

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2022



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

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			202.181.266,66	35,51%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	16.404.482,46	2,88%	264	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	3.125.195,39	0,55%	165	1,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	9.363.532,90	1,64%	92	2,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2022	6.919.792,48	1,22%	45	3,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.364.579,18	0,94%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	7.451.244,66	1,31%	209	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2024	6.372.600,00	1,12%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	15/08/2030	12.393.459,23	2,18%	23	5,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	45.610,73	0,01%	321	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	196.291,22	0,03%	869	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info		21.268.428,95	3,74%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	19.352,49	0,00%	47	0,09%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	304,73	0,00%	42	0,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	Não se ...	Não se aplica	47.705,95	0,01%	85	2,67%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	593.851,96	0,10%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	10.167.513,23	1,79%	69	1,61%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO P...	D+21	Não há	28.774.946,74	5,05%	1.223	3,38%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
BTG PACTUAL INFRA-B FI INFRA RENDA FIXA	5º dia ...	Não há	378.283,15	0,07%	14	5,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	10.508.118,09	1,85%	13	1,31%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2022)

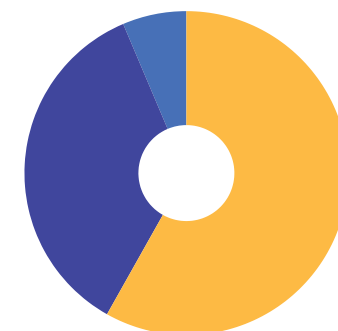
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.288.925,57	1,98%	5.515	3,60%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	21.660.387,63	3,80%	4.392	1,41%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	8.992.381,45	1,58%	33	0,58%	Artigo 8º, Inciso I
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	10.410.451,83	1,83%	6.823	2,29%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	7.870.163,49	1,38%	3.658	0,56%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	19.368.275,07	3,40%	4.043	2,12%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	16.022.151,69	2,81%	2.156	1,61%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	8.416.715,33	1,48%	15	13,96%	Artigo 8º, Inciso I
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	10.497.848,91	1,84%	4.597	3,78%	Artigo 9º, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	9.154.158,84	1,61%	69	0,67%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+6 du	Não há	5.539.708,99	0,97%	185	2,75%	Artigo 9º, Inciso II
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO ...	D+6 du	Não há	11.150.541,80	1,96%	222	19,70%	Artigo 9º, Inciso II
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	29.815.546,71	5,24%	3.228	6,92%	Artigo 10º, Inciso I
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	11.033.706,43	1,94%	10	6,35%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	9.737.387,00	1,71%	22	7,93%	Artigo 10º, Inciso I
BB VOTORANTIM ENERGIA SUSTENTÁVEL II FIP INFRAES...	Não se ...	Não se aplica	568.219,11	0,10%	87	0,40%	Artigo 10º, Inciso II
BRASIL ÓLEO & GÁS FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	455,01	0,00%	15	0,40%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	17.769.621,00	3,12%	99	0,70%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	Não se ...	Não se aplica	78.606,08	0,01%	39	0,13%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	2.364.594,84	0,42%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I F...	Não se ...	Não se aplica	10.633.401,01	1,87%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FI...	Não se ...	Não há	945.267,16	0,17%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
NOVA RAPOSO FIP MULTIESTRATÉGIA - NVRP11	Não se ...	Não se aplica	1.147.195,72	0,20%	226	0,67%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	184.535,10	0,03%		0,01%	Artigo 11º
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se ...	Não se aplica	85.776,42	0,02%		0,52%	Artigo 11º
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - O...	Não se ...	Não se aplica	2.984.897,45	0,52%		6,90%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		13.542,17	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			569.297.479,84				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			13.542,17	Artigo 6º			
PL Total			569.311.022,01				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Julho / 2022)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	202.181.266,66	35,51%	0,00%	25,00%	100,00%	367.116.213,18
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	67.440.497,03	11,85%	0,00%	10,00%	100,00%	501.856.982,81
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	569.297.479,84
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.464.873,99
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	196.291,22	0,03%	0,00%	0,00%	70,00%	398.311.944,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	70,00%	398.508.235,89
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	21.268.428,95	3,74%	0,00%	2,00%	20,00%	92.591.067,02
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	10,00%	661.215,13	0,12%	0,00%	0,00%	10,00%	56.268.532,85
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10,00%	38.942.459,97	6,84%	0,00%	6,00%	10,00%	17.987.288,01
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	10,00%	378.283,15	0,07%	0,00%	2,00%	10,00%	56.551.464,83
Total Renda Fixa	100,00%	331.068.442,11	58,15%	0,00%	45,00%	495,00%	

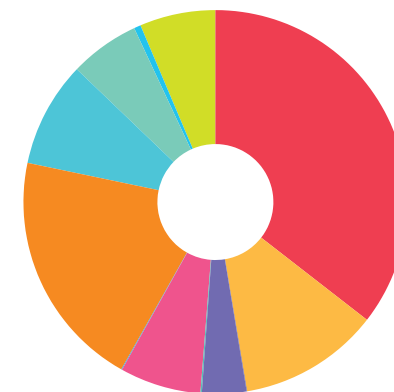


RENTA FIXA 331.068.442,11
RENTA VARIÁVEL 201.886.779,11
EXTERIOR 36.342.251,11

ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	114.537.570,15	20,12%	0,00%	20,00%	40,00%	113.181.421,79
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	227.718.991,94
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	50.586.640,14	8,89%	0,00%	10,00%	10,00%	6.343.107,84
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	33.507.359,93	5,89%	0,00%	5,00%	5,00%	-5.042.485,94
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.464.873,99
Artigo 11º	10,00%	3.255.208,97	0,57%	0,00%	5,00%	10,00%	53.674.539,01
Total Renda Variável	40,00%	201.886.779,19	35,46%	0,00%	40,00%	110,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	56.929.747,98
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	36.342.258,54	6,38%	0,00%	10,00%	10,00%	20.587.489,44
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	56.929.747,98
Total Exterior	10,00%	36.342.258,54	6,38%	0,00%	10,00%	30,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2022)

Gestão	valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	202.181.266,66	35,51	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	65.741.418,35	11,55	-
ICATU VANGUARDA	48.143.221,81	8,46	0,09
AZ QUEST INVESTIMENTOS	41.941.694,65	7,37	0,13
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	38.063.993,35	6,69	0,02
CAIXA DTVM	26.262.914,62	4,61	0,09
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	25.761.936,20	4,53	0,02
XP ASSET MANAGEMENT	21.648.390,71	3,80	0,15
OCCAM BRASIL	16.022.151,69	2,81	0,08
BV ASSET	12.749.121,26	2,24	0,03
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	11.664.444,59	2,05	0,00
ARX INVESTIMENTOS	10.508.118,09	1,85	0,02
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	9.737.387,00	1,71	0,99
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	8.416.715,33	1,48	0,10
GENIAL INVESTIMENTOS	5.539.708,99	0,97	0,07
PLANNER CORRETORA	2.984.897,45	0,52	0,11
PETRA CAPITAL	593.851,96	0,10	0,01
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIRO...	47.705,95	0,01	0,01
VILA RICA CAPITAL	19.352,49	0,00	0,01
VALORA INVESTIMENTOS	455,01	0,00	0,00
PLURAL	304,73	0,00	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
130% do CDI (Benchmark)	1,35%	8,52%	4,06%	7,50%	12,38%	15,94%	-	-
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	-0,31%	-7,59%	-3,59%	-6,88%	1,53%	18,33%	0,82%	0,38%
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,32%	8,62%	4,02%	7,52%	13,20%	19,98%	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3,45%	-78,91%	-75,55%	-79,34%	-88,37%	-70,89%	-	0,81%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-53,34%	-40,10%	-53,43%	-40,26%	-55,50%	421,65%	-	0,63%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,17%	6,66%	1,15%	6,61%	10,11%	16,59%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	8,06%	1,79%	7,45%	11,95%	19,70%	0,77%	0,03%
IMA Geral (Benchmark)	0,47%	4,98%	1,83%	4,76%	5,95%	7,72%	-	-
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,15%	6,61%	1,23%	6,77%	9,06%	16,54%	1,85%	0,05%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,01%	6,62%	1,13%	6,50%	10,04%	15,61%	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14%	3,69%	1,09%	3,27%	3,97%	-26,65%	0,94%	0,06%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,33%	2,93%	0,78%	2,96%	3,22%	1,26%	1,51%	0,06%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,32%	3,18%	0,79%	3,21%	3,47%	1,48%	1,51%	0,06%
IMA-B (Benchmark)	-0,88%	3,43%	-0,28%	4,20%	3,25%	5,86%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,15%	0,55%	-0,10%	1,49%	-1,70%	-5,59%	2,99%	0,08%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,03%	6,49%	3,11%	5,72%	9,39%	12,05%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,38%	-59,25%	-59,06%	-59,18%	-59,86%	-59,35%	0,28%	0,58%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,95%	5,87%	2,86%	5,18%	8,24%	9,65%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,90%	5,54%	2,69%	4,90%	7,81%	9,49%	0,00%	0,01%
IPCA (Benchmark)	-0,68%	4,77%	0,46%	4,21%	10,07%	19,97%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	7,21%	0,92%	7,11%	10,41%	15,65%	0,76%	0,04%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,17%	6,18%	0,98%	6,15%	9,87%	15,06%	1,47%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	8,06%	1,79%	7,45%	11,96%	19,27%	0,77%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	7,04%	1,33%	6,73%	10,61%	16,16%	0,91%	0,03%
BTG PACTUAL INFRA-B FI INFRA RENDA FIXA	-5,72%	-23,91%	-3,42%	-19,96%	-50,29%	-88,08%	10,24%	0,40%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 15,00% ao ano (Benchmark)	0,48%	13,54%	4,09%	11,63%	26,51%	58,40%	-	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	0,34%	-87,51%	-87,69%	-87,50%	-87,58%	-88,51%	1,70%	0,87%
S&P 500 (Benchmark)	9,11%	-13,34%	-0,04%	-8,53%	-6,03%	26,27%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	10,21%	-9,07%	2,63%	-4,08%	1,48%	38,77%	8,98%	0,21%
IPCA + 11,00% ao ano (Benchmark)	0,19%	11,25%	3,15%	9,70%	22,13%	47,63%	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS FIP MULTIESTRATÉGIA	-1,04%	661.349.400,00%	-	661.349.400,00%	661.349.400,00%	2,47%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	-0,04%	9,51%	2,44%	8,23%	18,84%	39,80%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	3,30%	9,46%	4,50%	9,65%	3,95%	-	-	-
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	-0,20%	8,34%	1,95%	7,24%	16,65%	34,70%	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-15,14%	59,25%	-15,86%	61,61%	57,98%	-	-	0,96%
NOVA RAPOSO FIP MULTIESTRATÉGIA - NVRP11	-0,07%	1,23%	-0,21%	1,36%	-63,57%	-64,00%	0,00%	0,64%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGI...	0,64%	4,52%	-1,53%	0,39%	0,27%	-	-	-
IDIV (Benchmark)	1,98%	6,66%	-2,58%	-0,76%	-0,49%	13,65%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,85%	-1,18%	-4,55%	-7,53%	-17,74%	-12,32%	7,76%	0,19%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	4,69%	-1,58%	-4,37%	-8,01%	-15,30%	0,25%	-	-
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,55%	-6,06%	-8,01%	-12,13%	-14,98%	-	7,55%	0,21%
BB AGRO FIC AÇÕES	3,28%	-4,59%	-7,77%	-4,87%	-5,32%	-	7,37%	0,20%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,51%	-5,83%	-3,75%	-10,32%	-35,56%	-30,25%	8,55%	0,25%
OCCAM FIC AÇÕES	3,41%	-0,75%	-2,76%	-6,82%	-13,67%	-1,97%	7,13%	0,19%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4,55%	-3,18%	-5,97%	-10,12%	-20,97%	-13,17%	6,81%	0,21%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1,54%	-	-0,20%	-2,83%	-	-	2,08%	-
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	4,96%	7,00%	-2,57%	-4,76%	-10,10%	3,71%	8,24%	0,24%

SMLL (Benchmark)	5,16%	-15,55%	-13,62%	-18,34%	-32,57%	-19,00%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3,78%	-8,64%	-8,63%	-10,99%	-23,76%	-12,16%	6,00%	0,17%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,78%	-7,95%	-8,08%	-10,24%	-23,27%	-11,47%	5,97%	0,17%

CDI (Benchmark)	1,03%	6,49%	3,11%	5,72%	9,39%	12,05%	-	-
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,14%	5,80%	0,80%	5,81%	9,17%	17,95%	1,51%	0,04%

IFIX (Benchmark)	0,66%	0,33%	0,04%	1,34%	-0,35%	2,96%	-	-
BB VOTORANTIM ENERGIA SUSTENTÁVEL II FIP INFRAESTRUTURA - ESUD11	0,72%	0,02%	0,45%	0,13%	-1,55%	-22,28%	1,40%	0,01%
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	-0,38%	-2,12%	-1,20%	-1,92%	-0,37%	9,91%	0,00%	0,17%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	-3,26%	-47,95%	0,00%	-41,06%	-63,67%	-78,91%	26,20%	0,34%

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

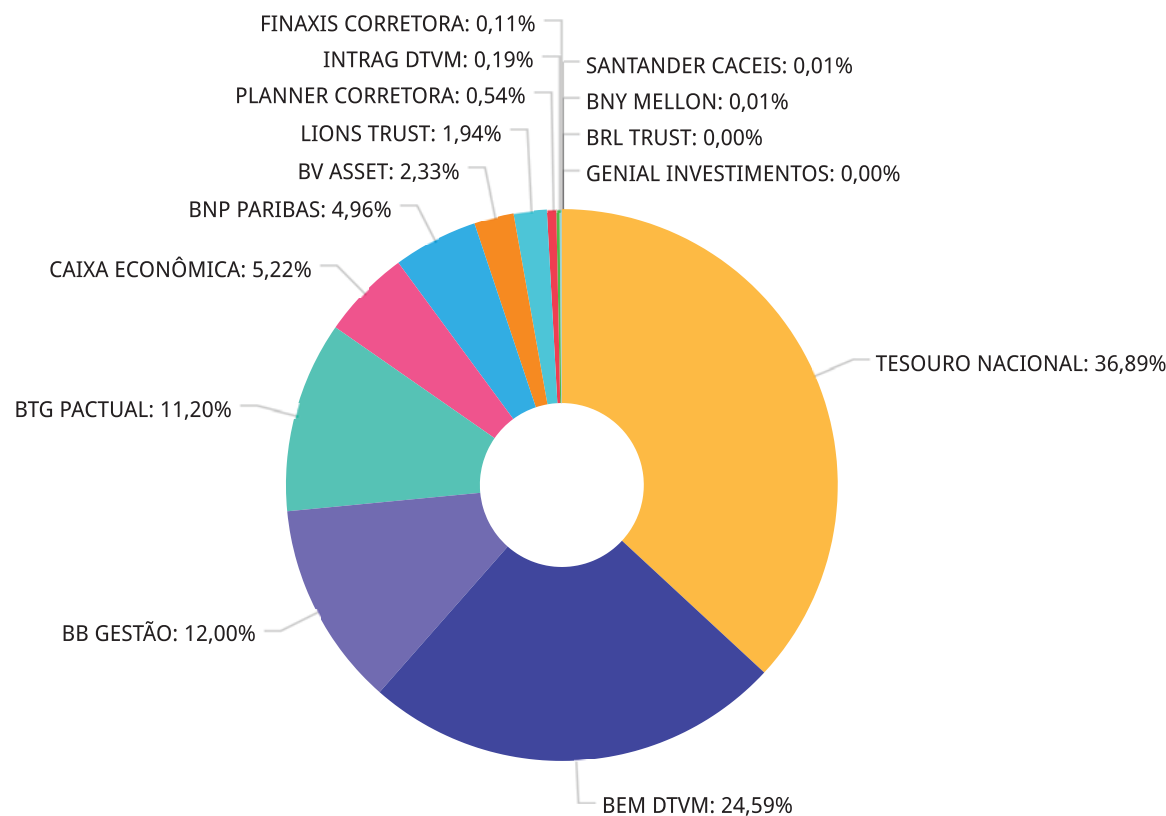
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	-8,14%	-21,79%	-18,44%	-20,01%	-29,82%	-37,53%	8,46%	0,22%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	6,84%	-20,99%	3,62%	-13,05%	-9,35%	18,81%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	7,73%	-19,76%	0,07%	-11,87%	-8,87%	26,34%	11,68%	0,18%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	12,36%	-55,08%	-15,93%	-37,50%	-56,12%	-	27,24%	0,44%
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	6,22%	-20,95%	1,36%	-12,29%	-15,31%	-	11,80%	0,18%

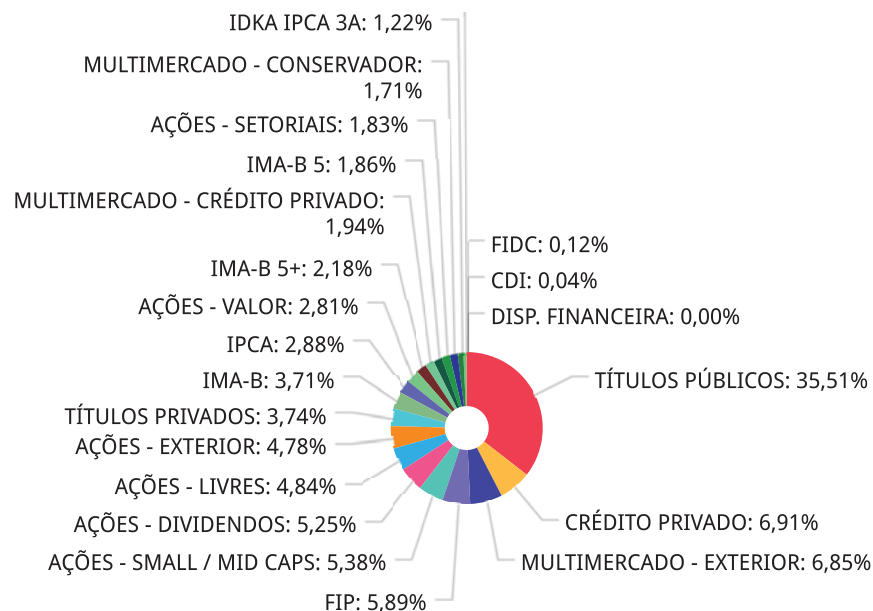
MSCI ACWI (Benchmark)	5,85%	-21,45%	2,90%	-13,91%	-10,79%	15,22%	-	-
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	10,07%	-26,05%	-4,90%	-18,64%	-25,56%	-0,38%	12,26%	0,22%

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



TESOURO NACIONAL	202.181.266,66
BEM DTVM	134.769.743,58
BB GESTÃO	65.741.418,35
BTG PACTUAL	61.382.728,63
CAIXA ECONÔMICA	28.627.509,46
BNP PARIBAS	27.188.099,70
BV ASSET	12.749.121,26
LIONS TRUST	10.633.401,01
PLANNER CORRETORA	2.984.897,45
INTRAG DTVM	1.031.043,58
FINAXIS CORRETORA	593.851,96
SANTANDER CACEIS	78.606,08
BNY MELLON	47.705,95
BRL TRUST	19.352,49
GENIAL INVESTIMENTOS	304,73

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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	202.181.266,66	■ CRÉDITO PRIVADO	39.320.743,12	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	38.969.705,55
■ FIP	33.507.359,93	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	30.652.769,08	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	29.876.393,16
■ AÇÕES - LIVRES	27.575.804,39	■ AÇÕES - EXTERIOR	27.188.099,70	■ TÍTULOS PRIVADOS	21.268.428,95
■ IMA-B	21.100.712,08	■ IPCA	16.404.482,46	■ AÇÕES - VALOR	16.022.151,69
■ IMA-B 5+	12.393.459,23	■ MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	11.033.706,43	■ IMA-B 5	10.576.440,05
■ AÇÕES - SETORIAIS	10.410.451,83	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	9.737.387,00	■ IDKA IPCA 3A	6.919.792,48
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	3.255.208,97	■ FIDC	661.215,13	■ CDI	241.901,95
■ DISP. FINANCEIRA	13.542,17				

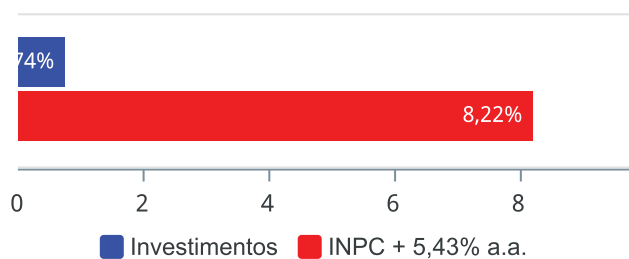
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 2022)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	23/08/2021	786	4.138,609878	4.650,691352	3.252.947,36	3.655.443,40	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/09/2021	740	4.212,618239	4.666,008716	3.117.337,50	3.452.846,45	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	26/10/2021	9.616	3.969,354649	4.344,730690	38.169.314,30	41.778.930,32	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	29/10/2021	5.795	3.967,190665	4.326,276514	22.989.869,90	25.070.772,40	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	23/11/2021	1.070	4117,162661	4.429,165517	4.405.364,05	4.739.207,10	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	20/12/2021	4.550	4184,787611	4.448,245461	19.040.783,63	20.239.516,85	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	17/12/2021	3.380	4.217,547483	4.011,682646	14.255.310,49	13.559.487,34	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	23/12/2021	2.480	4.209,588785	4.467,393162	10.439.780,19	11.079.135,04	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/01/2022	2.350	3945,9088	4.262,523915	9.272.885,68	10.016.931,20	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/07/2022	1.500	4018,213871	4.016,636974	6.027.320,81	6.024.955,46	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/07/2021	664	4.446,535372	4.937,599972	2.952.499,49	3.278.566,38	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	26/07/2021	487	4.514,560371	4.990,610886	2.198.590,90	2.430.427,50	Curva
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2027	04/06/2018	8.169	981,57508630	970,111954	8.018.486,88	7.924.844,55	Curva
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	21/06/2018	37.673	944,42428211	932,429610	35.579.295,98	35.127.420,70	Curva
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	16/08/2018	14.670	922,885690	940,884933	13.538.733,07	13.802.781,97	Curva

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	533.873.086,73	53.491.124,79	39.816.397,47	546.819.589,96	-728.224,09	-728.224,09	-0,13%	-0,13%	1,11%	1,11%	-11,93%	6,85%
Fevereiro	546.819.589,96	18.078.450,92	17.593.242,22	551.998.775,45	4.693.976,79	3.965.752,70	0,86%	0,72%	1,40%	2,53%	28,56%	6,67%
Março	551.998.775,45	15.975.802,16	9.338.787,04	572.187.488,84	13.551.698,27	17.517.450,97	2,43%	3,17%	2,18%	4,77%	66,40%	7,44%
Abril	572.187.488,84	9.074.056,64	6.298.435,36	563.075.041,68	-11.888.068,44	5.629.382,53	-2,07%	1,03%	1,44%	6,28%	16,46%	6,37%
Mai	563.075.041,68	10.313.002,66	7.438.237,22	567.143.174,74	1.193.367,62	6.822.750,15	0,21%	1,25%	0,91%	7,25%	17,19%	7,42%
Junho	567.143.174,74	19.057.599,71	16.039.853,24	555.690.520,98	-14.470.400,23	-7.647.650,08	-2,54%	-1,32%	1,06%	8,40%	-15,75%	6,59%
Julho	555.690.520,98	27.668.145,45	25.701.419,97	569.297.479,84	11.640.233,38	3.992.583,30	2,09%	0,74%	-0,16%	8,22%	8,96%	5,76%

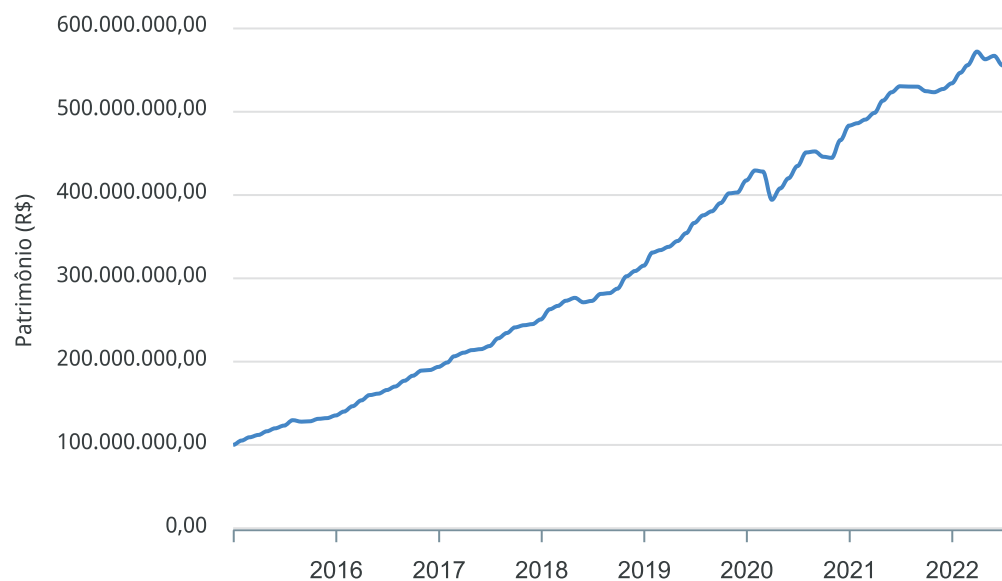
Investimentos x Meta de Rentabilidade



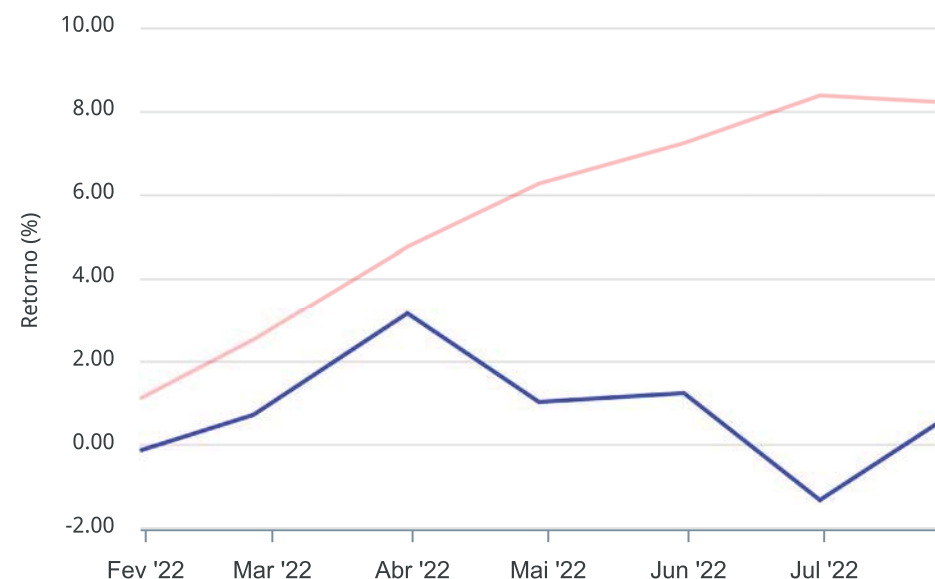
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- ☒ 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

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

F NDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	294,57	0,00	0,00	304,73	10,16	3,45%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	3.099.663,57	0,00	0,00	3.125.195,39	25.531,82	0,82%	0,82%	0,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	6.863.317,37	0,00	0,00	6.919.792,48	56.475,11	0,82%	0,82%	0,77%
LETRA FINANCEIRA BTG	21.153.008,00	0,00	0,00	21.268.428,95	115.420,95	0,55%	-	-
BTG PACTUAL INFRA-B FI INFRA RENDA FIXA	401.210,63	0,00	25.000,01	378.283,15	2.072,53	0,52%	-5,71%	10,24%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	14.177.190,32	8.578.806,35	22.644.564,45	196.291,22	84.859,00	0,37%	0,95%	0,00%
TÍTULOS PÚBLICOS	198.354.287,11	6.027.320,80	2.953.521,13	202.181.266,66	753.179,88	0,37%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.335.505,31	0,00	0,00	9.363.532,90	28.027,59	0,30%	0,30%	0,91%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI...	28.730.611,93	0,00	0,00	28.774.946,74	44.334,81	0,15%	0,15%	1,85%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.357.120,83	0,00	0,00	5.364.579,18	7.458,35	0,14%	0,14%	0,94%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	42.622,32	47.800,00	44.895,96	45.610,73	84,37	0,09%	0,90%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	16.391.723,73	0,00	0,00	16.404.482,46	12.758,73	0,08%	0,08%	0,76%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	41.473,98	0,00	22.076,46	19.352,49	-45,03	-0,11%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.185.207,07	0,00	0,00	10.167.513,23	-17.693,84	-0,17%	-0,17%	1,47%
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	47.852,83	0,00	0,00	47.705,95	-146,88	-0,31%	-0,31%	0,82%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.475.229,91	0,00	0,00	7.451.244,66	-23.985,25	-0,32%	-0,32%	1,51%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.393.560,00	0,00	0,00	6.372.600,00	-20.960,00	-0,33%	-0,33%	1,51%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	596.089,23	0,00	0,00	593.851,96	-2.237,27	-0,38%	-0,38%	0,28%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	12.537.702,10	0,00	0,00	12.393.459,23	-144.242,87	-1,15%	-1,15%	2,99%
Total Renda Fixa	341.183.670,81	14.653.927,15	25.690.058,01	331.068.442,11	920.902,16	0,27%		1,52%

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

FONDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRASIL ÓLEO & GÁS FIP MULTISTRATÉGIA	459,79	0,00	4.639,98	455,01	4.635,20	1.008,11%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	27.053.797,20	0,00	0,00	29.815.546,71	2.761.749,51	10,21%	10,21%	8,98%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.253.012,44	0,00	0,00	7.870.163,49	617.151,05	8,51%	8,51%	8,55%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	10.508.118,09	508.118,09	5,08%	3,55%	7,55%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	8.018.944,39	0,00	0,00	8.416.715,33	397.770,94	4,96%	4,96%	8,24%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.797.468,55	0,00	0,00	11.288.925,57	491.457,02	4,55%	4,55%	6,81%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	18.649.676,02	0,00	0,00	19.368.275,07	718.599,05	3,85%	3,85%	7,76%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.664.932,43	0,00	0,00	8.992.381,45	327.449,02	3,78%	3,78%	5,97%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	20.872.054,53	0,00	0,00	21.660.387,63	788.333,10	3,78%	3,78%	6,00%
OCCAM FIC AÇÕES	15.494.201,96	0,00	0,00	16.022.151,69	527.949,73	3,41%	3,41%	7,13%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.289.125,08	0,00	0,00	2.364.594,84	75.469,76	3,30%	-	-
BB AGRO FIC AÇÕES	10.079.585,47	0,00	0,00	10.410.451,83	330.866,36	3,28%	3,28%	7,37%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	88.667,76	0,00	5.196,36	85.776,42	2.305,02	2,60%	-3,26%	26,20%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	9.589.602,00	0,00	0,00	9.737.387,00	147.785,00	1,54%	1,54%	2,08%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATÉGIA	14.627.878,29	3.014.218,30	0,00	17.769.621,00	127.524,41	0,72%	-	-
BB VOTORANTIM ENERGIA SUSTENTÁVEL II FIP INFRAESTR...	564.148,54	0,00	0,00	568.219,11	4.070,57	0,72%	0,72%	1,40%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	10.565.655,36	0,00	0,00	10.633.401,01	67.745,65	0,64%	-	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	78.336,30	0,00	0,00	78.606,08	269,78	0,34%	0,34%	1,70%
NOVA RAPOSO FIP MULTISTRATÉGIA - NVRP11	1.147.957,28	0,00	0,00	1.147.195,72	-761,56	-0,07%	-0,07%	0,00%
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	11.049.523,71	0,00	0,00	11.033.706,43	-15.817,28	-0,14%	-0,14%	1,51%

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

FONDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORP...	2.996.271,79	0,00	0,00	2.984.897,45	-11.374,34	-0,38%	-0,38%	0,00%
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	961.342,71	0,00	0,00	945.267,16	-16.075,55	-1,67%	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	200.894,94	0,00	1.525,62	184.535,10	-14.834,22	-7,38%	-8,14%	8,46%
Total Renda Variável	181.043.536,54	13.014.218,30	11.361,96	201.886.779,19	7.840.386,31	4,04%		6,62%

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

F NDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	4.930.379,15	0,00	0,00	5.539.708,99	609.329,84	12,36%	12,36%	27,24%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	9.537.684,00	0,00	0,00	10.497.848,91	960.164,91	10,07%	10,07%	12,26%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	8.497.199,14	0,00	0,00	9.154.158,84	656.959,70	7,73%	7,73%	11,68%
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO...	10.498.051,34	0,00	0,00	11.150.541,80	652.490,46	6,22%	6,22%	11,80%
Total Exterior	33.463.313,63	0,00	0,00	36.342.258,54	2.878.944,91	8,60%		14,26%

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 nº 519, de 24 de agosto de 2011 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.