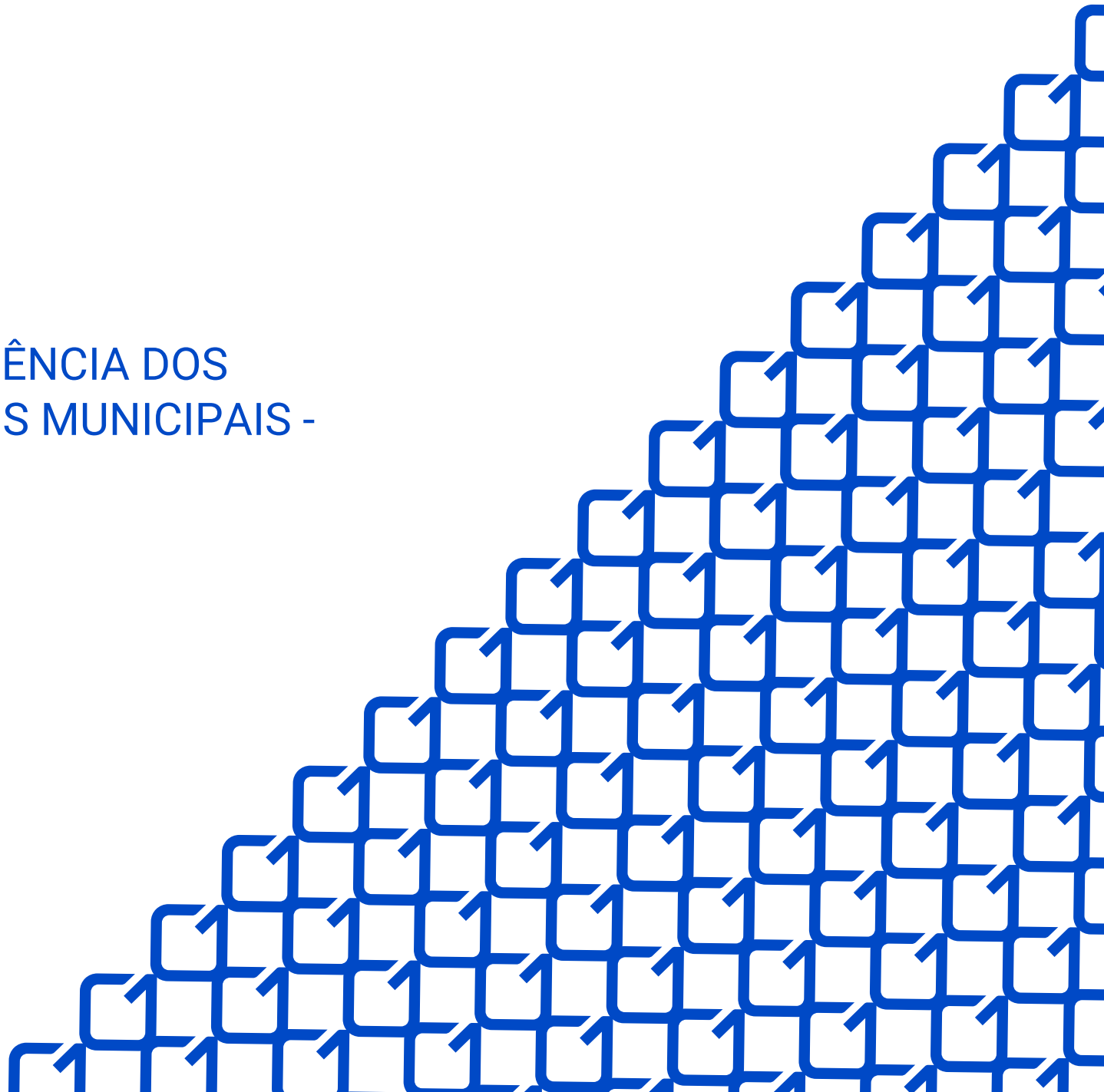




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS - CAPREV

 Agosto/2022



Patrimônio

R\$ 26.843.828,38

Rentabilidade

Mês	Acum.
1,09%	6,00%

Meta

Mês	Acum.
0,03%	14,34%

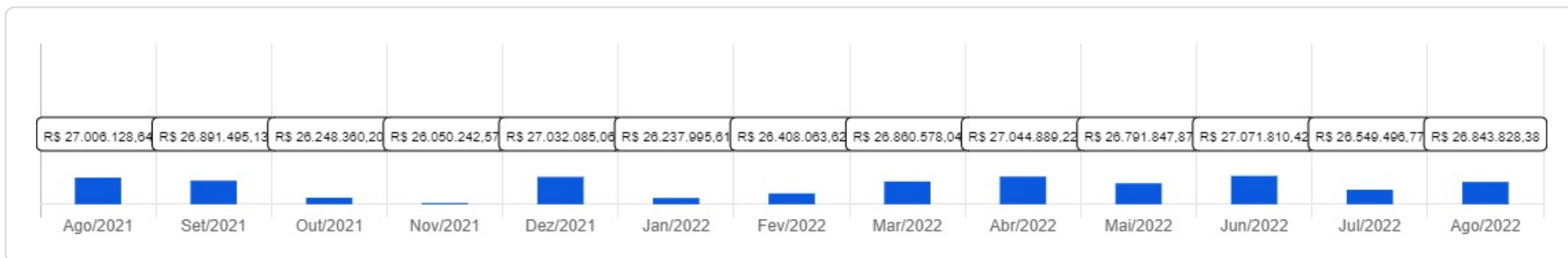
Gap

Mês	Acum.
1,06%	-8,34%

VaR

0,53%

Evolução do Patrimônio (Últimos 12 meses)

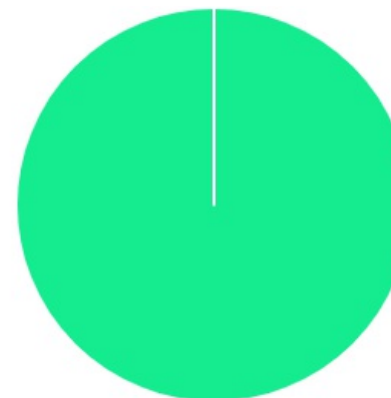


Comparativo (Rentabilidades | Metas) (Últimos 12 meses)

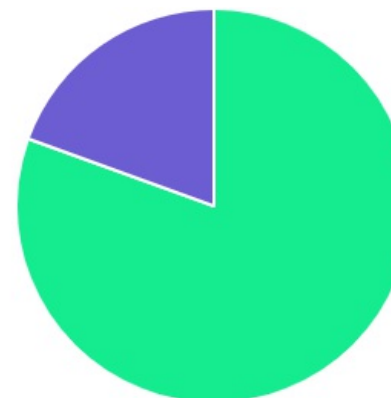


ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	R\$ 4.934.875,10	18.39%	D+0	7, I "b"	R\$ 58.333,00	1,20%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	R\$ 4.629.673,85	17.25%	D+0	7, I "b"	R\$ 2.203,16	0,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	R\$ 256.229,95	0.95%	D+0	7, I "b"	R\$ 5.214,55	0,77%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...	R\$ 4.105.162,99	15.30%	D+0	7, I "b"	R\$ 99.926,71	2,49%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	R\$ 1.736.535,52	6.47%	D+0	7, I "b"	R\$ -2.119,55	-0,12%
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 5.951.949,06	22.18%	D+1	7, I "b"	R\$ 61.202,65	1,04%
CAIXA FIC FI NOVO BRASIL RF...	R\$ 5.188.397,74	19.33%	D+0	7, III "a"	R\$ 60.280,30	1,18%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	R\$ 32.470,70	0.12%	D+0	7, III "a"	R\$ 380,98	1,19%
Total investimentos	R\$ 26.835.294,91	100.00%			R\$ 285.421,80	1,09%
Disponibilidade	R\$ 8.533,47	-			-	-
Total patrimônio	R\$ 26.843.828,38	100.00%			-	-

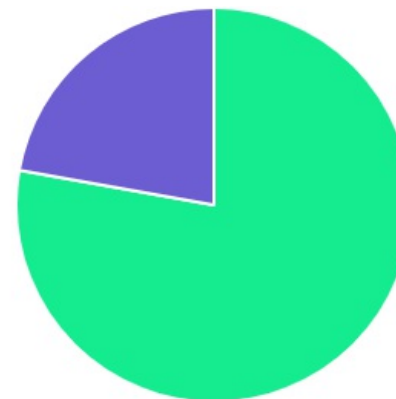
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	100,00%	R\$ 26.835.294,91	
Total	100,00%	R\$ 26.835.294,91	



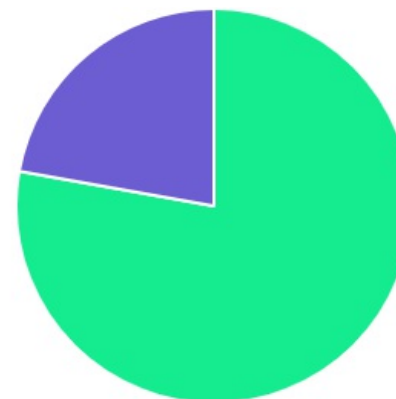
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	80,54%	R\$ 21.614.426,47	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	19,46%	R\$ 5.220.868,44	
Total	100,00%	R\$ 26.835.294,91	



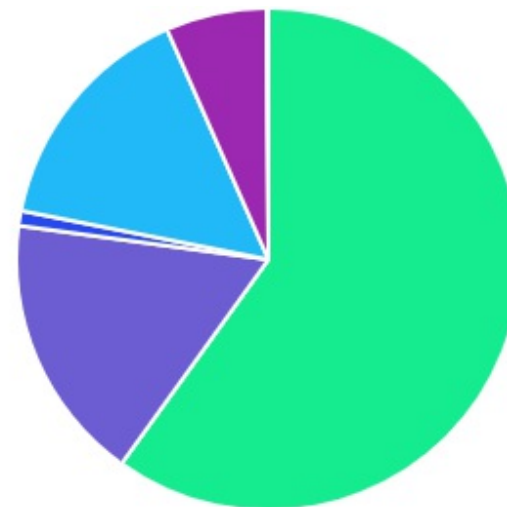
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA DISTRIBUIDORA	77,82%	R\$ 20.883.345,85	
BANCO DO NORDESTE	22,18%	R\$ 5.951.949,06	
Total	100,00%	R\$ 26.835.294,91	



ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA ECONOMICA	77,82%	R\$ 20.883.345,85	
SANTANDER CACEIS	22,18%	R\$ 5.951.949,06	
Total	100,00%	R\$ 26.835.294,91	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA-B	59,90%	R\$ 16.075.221,90	
IMA-B 5	17,25%	R\$ 4.629.673,85	
IMA-B 5+	15,30%	R\$ 4.105.162,99	
IDKA IPCA 2A	6,47%	R\$ 1.736.535,52	
IRF-M 1	0,95%	R\$ 256.229,95	
CDI	0,12%	R\$ 32.470,70	
Total	100,00%	R\$ 26.835.294,91	



RENTA 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\$ 21.614.426,47	80.54%	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\$ 5.220.868,44	19.46%	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\$ 26.835.294,91	100,00%			
RENTA 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\$ 26.835.294,91	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%
Maiο	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%
Agosto	R\$ 26.540.495,39	R\$ 26.835.294,91	0,03%	R\$ 285.421,80	1,09%	1,06%
Total	R\$ 26.540.495,39	R\$ 26.835.294,91	7,71%	R\$ 1.251.467,99	4,82%	-2,89%
2021			IPCA + 5.87% a.a.			
Janeiro	R\$ 26.483.918,17	R\$ 25.951.057,75	0,73%	R\$ -198.860,42	-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%
Maiο	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\$ -186.946,26	-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	1,19%	7,93%	4,60%	-	12,89%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	10.740.670/0001-06	0,77%	5,81%	1,62%	-	1,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	11.060.913/0001-10	0,05%	6,58%	4,31%	-	11,18%
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	10.740.658/0001-93	1,20%	4,52%	-1,53%	-	2,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	14.386.926/0001-71	-0,12%	5,94%	4,76%	-	7,78%
BNB RPPS IMA-B FI RF	08.266.261/0001-60	1,04%	4,65%	-0,98%	-	3,62%
CAIXA FIC FI NOVO BRASIL RF...	10.646.895/0001-90	1,18%	4,49%	-1,50%	-	2,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...	10.577.503/0001-88	2,49%	2,50%	-7,00%	-	-4,68%