



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS - CAPREV

 Abril/2022





Patrimônio

R\$ 27.044.889,22

Rentabilidade

| Mês   | Acum. |
|-------|-------|
| 0,86% | 5,04% |

Meta

| Mês   | Acum.  |
|-------|--------|
| 1,45% | 18,32% |

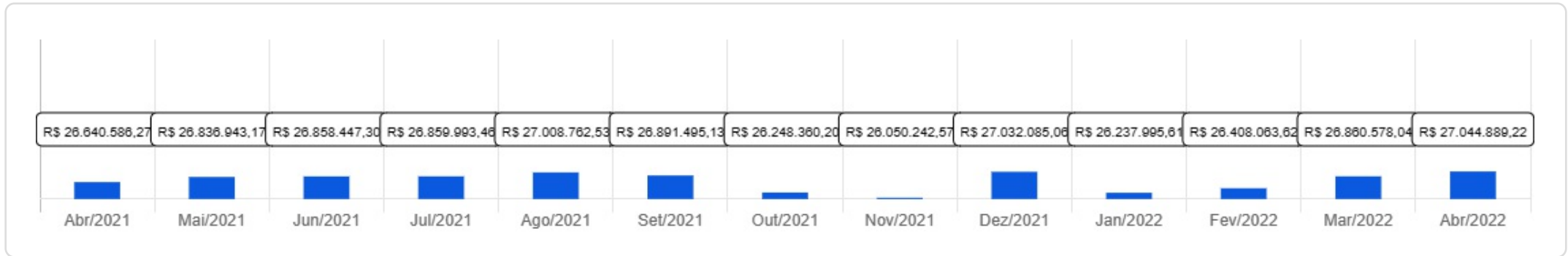
Gap

| Mês    | Acum.   |
|--------|---------|
| -0,59% | -13,28% |

VaR

0,53%

## Evolução do Patrimônio (Últimos 12 meses)



## Comparativo (Rentabilidades | Metas) (Últimos 12 meses)



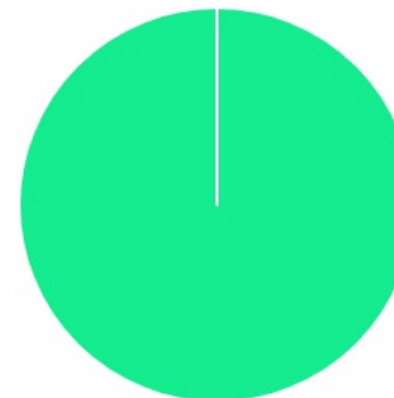


| ATIVO                           | SALDO             | CARTEIRA(%) | RESG. | 4.963      | RETORNO (R\$)  | (%)   |
|---------------------------------|-------------------|-------------|-------|------------|----------------|-------|
| CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF     | R\$ 4.893.492,05  | 18.20%      | D+0   | 7, I "b"   | R\$ 38.907,66  | 0,80% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...   | R\$ 4.576.141,06  | 17.02%      | D+0   | 7, I "b"   | R\$ 69.217,35  | 1,54% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...   | R\$ 13.335,93     | 0.05%       | D+0   | 7, I "b"   | R\$ 582,82     | 0,65% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...  | R\$ 4.082.062,96  | 15.18%      | D+0   | 7, I "b"   | R\$ 1.867,04   | 0,05% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP... | R\$ 2.252.485,90  | 8.38%       | D+0   | 7, I "b"   | R\$ 32.808,99  | 1,40% |
| BNB RPPS IMA-B FI RF            | R\$ 5.902.682,77  | 21.95%      | D+1   | 7, I "b"   | R\$ 50.478,85  | 0,86% |
| CAIXA FIC FI NOVO BRASIL RF...  | R\$ 5.141.494,86  | 19.12%      | D+0   | 7, III "a" | R\$ 38.340,90  | 0,75% |
| CAIXA BRASIL FI RF REF DI...    | R\$ 31.101,61     | 0.12%       | D+0   | 7, III "a" | R\$ 460,98     | 0,80% |
| Total investimentos             | R\$ 26.892.797,14 | 100.00%     |       |            | R\$ 232.664,59 | 0,86% |
| Disponibilidade                 | R\$ 152.092,08    | -           |       |            | -              | -     |
| Total patrimônio                | R\$ 27.044.889,22 | 100.00%     |       |            | -              | -     |

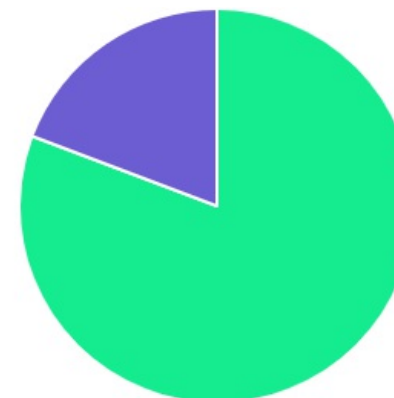
As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.



| CLASSE     | PERCENTUAL | VALOR             | LEG.                                                                                |
|------------|------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| Renda Fixa | 100,00%    | R\$ 26.892.797,14 |  |
| Total      | 100,00%    | R\$ 26.892.797,14 |                                                                                     |

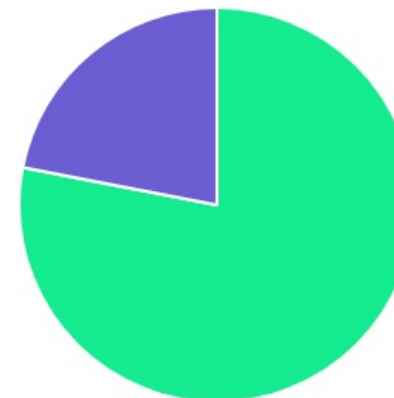


| ENQUADRAMENTO                       | PERCENTUAL | VALOR             | LEG.                                                                                |
|-------------------------------------|------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   | 80,77%     | R\$ 21.720.200,67 |  |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 19,23%     | R\$ 5.172.596,47  |  |
| Total                               | 100,00%    | R\$ 26.892.797,14 |                                                                                     |

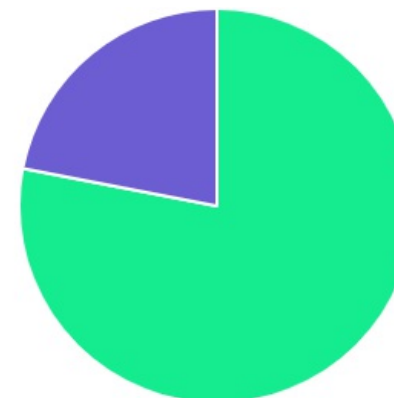




| GESTOR              | PERCENTUAL | VALOR             | LEG.                                                                                |
|---------------------|------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| CAIXA DISTRIBUIDORA | 78,05%     | R\$ 20.990.114,37 |  |
| BANCO DO NORDESTE   | 21,95%     | R\$ 5.902.682,77  |  |
| Total               | 100,00%    | R\$ 26.892.797,14 |                                                                                     |

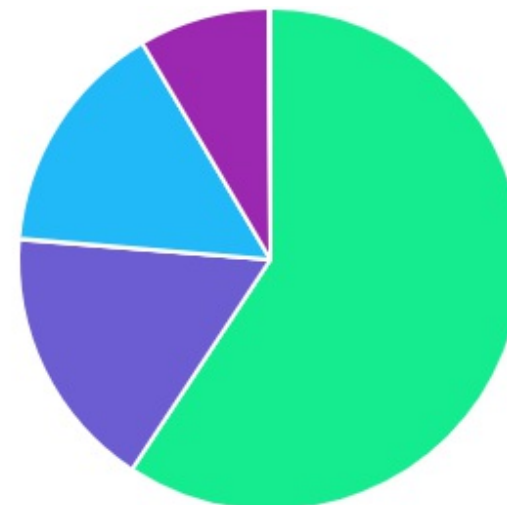


| ADMINISTRADOR    | PERCENTUAL | VALOR             | LEG.                                                                                |
|------------------|------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| CAIXA ECONOMICA  | 78,05%     | R\$ 20.990.114,37 |  |
| SANTANDER CACEIS | 21,95%     | R\$ 5.902.682,77  |  |
| Total            | 100,00%    | R\$ 26.892.797,14 |                                                                                     |



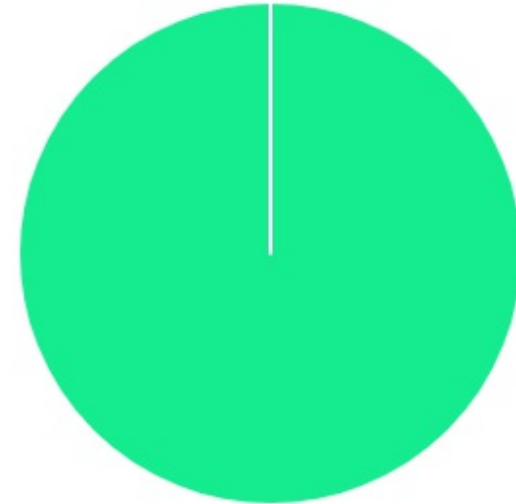


| BENCHMARK    | PERCENTUAL | VALOR             | LEG.                                                                                |
|--------------|------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| IMA-B        | 59,26%     | R\$ 15.937.669,68 |  |
| IMA-B 5      | 17,02%     | R\$ 4.576.141,06  |  |
| IMA-B 5+     | 15,18%     | R\$ 4.082.062,96  |  |
| IDKA IPCA 2A | 8,38%      | R\$ 2.252.485,90  |  |
| CDI          | 0,12%      | R\$ 31.101,61     |  |
| IRF-M 1      | 0,05%      | R\$ 13.335,93     |  |
| Total        | 100,00%    | R\$ 26.892.797,14 |                                                                                     |





| LIQUIDEZ    | PERCENTUAL | VALOR             | LEG.        |
|-------------|------------|-------------------|-------------|
| 0 a 30 dias | 100,00%    | R\$ 26.892.797,14 | <div></div> |
| Total       | 100,00%    | R\$ 26.892.797,14 |             |





| 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\$ 21.720.200,67 | 80.77%  | 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\$ 5.172.596,47  | 19.23%  | 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\$ 26.892.797,14 | 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\$ 26.892.797,14 | 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%  |
| Total     | R\$ 26.837.754,83 | R\$ 26.892.797,14 | 5,94%  | R\$ 1.005.481,10 | 3,84%    | -2,10%  |
| 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 | 0,80%         | 3,38%   | 4,60%        | -            | 8,13%      |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...   | 10.740.670/0001-06 | 0,65%         | 2,75%   | 1,62%        | -            | 1,43%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...   | 11.060.913/0001-10 | 1,54%         | 5,35%   | 4,31%        | -            | 9,90%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF     | 10.740.658/0001-93 | 0,80%         | 3,65%   | -1,53%       | -            | 2,06%      |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP... | 14.386.926/0001-71 | 1,40%         | 5,26%   | 4,76%        | -            | 9,50%      |
| BNB RPPS IMA-B FI RF            | 08.266.261/0001-60 | 0,86%         | 3,78%   | -0,98%       | -            | 2,76%      |
| CAIXA FIC FI NOVO BRASIL RF...  | 10.646.895/0001-90 | 0,75%         | 3,54%   | -1,50%       | -            | 1,99%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...  | 10.577.503/0001-88 | 0,05%         | 1,92%   | -7,00%       | -            | -5,21%     |