

REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE

PARANHOS / PREVIPAR

RELATÓRIO SEMESTRAL DE INVESTIMENTOS

1º SEMESTRE

2022

20 de julho de 2022

ÍNDICE

1 – INTRODUÇÃO	3
2 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA e POLÍTICA DE INVESTIMENTOS	4
3 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO	6
4 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RENDA FIXA	12
5 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	22
5.1 - Melhor Desempenho Trimestral dos Investimentos	24
5.2 - Pior Desempenho Trimestral dos Investimentos	26
6 – ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO	28
7 – CONCLUSÃO	29
7.1 - Rentabilidade da Carteira Semestral	29
7.2 - Meta Atuarial	30
7.3 - Perfil de Risco do Investidor	31
7.4 - Avaliação de Desempenho no 1º Semestre	32
7.5 - Orientação para a Carteira de Investimento no 2º Semestre	32

1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o Relatório Semestral dos investimentos, referente ao 1º SEMESTRE, sobre o desempenho das rentabilidades e os riscos das aplicações financeiras da PREVIPAR.

Este relatório vem atender o **Inciso III, do Art. 3º da Portaria MPS 519/2011**, que exige a elaboração de **Relatórios Semestrais**, para acompanhamento dos riscos e desempenho das aplicações financeiras.

***Art. 3. III** – realizar avaliação do desempenho das aplicações efetuadas por entidade autorizada e credenciada, no mínimo semestralmente, adotando, de imediato, medidas cabíveis no caso da constatação de performance insatisfatória.*

2.1-MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2022 - PREVIPAR

Nº	MESES	SALDO INICIAL	APORTES (Aplicação)	RESGATES	VARIAÇÃO PU - TÍTULOS PÚBLICOS	RENTABILIDADE			SALDO FINAL
						Positiva (a)	Negativa (b)	Consolidado c = (a) - (b)	
1	JANEIRO	43.978.422,53	697.295,06	(352.925,46)	-	261.331,39	(237.995,46)	23.335,93	44.346.128,06
2	FEVEREIRO	44.346.128,06	905.509,32	(239.937,13)	-	329.408,59	(89.519,88)	239.888,71	45.251.588,96
3	MARÇO	45.251.588,96	355.897,24	(210.547,12)	-	1.193.336,71	(31.634,95)	1.161.701,76	46.558.640,84
4	ABRIL	46.558.640,84	508.448,90	(196.335,16)	-	449.797,47	(267.507,32)	182.290,15	47.053.044,73
5	MAIO	47.053.044,73	2.028.343,64	(1.798.359,45)	-	487.969,29	(45.247,55)	442.721,74	47.725.750,67
6	JUNHO	47.725.750,67	339.958,57	(113.753,59)	-	138.690,64	(436.752,59)	(298.061,95)	47.653.893,70
7	JULHO	47.653.893,70	-	-	-	-	-	-	47.653.893,70
8	AGOSTO	47.653.893,70	-	-	-	-	-	-	47.653.893,70
9	SETEMBRO	47.653.893,70	-	-	-	-	-	-	47.653.893,70
10	OUTUBRO	47.653.893,70	-	-	-	-	-	-	47.653.893,70
11	NOVEMBRO	47.653.893,70	-	-	-	-	-	-	47.653.893,70
12	DEZEMBRO	47.653.893,70	-	-	-	-	-	-	47.653.893,70
13	ANO	43.978.422,53	4.835.452,73	(2.911.857,91)	-	2.860.534,10	(1.108.657,75)	1.751.876,35	47.653.893,70

*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

2.2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2022 - LIMITE DE SEGMENTO - PREVIPAR

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.963/2021	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.963/2021	Limites do PAI			Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
RENDA FIXA								
1	Títulos Públicos Federal	Art. 7, I, a (100%)	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
2	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, b (100%)	0,0%	62,0%	100,0%	61,0%	29.057.871,21	-
3	F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Operações	Art. 7, I, c (100%)	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7, II (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
5	F.I. de Renda Fixa	Art. 7, III, a (60%)	0,0%	0,0%	60,0%	29,0%	13.825.435,49	-
6	F.I. de Índice de Renda Fixa	Art. 7, III, b (0%)	0,0%	27,8%	60,0%	0,0%	-	-
7	Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F.	Art. 7, IV (20%)	0,0%	0,0%	20,0%	0,0%	-	-
8	FIDC - Classe Sênior	Art. 7, V, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
9	F.I. Renda Fixa de "Crédito Privado"	Art. 7, V, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
10	F.I. em 85% de Debêntures	Art. 7, V, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
11	TOTAL - RENDA FIXA					90,0%	42.883.306,70	
RENDA VARIÁVEL								
12	F.I. Ações	Art. 8, I (30%)	0,0%	5,8%	30,0%	4,8%	2.276.674,64	-
13	F.I. Ações em Índices de Renda Variável	Art. 8, II (30%)	0,0%	0,0%	30,0%	0,8%	395.168,81	-
14	TOTAL - RENDA VARIÁVEL		Art. 8, §1º (30%)			5,6%	2.671.843,46	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS								
15	F.I. e F.I.C FI Multimercados	Art. 10, I (10%)	0,0%	2,9%	10,0%	2,8%	1.322.450,45	-
16	F.I. em Participações	Art. 10, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
17	F.I. Ações - Mercado de Acesso	Art. 10, III (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
18	TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		Art. 10 (15%)			2,8%	1.322.450,45	
FUNDOS IMOBILIÁRIOS								
19	F.I. Imobiliário	Art. 11 (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
20	TOTAL - FUNDOS IMOBILIÁRIOS		Art. 11 (5%)			0,0%	-	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR								
21	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9º, I (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
22	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	Art. 9º, II (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
23	Fundos de Ações - BDR Nível I	Art. 9º, III (10%)	0,0%	1,6%	10,0%	1,6%	776.293,09	-
24	TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR		Art. 9 (10%)			1,6%	776.293,09	
EMPRÉSTIMO CONSIGNADO								
25	Empréstimo Consignado	Art. 12 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
26	TOTAL - EMPRÉSTIMO CONSIGNADO		Art. 12 (5%)			0,0%	-	
27	DESENQUADRADO	-	100,0%			0,0%	-	-
28	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-				0,0%	-	
29	PATRIMÔNIO TOTAL					100,0%	47.653.893,70	5

3-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

1

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI
CNPJ	13.077.415/0001-05	13.077.418/0001-49	13.322.205/0001-35	03.543.447/0001-03
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Previdência Renda Fixa	Renda Fixa	Previdência Renda Fixa	Renda Fixa Índices
ÍNDICE	CDI	CDI	IDKA 2	IMA - B 5
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ ADM	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ GESTOR	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Banco do Brasil S.A.	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Banco do Brasil S.A.
CNPJ CUSTODIANTE	30.822.936/0001-69	00.000.000/0001-91	30.822.936/0001-69	00.000.000/0001-91
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ DISTRIBUIDOR	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
AUDITORIA	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	KPMG Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	KPMG Auditores independentes
CNPJ AUDITORIA	57.755.217/0001.29	57.755.217/0001.29	49.928.567/0001.11	57.755.217/0001.29
DATA DE INÍCIO	28/04/2011	28/04/2011	28/04/2011	17/12/1999
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,00% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,20%a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	1.000,00	10.000,00	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	Qualquer valor	0,01	Qualquer valor	0,01
RESGATE MÍNIMO	Qualquer valor	0,01	Qualquer valor	0,01
SALDO MÍNIMO	Qualquer valor	0,01	Qualquer valor	0,01
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	2 - Baixo	2 - Baixo	1 - Muito baixo	4 - Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

2

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI
CNPJ	15.486.093/0001-83	07.111.384/0001-69	07.442.078/0001-05	07.861.554/0001-22
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices
ÍNDICE	IPCA + 6,00%	IRF – M	IMA – B	IMA – B
PÚBLICO ALVO	Investidores Qualificados	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ ADM	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ GESTOR	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	BB Gestão de Recursos DTVM s.a.	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ CUSTODIANTE	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil s.a.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ DISTRIBUIDOR	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
AUDITORIA	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores Independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes
CNPJ AUDITORIA	49.928.567/0001.11	49.928.567/0001.11	49.928.567/0001.11	57.755.217/0001.29
DATA DE INÍCIO	27/01/2014	08/12/2004	24/07/2005	09/03/2006
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,15% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,30% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	300.000,00	10.000,00	10.000,00	10.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,00	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor
RESGATE MÍNIMO	0,00	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor
SALDO MÍNIMO	0,00	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor
CARÊNCIA	Até dia 16/05/2023	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	3 - Médio	4 - Alto	5 - Muito Alto	5 - Muito Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

7

3

INFORMAÇÕES	BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC FI	BB AÇÕES AGRO FIC FI	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC FI	BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO FIC FI
CNPJ	05.962.491/0001-75	40.054.357/0001-77	05.100.221/0001-55	08.973.948/0001-35
SEGMENTO	Investimentos Estruturados	Renda Variável	Renda Variável	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	Multimercados Macro	Fundo de Ações	Ações Small Caps	Ações Setoriais
ÍNDICE	Multimercado	IBOV	SMLL	IFNC
PÚBLICO ALVO	Regime Próprio de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Público em geral	Público em geral
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ ADM	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ GESTOR	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
CUSTODIANTE	BANCO DO BRASIL S.A.	Banco do Brasil S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.
CNPJ CUSTODIANTE	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91
DISTRIBUIDOR	BANCO DO BRASIL S.A.	Banco do Brasil S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.
CNPJ DISTRIBUIDOR	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
AUDITORIA	KPMG Auditores independentes	KPMG Auditores Independentes	KPMG Auditores independentes	KPMG Auditores independentes
CNPJ AUDITORIA	57.755.217/0001-29	57.755.217/0001-29	57.755.217/0001.25	57.755.217/0001.27
DATA DE INÍCIO	08/12/2003	11/02/2021	18/07/2002	02/10/2007
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,00% a.a.	1,00% a.a.	2,00% a.a.	2,00% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	20% IBOV	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	0,00	0,01	200,00	0,01
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,00	0,01	200,00	0,01
RESGATE MÍNIMO	0,00	0,01	200,00	0,01
SALDO MÍNIMO	0,00	0,01	200,00	0,01
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	4 - Alto	4 - Alto	5 - Muito Alto	5 - Muito Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações em Índices de Renda Variável, Art. 8, II (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

8

4

INFORMAÇÕES	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP
CNPJ	36.178.569/0001-99	21.470.644/0001-13	05.164.356/0001-84	14.386.926/0001-71
SEGMENTO	Renda Variável	Investimento no Exterior	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Ações	Fundo de Ações	Renda Fixa	Renda Fixa índices
ÍNDICE	S&P500	BDR	CDI	IDKA 2
PÚBLICO ALVO	Pessoas físicas e jurídicas e Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprio de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
CNPJ ADM	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	CAIXA ASSET DTVM	CAIXA ASSET DTVM
CNPJ GESTOR	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40
CUSTODIANTE	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
CNPJ CUSTODIANTE	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
CNPJ DISTRIBUIDOR	-	00.000.000/0001-91	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
AUDITORIA	-	KPMG Auditores Independentes	kPMG Auditores independentes	kPMG Auditores independentes
CNPJ AUDITORIA	0	57.755.217/0001-29	57.755.217/0001.29	57.755.217/0001.29
DATA DE INÍCIO	04/05/2020	22/01/2015	10/02/2006	16/08/2012
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,00% a.a.	0,50% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	10% do S&P 500	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	0,01	200,00	1.000,00	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	200,00	0	0,00
RESGATE MÍNIMO	0,01	0,01	0	0,00
SALDO MÍNIMO	0,01	200,00	0	0,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO*	4 - Alto	5 - Muito Alto	1 - Muito baixo	3 - Médio
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

9

5

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	FI AÇÕES CAIXA INFRAESTRUTURA
CNPJ	11.060.913/0001-10	10.577.503/0001-88	10.740.658/0001-93	10.551.382/0001-03
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa Índices	Renda Fixa Índices	Renda Fixa Índices	AÇÕES SETORIAIS
ÍNDICE	IMA - B 5	IMA - B 5 +	IMA - B	IBOV
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Investidores Qualificados	Regimes Próprios de Previdência Social	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
CNPJ ADM	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
GESTOR	CAIXA ASSET DTVM	CAIXA ASSET DTVM	CAIXA ASSET DTVM	CAIXA ASSET DTVM
CNPJ GESTOR	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40	42.040.639/0001-40
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
CNPJ CUSTODIANTE	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
CNPJ DISTRIBUIDOR	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
AUDITORIA	kPMG Auditores independentes	Ernst & Young Terco Auditores Independentes	kPMG Auditores independentes	KPMG Auditores Independentes
CNPJ AUDITORIA	57.755.217/0001.29	0	57.755.217/0001.29	57.755.217/0001-29
DATA DE INÍCIO	09/07/2010	18/04/2012	08/03/2010	19/04/2010
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.	2,00% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	1.000,00	1.000,00	100,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,00	Qualquer valor	0,00	100,00
RESGATE MÍNIMO	0,00	Qualquer valor	0,00	100,00
SALDO MÍNIMO	0,00	Qualquer valor	0,00	50,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	2 - Baixo	3 - Médio	3 - Médio	4 - Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

10

6

INFORMAÇÕES	FI AÇÕES CAIXA PETROBRAS	BRADESCO FIC FI RF REF DI PODER PUBLICO	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	BRADESCO FI AÇÕES SUSTENTABILIDADE EMPRESARIAL
CNPJ	03.914.671/0001-56	07.187.570/0001-81	03.256.793/0001-00	07.187.751/0001-08
SEGMENTO	Renda Variável	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Ações	Referenciados - DI	Referenciado DI	Ações Sustentab/Governança
ÍNDICE	PETR3	CDI	CDI	IGC
PÚBLICO ALVO	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de Previdência Social	Clientes pessoa jurídica	Público em geral	Regimes Próprio de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal	Banco Bradesco s.a	Banco Bradesco s.a	BEM - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda
CNPJ ADM	00.360.305/0001-04	60.746.948/0001-12	60.746.948/0001-12	00.066.670/0001-00
GESTOR	CAIXA ASSET DTVM	BRAM - Bradesco Asset Management DTVM	BRAM – Bradesco Asset Management	BRAM - Bradesco Asset Management DTVM
CNPJ GESTOR	42.040.639/0001-40	62.375.134/0001-44	62.375.134/0001-44	62.375.134/0001-44
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal	Bradesco S.A.	Banco Bradesco S.A.	Banco Bradesco SA
CNPJ CUSTODIANTE	00.360.305/0001-04	60.746.948/0001-12	00.360.305/0001-04	60.746.948/0001-12
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal	Bradesco S.A.	Banco Bradesco S.A.	Banco Bradesco SA
CNPJ DISTRIBUIDOR	00.360.305/0001-04	60.746.948/0001-12	60.746.948/0001-12	60.746.948/0001-12
AUDITORIA	KPMG Auditores Independentes	KPMG Auditores Independentes	PricewaterhouseCoopers Auditores Independentes	KPMG Auditores Independentes
CNPJ AUDITORIA	57.755.217/0001.29	57.755.217/0001.29	0	57.755.217/0001-29
DATA DE INÍCIO	10/07/2000	12/04/2005	02/08/1999	30/11/2007
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,50% a.a.	0,90% a.a.	0,15% a.a.	1,00% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	50.000,00	Qualquer Valor	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	100,00	1.000,00	Qualquer Valor	1.000,00
RESGATE MÍNIMO	100,00	15,00	Qualquer Valor	100,00
SALDO MÍNIMO	100,00	15,00	Qualquer Valor	100,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	4 - Alto	2 - Baixo	2 - Baixo	4 - Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

4.1 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP						
1	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	3.282.699,62	-	-	24.854,55	3.257.845,07	-0,763%
FEVEREIRO	3.257.845,07	-	-	17.170,14	3.275.015,21	0,524%
MARÇO	3.275.015,21	-	-	100.317,90	3.375.333,11	2,972%
ABRIL	3.375.333,11	-	-	27.052,02	3.402.385,13	0,795%
MAIO	3.402.385,13	-	-	32.863,83	3.435.248,96	0,957%
JUNHO	3.435.248,96	-	-	12.998,97	3.422.249,99	-0,380%

FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP						
2	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	246.914,52	-	-	223,16	247.137,68	0,090%
FEVEREIRO	247.137,68	-	-	2.597,23	249.734,91	1,040%
MARÇO	249.734,91	-	-	6.458,98	256.193,89	2,521%
ABRIL	256.193,89	-	-	3.934,63	260.128,52	1,513%
MAIO	260.128,52	-	-	1.989,05	262.117,57	0,759%
JUNHO	262.117,57	-	-	874,37	262.991,94	0,332%

FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP						
3	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	298.193,44	-	-	56,09	298.249,53	0,019%
FEVEREIRO	298.249,53	40.903,41	-	3.574,03	342.726,97	1,043%
MARÇO	342.726,97	-	-	9.001,62	351.728,59	2,559%
ABRIL	351.728,59	-	-	4.925,87	356.654,46	1,381%
MAIO	356.654,46	-	-	3.042,89	359.697,35	0,846%
JUNHO	359.697,35	-	-	806,94	360.504,29	0,224%

FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP						
4	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.131.264,21	-	-	18.308,87	1.112.955,34	-1,645%
FEVEREIRO	1.112.955,34	-	-	235,35	1.113.190,69	0,021%
MARÇO	1.113.190,69	-	-	39.296,96	1.152.487,65	3,410%
ABRIL	1.152.487,65	-	-	527,36	1.153.015,01	0,046%
MAIO	1.153.015,01	-	-	13.102,31	1.166.117,32	1,124%
JUNHO	1.166.117,32	-	-	12.825,43	1.153.291,89	-1,112%

FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP						
5	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.801.139,78	-	-	14.302,26	1.815.442,04	0,788%
FEVEREIRO	1.815.442,04	-	-	15.922,80	1.831.364,84	0,869%
MARÇO	1.831.364,84	-	-	16.134,23	1.847.499,07	0,873%
ABRIL	1.847.499,07	-	-	13.798,45	1.861.297,52	0,741%
MAIO	1.861.297,52	-	-	19.985,24	1.881.282,76	1,062%
JUNHO	1.881.282,76	-	-	19.253,81	1.900.536,57	1,013%

4.2 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - BANCO DO BRASIL

BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI						
6	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	21.669,38	46.380,73	- 32.327,46	273,91	35.996,56	0,761%
FEVEREIRO	35.996,56	26.270,92	- 17.622,49	291,04	44.936,03	0,648%
MARÇO	44.936,03	26.353,93	- 28.775,36	413,61	42.928,21	0,963%
ABRIL	42.928,21	26.338,13	- 22.267,18	367,04	47.366,20	0,775%
MAIO	47.366,20	24.764,31	- 44.134,61	398,46	28.394,36	1,403%
JUNHO	28.394,36	18.298,83	- 13.169,71	400,36	33.923,84	1,180%

BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI						
7	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	93.257,33	-	-	730,54	93.987,87	0,777%
FEVEREIRO	93.987,87	-	-	750,32	94.738,19	0,792%
MARÇO	94.738,19	-	-	912,87	95.651,06	0,954%
ABRIL	95.651,06	-	-	748,11	96.399,17	0,776%
MAIO	96.399,17	-	-	1.027,78	97.426,95	1,055%
JUNHO	97.426,95	-	-	999,52	98.426,47	1,015%

BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI						
8	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	6.439.369,36	-	-	4.946,27	6.444.315,63	0,077%
FEVEREIRO	6.444.315,63	-	-	67.946,37	6.512.262,00	1,043%
MARÇO	6.512.262,00	-	-	167.931,19	6.680.193,19	2,514%
ABRIL	6.680.193,19	-	-	102.038,74	6.782.231,93	1,505%
MAIO	6.782.231,93	-	-	52.215,51	6.834.447,44	0,764%
JUNHO	6.834.447,44	-	-	21.712,32	6.856.159,76	0,317%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI						
9	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	6.363.804,90	-	-	48.189,41	6.315.615,49	-0,763%
FEVEREIRO	6.315.615,49	-	-	34.700,63	6.350.316,12	0,546%
MARÇO	6.350.316,12	-	-	195.216,57	6.545.532,69	2,982%
ABRIL	6.545.532,69	-	-	55.293,98	6.600.826,67	0,838%
MAIO	6.600.826,67	-	-	61.088,04	6.661.914,71	0,917%
JUNHO	6.661.914,71	-	-	27.063,75	6.634.850,96	-0,408%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI						
10	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	745.426,69	-	-	948,76	744.477,93	-0,127%
FEVEREIRO	744.477,93	-	-	4.227,89	748.705,82	0,565%
MARÇO	748.705,82	-	-	6.321,66	755.027,48	0,837%
ABRIL	755.027,48	-	-	779,76	754.247,72	-0,103%
MAIO	754.247,72	200.000,00	-	5.783,32	960.031,04	0,602%
JUNHO	960.031,04	-	-	3.248,37	963.279,41	0,337%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI						
11	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	6.771.703,33	-	-	51.999,06	6.719.704,27	-0,774%
FEVEREIRO	6.719.704,27	-	-	35.854,49	6.755.558,76	0,531%
MARÇO	6.755.558,76	-	-	203.330,49	6.958.889,25	2,922%
ABRIL	6.958.889,25	-	-	55.925,19	7.014.814,44	0,797%
MAIO	7.014.814,44	-	-	67.304,85	7.082.119,29	0,950%
JUNHO	7.082.119,29	-	-	24.981,11	7.057.138,18	-0,354%

BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA						
12	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.172.113,86	-	-	1.030,96	1.173.144,82	0,088%
FEVEREIRO	1.173.144,82	-	-	16.225,91	1.189.370,73	1,364%
MARÇO	1.189.370,73	-	-	28.686,84	1.218.057,57	2,355%
ABRIL	1.218.057,57	-	-	27.146,35	1.245.203,92	2,180%
MAIO	1.245.203,92	-	35.052,48	6.524,01	1.216.675,45	0,536%
JUNHO	1.216.675,45	-	-	3.984,85	1.220.660,30	0,326%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI						
13	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	5.361.135,78	-	-	516,36	5.361.652,14	0,010%
FEVEREIRO	5.361.652,14	-	-	62.017,31	5.423.669,45	1,143%
MARÇO	5.423.669,45	-	-	142.108,96	5.565.778,41	2,553%
ABRIL	5.565.778,41	-	-	82.589,75	5.648.368,16	1,462%
MAIO	5.648.368,16	-	-	43.774,71	5.692.142,87	0,769%
JUNHO	5.692.142,87	-	-	15.147,14	5.707.290,01	0,265%

BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI						
14	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.379.673,27	503.556,64	- 173.240,31	11.402,07	1.721.391,67	0,662%
FEVEREIRO	1.721.391,67	690.977,30	- 181.411,23	14.677,41	2.245.635,15	0,654%
MARÇO	2.245.635,15	329.543,31	- 181.771,76	19.834,14	2.413.240,84	0,822%
ABRIL	2.413.240,84	482.110,77	- 174.067,98	19.416,56	2.740.700,19	0,708%
MAIO	2.740.700,19	468.526,85	- 1.719.172,36	15.385,94	1.505.440,62	1,022%
JUNHO	1.505.440,62	321.659,74	- 100.583,88	16.420,15	1.742.936,63	0,942%

BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI						
15	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	4.070.039,81	-	-	31.882,97	4.101.922,78	0,777%
FEVEREIRO	4.101.922,78	-	-	32.746,38	4.134.669,16	0,792%
MARÇO	4.134.669,16	-	-	39.840,57	4.174.509,73	0,954%
ABRIL	4.174.509,73	-	-	32.649,59	4.207.159,32	0,776%
MAIO	4.207.159,32	600.000,00	-	50.991,13	4.858.150,45	1,050%
JUNHO	4.858.150,45	-	-	49.840,33	4.907.990,78	1,015%

4.4 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - BRADESCO

BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA						
16	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	-	-	-	-	-	-
FEVEREIRO	-	147.357,69	-	967,40	148.325,09	0,652%
MARÇO	148.325,09	-	-	1.335,12	149.660,21	0,892%
ABRIL	149.660,21	-	-	1.049,79	150.710,00	0,697%
MAIO	150.710,00	-	-	1.540,26	152.250,26	1,012%
JUNHO	152.250,26	-	-	1.518,61	153.768,87	0,988%

BRADESCO FIC FI RF REF DI PODER PUBLICO						
17	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	-	-	-	-	-	-
FEVEREIRO	-	-	-	-	-	-
MARÇO	-	-	-	-	-	-
ABRIL	-	-	-	-	-	-
MAIO	-	400.000,00	-	3.604,00	403.604,00	0,893%
JUNHO	403.604,00	-	-	3.702,81	407.306,81	0,909%

4.7 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - RENDA VARIÁVEL

BRADESCO FI AÇÕES SUSTENTABILIDADE EMPRESARIAL

1	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	325.311,64	147.357,69	- 147.357,69	19.128,16	344.439,80	5,553%
FEVEREIRO	344.439,80	-	-	6.335,03	338.104,76	-1,874%
MARÇO	338.104,76	-	-	21.176,79	359.281,55	5,894%
ABRIL	359.281,55	-	-	34.760,95	324.520,60	-10,711%
MAIO	324.520,60	-	-	7.178,71	331.699,31	2,164%
JUNHO	331.699,31	-	-	41.185,40	290.513,91	-14,177%

FI AÇÕES CAIXA INFRAESTRUTURA

2	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	517.056,26	-	-	21.720,95	538.777,21	4,032%
FEVEREIRO	538.777,21	-	-	744,16	539.521,37	0,138%
MARÇO	539.521,37	-	-	43.585,12	583.106,49	7,475%
ABRIL	583.106,49	-	-	31.944,83	551.161,66	-5,796%
MAIO	551.161,66	-	-	17.611,82	568.773,48	3,096%
JUNHO	568.773,48	-	-	58.792,13	509.981,35	-11,528%

BB AÇÕES SMALL CAPS FIC FI

3	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	489.288,15	-	-	21.191,89	510.480,04	4,151%
FEVEREIRO	510.480,04	-	-	28.277,36	482.202,68	-5,864%
MARÇO	482.202,68	-	-	45.443,61	527.646,29	8,613%
ABRIL	527.646,29	-	-	43.230,57	484.415,72	-8,924%
MAIO	484.415,72	-	-	11.099,69	473.316,03	-2,345%
JUNHO	473.316,03	-	-	78.147,22	395.168,81	-19,776%

BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC FI

4	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.252.897,16	-	-	16.521,33	1.269.418,49	1,301%
FEVEREIRO	1.269.418,49	-	-	11.920,92	1.281.339,41	0,930%
MARÇO	1.281.339,41	-	-	16.286,23	1.297.625,64	1,255%
ABRIL	1.297.625,64	-	-	15.238,96	1.312.864,60	1,161%
MAIO	1.312.864,60	-	-	10.323,98	1.323.188,58	0,780%
JUNHO	1.323.188,58	-	-	738,13	1.322.450,45	-0,056%

BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO FIC FI

5	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	483.097,70	-	-	81.093,81	564.191,51	14,373%
FEVEREIRO	564.191,51	-	-	8.044,27	556.147,24	-1,446%
MARÇO	556.147,24	-	-	40.296,36	596.443,60	6,756%
ABRIL	596.443,60	-	-	71.540,94	524.902,66	-13,629%
MAIO	524.902,66	35.052,48	-	33.811,63	593.766,77	5,694%
JUNHO	593.766,77	-	-	74.641,59	519.125,18	-14,378%

BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I

6	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	673.246,66	-	-	70.968,80	602.277,86	-11,783%
FEVEREIRO	602.277,86	-	-	34.640,04	567.637,82	-6,102%
MARÇO	567.637,82	-	-	24.080,06	543.557,76	-4,430%
ABRIL	543.557,76	-	-	33.897,89	509.659,87	-6,651%
MAIO	509.659,87	300.000,00	-	34.147,86	775.512,01	-4,403%
JUNHO	775.512,01	-	-	781,08	776.293,09	0,101%

BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA

7	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	420.228,64	-	-	22.726,01	397.502,63	-5,717%
FEVEREIRO	397.502,63	-	-	10.185,95	387.316,68	-2,630%
MARÇO	387.316,68	-	-	18.296,29	405.612,97	4,511%
ABRIL	405.612,97	-	-	35.067,61	370.545,36	-9,464%
MAIO	370.545,36	-	-	2.592,73	373.138,09	0,695%
JUNHO	373.138,09	-	-	27.774,82	345.363,27	-8,042%

BB AÇÕES AGRO FIC FI

8	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	404.889,83	-	-	1.175,86	406.065,69	0,290%
FEVEREIRO	406.065,69	-	-	2.037,23	404.028,46	-0,504%
MARÇO	404.028,46	-	-	31.110,59	435.139,05	7,150%
ABRIL	435.139,05	-	-	16.284,77	418.854,28	-3,888%
MAIO	418.854,28	-	-	13.010,41	431.864,69	3,013%
JUNHO	431.864,69	-	-	57.846,84	374.017,85	-15,466%

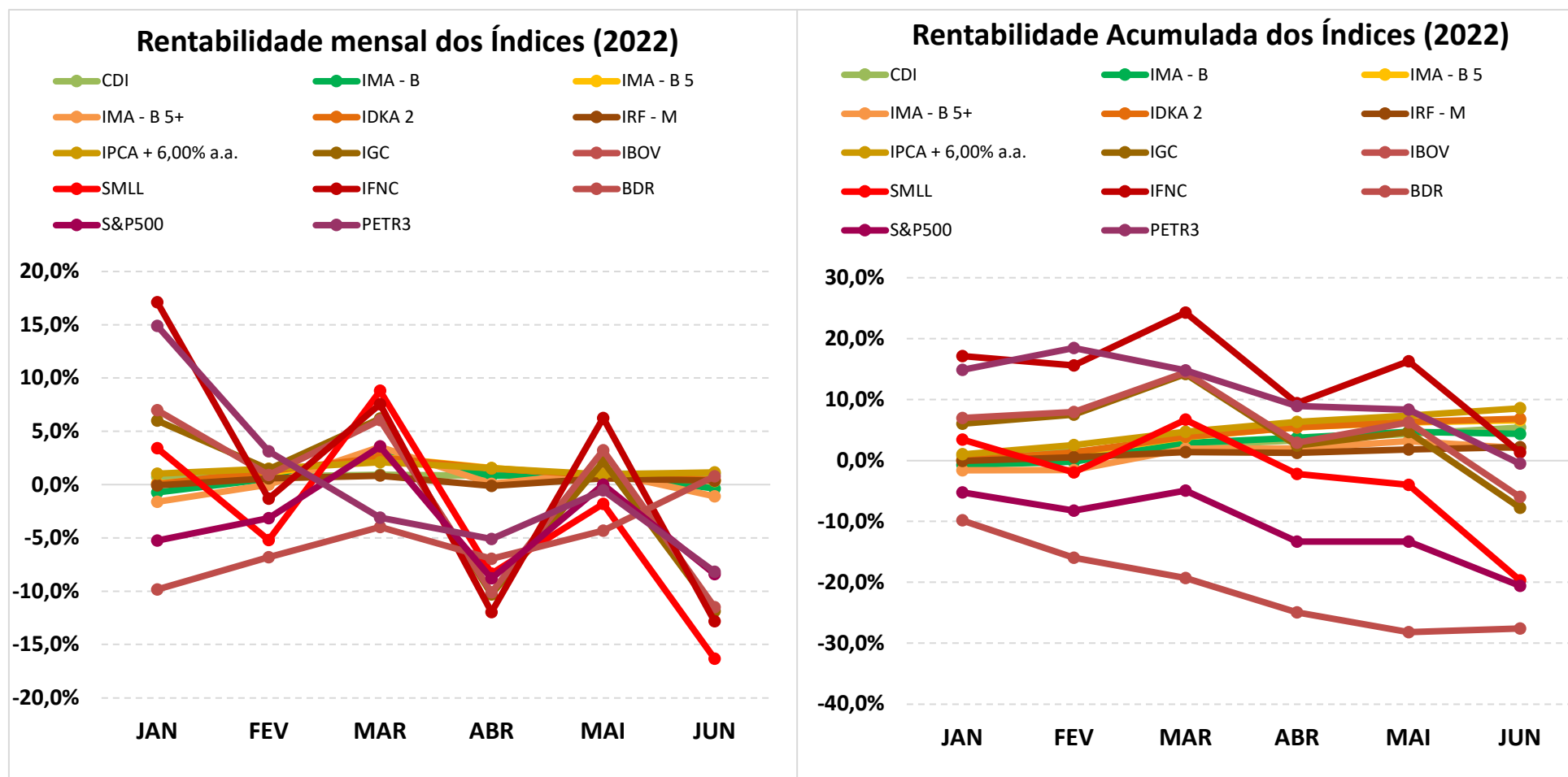
FI AÇÕES CAIXA PETROBRAS

9	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	234.001,21	-	-	35.134,80	269.136,01	13,055%
FEVEREIRO	269.136,01	-	40.903,41	6.838,82	235.071,42	2,909%
MARÇO	235.071,42	-	-	7.554,88	227.516,54	-3,321%
ABRIL	227.516,54	-	-	7.095,08	234.611,62	3,024%
MAIO	234.611,62	-	-	22.818,68	257.430,30	8,864%
JUNHO	257.430,30	-	-	19.757,22	237.673,08	-8,313%

5-TABELA DE RENTABILIDADE

Nº	INVESTIMENTOS	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	ACUMULADO
1	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	0,65%	0,68%	0,83%	0,73%	0,95%	0,93%	4,87%
2	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,78%	0,80%	0,96%	0,78%	1,07%	1,03%	5,54%
3	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	0,01%	1,16%	2,62%	1,48%	0,77%	0,27%	6,45%
4	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	0,08%	1,05%	2,58%	1,53%	0,77%	0,32%	6,48%
5	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA	0,09%	1,38%	2,41%	2,23%	0,51%	0,33%	7,13%
6	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	-0,13%	0,57%	0,84%	-0,10%	0,58%	0,34%	2,11%
7	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	-0,77%	0,53%	3,01%	0,80%	0,96%	-0,35%	4,21%
8	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	-0,76%	0,55%	3,07%	0,84%	0,93%	-0,41%	4,25%
9	BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC FI	1,32%	0,94%	1,27%	1,17%	0,79%	-0,06%	5,54%
10	BB AÇÕES AGRO FIC FI	0,29%	-0,50%	7,70%	-3,74%	3,11%	-13,39%	-7,62%
11	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC FI	4,33%	-5,54%	9,42%	-8,19%	-2,29%	-16,51%	-19,23%
12	BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO FIC FI	16,79%	-1,43%	7,24%	-11,99%	6,10%	-12,57%	0,79%
13	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	-5,41%	-2,56%	4,72%	-8,65%	0,70%	-7,44%	-17,82%
14	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	-10,54%	-5,75%	-4,24%	-6,24%	-3,68%	0,10%	-27,01%
15	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,79%	0,88%	0,88%	0,75%	1,07%	1,02%	5,51%
16	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	0,02%	1,15%	2,63%	1,40%	0,85%	0,22%	6,41%
17	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	0,09%	1,05%	2,59%	1,54%	0,76%	0,33%	6,51%
18	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP	-1,62%	0,02%	3,53%	0,05%	1,14%	-1,10%	1,95%
19	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	-0,76%	0,53%	3,06%	0,80%	0,97%	-0,38%	4,24%
20	FI AÇÕES CAIXA INFRAESTRUTURA	4,20%	0,14%	8,08%	-5,48%	3,20%	-10,34%	-1,37%
21	FI AÇÕES CAIXA PETROBRAS	14,71%	3,00%	-3,21%	3,12%	9,73%	-7,67%	19,46%
22	BRADESCO FIC FI RF REF DI PODER PUBLICO	0,66%	0,69%	0,81%	0,63%	0,94%	0,92%	4,74%
23	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	0,74%	0,76%	0,90%	0,70%	1,02%	1,00%	5,23%
24	BRADESCO FI AÇÕES SUSTENTABILIDADE EMPRESARIAL	5,03%	-1,84%	6,26%	-9,68%	2,21%	-12,42%	-11,43%
	CDI	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	5,42%
	IMA - B	-0,73%	0,54%	3,07%	0,83%	0,96%	-0,36%	4,35%
	IMA - B 5	0,11%	1,06%	2,61%	1,56%	0,78%	0,33%	6,61%
	IMA - B 5+	-1,61%	0,01%	3,56%	0,08%	1,16%	-1,10%	2,03%
	IDKA 2	0,05%	1,26%	2,54%	1,51%	0,85%	0,47%	6,85%
	IRF - M	-0,08%	0,58%	0,84%	-0,12%	0,58%	0,37%	2,19%
	IPCA + 6,00% a.a.	1,03%	1,50%	2,11%	1,55%	0,96%	1,16%	8,58%
	IGC	6,01%	1,43%	6,21%	-10,31%	2,17%	-11,86%	-7,76%
	IBOV	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	-5,99%
	SMLL	3,42%	-5,19%	8,81%	-8,36%	-1,82%	-16,33%	-19,68%
	IFNC	17,12%	-1,31%	7,53%	-11,96%	6,25%	-12,83%	1,35%
	BDR	-9,83%	-6,82%	-3,98%	-6,96%	-4,32%	0,79%	-27,61%
	S&P500	-5,26%	-3,14%	3,58%	-8,80%	0,01%	-8,39%	-20,58%
	PETR3	14,89%	3,12%	-3,11%	-5,11%	-0,54%	-8,18%	-0,53%

GRÁFICO COMPARATIVO DE RENTABILIDADE DOS ÍNDICES

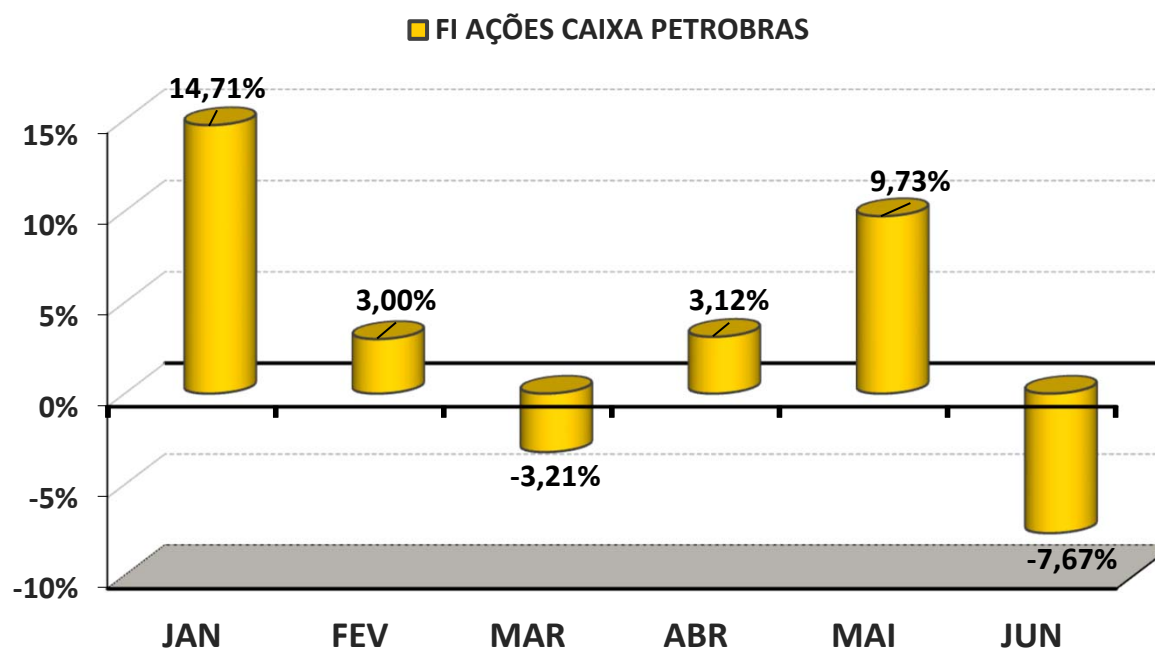


5.1-MELHOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDO DE INVESTIMENTO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
FI AÇÕES CAIXA PETROBRAS	14,71%	3,00%	-3,21%	3,12%	9,73%	-7,67%

Comportamento MENSAL no Semestre

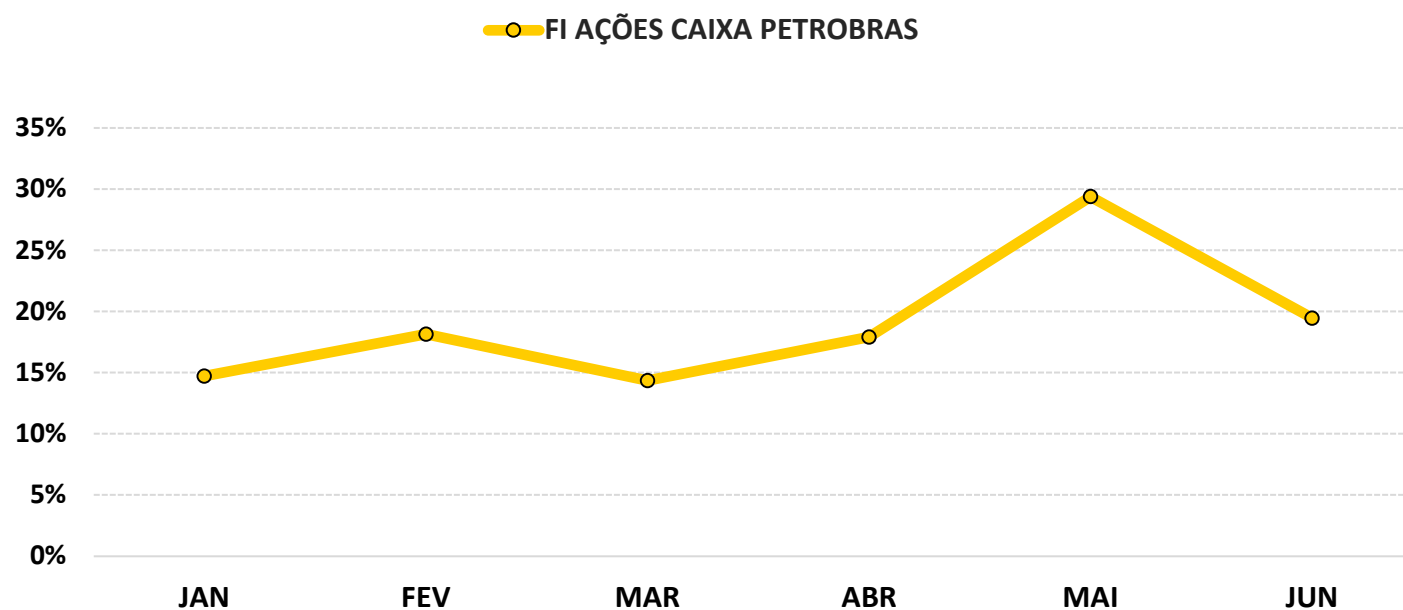


5.1-MELHOR DESEMPENHO ACUMULADO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDO DE INVESTIMENTO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
FI AÇÕES CAIXA PETROBRAS	14,71%	18,15%	14,35%	17,92%	29,39%	19,46%

Comportamento ACUMULADO no Semestre

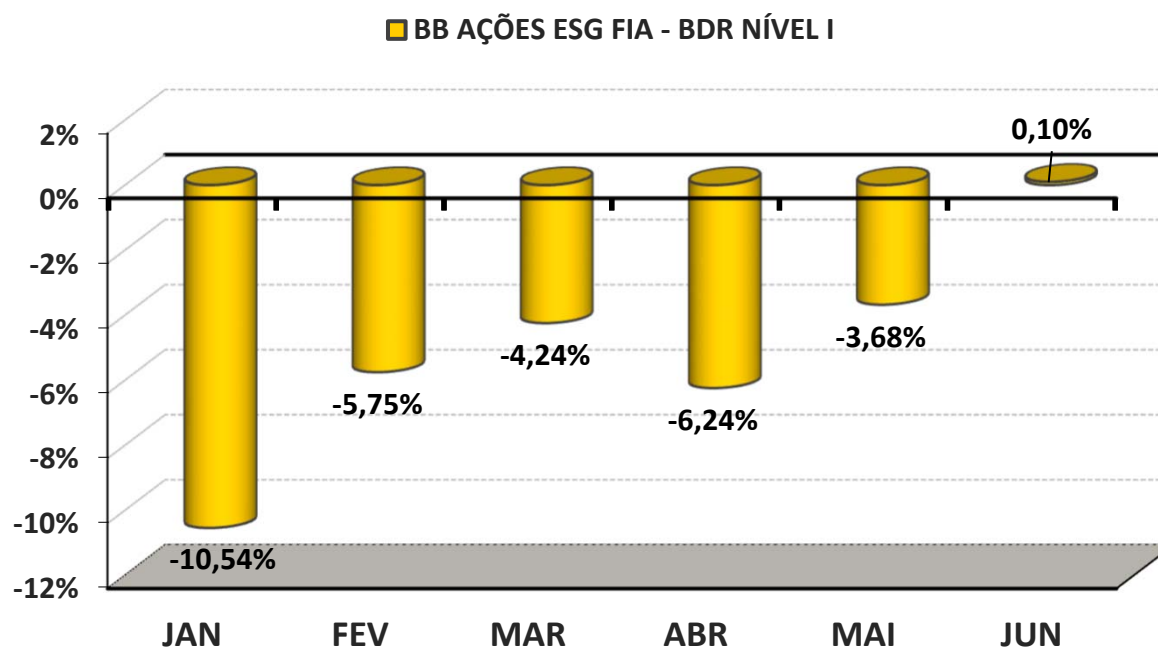


5.2-PIOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDO DE INVESTIMENTO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	-10,54%	-5,75%	-4,24%	-6,24%	-3,68%	0,10%

Comportamento MENSAL no Semestre

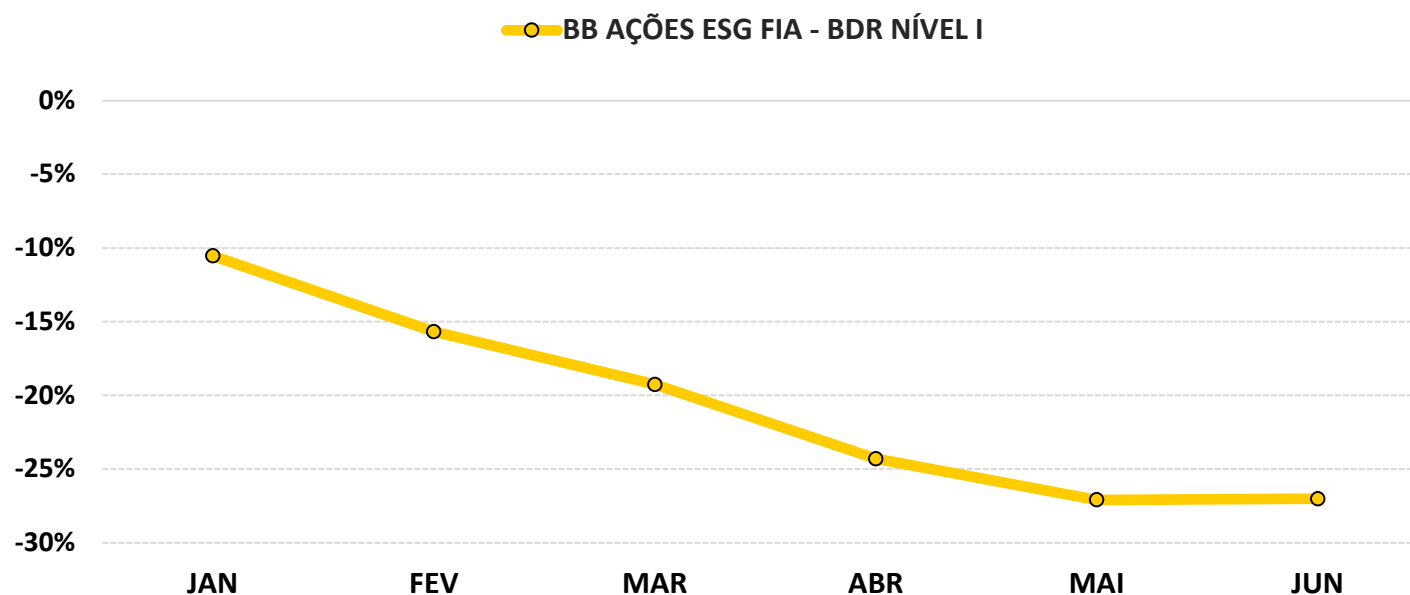


5.2-PIOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDO DE INVESTIMENTO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	-10,54%	-15,69%	-19,26%	-24,30%	-27,08%	-27,01%

Comportamento ACUMULADO no Semestre



6-ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - 1º SEMESTRE - 2022

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
MENSAL	0,05%	0,54%	2,57%	0,39%	0,94%	-0,62%
CDI	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%
IBOVESPA	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%
META ATUARIAL	0,94%	1,41%	2,02%	1,46%	0,87%	1,07%

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN
ACUMULADO DO SEMESTRE	0,05%	0,59%	3,18%	3,58%	4,56%	3,90%
CDI	0,73%	1,50%	2,44%	3,29%	4,35%	5,42%
IBOVESPA	6,98%	7,93%	14,47%	2,91%	6,22%	-5,99%
META ATUARIAL	0,94%	2,37%	4,44%	5,96%	6,89%	8,03%

RENTABILIDADE ACUMULADA DO SEMESTRE DA PREVIPAR:

R\$ 1.751.876,35

META ATUARIAL ACUMULADA DO SEMESTRE:

R\$ 3.557.580,60

DEFASAGEM PARA O CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL:

R\$ (1.805.704,25)

7-CONCLUSÃO

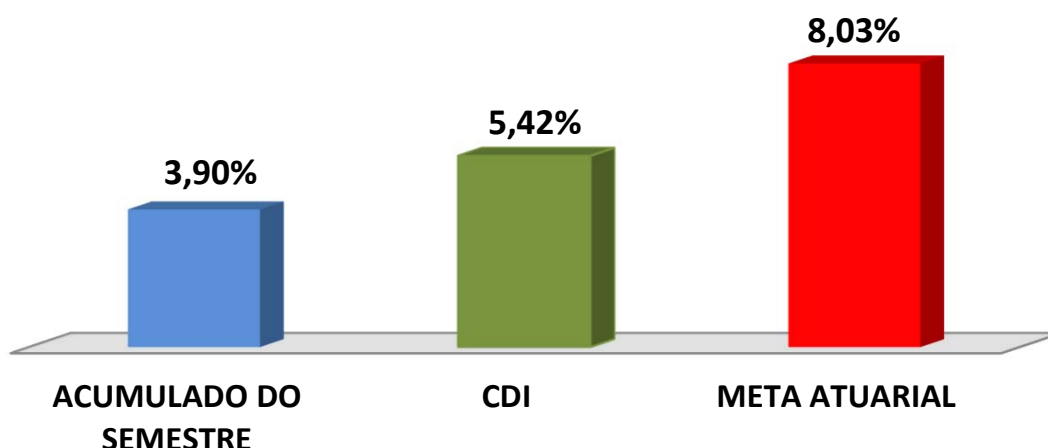
Atendendo o Art. 3, III, da Portaria MPS 519, detalhado na página 3 deste relatório, segue uma análise do desempenho da Carteira de Investimento da PREVIPAR, no 1º Semestre/2022, analisando rentabilidade, risco das operações e aderência ao PAI/2022.

7.1.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA SEMESTRAL

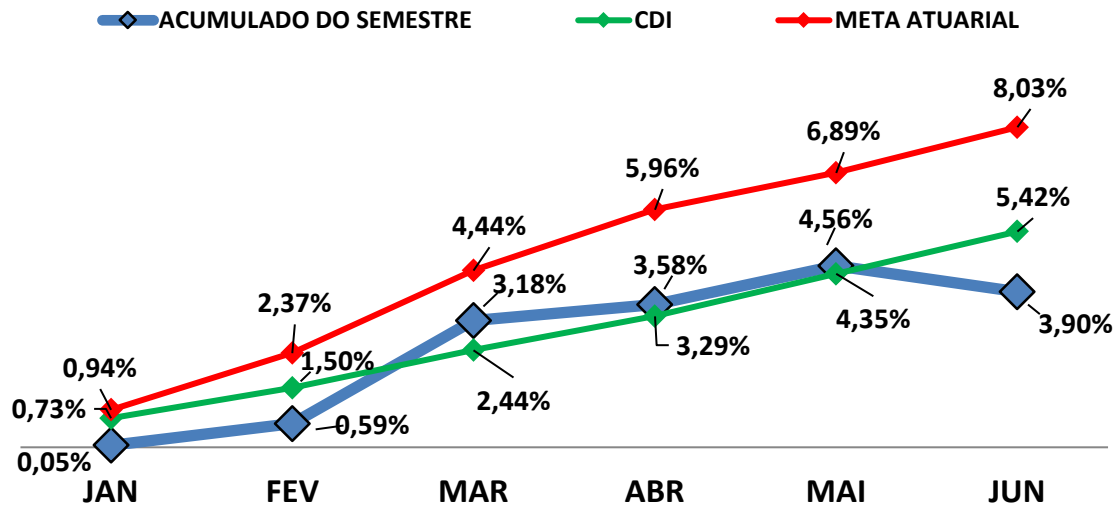
A Carteira de Investimentos da PREVIPAR, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada no semestre de 3,90% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado no semestre de 5,42% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou no período, uma rentabilidade de 72,03% sobre o índice de referência do mercado.

GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL

Rentabilidade Acumulada no Semestre



Rentabilidade Acumulada no Semestre

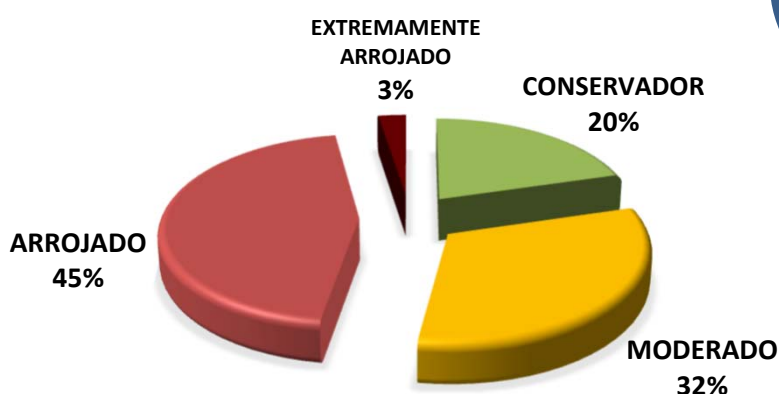


7.2-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada no semestre da PREVIPAR é de 3,90% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 8,03%, representando 48,58% sobre a Meta Atuarial.

7.3-PERFIL DE RISCO DO INVESTIDOR

PERFIL DOS INVESTIMENTOS



PERFIL 6
MODERADO COM
TENDÊNCIA
ARROJADA

Descrição do Perfil de Investidor

Objetivo do perfil

Perfil que tem o objetivo de buscar ganhos acima da inflação. A carteira possui uma grande concentração de ativos moderados, mas busca investir um pouco em ativos arrojados. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo (como Planos de Previdência) é o perfil mais indicado.

Comportamento da carteira

A carteira com perfil MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA, busca investimentos que rentabilizam acima da inflação, mas que podem apresentar rentabilidades negativas no curto prazo. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo é o perfil mais indicado, pois os investimentos podem oferecer ganhos mais vultuosos no médio e longo prazo. Esse tipo de perfil é o mais equilibrado, entre cumprir a Meta Atuarial e se proteger um pouco das oscilações de mercado.

Classificação de Perfil de Investidor - Metodologia Atuarial Consultoria

CONSERVADOR	1	EXTREMAMENTE CONSERVADOR
	2	CONSERVADOR
	3	CONSERVADOR COM TENDÊNCIA MODERADA
MODERADO	4	MODERADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	5	MODERADO
	6	MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA
ARROJADO	7	ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	8	ARROJADO COM TENDÊNCIA MODERADA
	9	ARROJADO
	10	EXTREMAMENTE ARROJADO

7.4-AVALIAÇÃO DE DESEMPENHO NO 1º SEMESTRE

No 1º trimestre e 2º trimestre, o RPPS optou por uma carteira com perfil 6 - Moderado com Tendência Arrojada. Por conta do fraco desempenho da atividade econômica e da pressão de elevação da inflação, tanto a nível nacional quanto internacional, o mercado financeiro e de capitais apresentou desempenho modesto. Por conta do risco de perpetuação da guerra na Ucrânia, aliado ao risco de recessão dos E.U.A e problemas de choques de oferta na Europa, os índices de Renda Variável e Investimento no Exterior apresentaram desvalorização entre -6,00% a -30,00%. Já a Renda Fixa, apresentou um melhor desempenho, cujos índices valorizaram entre +2,00% a +7,00%. Como a carteira do RPPS possui grande concentração em Renda Fixa, isso ajudou a carteira a apresentar desempenho positivo.

7.5-ORIENTAÇÃO PARA A CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO 2º SEMESTRE

Com relação a Renda Fixa, a iminência de encerramento do ciclo de alta da Taxa Selic parece estar chegando ao fim. O mercado financeiro projeta a Taxa Selic finalizando 2022 próximo de 14,00% a.a., com isso, os Ativos de Juros Pré-Fixados (como os sub-índices IMA) tendem a apresentar melhor desempenho do que o verificado no 1º semestre/2022. Outro ativo recomendado em períodos de Juros altos são os investimentos atrelados ao DI.

Com relação a Investimento no Exterior, segundo a ata do COPOM, o ambiente externo segue se deteriorando, marcado por revisões negativas para o crescimento global, decorrente da persistente pressão inflacionária. Essas pressões são decorrentes da recuperação global após a pandemia, aliado aos problemas geopolíticos que prolongaram ainda mais o processo de normalização da economia global. A reorganização das cadeias de produção globais devem demorar um pouco mais, impulsionadas pela guerra na Ucrânia. Na visão do COPOM, esses desdobramentos podem ter consequências de longo prazo e se traduzir em pressões inflacionárias mais prolongadas. Assim, orientamos o RPPS a priorizar Investimentos atrelados ao DI, uma pequena distribuição de recursos em Investimentos Pré-Fixados, assim como de Renda Variável Brasileira e evitar Investimentos no Exterior, pelo menos até o fim do 3º Trimestre/2022.

As orientações e análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 4.963/2021**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

É o Relatório.


Igor França Garcia
Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA
Consultor de Investimentos credenciado pela CVM