depository Receipts	2.220.150,78	98.59%
Fundos de Investimento	30.815,69	1.37%
Valores a pagar/receber	764,36	0.03%
Outros	202,19	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
APPLE DRN - AAPL34	206.029,33	9,15	Brazilian Depo...	08/09/2022
MICROSOFT DRN - MSFT34	155.879,17	6,92	Brazilian Depo...	08/09/2022
AMAZON DRN - AMZO34	102.797,64	4,56	Brazilian Depo...	08/09/2022
TESLA INC DRN - TSLA34	68.710,93	3,05	Brazilian Depo...	08/09/2022
ALPHABET DRN C - GOGL35	55.315,93	2,46	Brazilian Depo...	08/09/2022
ALPHABET DRN A - GOGL34	49.610,13	2,20	Brazilian Depo...	08/09/2022
UNITEDHEALTH DRN - UNHH34	38.829,50	1,72	Brazilian Depo...	08/09/2022
TAIWANSMFAC DRN - TSMC34	34.512,42	1,53	Brazilian Depo...	08/09/2022
EXXON MOBIL CORPORATIO - EXXO34	32.353,19	1,44	Brazilian Depo...	08/09/2022
Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA RE...	30.815,69	1,37	Fundos de Inve...	08/09/2022
NVIDIA CORP DRN - NVDC34	30.250,04	1,34	Brazilian Depo...	08/09/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - M1TA34	30.065,60	1,34	Brazilian Depo...	08/09/2022
WALMART INC - WALM34	29.002,33	1,29	Brazilian Depo...	08/09/2022
JPMORGAN DRN - JPMC34	26.680,03	1,18	Brazilian Depo...	08/09/2022
PG DRN - PGCO34	26.392,88	1,17	Brazilian Depo...	08/09/2022
MASTERCARD DRN - MSCD34	25.109,56	1,11	Brazilian Depo...	08/09/2022
CHEVRON DRN - CHVX34	24.642,53	1,09	Brazilian Depo...	08/09/2022
THE HOME DEPOT, INC - HOME34	23.790,80	1,06	Brazilian Depo...	08/09/2022
ELI LILLY AND COMPAN - LILY34	22.803,95	1,01	Brazilian Depo...	08/09/2022
BANK OF AMERICA CORPORATIO - BOAC34	21.691,93	0,96	Brazilian Depo...	08/09/2022
COCA COLA DRN - COCA34	21.452,25	0,95	Brazilian Depo...	08/09/2022
ALIBABAGR DRN - BABA34	20.558,71	0,91	Brazilian Depo...	08/09/2022
PFIZER DRN - PFIZ34	20.435,95	0,91	Brazilian Depo...	08/09/2022
TOYOTA MOTOR CORP - TMCO34	19.421,82	0,86	Brazilian Depo...	08/09/2022
ABBVIE DRN - ABBV34	18.824,62	0,84	Brazilian Depo...	08/09/2022
COSTCO DRN - COWC34	18.462,48	0,82	Brazilian Depo...	08/09/2022
MERCK DRN - MRCK34	17.141,10	0,76	Brazilian Depo...	08/09/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
1,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
12.074

Patrimônio Líquido Fundo
2.072.988.175,00

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 10º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

Classificação ANBIMA
Multimercados Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos nos mercados de renda fixa e renda variável, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial. No mercado de renda variável, realizará operações de derivativos envolvendo contratos futuros de S&P500.

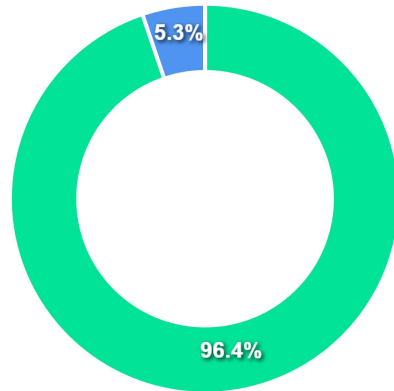
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-7,78%	-17,57%	-14,98%	-17,57%	-5,74%	30,65%	13,68%	28,82%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
LFT - Venc: 01/03/2026	554.033,98	28,03	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2027	455.935,33	23,07	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2026	360.638,97	18,25	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/03/2027	290.152,86	14,68	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/03/2025	136.732,55	6,92	Títulos Federa...	06/09/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2023	103.954,46	5,26	Operação compr...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	34.143,48	1,73	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/03/2028	26.373,33	1,33	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/09/2024	16.803,86	0,85	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc: 01/03/2024	15.265,79	0,77	Títulos Federa...	06/09/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	1.464,13	0,07	Títulos Federa...	06/09/2022
Outras Disponibilidades	105,88	0,01	Valores a paga...	06/09/2022
Outros Valores a receber	19,34	0,00	Valores a paga...	06/09/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / Bolsa Mercad...	-14.096,07	-0,71	Outros	06/09/2022
Outros Valores a pagar	-19.034,79	-0,96	Valores a paga...	06/09/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.891.544,28	96.38%
Operação compromissada	103.954,46	5.30%
Outros	-14.096,07	-0.72%
Valores a pagar/receber	-18.909,56	-0.96%