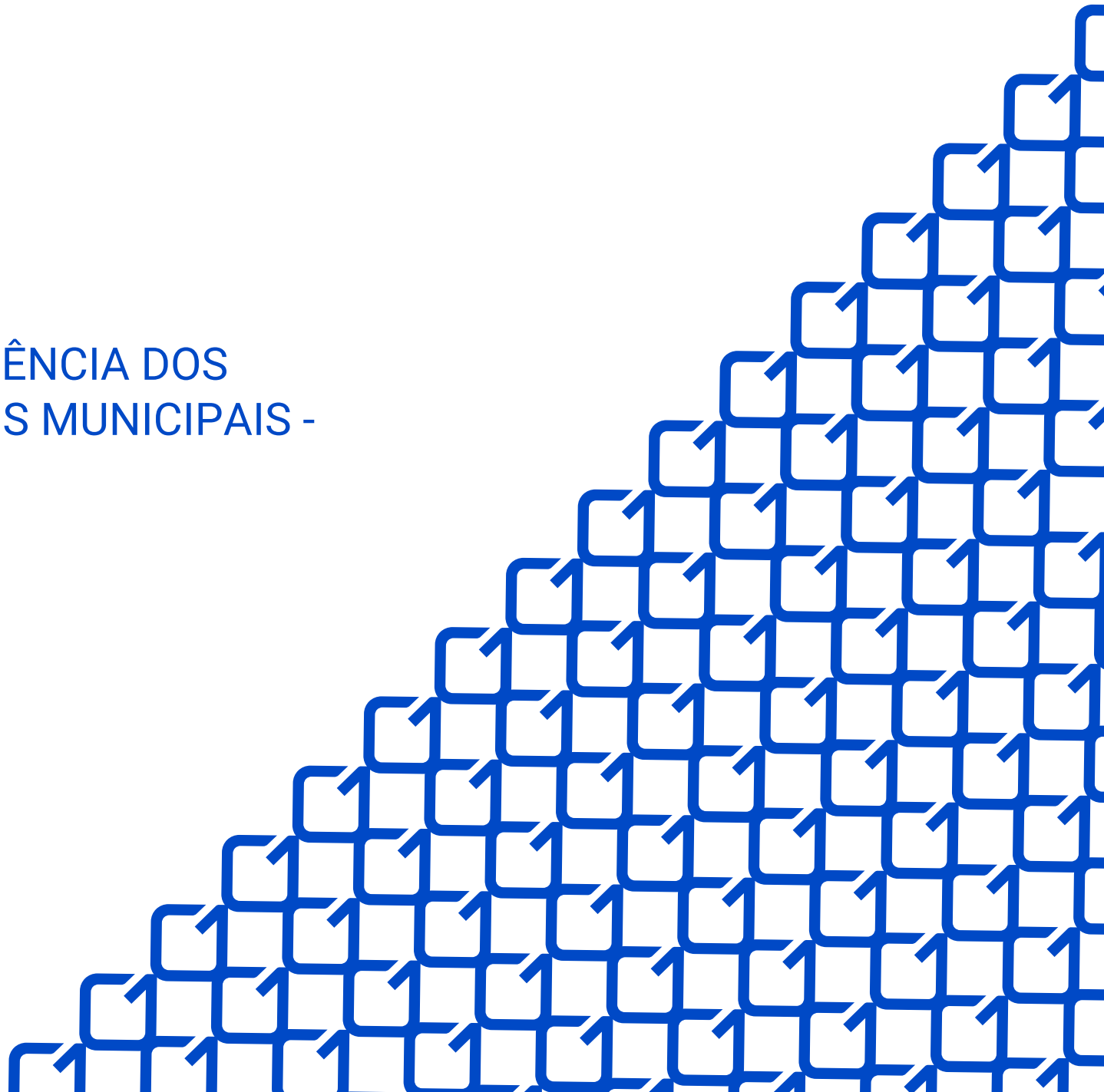




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS - CAPREV

 Julho/2022



Patrimônio
R\$ 26.549.496,77

Rentabilidade
Mês Acum.
-0,78% 3,89%

Meta
Mês Acum.
-0,29% 15,85%

Gap
Mês Acum.
-0,49% -11,96%

VaR
0,53%

Evolução do Patrimônio (Últimos 12 meses)

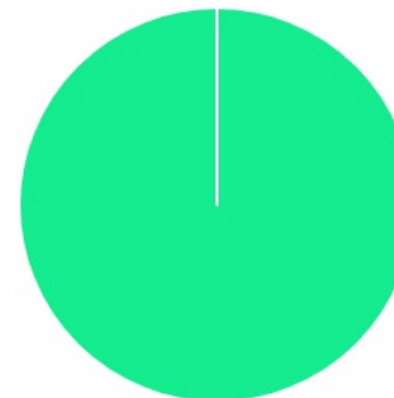


Comparativo (Rentabilidade | Metas) (Últimos 12 meses)

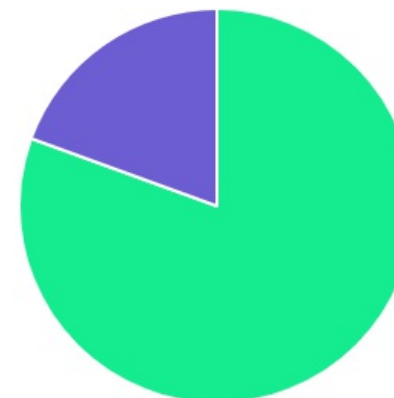


ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	R\$ 4.876.542,10	18.37%	D+0	7, I "b"	R\$ -45.520,66	-0,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	R\$ 4.627.470,69	17.44%	D+0	7, I "b"	R\$ 956,79	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	R\$ 269.015,40	1.01%	D+0	7, I "b"	R\$ 5.675,81	1,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...	R\$ 4.005.236,28	15.09%	D+0	7, I "b"	R\$ -77.806,91	-1,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	R\$ 1.711.277,35	6.45%	D+0	7, I "b"	R\$ -4.818,97	-0,28%
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 5.890.746,41	22.20%	D+1	7, I "b"	R\$ -45.303,70	-0,76%
CAIXA FIC FI NOVO BRASIL RF...	R\$ 5.128.117,44	19.32%	D+0	7, III "a"	R\$ -46.301,71	-0,89%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	R\$ 32.089,72	0.12%	D+0	7, III "a"	R\$ 319,89	1,01%
Total investimentos	R\$ 26.540.495,39	100.00%			R\$ -212.799,46	-0,78%
Disponibilidade	R\$ 9.001,38	-			-	-
Total patrimônio	R\$ 26.549.496,77	100.00%			-	-

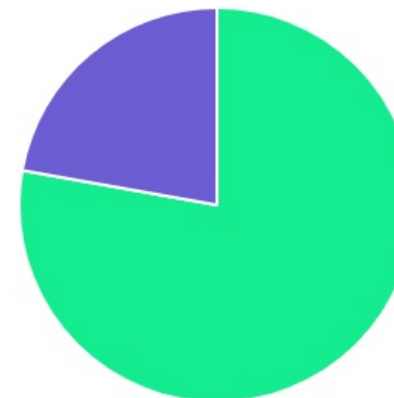
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	100,00%	R\$ 26.540.495,39	
Total	100,00%	R\$ 26.540.495,39	



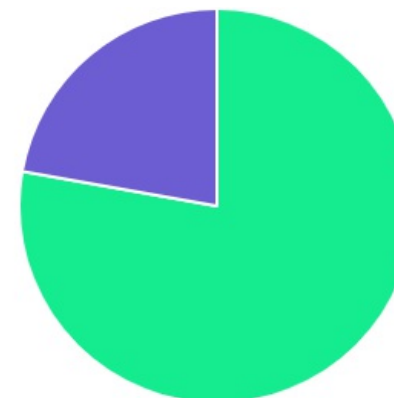
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	80,56%	R\$ 21.380.288,23	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	19,44%	R\$ 5.160.207,16	
Total	100,00%	R\$ 26.540.495,39	



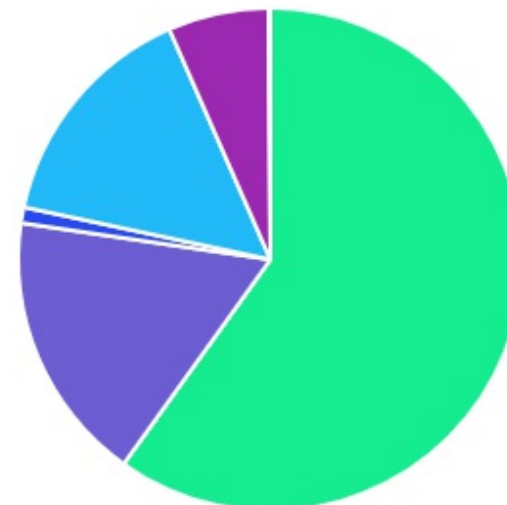
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA DISTRIBUIDORA	77,80%	R\$ 20.649.748,98	
BANCO DO NORDESTE	22,20%	R\$ 5.890.746,41	
Total	100,00%	R\$ 26.540.495,39	



ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA ECONOMICA	77,80%	R\$ 20.649.748,98	
SANTANDER CACEIS	22,20%	R\$ 5.890.746,41	
Total	100,00%	R\$ 26.540.495,39	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA-B	59,89%	R\$ 15.895.405,95	
IMA-B 5	17,44%	R\$ 4.627.470,69	
IMA-B 5+	15,09%	R\$ 4.005.236,28	
IDKA IPCA 2A	6,45%	R\$ 1.711.277,35	
IRF-M 1	1,01%	R\$ 269.015,40	
CDI	0,12%	R\$ 32.089,72	
Total	100,00%	R\$ 26.540.495,39	



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional – SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	100,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 21.380.288,23	80.56%	50,00%	55,00%	100,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	100,00%
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa - 7, III "a"	60%	R\$ 5.160.207,16	19.44%	0,00%	10,00%	60,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	60,00%
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	20,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	10,00%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	5,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa		R\$ 26.540.495,39	100,00%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	7,50%	30,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	7,50%	30,00%
Total Renda Variável		R\$ 0,00	0,00%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Renda Fixa - Dívida Externa - 9, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	10,00%
FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	10,00%

FI Ações – BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		R\$ 0,00	0,00%			

FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	10,00%
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Fundos Estruturados		R\$ 0,00	0,00%			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	5,00%	5,00%
Total Fundos Imobiliários		R\$ 0,00	0,00%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	5,00%	5,00%
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 26.540.495,39	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2022			IPCA + 4.81% a.a.			
Janeiro	R\$ 27.031.480,72	R\$ 26.228.226,92	0,93%	R\$ -163.253,80	-0,60%	-1,53%
Fevereiro	R\$ 26.228.226,92	R\$ 26.316.123,00	1,40%	R\$ 158.363,21	0,60%	-0,80%
Março	R\$ 26.316.123,00	R\$ 26.837.754,83	2,01%	R\$ 777.707,10	2,95%	0,94%
Abril	R\$ 26.837.754,83	R\$ 26.892.797,14	1,45%	R\$ 232.664,59	0,86%	-0,59%
Maio	R\$ 26.892.797,14	R\$ 26.782.753,42	0,86%	R\$ 254.578,56	0,95%	0,08%
Junho	R\$ 26.782.753,42	R\$ 27.059.917,13	1,06%	R\$ -81.214,01	-0,30%	-1,36%
Julho	R\$ 27.059.917,13	R\$ 26.540.495,39	-0,29%	R\$ -212.799,46	-0,78%	-0,49%
Total	R\$ 27.059.917,13	R\$ 26.540.495,39	7,68%	R\$ 966.046,19	3,69%	-3,99%
2021			IPCA + 5.87% a.a.			
Janeiro	R\$ 0,00	R\$ 25.951.057,75	0,73%	R\$ 26.285.057,75	-0,74%	-1,47%
Fevereiro	R\$ 25.951.057,75	R\$ 26.295.202,99	1,34%	R\$ -364.253,98	-1,39%	-2,72%
Março	R\$ 26.295.202,99	R\$ 26.312.768,31	1,41%	R\$ -98.434,68	-0,36%	-1,77%
Abril	R\$ 26.312.768,31	R\$ 26.640.586,27	0,79%	R\$ 173.579,71	0,66%	-0,13%
Maio	R\$ 26.640.586,27	R\$ 26.821.801,14	1,31%	R\$ 262.394,00	0,98%	-0,32%
Junho	R\$ 26.821.801,14	R\$ 26.849.707,98	1,01%	R\$ 80.906,84	0,30%	-0,70%
Julho	R\$ 26.849.707,98	R\$ 26.844.958,41	1,44%	R\$ -87.192,46	-0,32%	-1,76%
Agosto	R\$ 26.844.958,41	R\$ 27.006.128,64	1,35%	R\$ -248.474,31	-0,93%	-2,28%
Setembro	R\$ 27.006.128,64	R\$ 26.881.794,98	1,64%	R\$ 10.797,72	0,04%	-1,60%
Outubro	R\$ 26.881.794,98	R\$ 26.241.259,48	1,73%	R\$ -633.629,92	-2,34%	-4,07%
Novembro	R\$ 26.241.259,48	R\$ 26.039.269,75	1,43%	R\$ 846.010,27	3,23%	1,80%

Dezembro	R\$ 26.039.269,75	R\$ 27.031.480,72	1,21%	R\$ 70.210,97	0,28%	-0,93%
Total	R\$ 26.039.269,75	R\$ 27.031.480,72	16,52%	R\$ 26.296.971,91	-0,69%	-17,21%

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	03.737.206/0001-97	1,01%	6,66%	4,60%	-	11,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	10.740.670/0001-06	1,03%	5,00%	1,62%	-	1,79%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	11.060.913/0001-10	0,02%	6,53%	4,31%	-	11,13%
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	10.740.658/0001-93	-0,92%	3,29%	-1,53%	-	1,71%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	14.386.926/0001-71	-0,28%	6,07%	4,76%	-	8,05%
BNB RPPS IMA-B FI RF	08.266.261/0001-60	-0,76%	3,57%	-0,98%	-	2,56%
CAIXA FIC FI NOVO BRASIL RF...	10.646.895/0001-90	-0,89%	3,27%	-1,50%	-	1,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...	10.577.503/0001-88	-1,91%	0,00%	-7,00%	-	-7,00%