

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2022

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	2.121.694,83	2,50%	241	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	13.850.265,49	16,30%	161	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.002.215,95	4,71%	868	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	7.632.896,18	8,98%	1.073	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	330.968,46	0,39%	249	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	11.359.304,40	13,37%	547	0,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	10.073.076,45	11,85%	859	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	905,00	0,00%	16.673	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.012.061,90	3,54%	248	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	5.661.121,00	6,66%	661	0,66%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	805.305,92	0,95%	743	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	6.529.316,26	7,68%	33.893	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.243.283,76	1,46%	2.100	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.366.431,25	2,78%	1.797	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.709.168,32	2,01%	25.804	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.019.415,85	1,20%	13.635	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	722.632,39	0,85%	844	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	311.001,34	0,37%	1.588	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	205.070,72	0,24%	18.477	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	232.922,21	0,27%	3.850	0,10%	Artigo 8º, Inciso I



CRÉDITO
& MERCADO

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.650.625,47	1,94%	99	0,00%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	1.608.936,62	1,89%	63	0,24%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.144.286,53	3,70%	17.281	0,41%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	5.395.914,32	6,35%	100	4,57%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			84.988.820,62				



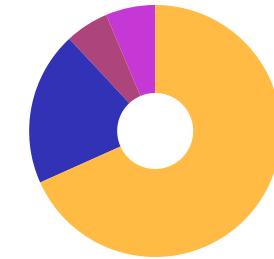
**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	18,41%	59,24%	50.347.377,34
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	27.938.040,91	32,87%	13,81%	18,41%	100,00%	57.050.779,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	30.106.468,75	35,42%	12,62%	16,83%	50,00%	12.387.941,56
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	16,83%	20,00%	16.997.764,12
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,79%	5,00%	4.249.441,03
Total Renda Fixa	100,00%	58.044.509,66	68,30%	26,43%	73,27%	234,24%	



- █ RENDA FIXA 58.044.509,66
- █ RENDA VARIÁVEL 16.795.173,49
- █ EXTERIOR 4.753.223,15
- █ ESTRUTURADOS 5.395.914,32



**CRÉDITO
& MERCADO**

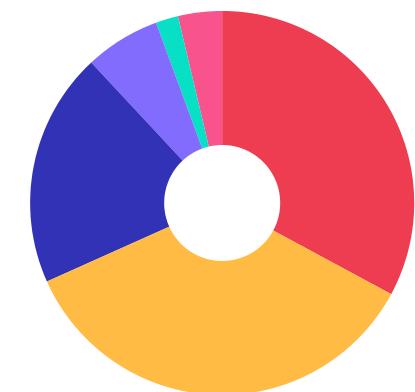
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	16.795.173,49	19,76%	0,00%	16,11%	20,00%	202.590,63
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,84%	20,00%	16.997.764,12
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.395.914,32	6,35%	2,09%	2,78%	10,00%	3.102.967,74
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	22.191.087,81	26,11%	2,09%	21,73%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	1.608.936,62	1,89%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.608.936,62
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.144.286,53	3,70%	0,00%	5,00%	10,00%	5.354.595,53
Total Exterior	10,00%	4.753.223,15	5,59%	0,00%	5,00%	10,00%	



■ 7º I b ■ 7º III a ■ 8º I ■ 10º I
■ 9º II ■ 9º III



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	61.226.400,00	72,04	0,00
CAIXA DTVM	12.715.979,86	14,96	-
SICREDI	5.661.121,00	6,66	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	3.012.061,90	3,54	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.650.625,47	1,94	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	722.632,39	0,85	0,00

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	59,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	27.938.040,91	32,87	13,81	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	13.086.043,35	15,40	12,62	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	16.795.173,49	19,76	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	3.144.286,53	3,70	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.395.914,32	6,35	2,09	10,00



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,47%	6,85%	2,86%	6,85%	10,11%	17,88%	-	-
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%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	0,37%	2,19%	0,83%	2,19%	1,76%	1,90%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,34%	2,15%	0,76%	2,15%	1,63%	1,54%	1,76%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,80%	4,14%	2,28%	4,14%	6,18%	6,69%	0,01%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	7,13%	3,08%	7,13%	10,31%	16,86%	1,37%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,93%	4,87%	2,63%	4,87%	7,48%	8,72%	0,01%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,22%	-	2,37%	-	-	-	1,44%	-
IPCA (Benchmark)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,79%	5,28%	2,57%	5,28%	8,95%	10,68%	0,42%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,23%	4,59%	2,22%	4,59%	3,73%	6,51%	1,57%	0,03%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	11,52%	-	-	-	-	-	10,31%	-
CDI (Benchmark)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,03%	5,10%	1,73%	5,10%	5,87%	9,14%	0,71%	0,02%
Ibovespa (Benchmark)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-	-
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-10,46%	-10,71%	-19,62%	-10,71%	-32,68%	-18,43%	8,99%	0,21%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-10,34%	-1,37%	-12,54%	-1,37%	-11,64%	8,62%	8,25%	0,20%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-10,49%	-8,08%	-16,17%	-8,08%	-27,94%	-7,88%	7,94%	0,19%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-12,77%	-7,24%	-16,81%	-7,24%	-17,83%	14,76%	9,44%	0,20%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-11,79%	-6,80%	-18,32%	-6,80%	-24,50%	2,17%	9,10%	0,22%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-11,05%	-5,03%	-15,73%	-5,03%	-22,86%	2,62%	9,03%	0,20%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-11,61%	-8,53%	-15,87%	-8,53%	-16,66%	12,69%	9,62%	0,18%
S&P 500 (Benchmark)	-8,39%	-20,58%	-16,45%	-20,58%	-11,92%	22,10%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-7,44%	-17,82%	-14,85%	-17,82%	-7,14%	28,23%	14,21%	0,18%
SMALL (Benchmark)	-16,33%	-19,69%	-24,72%	-19,69%	-39,59%	-15,65%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-15,24%	-12,85%	-22,04%	-12,85%	-30,80%	-8,69%	10,25%	0,24%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-16,51%	-19,24%	-25,11%	-19,24%	-41,34%	-18,56%	11,07%	0,25%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,34%	-27,01%	-8,36%	-27,01%	-10,80%	14,52%	-	-



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,34%	-27,01%	-8,36%	-27,01%	-10,80%	14,52%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,39%	-27,37%	-11,18%	-27,37%	-11,10%	9,17%	11,56%	0,20%
MSCI WORLD (Benchmark)	1,05%	-26,05%	-7,80%	-26,05%	-11,63%	10,62%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-2,14%	-28,66%	-8,52%	-28,67%	-11,83%	20,06%	11,58%	0,22%

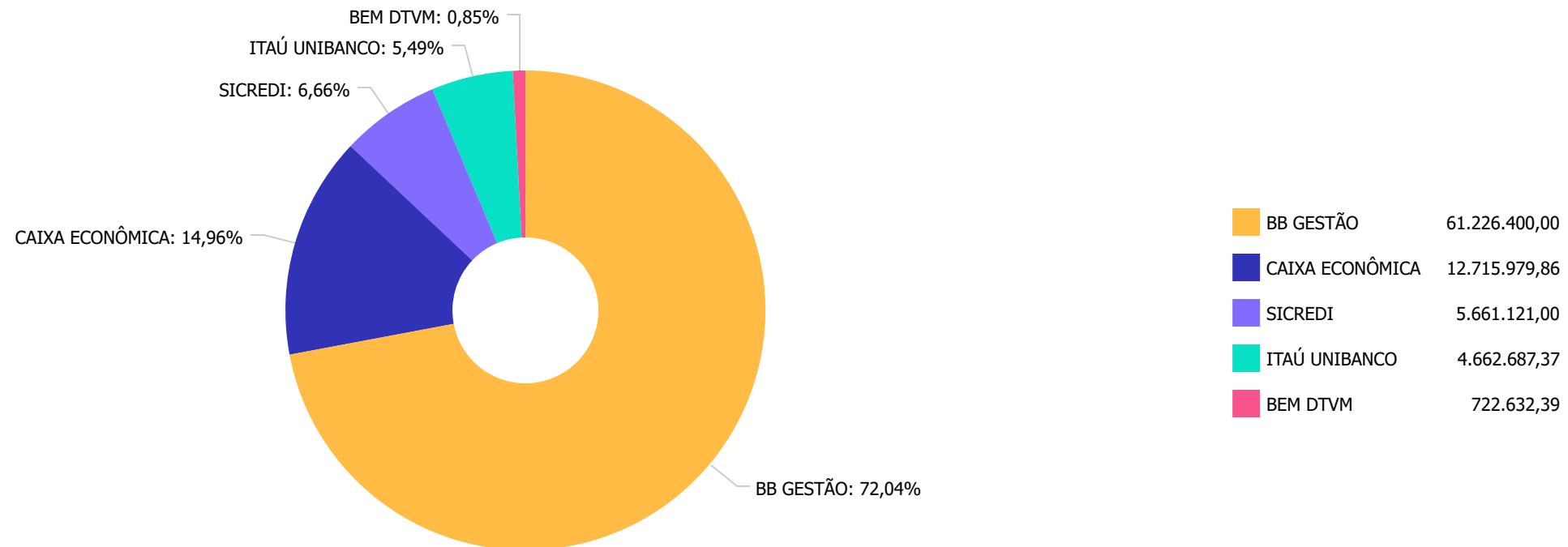


CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Junho / 2022)



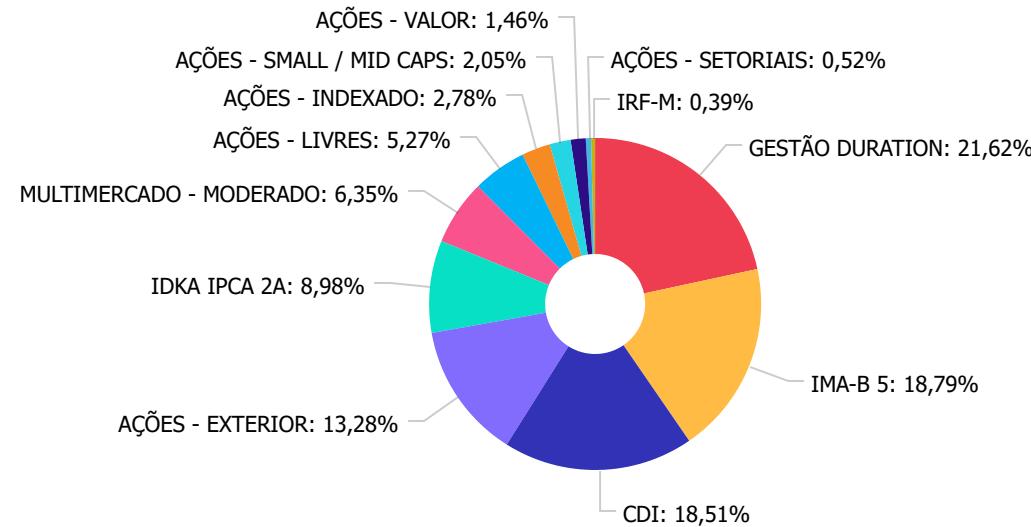


CRÉDITO
& MERCADO

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022



■ GESTÃO DURATION	18.373.582,25	■ IMA-B 5	15.971.960,32	■ CDI	15.735.102,45	■ AÇÕES - EXTERIOR	11.282.539,41
■ IDKA IPCA 2A	7.632.896,18	■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.395.914,32	■ AÇÕES - LIVRES	4.476.101,05	■ AÇÕES - INDEXADO	2.366.431,25
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.742.048,24	■ AÇÕES - VALOR	1.243.283,76	■ AÇÕES - SETORIAIS	437.992,93	■ IRF-M	330.968,46



**CRÉDITO
& MERCADO**

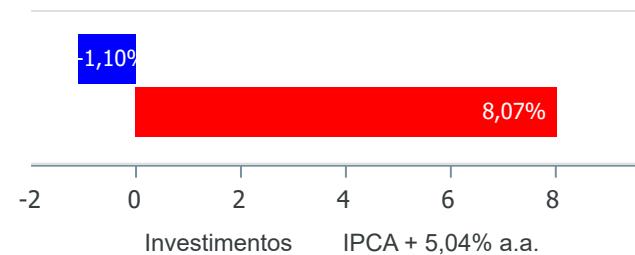
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	85.552.823,02	2.390.023,42	3.876.712,66	83.633.208,53	-432.925,25	-432.925,25	-0,51%	-0,51%	0,95%	0,95%	-53,11%	3,43%
Fevereiro	83.633.208,53	5.472.725,52	4.923.698,75	84.095.637,06	-86.598,24	-519.523,49	-0,10%	-0,61%	1,39%	2,35%	-25,88%	3,11%
Março	84.095.637,06	3.542.424,26	2.889.784,60	86.617.773,21	1.869.496,49	1.349.973,00	2,21%	1,58%	2,06%	4,46%	35,54%	3,72%
Abril	86.617.773,21	2.208.180,40	1.591.525,10	86.678.063,63	-556.364,88	793.608,12	-0,64%	0,94%	1,44%	5,96%	15,72%	3,40%
Maio	86.678.063,63	6.075.734,39	3.046.659,83	89.548.810,97	-158.327,22	635.280,90	-0,18%	0,76%	0,90%	6,91%	10,97%	3,55%
Junho	89.548.810,97	36.056.844,98	38.965.012,15	84.988.820,62	-1.651.823,18	-1.016.542,28	-1,84%	-1,10%	1,08%	8,07%	-13,64%	3,52%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

ANO

36M

Evolução do Patrimônio



- Investimentos Meta de Rentabilidade
- CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
- Investimentos Meta de Rentabilidade
- CDI IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.988.592,90	0,00	0,00	3.012.061,90	23.469,00	0,79%	0,79%	0,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIA	5.553.274,01	0,00	5.583.207,21	0,00	29.933,20	0,54%	0,27%	1,38%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.739.746,05	0,00	1.748.842,35	0,00	9.096,30	0,52%	1,02%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	13.087.639,55	12.679.530,71	15.826.972,11	10.073.076,45	132.878,30	0,52%	0,93%	0,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.373.788,68	0,00	5.400.660,63	0,00	26.871,95	0,50%	0,32%	1,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.353.267,16	0,00	1.359.758,92	0,00	6.491,76	0,48%	0,04%	2,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIA	8.633.682,27	2.674.389,93	0,00	11.359.304,40	51.232,20	0,45%	0,46%	0,81%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	329.833,17	0,00	0,00	330.968,46	1.135,29	0,34%	0,34%	1,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	322.704,95	0,00	323.793,12	0,00	1.088,17	0,34%	0,91%	0,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.114.768,56	0,00	0,00	2.121.694,83	6.926,27	0,33%	0,33%	1,37%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.993.015,55	0,00	0,00	4.002.215,95	9.200,40	0,23%	0,23%	1,57%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	185.567,76	662.592,46	849.020,90	905,00	1.765,68	0,21%	0,80%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.257.753,52	1.359.758,92	0,00	7.632.896,18	15.383,74	0,20%	0,22%	1,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.734.710,96	0,00	1.735.612,31	0,00	901,35	0,05%	0,33%	1,23%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIAL	0,00	5.658.394,36	0,00	5.661.121,00	2.726,64	0,05%	1,02%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIA	1.837.178,59	0,00	1.837.896,80	0,00	718,21	0,04%	0,92%	0,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.300.819,81	0,00	4.299.247,80	0,00	-1.572,01	-0,04%	0,33%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.026.119,89	12.837.178,60	0,00	13.850.265,49	-13.033,00	-0,09%	0,22%	1,44%
Total Renda Fixa	60.832.463,38	35.871.844,98	38.965.012,15	58.044.509,66	305.213,45	0,50%		0,88%



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	0,00	185.000,00	0,00	205.070,72	20.070,72	10,85%	11,52%	10,31%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	7.054.417,13	0,00	0,00	6.529.316,26	-525.100,87	-7,44%	-7,44%	14,21%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	259.774,15	0,00	0,00	232.922,21	-26.851,94	-10,34%	-10,34%	8,25%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.843.521,13	0,00	0,00	1.650.625,47	-192.895,66	-10,46%	-10,46%	8,99%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	347.435,64	0,00	0,00	311.001,34	-36.434,30	-10,49%	-10,49%	7,94%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	905.372,30	0,00	0,00	805.305,92	-100.066,38	-11,05%	-11,05%	9,03%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.406.562,77	0,00	0,00	1.243.283,76	-163.279,01	-11,61%	-11,61%	9,62%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.682.626,00	0,00	0,00	2.366.431,25	-316.194,75	-11,79%	-11,79%	9,10%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.959.259,44	0,00	0,00	1.709.168,32	-250.091,12	-12,76%	-12,76%	9,44%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	852.593,62	0,00	0,00	722.632,39	-129.961,23	-15,24%	-15,24%	10,25%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.221.011,99	0,00	0,00	1.019.415,85	-201.596,14	-16,51%	-16,51%	11,07%
Total Renda Variável	18.532.574,17	185.000,00	0,00	16.795.173,49	-1.922.400,68	-10,27%		11,30%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.143.711,08	0,00	0,00	3.144.286,53	575,45	0,02%	0,02%	11,56%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO...	1.645.557,43	0,00	0,00	1.608.936,62	-36.620,81	-2,23%	-2,23%	11,58%
Total Exterior	4.789.268,51	0,00	0,00	4.753.223,15	-36.045,36	-0,75%		11,56%



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	9.275.667,04	20.820.000,05	20.405.936,50	10.073.076,45	383.345,86	1,27%	2,63%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.501.869,09	2.674.389,93	0,00	11.359.304,40	183.045,38	1,64%	2,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.119.118,67	1.359.758,92	0,00	7.632.896,18	154.018,59	2,06%	2,50%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.429.992,41	0,00	5.583.207,21	0,00	153.214,80	2,82%	2,54%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.252.501,67	0,00	5.400.660,63	0,00	148.158,96	2,82%	2,63%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.915.268,62	0,00	0,00	4.002.215,95	86.947,33	2,22%	2,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.936.551,70	0,00	0,00	3.012.061,90	75.510,20	2,57%	2,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.057.886,42	59.220,54	59.220,54	2.121.694,83	63.808,41	3,01%	3,08%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.243.949,98	0,00	4.299.247,80	0,00	55.297,82	1,30%	1,67%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.707.414,73	0,00	1.748.842,35	0,00	41.427,62	2,43%	2,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.695.507,70	0,00	1.735.612,31	0,00	40.104,61	2,37%	2,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.807.753,60	0,00	1.837.896,80	0,00	30.143,20	1,67%	2,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.004.563,48	12.837.178,60	0,00	13.850.265,49	8.523,41	0,06%	2,37%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	317.440,81	0,00	323.793,12	0,00	6.352,31	2,00%	2,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.355.372,53	0,00	1.359.758,92	0,00	4.386,39	0,32%	-0,11%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	99.367,25	746.817,37	849.020,90	905,00	3.741,28	0,44%	2,28%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFEREN...	0,00	5.658.394,36	0,00	5.661.121,00	2.726,64	0,05%	2,85%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	328.468,20	0,00	0,00	330.968,46	2.500,26	0,76%	0,76%
Total Renda Fixa	56.048.693,90	44.155.759,77	43.603.197,08	58.044.509,66	1.443.253,07	2,55%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	5.304.187,83	0,00	0,00	5.395.914,32	91.726,49	1,73%	1,73%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	0,00	185.000,00	0,00	205.070,72	20.070,72	10,85%	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	266.320,43	0,00	0,00	232.922,21	-33.398,22	-12,54%	-12,54%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	370.971,91	0,00	0,00	311.001,34	-59.970,57	-16,17%	-16,17%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	955.653,89	0,00	0,00	805.305,92	-150.347,97	-15,73%	-15,73%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	926.911,06	0,00	0,00	722.632,39	-204.278,67	-22,04%	-22,04%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.477.765,31	0,00	0,00	1.243.283,76	-234.481,55	-15,87%	-15,87%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.361.167,62	0,00	0,00	1.019.415,85	-341.751,77	-25,11%	-25,11%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.054.566,27	0,00	0,00	1.709.168,32	-345.397,95	-16,81%	-16,81%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.053.526,68	0,00	0,00	1.650.625,47	-402.901,21	-19,62%	-19,62%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.897.197,08	0,00	0,00	2.366.431,25	-530.765,83	-18,32%	-18,32%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	7.668.375,79	0,00	0,00	6.529.316,26	-1.139.059,53	-14,85%	-14,85%
Total Renda Variável	25.336.643,87	185.000,00	0,00	22.191.087,81	-3.330.556,06	-13,05%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO FUNDAMENTALISMO SUSTENTABILIDADE E GESTÃO DE RISCOS	1.745.936,33	0,00	0,00	1.608.936,62	-136.999,71	-7,85%	-7,85%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.486.499,11	0,00	0,00	3.144.286,53	-342.212,58	-9,82%	-9,82%
Total Exterior	5.232.435,44	0,00	0,00	4.753.223,15	-479.212,29	-9,16%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2022

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	12.417.672,38	29.084.835,79	32.057.902,00	10.073.076,45	628.470,28	1,51%	4,87%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.893.835,58	1.359.758,92	0,00	7.632.896,18	379.301,68	5,23%	6,41%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.316.107,91	2.674.389,93	0,00	11.359.304,40	368.806,56	3,36%	4,30%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.230.342,35	0,00	5.583.207,21	0,00	352.864,86	6,75%	6,46%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.063.146,73	0,00	5.400.660,63	0,00	337.513,90	6,67%	6,47%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.826.677,00	0,00	0,00	4.002.215,95	175.538,95	4,59%	4,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.861.134,10	0,00	0,00	3.012.061,90	150.927,80	5,28%	5,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.160.514,98	0,00	4.299.247,80	0,00	138.732,82	3,33%	3,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	2.059.220,54	59.220,54	2.121.694,83	121.694,83	5,91%	7,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.592.807,45	41.631,38	1.735.612,31	0,00	101.173,48	6,19%	6,51%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.665.056,25	0,00	1.748.842,35	0,00	83.786,10	5,03%	5,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.768.238,97	0,00	1.837.896,80	0,00	69.657,83	3,94%	4,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	13.837.178,60	28.230,51	13.850.265,49	41.317,40	0,30%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.345.571,23	0,00	1.359.758,92	0,00	14.187,69	1,05%	0,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	320.431,11	0,00	333.793,12	0,00	13.362,01	4,17%	4,86%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	324.007,48	0,00	0,00	330.968,46	6.960,98	2,15%	2,15%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	616,21	845.523,45	849.020,90	905,00	3.786,24	0,45%	4,14%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFEREN...	0,00	5.658.394,36	0,00	5.661.121,00	2.726,64	0,05%	5,40%
Total Renda Fixa	54.786.159,73	55.560.932,97	55.293.393,09	58.044.509,66	2.990.810,05	5,43%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	5.134.021,72	0,00	0,00	5.395.914,32	261.892,60	5,10%	5,10%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	0,00	185.000,00	0,00	205.070,72	20.070,72	10,85%	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	236.153,51	0,00	0,00	232.922,21	-3.231,30	-1,37%	-1,37%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	338.336,90	0,00	0,00	311.001,34	-27.335,56	-8,08%	-8,08%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	847.926,77	0,00	0,00	805.305,92	-42.620,85	-5,03%	-5,03%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	829.204,93	0,00	0,00	722.632,39	-106.572,54	-12,85%	-12,85%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.359.207,83	0,00	0,00	1.243.283,76	-115.924,07	-8,53%	-8,53%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.842.655,23	0,00	0,00	1.709.168,32	-133.486,91	-7,24%	-7,24%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.538.991,46	0,00	0,00	2.366.431,25	-172.560,21	-6,80%	-6,80%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.848.603,17	0,00	0,00	1.650.625,47	-197.977,70	-10,71%	-10,71%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.262.215,22	0,00	0,00	1.019.415,85	-242.799,37	-19,24%	-19,24%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	7.944.694,48	0,00	0,00	6.529.316,26	-1.415.378,22	-17,82%	-17,82%
Total Renda Variável	24.182.011,22	185.000,00	0,00	22.191.087,81	-2.175.923,41	-8,93%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2022

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO FUNDAMENTALISMO SUSTENTABILIDADE E GESTÃO DE RISCOS	2.255.461,29	0,00	0,00	1.608.936,62	-646.524,67	-28,66%	-28,66%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.329.190,78	0,00	0,00	3.144.286,53	-1.184.904,25	-27,37%	-27,37%
Total Exterior	6.584.652,07	0,00	0,00	4.753.223,15	-1.831.428,92	-27,81%	



Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

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

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria 1.467, de 02 de junho de 2022. e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

