



RELATÓRIO SEMESTRAL DE DILIGÊNCIA

1º Semestre de 2022

SUMÁRIO

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS	3
APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL	4
INTRODUÇÃO	5
ANÁLISE DE CARTEIRA.....	6
Composição da Carteira de Investimentos.....	6
Distribuição por artigos da Res 4.963/2021	8
Distribuição por estratégias alvo da Política de Investimentos	9
Distribuição por Indexadores	10
Distribuição por segmentos	11
Controle de Risco	13
Liquidez	14
ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO DAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS.....	15
Instituições Financeiras.....	15
Gestoras:	15
Administradoras:	16
Análise da Situação das Instituições Financeiras.....	16
ANÁLISE E ACOMPANHAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS.....	17
Fundos Líquidos:.....	17
Fundos Ilíquidos ou Estruturados:	17
ACOMPANHAMENTO DE RISCOS E MONITORAMENTO DE NOTÍCIAS	20
CONCLUSÃO	22

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos do **ANGRAPREV** analisou e atestou a conformidade do Relatório de Diligência referente ao 1º Semestre de 2022 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do **ANGRAPREV**, e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos, e encaminha ao Conselho Fiscal para aprovação.

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL

O Conselho Fiscal do **ANGRAPREV**, considerando os dados constantes no Relatório de Diligência referente ao 1º Semestre de 2022 apresentado, e as explicações dos gestores, **APROVA** o Relatório.

INTRODUÇÃO

Este **Relatório de Diligência** foi elaborado visando atender as novas diretrizes de modernização, e adesão às boas práticas de governança corporativa impostas aos RPPS pelo Ministério da Economia, através da Secretaria de Previdência, com o Programa Pró-Gestão, e atende o ítem 3.2.6 do respectivo Manual do Programa versão 3.3 aprovado pela Portaria SPREV 918 de 02/02/2022.

ANÁLISE DE CARTEIRA

Composição da Carteira de Investimentos

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
TÍTULOS PÚBLICOS	152.324.245,80	15,16%	0,00		7° I a
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	78.263.565,25	7,79%	6.996.220.208,08	1,12%	7° I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.671.802,16	1,16%	5.700.982.768,47	0,20%	7° I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.676.254,62	1,66%	5.103.254.867,87	0,33%	7° I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.010.311,81	1,79%	546.767.222,62	3,29%	7° I b
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.041.442,50	1,30%	100.979.522,46	12,91%	7° I b
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.057.515,00	1,30%	234.204.187,53	5,58%	7° I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.459.301,47	0,74%	6.957.180.815,09	0,11%	7° I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	45.987.047,66	4,58%	11.226.928.091,22	0,41%	7° I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.527.765,75	3,64%	11.084.704.335,99	0,33%	7° I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	27.438.356,17	2,73%	5.096.804.349,76	0,54%	7° I b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.128.785,91	0,11%	3.751.851.953,61	0,03%	7° III a
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	23.843.519,88	2,35%	857.365.563,33	2,76%	7° III a
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	32.971.235,13	3,28%	1.352.871.181,17	2,44%	7° III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	30.078.047,57	2,99%	12.613.402.228,26	0,24%	7° III a
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	5.414.707,98	0,54%	439.811.945,70	1,23%	7° III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	14.941.412,12	1,49%	2.668.371.249,57	0,56%	7° III a
MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA	20.959.548,17	2,09%	510.513.087,88	4,11%	7° III a
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	46.084.861,49	4,59%	743.360.830,24	6,20%	7° III a
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	23.000.515,95	2,29%	784.041.551,98	2,93%	7° III a
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	6.520,37	0,00%	216.576,81	3,01%	7° V a
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	8.175.817,31	0,81%	196.409.943,73	4,16%	7° V b
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	911.041,81	0,09%	27.085.080,97	3,36%	7° V b
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	17.828.803,05	1,77%	333.342.779,70	5,35%	8° I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	13.326.094,56	1,33%	313.294.053,39	4,25%	8° I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8.734.314,13	0,87%	1.508.361.079,83	0,58%	8° I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.372.611,43	1,03%	467.445.731,05	2,22%	8° I

BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	12.471.776,33	1,24%	395.433.404,84	3,15%	8° I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.959.988,13	0,49%	1.325.121.841,07	0,37%	8° I
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6.143.488,22	0,61%	49.171.876,34	12,49%	8° I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	43.857.910,91	4,37%	1.134.872.520,13	3,86%	8° I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.658.321,49	0,86%	889.058.860,37	0,97%	8° I
META VALOR FI AÇÕES	16.068.525,47	1,60%	233.820.067,07	6,87%	8° I
MULTINVEST FI AÇÕES	5.223.915,83	0,52%	74.889.811,07	6,98%	8° I
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	862.186,43	0,08%	9.298.111,20	9,27%	8° I
OCCAM FIC AÇÕES	16.653.643,60	1,66%	969.621.759,32	1,72%	8° I
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	15.517.467,39	1,54%	86.737.242,34	17,89% ▲	8° I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	47.029.405,15	4,68%	306.366.973,83	15,35% ▲	8° I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	6.374.052,14	0,63%	186.106.545,82	3,42%	8° I
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.696.871,64	0,17%	296.300.560,39	0,57%	8° I
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD ...	9.008.443,06	0,90%	14.900.000.000,00	0,08%	9° II
CLOU GLOBAL X MIRAE ASSET CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXT...	8.373.373,03	0,83%	6.800.000.000,00	0,12%	9° II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	5.995.842,85	0,60%	179.511.776,28	3,34%	9° II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	11.057.588,63	1,10%	269.329.951,07	4,11%	9° II
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	19.885.740,33	1,98%	775.941.708,13	2,56%	9° III
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.139.374,57	0,11%	127.248.350,22	0,90%	9° III
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.827.022,17	0,38%	25.823.215,23	14,82%	9° III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.799.331,83	0,48%	1.869.646.059,30	0,26%	9° III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.185.848,77	0,22%	118.016.991,27	1,85%	10° I
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	12.553.862,33	1,25%	393.628.937,87	3,19%	10° I
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	1.688.389,58	0,17%	25.347.727,75	6,66%	10° I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	9.582.949,52	0,95%	120.868.950,78	7,93%	10° I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	15.326.740,55	1,53%	160.450.442,76	9,55%	10° I
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	14.627.878,28	1,46%	2.138.523.311,79	0,68%	10° II
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	3.099.608,06	0,31%	116.607.223,08	2,66%	10° II
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.474.635,47	0,25%	0,00		11°
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	4.754.285,12	0,47%	148.802.863,04	3,20%	11°
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	10.654.463,85	1,06%	0,00		11°

Em 30/06/2022 a carteira de investimentos do **ANGRAPREV** alcançou o valor de R\$ 1.004588.375,88. Suas posições estão em conformidade com a Resolução 4.963/21.

Distribuição por artigos da Res 4.963/2021

Artigos	Limite (%)	Utilizado	
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	15,16%	152.324.245,80
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	26,69%	268.133.362,39
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	19,73%	198.222.634,20
7º V a - FIDC Cota Sênior	10,00%	0,00%	6.520,37
7º V b - Fundos de RF - Crédito Privado	10,00%	0,90%	9.086.859,12
8º I - Fundos de Ações	40,00%	23,47%	235.779.375,90
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,43%	34.435.247,57
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	2,95%	29.651.468,90
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	4,11%	41.337.790,75
10º II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	1,76%	17.727.486,34
11º - Fundos Imobiliários	10,00%	1,78%	17.883.384,44

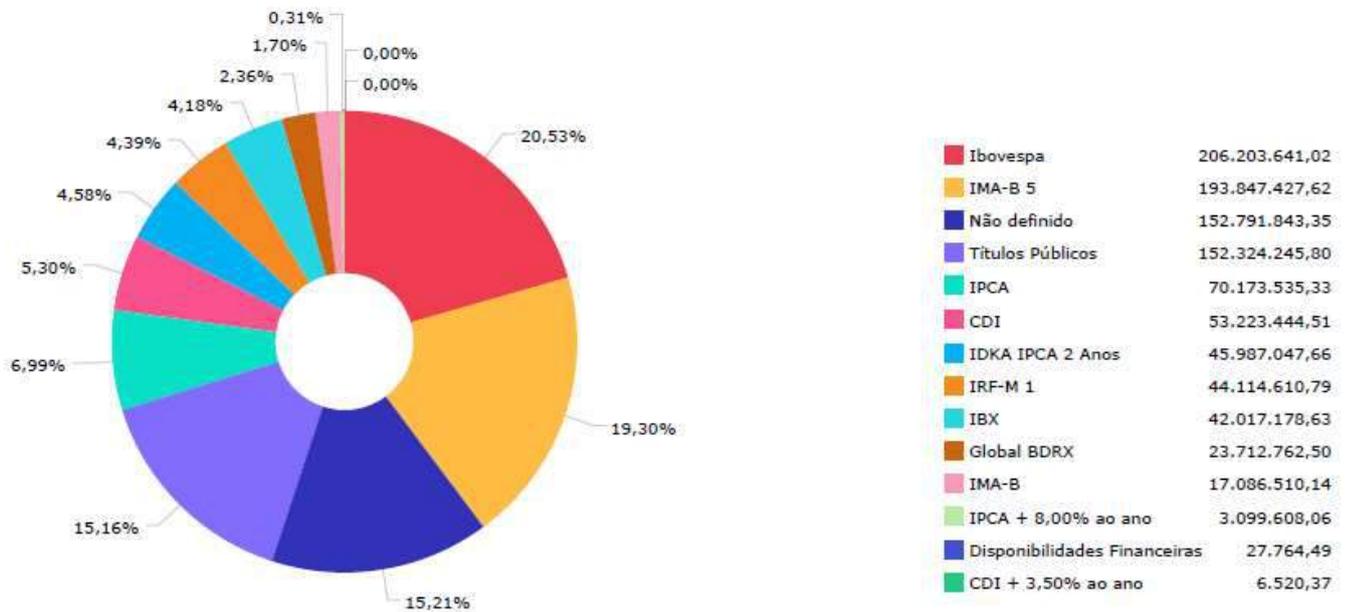
O **ANGRAPREV** vem mantendo a totalidade de seus recursos aplicados em fundos de investimentos das estratégias definidas nos artigos da Res 4.962/21 conforme detalhado na tabela acima. Tal distribuição está adequada à execução de sua Política de Investimentos aprovada para o ano de 2022, assim como atende os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos para a Carteira de Investimentos.

Distribuição por estratégias alvo da Política de Investimentos

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	15,16%	0,00%	21,16%	61,61%
7º I b - FI 100% Títulos TN	26,69%	16,60%	21,16%	61,61%
7º III a - FI Referenciados RF	19,73%	2,51%	3,34%	70,00%
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	3,34%	20,00%
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,90%	0,00%	3,50%	10,00%
8º I - Fundos de Ações	23,47%	20,63%	23,38%	40,00%
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	4,13%	40,00%
9º II - Constituídos no Brasil	3,43%	2,63%	3,50%	10,00%
9º III - Ações - BDR Nível I	2,95%	2,63%	3,50%	10,00%
10º I - Fundos Multimercados	4,11%	4,50%	6,00%	10,00%
10º II - Fundos em Participaçõ...	1,76%	0,00%	2,50%	2,50%
11º - Fundos Imobiliários	1,78%	0,00%	0,00%	0,00%
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%

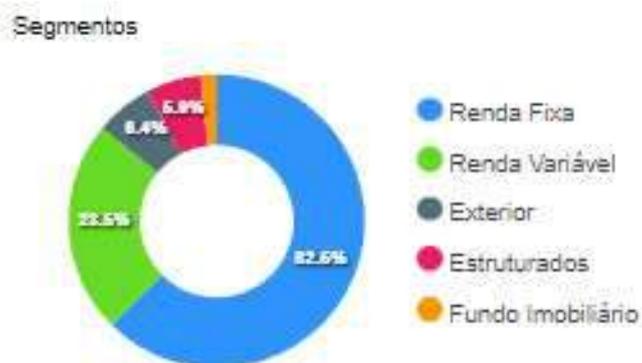
A situação ao término do semestre evidencia para o **ANGRAPREV** que, apesar de alguns objetivos não terem sido alcançados (estratégias alvo), ficou demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria política de investimentos definida para o ano de 2022. As diferenças verificadas entre os percentuais da Carteira de Investimentos em relação à Política de Investimentos, demonstra apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2022 ainda não foram integralmente atingidos, não configurando desenquadramento em relação aos limites legais.

Distribuição por Indexadores



No tocante a distribuição dos recursos por indexadores, o gráfico acima demonstra que o **ANGRAPREV** vem mantendo a totalidade de seus recursos aplicados em ativos e fundos de investimentos indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e que estão em conformidade, com os objetivos pretendidos de rentabilidade e liquidez para a Carteira de Investimentos.

Distribuição por segmentos



A carteira de investimentos do **ANGRAPREV** está segregada de acordo com a Res 4.963/21 entre os segmentos de renda fixa 62,5%, renda variável 23,5%, investimentos no exterior 6,4%, investimentos estruturados 5,9% e fundos imobiliários 1,7%.

Rentabilidade e Riscos

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	983.185.970,32	37.179.497,27	30.799.507,72	993.688.912,70	4.122.952,83	4.122.952,83	0,42% ▲	0,42%	0,94%	0,94%	44,68%	3,92%
Fevereiro	993.688.912,70	12.217.293,39	8.751.027,84	1.003.758.089,94	6.602.911,49	10.725.864,32	0,66% ▲	1,08%	1,37%	2,33%	46,35%	3,53%
Março	1.003.758.089,94	8.336.000,00	4.395.000,00	1.033.371.700,51	25.872.610,57	36.398.474,89	2,55% ▲	3,66%	2,04%	4,42%	82,81%	4,21%
Abril	1.033.371.700,51	69.268.600,01	64.062.062,90	1.020.810.804,87	-17.767.432,75	18.631.042,14	-1,71% ▼	1,88%	1,42%	5,81%	31,81%	3,47%
Mai	1.020.810.804,87	36.219.578,01	30.408.588,96	1.033.591.193,35	6.969.399,43	25.600.441,57	0,68% ▲	2,56%	0,89%	6,85%	37,66%	4,16%
Junho	1.033.591.193,35	43.882.522,00	42.849.741,71	1.004.588.375,78	-30.035.597,86	-4.435.156,29	-2,90% ▼	-0,40%	1,07%	7,99%	-5,01%	4,38%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	36.398.474,89	3,66%	4,42%
2º Trim	-40.833.631,18	-3,92%	3,42%
1º Sem	-4.435.156,29	-0,40%	7,99%

Por fim, com relação à rentabilidade das aplicações, o **ANGRAPREV** apresentou no primeiro semestre de 2022, uma rentabilidade acumulada de -0,40% contra meta atuarial no mesmo período de 7,99%, lembrando que para o ano de 2022 a meta atuaria vigente é de IPCA + 4,89% que é uma imposição legal através da portaria SPREV 6.132, que trouxe a taxa máxima para planos com duration de 18,5 anos, que se justifica pela média de remuneração de títulos públicos nos últimos 5 anos.

A rentabilidade apresentada no período, voltou a ser impactada de forma contundente pela conjuntura econômica incerta, e a persistência do processo inflacionário ascendente, mantendo as taxas de juros reais negativas, e pressionando os mercados de Bolsa e Ativos Reais gerando alavancagem demasiada e distorcida de preços, e fazendo com que os riscos da carteira permaneçam sensíveis, como se pode observar pela evolução do indicador VaR no ano.

Controle de Risco

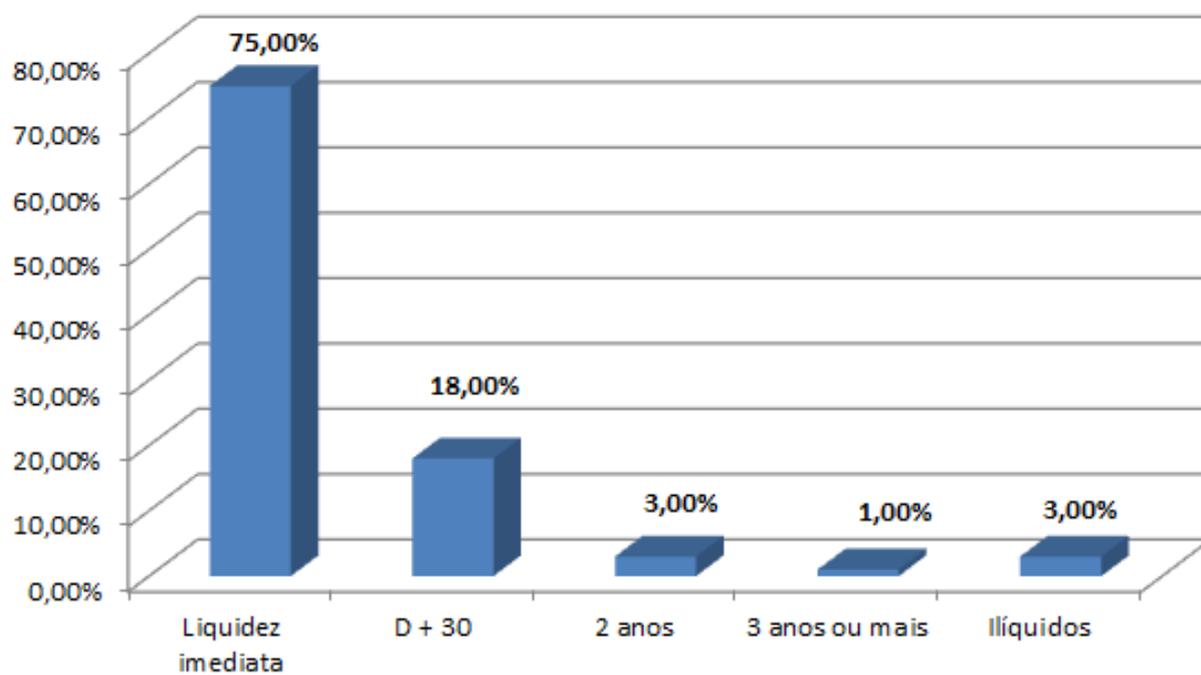
É relevante mencionar que qualquer aplicação financeira está sujeita à incidência de fatores de risco que podem afetar adversamente o seu retorno, e conseqüentemente, fica o **ANGRAPREV** obrigado a exercer o acompanhamento e o controle sobre esses riscos.

Quando se trata de risco de mercado, que é o risco inerente a todas as modalidades de aplicações financeiras disponíveis no mercado financeiro; corresponde à incerteza em relação ao resultado de um investimento financeiro ou de uma carteira de investimento, em decorrência de mudanças futuras nas condições de mercado. É o risco de variações, oscilações nas taxas e preços de mercado, tais como taxa de juros, preços de ações e outros índices.

Os resultados apresentados pela carteira de investimentos do **ANGRAPREV** são reflexos das oscilações do mercado, não estando isentos de novas baixas, mantendo-se a volatilidade do mercado e as incertezas. A evolução mensal do VaR da carteira de investimentos nos segmentos de renda fixa e renda variável estão em conformidade com a estratégia de risco traçada na Política Anual de Investimentos para o ano de 2022 e, caso haja o descasamento, para a regularização, sugerimos ater para as Políticas de Contingências.

Liquidez

A Carteira de Investimentos possui a configuração gerencial de liquidez apresentada abaixo. Sendo que as posições de liquidez imediata, D + 30 e até 2 anos totalizam 96% da carteira consitutando-se dessa forma, em posição confortável para auxílio no cumprimento das obrigações do **ANGRAPREV**.

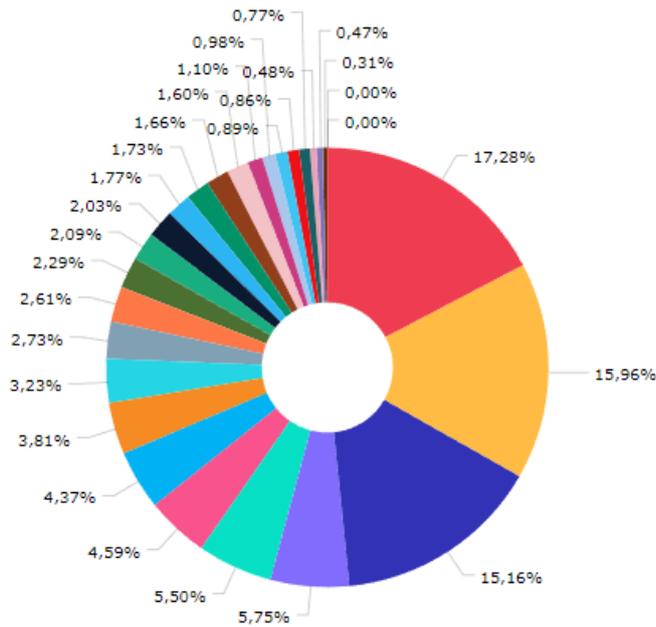


ACOMPANHAMENTO SISTEMÁTICO DAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS

Instituições Financeiras

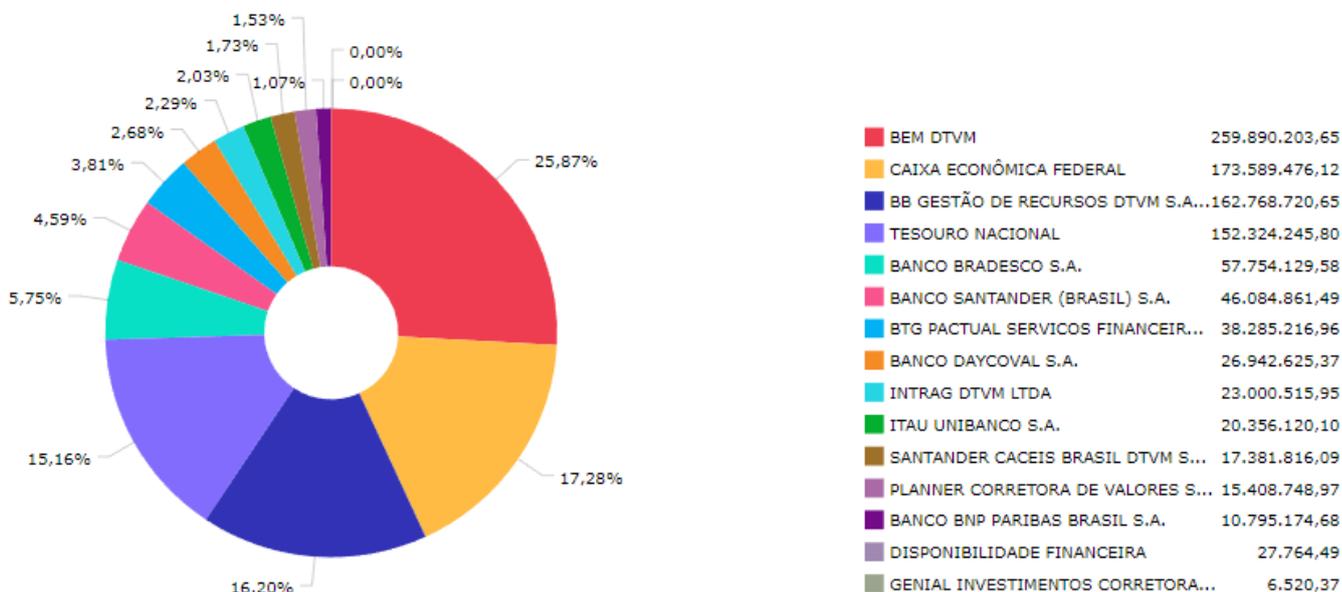
Os fundos de investimentos que compõe a carteira de investimentos do **ANGRAPREV**, tem os seguintes prestadores de serviços de Gestão e Administração:

Gestoras



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	173.589.476,12
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	160.294.085,18
TESOURO NACIONAL	152.324.245,80
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	57.754.129,58
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	55.205.222,46
SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...	46.084.861,49
CONSTANCIA INVESTIMENTOS LTDA.	43.857.910,91
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	38.285.216,96
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	32.433.020,12
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	27.384.325,54
QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINA...	26.171.931,24
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA...	23.000.515,95
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS L...	20.959.548,17
ITAU UNIBANCO S.A.	20.356.120,10
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	17.828.803,05
MIRAE ASSET GLOBAL INVESTIMENT...	17.381.816,09
OCCAM BRASIL GESTAO DE RECURSO...	16.653.643,60
META ASSET MANAGEMENT LTDA.	16.068.525,47
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	11.057.588,63
PLURAL INVESTIMENTOS GESTAO DE...	9.822.865,02
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	8.981.965,59
ICATU VANGUARDA GESTAO DE RECU...	8.658.321,49
MULTINVEST CAPITAL ADMINISTRAD...	7.774.491,84
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPA...	4.799.331,83
ZION GESTAO DE RECURSOS LTDA	4.754.285,12
LEGATUS GESTORA DE RECURSOS LT...	3.099.608,06
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	27.764,49
GENIAL GESTAO LTDA	6.520,37

Administradoras



Análise da Situação das Instituições Financeiras

A carteira na parcela referente a fundos de investimento, mantém a totalidade dos recursos aplicados em fundos cujos gestores e administradores são instituições regulares junto aos órgãos de Controle e Fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de consistência e regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos. A situação fiscal pode ser analisada através das certidões positivas, ainda que com efeito de negativas, bem como através das certidões de falência e concordata. É possível apurar se uma execução fiscal está suspensa mediante o pagamento mensal do débito tributário.

A situação jurídica é constantemente verificada através de pesquisa do nome dos sócios responsáveis pela instituição financeira nos mecanismos de busca disponíveis, site dos Tribunais, Receita Federal, BACEN e CVM – na hipótese de serem localizados processos, pedido de informações poderá ser formalizado.

Com o advento da Portaria 1.467, de 2 de junho de 2022, reforçou-se a necessidade de conferência quanto a inexistência de suspensão ou inabilitação pela CVM ou BACEN, observância de elevado padrão ético de conduta, análise do histórico de atuação dos principais controladores, incluindo a experiência mínima de 5 anos dos profissionais diretamente ligados à gestão de ativos, bem como análise quanto ao volume de recursos sob gestão e administração da instituição.

Como forma de segurança, ainda há conferência em relação à forma, se todas as declarações foram apresentadas em página eletrônica timbrada e devidamente assinada, eletronicamente ou manualmente e digitalizada. A avaliação documental e jurídica é encerrada com a elaboração de um parecer com detalhamento da análise realizada.

ANÁLISE E ACOMPANHAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS

Com o objetivo de garantir a apresentação dos lastros dos investimentos, ou seja, compreender a garantia de cada investimento que o **ANGRAPREV** possui, apresentamos como anexos, a abertura da carteira de cada fundo, com suas respectivas proporções nos ativos.

Destacamos a seguir os critérios de análises específicas:

Fundos Líquidos:

Considerando os fundos líquidos investidos pelo **ANGRAPREV**, é possível verificar todos os lastros dos papéis mantidos por esses fundos, que na sua composição estão de acordo com a resolução CVM 4.963/2021 e suas atualizações vigentes.

Fundos Ilíquidos ou Estruturados:

Já em relação aos fundos ilíquidos ou estruturados, considerando as particularidades de cada um que detalhamos individualmente abaixo:

MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR (CNPJ 12.138.813/0001-21)

O fundo tem por objetivo alocar, no mínimo, 50% do seu Patrimônio Líquido em Direitos de Crédito. As demais alocações deverão ser em (“Ativos Financeiros”), moeda corrente nacional; títulos de emissão do Tesouro Nacional; operações compromissadas lastreadas nos títulos mencionados acima, e quotas de fundos de investimento que sejam administrados por uma Instituição Autorizada e que (i) invistam, pelo menos, 95% (noventa e cinco por cento) da sua carteira em títulos de emissão do Tesouro Nacional e (ii) sejam remunerados com base na Taxa DI ou na Taxa SELIC.

O fundo é composto em mais de 99% de seu patrimônio investido em direito creditório que estão inadimplentes com o fundo em quase que sua totalidade e os demais ativos estão divididos em títulos públicos e operações compromissadas.

BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII – BBIM11 (CNPJ – 20.716.161/0001-93)

O FUNDO tem por objeto a realização de investimentos em ativos financeiros de origem imobiliária, por meio da aquisição (i) preponderantemente, de certificados de recebíveis imobiliários (“CRI”), emitidos nos termos da Lei n.º 9.514, de 17 de agosto de 1997 e demais dispositivos legais e 2 regulamentares aplicáveis; bem como (ii) de letras hipotecárias, emitidas nos termos da Lei n.º 7.684, de 2 de dezembro de 1988 (“LH”); (iii) de letras de crédito imobiliário, emitidas nos termos da Lei n.º 10.931, de 2 de agosto de 2004, (“LCI”); e (iv) de cotas de fundos de investimento imobiliário, emitidas nos termos da Instrução CVM n.º 472/08 (“Cotas de FII”, e, em conjunto com os CRI, com as LH e com as LCI que venham a ser adquiridos pelo FUNDO, os “Ativos Imobiliários”), nos termos da Política de Investimento descrita no Regulamento do FUNDO, de forma a proporcionar aos cotistas do FUNDO (“Cotistas”) uma remuneração para o investimento

realizado, por meio do fluxo de rendimentos gerado pelos Ativos Imobiliários e do aumento do valor patrimonial de suas Cotas.

O FUNDO é composto em quase 90% de seu PL de Certificado de Recebíveis Imobiliários (CRI) que estão adimplentes e são tangíveis. 8,68% em fundos de investimentos imobiliários e cerca de 2% em valores a pagar/receber.

BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII – CARE11 (CNPJ – 13.584.584/0001-31)

O Fundo tem por objeto a aplicação em investimentos de natureza imobiliária, sendo de quaisquer direitos reais sobre bens imóveis; direitos reais sobre bens imóveis, ações, debêntures, bônus de subscrição, seus cupons, direitos, recibos de subscrição e certificados de desdobramentos, certificados de depósito de valores mobiliários, cédulas de debêntures, cotas de fundos de investimento, notas promissórias, e quaisquer outros valores mobiliários, desde que se trate de emissores registrados na CVM e cujas atividades preponderantes sejam permitidas aos fundos de investimento imobiliários; ações ou cotas de sociedades cujo único propósito se enquadre entre as atividades permitidas aos fundos de investimento imobiliários; cotas de fundos de investimento em ações que sejam setoriais e que invistam exclusivamente em construção civil ou no mercado imobiliário; certificados de potencial adicional de construção emitidos com base na Instrução CVM nº 401, de 29 de dezembro de 2003, conforme alterada; cotas de outros fundos de investimento imobiliários; certificados de recebíveis imobiliários e cotas de fundos de investimento em direitos creditórios (FIDC) que tenham como política de investimento, exclusivamente, atividades permitidas aos fundos de investimento imobiliários e desde que estes certificados e cotas tenham sido objeto de oferta pública registrada na CVM ou cujo registro tenha sido dispensado nos termos da regulamentação em vigor; letras hipotecárias; letras de crédito imobiliário; e letras imobiliárias garantidas.

O FUNDO, possui pouco mais de 83% de ações ligados ao segmento imobiliário, 16,26% em aplicações no segmento de ativos imobiliários e 0,51% em valores a pagar e receber. Os ativos estão de acordo com a política de investimentos do fundo, são tangíveis e estão performando.

BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATEGIA (CNPJ 35.640.811/0001-31)

O Fundo investirá em Valores Mobiliários, sempre de acordo com a sua Política de Investimentos. O Fundo deverá participar no processo decisório das Sociedades Alvo, com efetiva influência na definição de sua política estratégica e gestão. "Sociedades Alvo" significam (i) sociedades por ações, constituídas nos termos da Lei das S.A. e (ii) fundos de investimento em participações.

A carteira atual do fundo reflete perfeitamente o que foi definido no regulamento do fundo e os ativos são tangíveis e estão em normal operação.

FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA LA SHOPPING CENTERS (CNPJ 16.685.929/0001-31)

O objetivo do FUNDO é buscar, no longo prazo, a valorização do capital investido, por meio da aquisição de ações, debêntures, bônus de subscrição, ou outros títulos e valores mobiliários conversíveis ou permutáveis em ações de emissão de companhias, abertas ou fechadas, que atuem no segmento imobiliário que tenham por objetivo principal, direta ou indiretamente, o desenvolvimento de atividades relacionadas à exploração de shopping centers, centros de convenções, conglomerados de lojas/imóveis comerciais, outros ativos do segmento imobiliário comercial, bem como à aquisição, locação de terrenos, participação em licitações, bem

com outras formas permitidas por lei, para a construção de tal classe de ativos imobiliários, podendo ainda realizar a negociação de suas unidades/lojas, participando do processo decisório, com efetiva influência na definição de sua política estratégica. Manter pelo menos 90% do PL do fundo em carteira de Títulos e Valores Mobiliários, participando do processo decisório da Companhia Alvo, exercendo efetiva influência na definição de sua política estratégica e na sua gestão, notadamente através da indicação de membros do conselho de administração, observada a política de investimento.

A carteira atual do fundo reflete o que foi definido no regulamento do fundo e os ativos são tangíveis e estão em normal operação.

VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 (CNPJ 13.842.683/0001-76).

O FUNDO tem como política de investimentos realizar investimentos imobiliários por meio da aquisição de Empreendimentos Imobiliários Prontos, inclusive bens e direitos a eles relacionados, predominantemente lajes corporativas e escritórios comerciais de alto padrão, visando gerar ganhos por meio de locação e/ou arrendamento e alienação, e se beneficiar de potencial valorização imobiliária, que atendam ao objeto do FUNDO.

Os ativos que compõe a carteira do fundo são tangíveis e correspondem a política de investimentos do fundo.

ACOMPANHAMENTO DE RISCOS E MONITORAMENTO DE NOTÍCIAS

Com o objetivo de monitoramento de riscos e notícias, realizamos o acompanhamento periodicamente na internet de informações que venham a impactar ou possam trazer algum prejuízo para os investimentos realizados pelo **ANGRAPREV**.

<https://investidor.estadao.com.br/mercado/ipo-caixa-asset-discussao-politica-guimaraes>

<https://gauchazh.clicrbs.com.br/economia/noticia/2022/06/apos-denuncias-de-assedio-sexual-presidente-da-caixa-pede-demissao-cl503eg750003019ienjjdnpi.html>

<https://www.suno.com.br/noticias/caixa-economica-federal-cxse3-lucro-4t21/>

<https://crcnews.com.br/fluxo/james-egan-junior-e-o-novo-diretor-comercial-da-somma-investimentos-e-jpp-capital/29/04/2022/>

[https://www.austin.com.br/Press Release/1980/Austin afirma o rating de qualidade de gest%C3%A3o %E2%80%98Q 3%E2%80%99 da SOMMA Investimentos; perspectiva est%C3%A1vel](https://www.austin.com.br/Press%20Release/1980/Austin%20afirma%20o%20rating%20de%20qualidade%20de%20gest%C3%A3o%20E2%80%98Q%203%E2%80%99%20da%20SOMMA%20Investimentos%20;perspectiva%20est%C3%A1vel)

<https://www.fitchratings.com/research/pt/fund-asset-managers/occam-brasil-gestao-de-recursos-ltda-21-06-2022>

<https://valorinveste.globo.com/mercados/renda-variavel/empresas/noticia/2022/02/01/btg-pactual-compra-corretora-elite-investimentos.ghtml>

<https://www.poder360.com.br/economia/btg-pactual-registra-lucro-de-rs-65-bilhoes-em-2021/>

<https://www.suno.com.br/noticias/banco-do-brasil-bbas3-desiste-vender-americas-acao/>

<https://www.cnnbrasil.com.br/business/clientes-do-banco-do-brasil-relatam-instabilidade-e-dificuldade-de-fazer-transacoes/>

<https://spbancarios.com.br/05/2022/lucro-do-banco-do-brasil-cresce-576-em-12-meses-por-meio-do-seu-encolhimento>

<https://economia.estadao.com.br/noticias/negocios,xp-investimentos-fecha-2021-com-lucro-liquido-de-r-4-bi-salto-de-76,70003973150>

<https://www.seudinheiro.com/2022/empresas/xp-perde-mais-de-2-bilhoes-em-valor-de-mercado-apos-balanco-1t22-flal/>

<https://valor.globo.com/financas/noticia/2022/02/25/vinci-partners-tem-lucro-liquido-de-r-566-milhoes-no-4otr-imestre-alta-de-41percent.ghtml>

<https://www.gov.br/mj/pt-br/assuntos/noticias/senacon-mantem-multa-de-r-2-4-milhoes-ao-banco-safra-por-abuso-em-oferta-de-emprestimo>

<https://valor.globo.com/patrocinado/investe-safra/noticia/2022/05/24/safra-corretora-e-a-mais-assertiva-do-mercado-e-lidera-carteira-de-acoes-do-valor.ghtml>

<https://neofeed.com.br/blog/home/az-quest-vai-criar-nova-gestora-e-entra-em-agro/>

<https://pipelinevalor.globo.com/mercado/noticia/como-a-tarpon-capital-driblou-a-derrocada-do-ibovespa.ghtml>

<https://maisretorno.com/portal/foi-dificil-vender-nossos-ativos-da-russia-diz-executivo-da-western-asset>

<https://www.fitchratings.com/research/pt/fund-asset-managers/fitch-affirms-bnp-paribas-asset-management-brasils-imq-rating-at-excellent-06-01-2022>

<https://oespecialista.com.br/bnp-paribas-lucro-resultado-quarto-trimestre-2021/>

<https://www.infomoney.com.br/mercados/resultado-santander-brasil-sanb11-primeiro-trimestre-2022/>

<https://cqcs.com.br/noticia/sulamerica-investimentos-alcancou-a-marca-de-r-50-bilhoes-em-ativos-sob-gestao-e-administracao/>

<https://setorsaude.com.br/rede-dor-adquire-a-sulamerica-seguros/>

<https://www.seudinheiro.com/2022/empresas/bradesco-bbdc4-balanco-1t22-flal/>

CONCLUSÃO

A rentabilidade insatisfatória que o **ANGRAPREV** apresentou em relação a sua meta atuarial no 1º semestre de 2022, nos parece bastante desafiadora para ser recuperada ao longo do ano, mas ressaltamos que este foi um semestre em que as Economias do mundo, Brasil incluído, se mantiveram sob o espectro da recuperação com políticas monetárias bastante restritivas visando conter a inflação provocada pela crise mundial em função da pandemia e suas variações.

Entretanto, convocamos os gestores do **ANGRAPREV** que olhem para um período maior, no tocante a sua meta atuarial, pois assim ela tem de ser buscada: no longo prazo. Cabe lembrar também, que deve ser observada a continuidade da expansão do conhecimento, inclusive em obediência a legislação em vigor, que vai exigir certificação de conselheiros e membros da diretoria, além das exigências já existentes, neste momento, para membros do comitê de investimentos. Cabe ressaltar que devem ser consolidadas as premissas do programa Pró Gestão. Dentro destes aspectos torna-se importante também que o **ANGRAPREV** busque maior agilidade de decisão para o aproveitamento de oportunidades de investimentos que devem surgir nos mercados diante dos aspectos aqui relacionados.

Orientamos também, em complemento, que o **ANGRAPREV** prossiga adotando regras, procedimentos e controles internos que integrem o fluxo de atividades, e os manuais de procedimentos na adequação da análise de fundos de investimentos, e/ou outros ativos para que contemplem sua carteira de investimentos.

Aproveitamos para ressaltar, em se tratando do cenário atual, que a diversificação em títulos públicos federais, proporciona a busca por maiores prêmios no curto prazo, não comprometendo a liquidez da carteira de investimentos em honrar seus compromissos. A diversificação é uma técnica que permite reduzir os riscos através da alocação em ativos de vários vértices, tornando-se uma importante ferramenta para maximizar o retorno correndo menos riscos

Ainda se tratando do risco de mercado, orientamos cautela e acompanhamento continuado, buscando a melhor saída para o retorno das aplicações, em um contexto favorável ao desinvestimento. Embora não seja o suficiente para garantir a não ocorrência de perdas, investir em ativos variados que reagem de forma diferente ao mesmo evento, certamente pode reduzir significativamente o risco ao investir.

Assim como a diversificação dos ativos que compõe a carteira de investimentos é de suma importância, a compreensão da necessidade da diversificação dos prestadores de serviços ligados aos fundos de investimentos, também é muito relevante. Este tipo de diversificação minimiza os riscos quanto a possíveis imprudências de gestão, administração e/ou custódia.

ANEXO

**LÂMINAS INDIVIDUAIS DOS FUNDOS DE
INVESTIMENTO**

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+1

Quantidade de Cotistas
 820

Patrimônio Líquido Fundo
 6.996.220.208,06

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
 IMA-B 5

Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

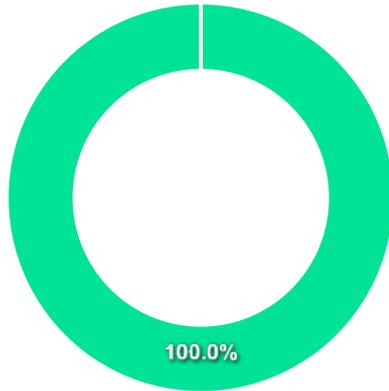
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,32%	6,47%	2,63%	6,47%	9,74%	16,08%	1,26%	2,65%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB TOP IMA-B 5 FI RENDA FIXA LP	6.260.500,90	100,00	Fundos de Inve...	04/10/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	28,41	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	6,45	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,10	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a receber	0,03	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-49,69	0,00	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	6.260.500,90	100.00%
● Valores a pagar/receber	-14,70	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+1

Quantidade de Cotistas
 597

Patrimônio Líquido Fundo
 5.700.982.768,47

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
 IMA-B

Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
 Aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e ou operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

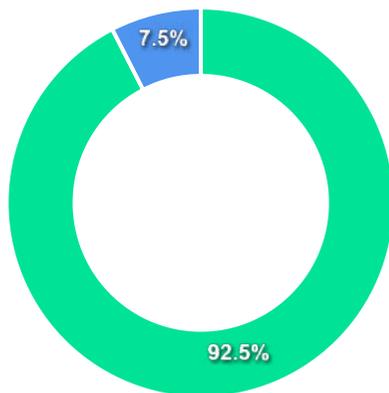
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,35%	4,22%	1,41%	4,22%	3,48%	10,88%	2,02%	4,26%
Indicador de Desempenho (CVM)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Títulos Federais	5.416.586,10	92.46%
● Operação compromissada	441.515,70	7.54%
● Valores a pagar/receber	175,77	0.00%
● Outros	153,84	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	711.584,55	12,15	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	670.156,35	11,44	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	580.840,28	9,91	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	493.788,26	8,43	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	473.624,24	8,08	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	445.971,83	7,61	Títulos Federa...	04/10/2022
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/20...	441.515,70	7,54	Operação compr...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	427.392,28	7,30	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	408.672,45	6,98	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	403.843,47	6,89	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	317.413,18	5,42	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	291.107,52	4,97	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	106.471,35	1,82	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	84.686,46	1,45	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	1.033,87	0,02	Títulos Federa...	04/10/2022
Outras Disponibilidades	201,75	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	129,16	0,00	Outros	04/10/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	60,96	0,00	Outros	04/10/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,76	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	23,01	0,00	Outros	04/10/2022
Outros Valores a receber	22,62	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	19,93	0,00	Outros	04/10/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	14,58	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Valores a pagar / Auditoria	3,80	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a pagar	0,03	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO B...	-21,12	0,00	Outros	04/10/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-46,50	0,00	Valores a paga...	04/10/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 0,10%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 1.068

Patrimônio Líquido Fundo
 5.103.254.867,87

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
 IRF-M 1

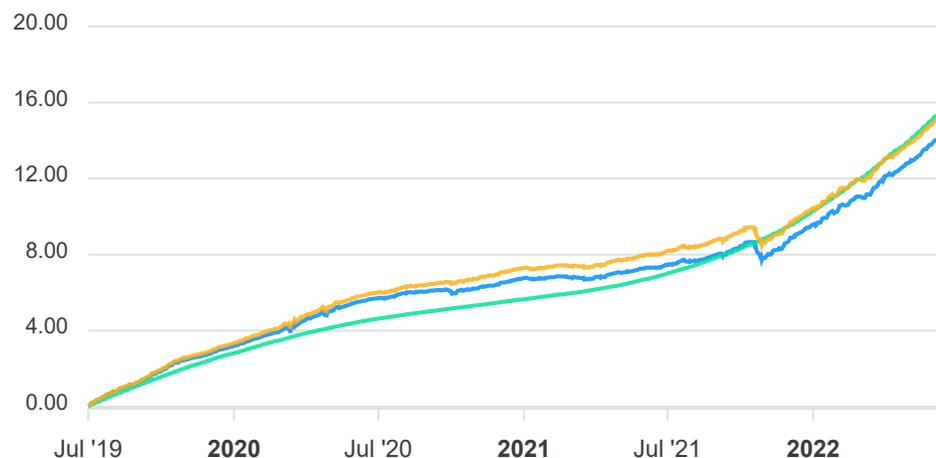
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
 Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que mantenham 100% de suas carteiras em Títulos Públicos Federais.

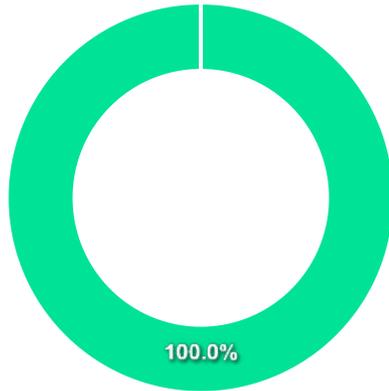
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,92%	4,85%	2,56%	4,85%	6,92%	8,69%	0,17%	0,36%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.071.804,59	100,00	Fundos de Inve...	04/10/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,73	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	24,09	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	4,25	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,84	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	6.071.804,59	100.00%
● Valores a pagar/receber	56,95	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão

BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração

0,15%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+0

Quantidade de Cotistas

95

Patrimônio Líquido Fundo

546.767.222,62

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)

Não definido

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento

Aplica seus recursos, principalmente, em ativos financeiros de renda fixa relacionados à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índice de preços. Não realiza operações de day-trade e não utiliza estratégia de alavancagem com derivativos.

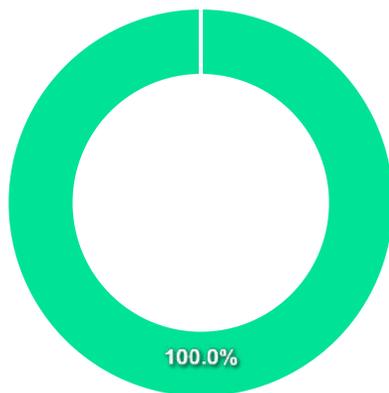
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,32%	7,21%	3,04%	7,21%	11,84%	19,81%	1,43%	3,00%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/20...	280.357,75	100,00	Operação compr...	05/10/2022
Outras Disponibilidades	33,94	0,01	Valores a paga...	05/10/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	-1,57	0,00	Valores a paga...	05/10/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-1,67	0,00	Valores a paga...	05/10/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-2,34	0,00	Valores a paga...	05/10/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-14,55	-0,01	Valores a paga...	05/10/2022

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
● Operação compromissada	280.357,75	100.00%
● Valores a pagar/receber	13,81	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
17

Patrimônio Líquido Fundo
100.979.522,46

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

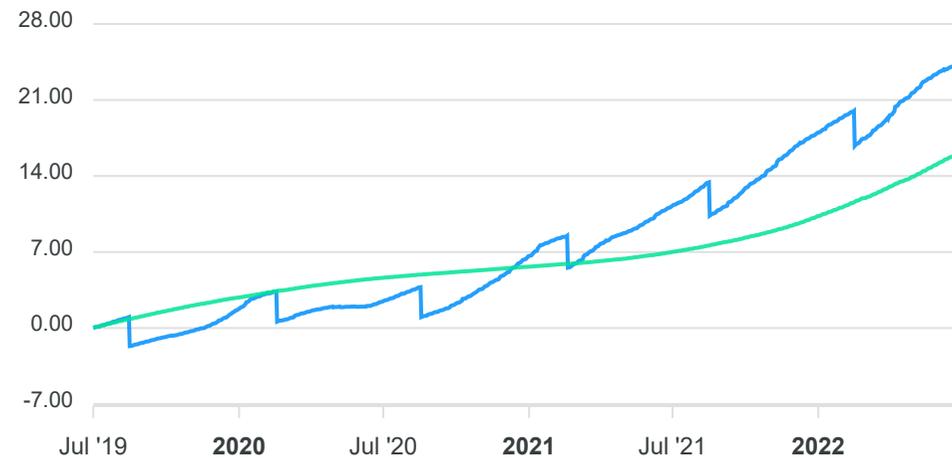
Classificação ANBIMA
Não classificado

Política de Investimento
Aplica seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA). Não realiza day-trade.

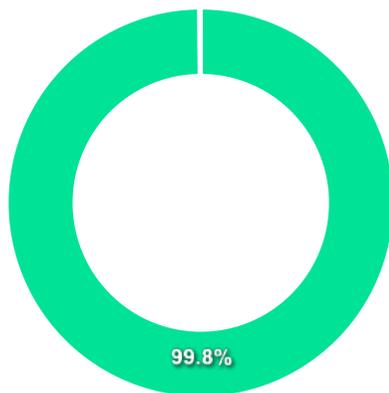
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,02%	5,68%	4,35%	5,68%	12,11%	21,71%	0,18%	0,37%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	101.330,31	99,85	Títulos Federa...	08/08/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	140,28	0,14	Operação compr...	08/08/2022
Outras Disponibilidades	11,27	0,01	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	8,55	0,01	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,42	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa Selic	0,33	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-0,60	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-3,25	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a pagar	-3,42	0,00	Valores a paga...	08/08/2022

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
● Títulos Federais	101.330,31	99.85%
● Operação compromissada	140,28	0.14%
● Valores a pagar/receber	13,30	0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
38

Patrimônio Líquido Fundo
234.204.187,53

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

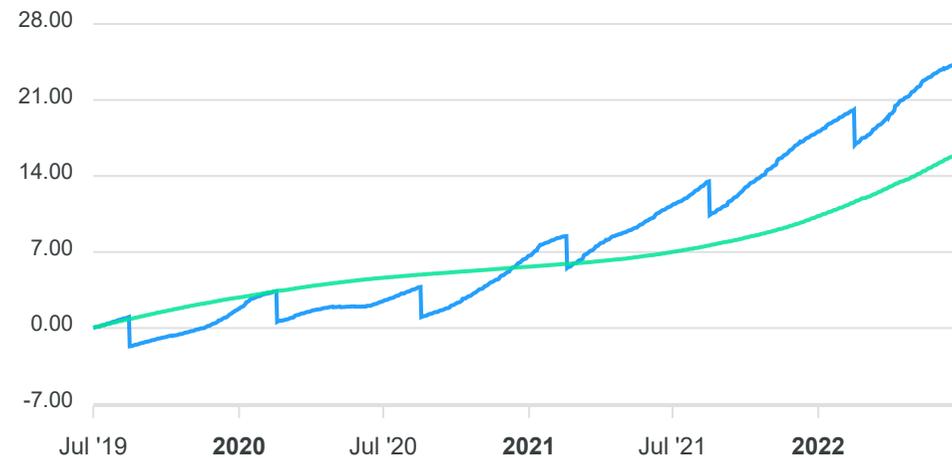
Classificação ANBIMA
Não classificado

Política de Investimento
Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós-fixadas e/ou índices de preços. Não realiza operações de day-trade.

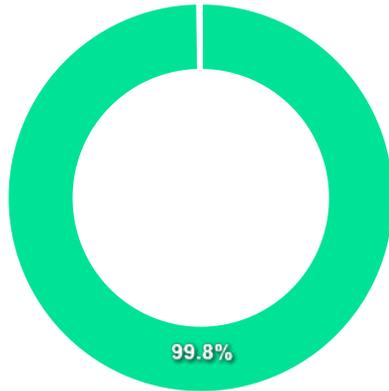
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,02%	5,70%	4,37%	5,70%	12,14%	21,81%	0,18%	0,37%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	228.665,84	99,78	Títulos Federa...	04/10/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024	511,18	0,22	Operação compr...	04/10/2022
Outras Disponibilidades	11,00	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a receber	7,50	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a pagar	-18,96	-0,01	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Títulos Federais	228.665,84	99.78%
● Operação compromissada	511,18	0.22%
● Valores a pagar/receber	-0,38	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração

0,20%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+0

Quantidade de Cotistas

868

Patrimônio Líquido Fundo

6.957.180.815,09

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)

IPCA

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento

Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA

MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA, CNPJ:

10.948.555/0001-13.

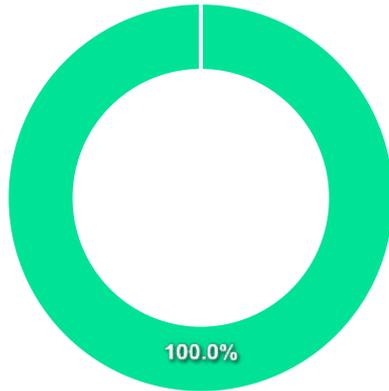
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,23%	4,59%	2,22%	4,59%	3,73%	6,51%	1,57%	3,30%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA...	5.851.300,62	100,01	Fundos de Inve...	04/10/2022
Outros Valores a receber	14,06	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a pagar	-514,34	-0,01	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	5.851.300,62	100.01%
● Valores a pagar/receber	-500,28	-0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
1.073

Patrimônio Líquido Fundo
11.226.926.091,22

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
IDKA IPCA 2 Anos

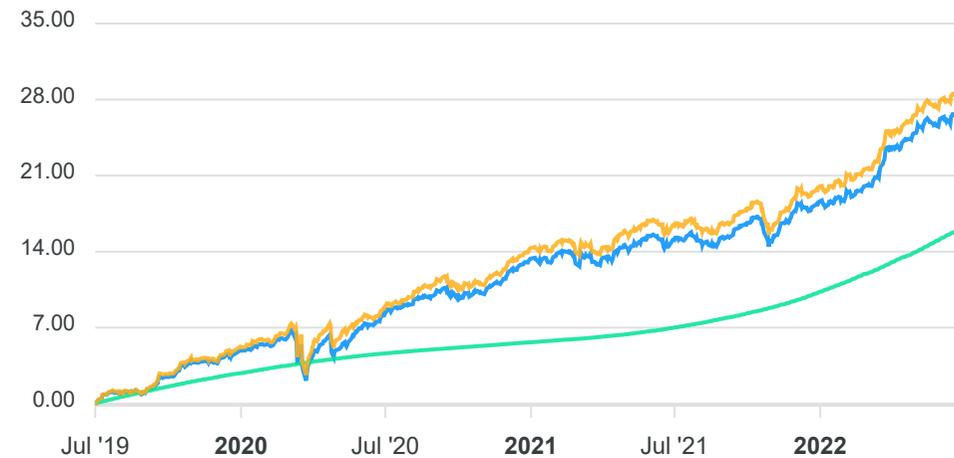
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
Aplica seus recursos em títulos públicos federais indexados a taxas pré e pós-fixadas e/ou índices de preços.

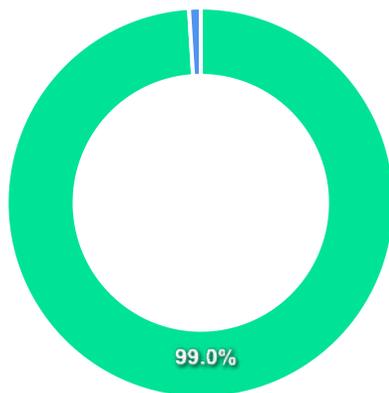
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,22%	6,41%	2,50%	6,41%	9,66%	16,68%	1,39%	2,93%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,47%	6,85%	2,86%	6,85%	10,11%	17,88%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	5.418.155,60	63,87	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	2.950.215,18	34,78	Títulos Federa...	04/10/2022
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/20...	82.346,55	0,97	Operação compr...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	30.575,74	0,36	Títulos Federa...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/09/2025	1.220,14	0,01	Títulos Federa...	04/10/2022
Outras Disponibilidades	525,19	0,01	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a receber	127,58	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ24	113,52	0,00	Derivativos	04/10/2022
Outros Valores a pagar	-439,77	-0,01	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
● Títulos Federais	8.400.166,67	99.03%
● Operação compromissada	82.346,55	0.97%
● Valores a pagar/receber	213,00	0.00%
● Derivativos	113,52	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 1.024

Patrimônio Líquido Fundo
 11.084.704.335,99

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
 IMA-B 5

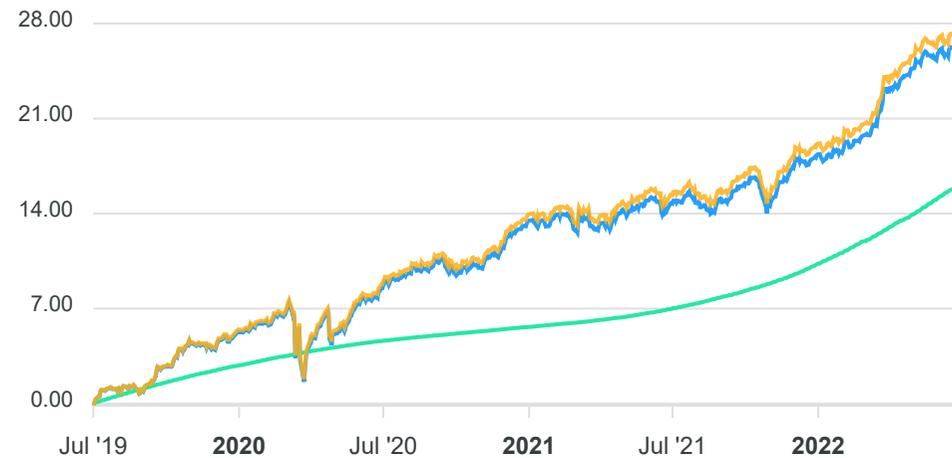
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
 Aplica 100% dos recursos em títulos públicos federais, em operações finais e/ou compromissadas, tendo como parâmetro de rentabilidade o IMA-B 5.

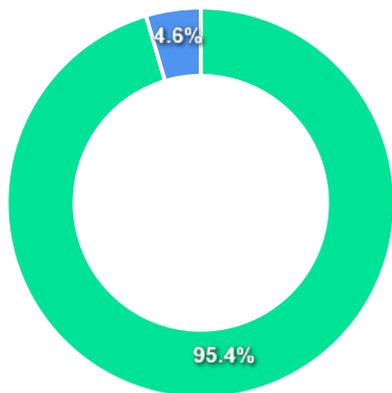
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,33%	6,51%	2,65%	6,51%	9,84%	16,18%	1,23%	2,59%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	2.600.662,64	29,27	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	1.899.014,57	21,37	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.749.019,38	19,68	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	1.564.236,55	17,60	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	641.742,85	7,22	Títulos Federa...	04/10/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024	405.922,81	4,57	Operação compr...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	12.231,17	0,14	Títulos Federa...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/09/2026	12.175,43	0,14	Títulos Federa...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/09/2025	1.207,94	0,01	Títulos Federa...	04/10/2022
Outras Disponibilidades	93,97	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a receber	14,06	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	-32,54	0,00	Derivativos	04/10/2022
Outros Valores a pagar	-485,49	-0,01	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
● Títulos Federais	8.480.290,52	95.44%
● Operação compromissada	405.922,81	4.57%
● Derivativos	-32,54	-0.00%
● Valores a pagar/receber	-377,45	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 1.175

Patrimônio Líquido Fundo
 5.096.804.349,76

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
 IRF-M 1

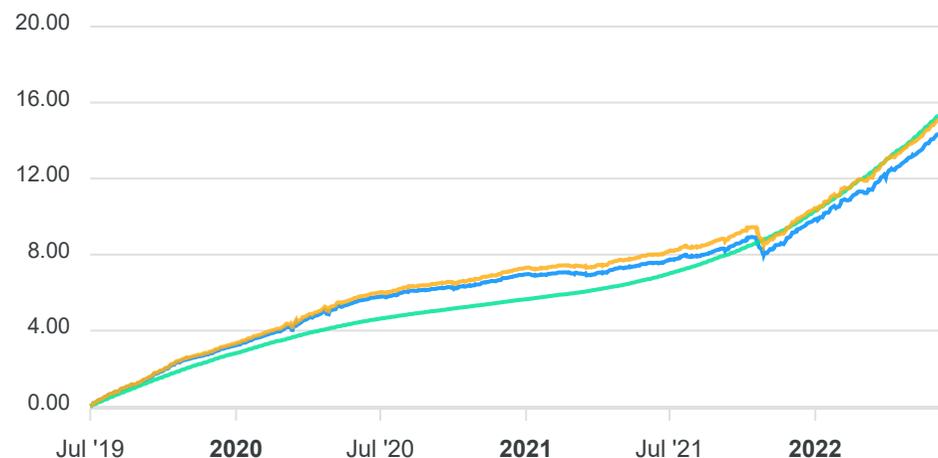
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Indexados

Política de Investimento
 Investe seus recursos em títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas e/ou pós-fixadas SELIC/CDI.

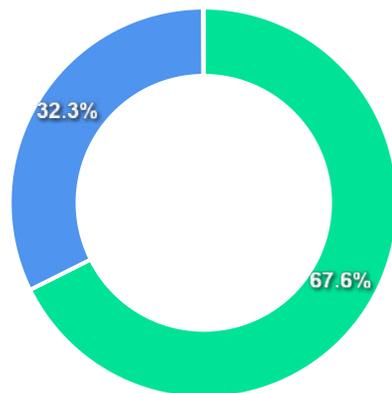
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,91%	4,86%	2,58%	4,86%	6,94%	8,89%	0,17%	0,35%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,93%	4,99%	2,65%	4,99%	7,19%	9,37%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024	1.748.350,90	32,28	Operação compr...	04/10/2022
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	1.165.188,74	21,51	Títulos Federa...	04/10/2022
LTN - Venc.: 01/07/2023	944.693,26	17,44	Títulos Federa...	04/10/2022
LTN - Venc.: 01/01/2023	867.189,20	16,01	Títulos Federa...	04/10/2022
LTN - Venc.: 01/10/2022	616.595,86	11,38	Títulos Federa...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	45.255,32	0,84	Títulos Federa...	04/10/2022
LTN - Venc.: 01/04/2023	25.485,69	0,47	Títulos Federa...	04/10/2022
Outras Disponibilidades	4.234,52	0,08	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a receber	116,20	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	105,17	0,00	Derivativos	04/10/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ23	3,45	0,00	Derivativos	04/10/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTV22	0,04	0,00	Derivativos	04/10/2022
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF23	-5,11	0,00	Derivativos	04/10/2022
Outros Valores a pagar	-293,46	-0,01	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Títulos Federais	3.664.408,07	67.65%
● Operação compromissada	1.748.350,90	32.28%
● Valores a pagar/receber	4.057,26	0.07%
● Derivativos	103,54	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 0,30%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+3

Quantidade de Cotistas
 547

Patrimônio Líquido Fundo
 3.751.851.953,61

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
 IPCA

Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe de Renda Fixa.

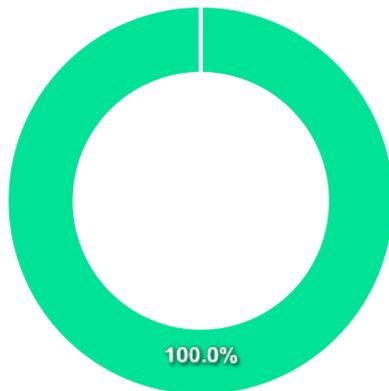
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,46%	4,30%	2,02%	4,30%	5,27%	8,66%	0,81%	1,71%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFEREN...	1.226.718,37	39,30	Fundos de Inve...	07/10/2022
Cotas de BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	967.766,69	31,00	Fundos de Inve...	07/10/2022
Cotas de BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	926.505,00	29,68	Fundos de Inve...	07/10/2022
Outras Disponibilidades	742,93	0,02	Valores a paga...	07/10/2022
Outros Valores a receber	19,26	0,00	Valores a paga...	07/10/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	3,45	0,00	Valores a paga...	07/10/2022
Valores a pagar / Auditoria	1,00	0,00	Valores a paga...	07/10/2022
Valores a pagar / Taxa Cetip	-20,79	0,00	Valores a paga...	07/10/2022
Valores a pagar / Controladoria	-25,88	0,00	Valores a paga...	07/10/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-35,83	0,00	Valores a paga...	07/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	3.120.990,06	99.98%
Valores a pagar/receber	684,13	0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,40%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+4

Quantidade de Cotistas

176

Patrimônio Líquido Fundo

857.365.563,33

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)

IPCA

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento

Política de Investimento

Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de renda fixa, os quais atuam nos mercados de juros pré e pós-fixados e índices de preços, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável.

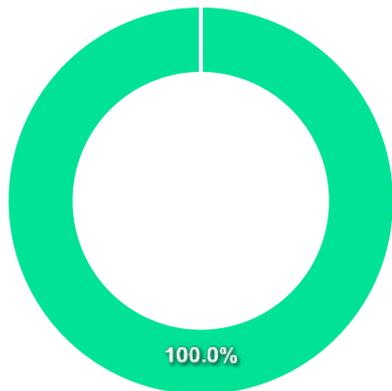
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,32%	4,08%	1,69%	4,08%	4,75%	6,86%	1,08%	2,28%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BRAM FEDERAL II FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	303.674,09	41,44	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BRAM IMA-B FI RENDA FIXA	225.134,90	30,72	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BRAM INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA	153.386,40	20,93	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BRAM IDKA PRÉ 5 FI RENDA FIXA	44.726,96	6,10	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	2.784,31	0,38	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BRAM IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.752,45	0,24	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	789,82	0,11	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BRAM IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	423,50	0,06	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BRAM H VOLGA FI RENDA FIXA LP	411,63	0,06	Fundos de Inve...	04/10/2022
Outros Valores a receber	12,45	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a pagar	-277,78	-0,04	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	733.084,05	100.03%
● Valores a pagar/receber	-255,33	-0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS
Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,20%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+1

Quantidade de Cotistas

166

Patrimônio Líquido Fundo

1.352.871.181,17

PERFIL DO FUNDO
Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)

IMA-B 5

Classificação ANBIMA

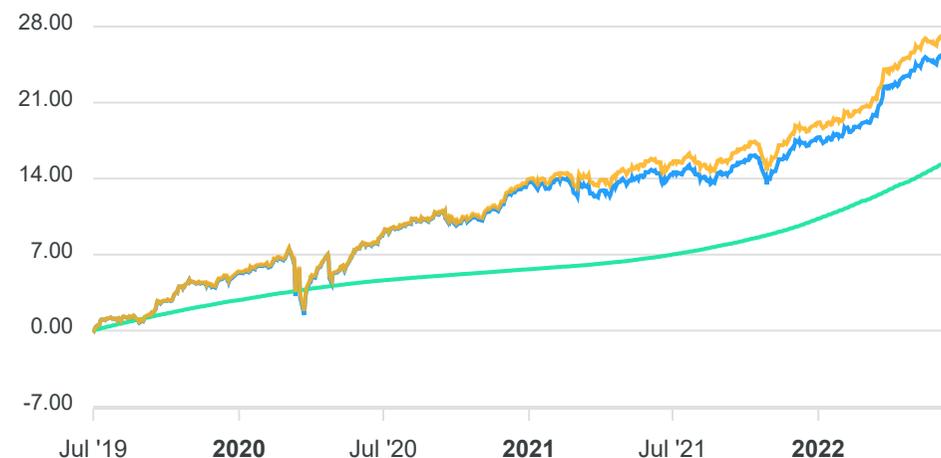
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento

Política de Investimento

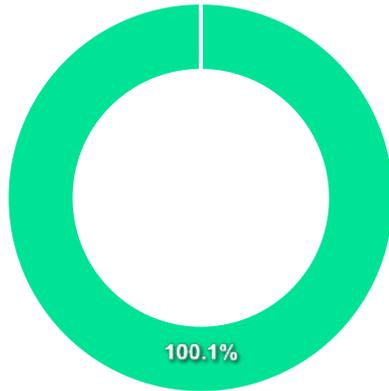
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa, que atuem principalmente no mercado de índices de preços.

COMPARATIVO
 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,28%	6,31%	2,55%	6,31%	9,47%	15,15%	1,27%	2,67%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BRAM IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.081.142,28	100,09	Fundos de Inve...	04/10/2022
Outros Valores a receber	14,78	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a pagar	-1.002,09	-0,09	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	1.081.142,28	100.09%
● Valores a pagar/receber	-977,30	-0.09%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+0

Quantidade de Cotistas
 948

Patrimônio Líquido Fundo
 12.613.402.228,26

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
 CDI

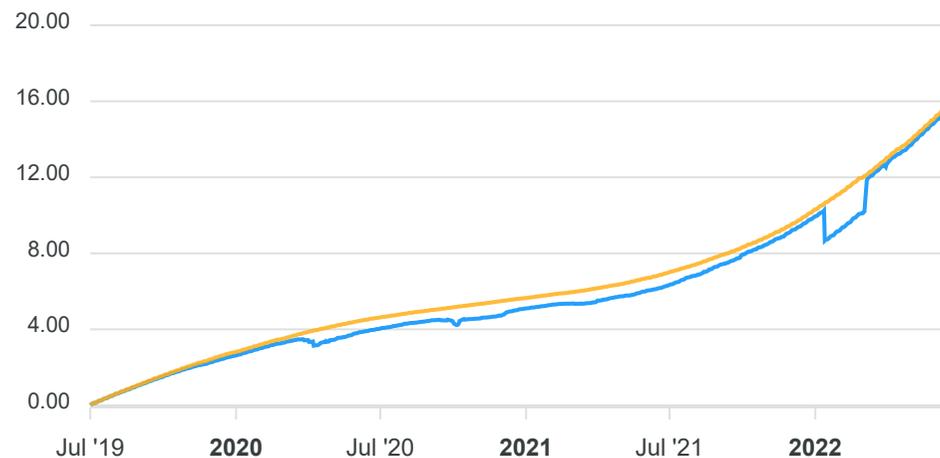
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

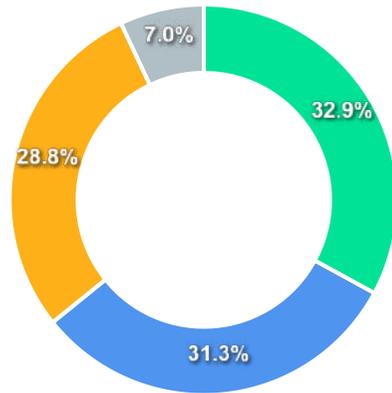
Política de Investimento
 Aplica seus recursos, principalmente, em ativos financeiros que sejam considerados de baixo risco de crédito e classificados por agência de risco registrada na CVM.

COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,06%	5,60%	2,97%	5,60%	9,19%	11,59%	0,04%	0,09%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Privados	4.595.181,54	32.93%
Operação compromissada	4.364.267,86	31.28%
Títulos Federais	4.016.348,62	28.78%
Debêntures	978.090,06	7.01%
Valores a pagar/receber	540,27	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	4.364.267,86	31,28	Operação compr...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	811.504,72	5,82	Títulos Federa...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/03/2024	794.980,12	5,70	Títulos Federa...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	788.910,23	5,65	Títulos Federa...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/09/2027	631.666,90	4,53	Títulos Federa...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	418.847,41	3,00	Títulos Privad...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/09/2024	387.254,65	2,78	Títulos Federa...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/000...	213.133,79	1,53	Títulos Privad...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/09/2028	196.626,08	1,41	Títulos Federa...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/03/2027	182.680,60	1,31	Títulos Federa...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90...	159.989,93	1,15	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/000...	159.221,44	1,14	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/000...	157.629,08	1,13	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90...	148.713,15	1,07	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90...	128.104,95	0,92	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO BV S.A. (59.588.111/0001-...	127.452,52	0,91	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90...	113.232,73	0,81	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	112.227,50	0,80	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	112.162,51	0,80	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/000...	111.335,15	0,80	Títulos Privad...	04/10/2022
Debêntures - PETRÓLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS (3...	109.791,94	0,79	Debêntures	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO BV S.A. (59.588.111/0001-...	92.647,60	0,66	Títulos Privad...	04/10/2022
Debênture não informado - BSA316	86.036,23	0,62	Debêntures	04/10/2022
CDB/ RDB - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-...	83.755,42	0,60	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/00...	80.819,07	0,58	Títulos Privad...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/03/2025	69.504,65	0,50	Títulos Federa...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/000...	69.448,45	0,50	Títulos Privad...	04/10/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
0,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1

Quantidade de Cotistas
92

Patrimônio Líquido Fundo
439.811.945,70

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento

Política de Investimento

Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa, os quais apliquem seus recursos em ativos financeiros de renda fixa relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos.

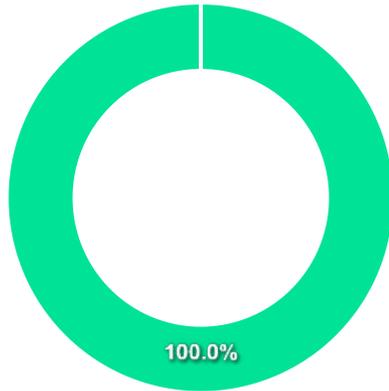
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,65%	4,18%	1,00%	4,18%	3,54%	10,75%	2,23%	4,70%
Indicador de Desempenho (CVM)	-0,36%	4,35%	1,43%	4,35%	3,78%	11,48%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ VERSO B FI RENDA FIXA	443.069,62	99,68	Fundos de Inve...	07/10/2022
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	1.548,62	0,35	Fundos de Inve...	07/10/2022
Outras Disponibilidades	69,35	0,02	Valores a paga...	07/10/2022
Outros Valores a receber	7,88	0,00	Valores a paga...	07/10/2022
Outros Valores a pagar	-192,24	-0,04	Valores a paga...	07/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	444.618,24	100.03%
● Valores a pagar/receber	-115,01	-0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 ITAU UNIBANCO S.A.

Gestão
 ITAU UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
 0,40%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+1

Quantidade de Cotistas
 248

Patrimônio Líquido Fundo
 2.668.371.249,57

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
 IPCA

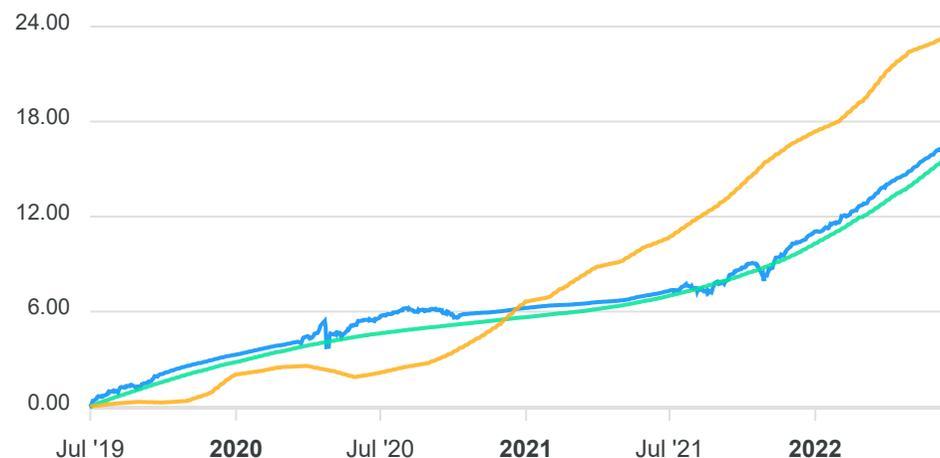
Classificação ANBIMA
 Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre

Política de Investimento
 Alocar preponderante em cotas de fundos de investimento de renda fixa atrelados ao IMA e seus sub-índices, podendo alocar também em fundos de investimento de renda fixa que seguem o CDI.

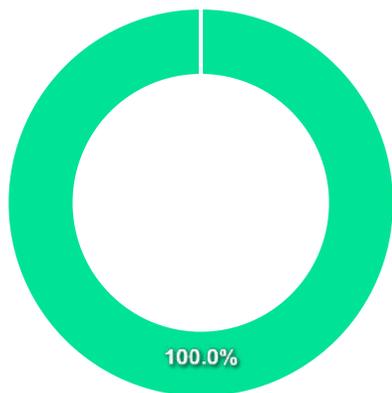
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,79%	5,28%	2,57%	5,28%	8,95%	10,68%	0,42%	0,89%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	2.447.547,62	99,83	Fundos de Inve...	08/10/2022
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	5.001,29	0,20	Fundos de Inve...	08/10/2022
Outros Valores a receber	1.011,08	0,04	Valores a paga...	08/10/2022
Outras Disponibilidades	70,00	0,00	Valores a paga...	08/10/2022
Outros Valores a pagar	-1.841,38	-0,08	Valores a paga...	08/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	2.452.548,91	100.03%
● Valores a pagar/receber	-760,30	-0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA

Taxa de Administração
0,30%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
2.565

Patrimônio Líquido Fundo
510.513.087,88

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
CDI

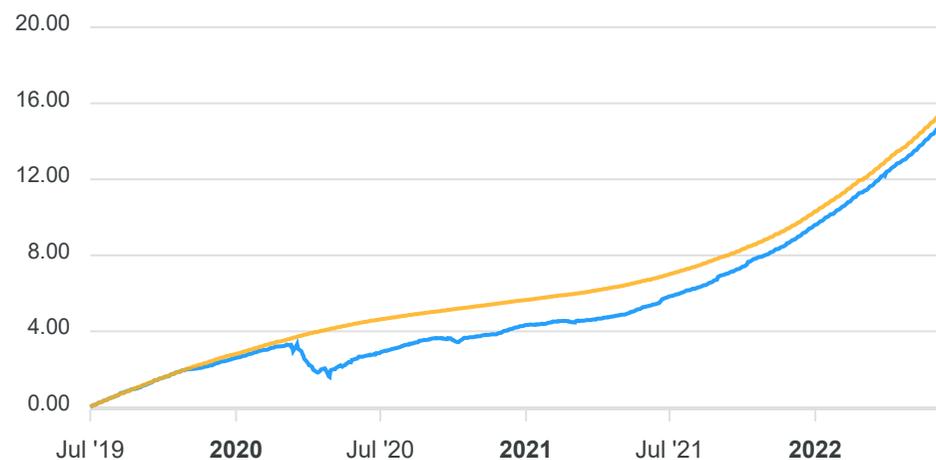
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento

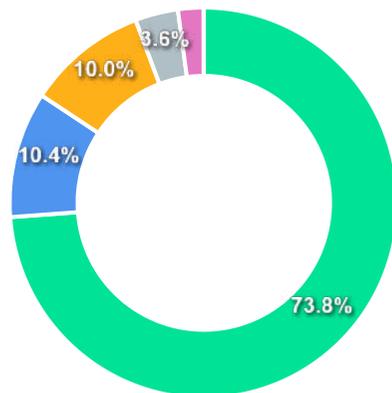
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em ativos de renda fixa, pré ou pós-fixados.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,02%	5,50%	2,90%	5,50%	9,24%	12,41%	0,03%	0,06%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	369.369,15	73.83%
Títulos Privados	52.233,24	10.44%
Debêntures	50.115,29	10.02%
Operação compromissada	17.876,00	3.57%
Fundos de Investimento	10.557,54	2.11%
Valores a pagar/receber	143,67	0.03%
Derivativos	-0,49	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
LFT - Venc.: 01/09/2023	200.570,47	39,29	Títulos Federa...	09/07/2022
LFT - Venc.: 01/03/2025	58.115,72	11,38	Títulos Federa...	09/07/2022
LFT - Venc.: 01/03/2026	49.511,35	9,70	Títulos Federa...	09/07/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2027	17.876,00	3,50	Operação compr...	09/07/2022
LFT - Venc.: 01/09/2027	15.641,59	3,06	Títulos Federa...	09/07/2022
LFT - Venc.: 01/09/2025	13.492,63	2,64	Títulos Federa...	09/07/2022
LFT - Venc.: 01/03/2027	12.693,08	2,49	Títulos Federa...	09/07/2022
Cotas de MAG CASH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.557,54	2,07	Fundos de Inve...	09/07/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	7.650,80	1,50	Títulos Federa...	09/07/2022
Debênture simples - LCAMB4	7.131,41	1,40	Debêntures	09/07/2022
DPGE - BANCO C6 S.A. (31.872.495/0001-72) - Venc.:...	6.775,66	1,33	Títulos Privad...	09/07/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	6.736,01	1,32	Títulos Privad...	09/07/2022
LFT - Venc.: 01/09/2024	6.523,49	1,28	Títulos Federa...	09/07/2022
Debênture Simples - MGLUA0	6.481,42	1,27	Debêntures	09/07/2022
Letra Financeira - CAIXA ECONOMICA FEDERAL (00.360...	5.315,29	1,04	Títulos Privad...	09/07/2022
CDB/ RDB - BANCO C6 S.A. (31.872.495/0001-72) - Ve...	5.052,15	0,99	Títulos Privad...	09/07/2022
Debênture Simples - ALGAA1	4.786,17	0,94	Debêntures	09/07/2022
Debênture Simples - SNGO19	4.568,50	0,89	Debêntures	09/07/2022
Letra Financeira - BANCO INDUSTRIAL DO BRASIL S.A....	4.392,22	0,86	Títulos Privad...	09/07/2022
LFT - Venc.: 01/03/2024	4.151,23	0,81	Títulos Federa...	09/07/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	4.079,19	0,80	Títulos Privad...	09/07/2022
Debênture não informado - CEAB12	3.937,54	0,77	Debêntures	09/07/2022
Debênture Simples - MULPA0	3.029,17	0,59	Debêntures	09/07/2022
Outros Valores a receber	3.007,99	0,59	Valores a paga...	09/07/2022
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A. (60....	2.888,98	0,57	Títulos Privad...	09/07/2022
Debênture simples - CSAN13	2.615,62	0,51	Debêntures	09/07/2022
Debênture Simples - VVAR27	2.481,01	0,49	Debêntures	09/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS
Administrador

BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.

Gestão

SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração

0,30%

Taxa de Performance

20,00%

Disponibilidade de Resgate

D+1

Quantidade de Cotistas

113

Patrimônio Líquido Fundo

743.360.830,24

PERFIL DO FUNDO
Enquadramento Resolução

Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)

IMA-B 5

Classificação ANBIMA

Renda Fixa Indexados

Política de Investimento

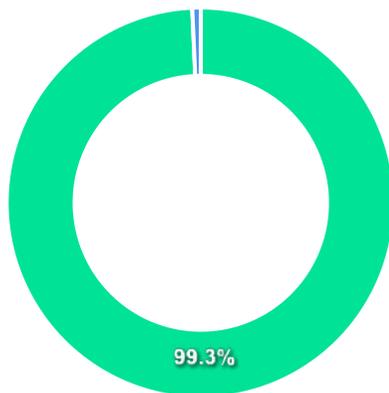
Aplica seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral, atrelados à variação dos índices de preços e/ou das taxas de juros.

COMPARATIVO
 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,31%	6,50%	2,62%	6,50%	9,29%	15,36%	1,25%	2,63%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,33%	6,61%	2,69%	6,61%	10,06%	16,74%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	174.309,71	29,17	Títulos Federa...	10/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	155.560,64	26,03	Títulos Federa...	10/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	115.690,99	19,36	Títulos Federa...	10/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	104.829,26	17,54	Títulos Federa...	10/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	43.143,85	7,22	Títulos Federa...	10/10/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	4.224,19	0,71	Operação compr...	10/10/2022
Outros Valores a receber	1.447,34	0,24	Valores a paga...	10/10/2022
Outras Disponibilidades	10,28	0,00	Valores a paga...	10/10/2022
Outros Valores a pagar	-1.667,90	-0,28	Valores a paga...	10/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Títulos Federais	593.534,44	99.33%
● Operação compromissada	4.224,19	0.71%
● Valores a pagar/receber	-210,28	-0.04%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
INTRAG DTVM LTDA

Gestão
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA.

Taxa de Administração
0,50%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+1 du ou D+5 du

Quantidade de Cotistas
8.957

Patrimônio Líquido Fundo
784.041.551,98

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
IPCA

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento

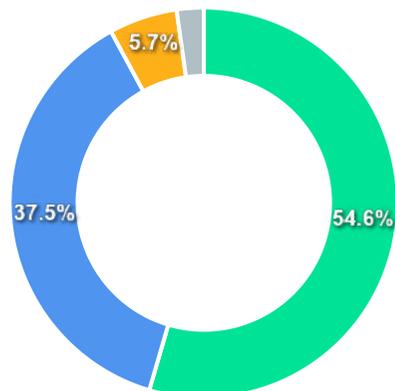
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em títulos públicos, títulos privados e outros ativos atrelados a juros que acompanhem direta ou indiretamente o índice de IPCA.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,18%	5,81%	2,24%	5,81%	8,68%	16,71%	1,65%	3,48%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,67%	5,49%	2,22%	5,49%	11,89%	21,23%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	427.154,40	54.56%
Debêntures	293.889,48	37.54%
Títulos Privados	44.546,65	5.69%
Fundos de Investimento	17.617,55	2.25%
Valores a pagar/receber	-296,70	-0.04%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	82.448,59	10,52	Títulos Federa...	15/07/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	82.137,64	10,48	Títulos Federa...	15/07/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	81.178,08	10,35	Títulos Federa...	15/07/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	80.480,85	10,26	Títulos Federa...	15/07/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	40.564,37	5,17	Títulos Federa...	15/07/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	20.282,56	2,59	Títulos Federa...	15/07/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	20.148,71	2,57	Títulos Federa...	15/07/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	19.913,58	2,54	Títulos Federa...	15/07/2022
Debênture Simples - GRRB24	19.716,46	2,51	Debêntures	15/07/2022
Cotas de SANTANDER CASH BLACK FI RENDA FIXA REFERE...	17.617,55	2,25	Fundos de Inve...	15/07/2022
Debênture Simples - SBSPC2	16.692,32	2,13	Debêntures	15/07/2022
Debênture simples - LORTA7	12.952,69	1,65	Debêntures	15/07/2022
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO S.A. (60.701.190/...	11.658,42	1,49	Títulos Privad...	15/07/2022
Debênture Simples - VAMO33	11.430,90	1,46	Debêntures	15/07/2022
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO S.A. (60.701.190/...	11.343,41	1,45	Títulos Privad...	15/07/2022
Debênture Simples - TAEE33	11.079,62	1,41	Debêntures	15/07/2022
Debênture Simples - LIGHD7	10.850,95	1,38	Debêntures	15/07/2022
Debênture Simples - GEPA28	10.414,64	1,33	Debêntures	15/07/2022
Debênture Simples - OMGE31	10.356,98	1,32	Debêntures	15/07/2022
Debênture Simples - LCAMD1	9.746,43	1,24	Debêntures	15/07/2022
Debênture Simples - UNDAB2	9.372,97	1,20	Debêntures	15/07/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	8.996,10	1,15	Títulos Privad...	15/07/2022
Debênture simples - BTOW15	7.456,51	0,95	Debêntures	15/07/2022
Debênture Simples - CMDT33	7.372,01	0,94	Debêntures	15/07/2022
Debênture simples - CSAN33	7.242,95	0,92	Debêntures	15/07/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	7.225,51	0,92	Títulos Privad...	15/07/2022
Debênture Simples - BRFS31	6.802,34	0,87	Debêntures	15/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 GENIAL INVESTIMENTOS CORRETORA DE VALORES
 MOBILIARIOS S.A.

Gestão
 GENIAL GESTAO LTDA

Taxa de Administração
 0,20%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 Não se aplica

Quantidade de Cotistas
 42

Patrimônio Líquido Fundo
 216.576,81

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 7º, Inciso V, Alínea A

Indicador de Desempenho (CVM)
 CDI + 3,50% ao ano

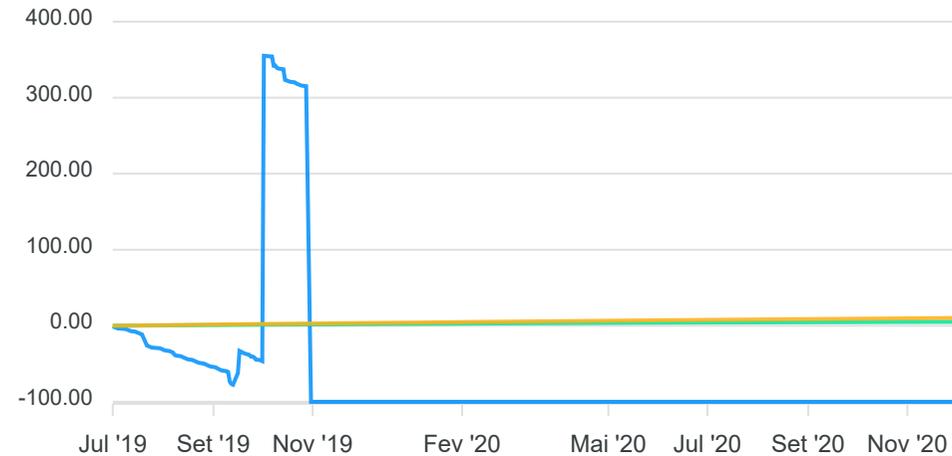
Classificação ANBIMA
 FIDC Outros

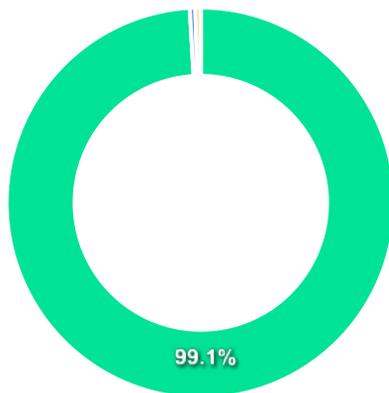
Política de Investimento
 Aplica em direitos creditórios concedidos pelo Banco BVA aos seus clientes pessoas jurídicas, representados por Cédulas de Crédito Bancário.

COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,95%	-79,62%	-79,71%	-79,62%	-89,15%	-75,69%	-%	-%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,30%	7,20%	3,80%	7,23%	12,46%	19,03%		
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Direito Creditório	200.015,31	99.09%
● Títulos Federais	930,99	0.46%
● Valores a pagar/receber	804,47	0.40%
● Operação compromissada	107,65	0.05%
● Títulos Privados	0,00	0.00%
● Fundos de Investimento	0,00	0.00%
● Nota Promissória	0,00	0.00%
● Derivativos	0,00	0.00%
● Debêntures	0,00	0.00%
● Outros	0,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Direitos Creditórios - Multiclasse	200.015,31	999,99	Direito Credit...	09/09/2022
Títulos Públicos Federais	930,99	391,56	Títulos Federa...	09/09/2022
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	802,67	337,60	Valores a paga...	09/09/2022
Operações Compromissadas	107,65	45,28	Operação compr...	09/09/2022
Disponibilidades	1,80	0,76	Valores a paga...	09/09/2022
Warrants, Contrato de Compra e Venda de Produtos, ...	0,00	0,00	Outros	09/09/2022
Valores a pagar - Longo Prazo (após 12 meses)	0,00	0,00	Valores a paga...	09/09/2022
Outros Valores Mobiliários	0,00	0,00	Outros	09/09/2022
Outros Ativos Financeiros de Renda Fixa	0,00	0,00	Outros	09/09/2022
Outros Ativos - Longo Prazo (após 12 meses)	0,00	0,00	Valores a paga...	09/09/2022
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	0,00	0,00	Valores a paga...	09/09/2022
Notas Promissórias Comerciais	0,00	0,00	Nota Promissór...	09/09/2022
Mercado Futuro - Ajustes Positivos	0,00	0,00	Derivativos	09/09/2022
Mercado Futuro - Ajustes Negativos	0,00	0,00	Derivativos	09/09/2022
Mercado de Opções - Posições Titulares	0,00	0,00	Derivativos	09/09/2022
Mercado de Opções - Posições Lançadas	0,00	0,00	Derivativos	09/09/2022
Mercado a Termo - Posições Vendidas	0,00	0,00	Derivativos	09/09/2022
Letras Financeiras	0,00	0,00	Títulos Privad...	09/09/2022
Diferencial de SWAP a Receber	0,00	0,00	Derivativos	09/09/2022
Diferencial de SWAP a Pagar	0,00	0,00	Derivativos	09/09/2022
Depósitos de Margem	0,00	0,00	Derivativos	09/09/2022
Debêntures	0,00	0,00	Debêntures	09/09/2022
Cotas de Fundos de Investimento em Direitos Credit...	0,00	0,00	Fundos de Inve...	09/09/2022
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	0,00	0,00	Fundos de Inve...	09/09/2022
Cotas de Fundos / Demais Fundos de Investimento em...	0,00	0,00	Fundos de Inve...	09/09/2022
Coberturas Prestadas	0,00	0,00	Derivativos	09/09/2022
Certificados e Recibos de Depósitos Bancários	0,00	0,00	Títulos Privad...	09/09/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.

Taxa de Administração
0,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+1 du

Quantidade de Cotistas
1.209

Patrimônio Líquido Fundo
196.409.943,73

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso V, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

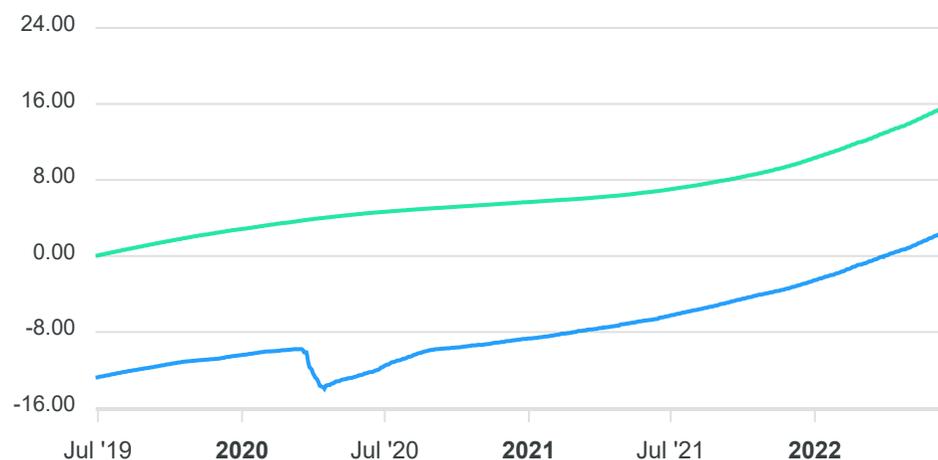
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento

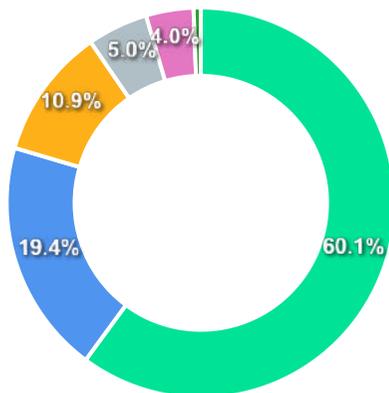
Política de Investimento
Aplica seus recursos em ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, derivativos e cotas de fundos de investimento, negociados nos mercados interno e externo, sendo vedada exposição de renda variável e alavancagem.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,17%	5,91%	3,15%	5,91%	10,11%	16,73%	0,04%	0,08%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Debêntures	118.060,43	60.11%
Operação compromissada	38.171,22	19.43%
Títulos Privados	21.322,96	10.86%
Fundos de Investimento	9.913,63	5.05%
Valores a pagar/receber	7.759,91	3.95%
Títulos Federais	1.181,79	0.60%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2027	38.171,22	19,43	Operação compr...	09/07/2022
Vendas a termo a receber - PETRÓLEO BRASILEIRO S.A...	5.050,42	2,57	Valores a paga...	09/07/2022
Debênture simples - ENGIC5	3.130,07	1,59	Debêntures	09/07/2022
Debênture simples - LORTB9	3.129,01	1,59	Debêntures	09/07/2022
Debênture simples - LCAMC3	3.071,56	1,56	Debêntures	09/07/2022
Cotas de RED REAL FIDC LP	2.863,28	1,46	Fundos de Inve...	09/07/2022
Debênture Simples - MNRVA1	2.777,00	1,41	Debêntures	09/07/2022
Debênture Simples - COGN27	2.522,46	1,28	Debêntures	09/07/2022
Debênture Simples - MATD11	2.241,43	1,14	Debêntures	09/07/2022
Letra Financeira - BANCO GERADOR (10.664.513/0001-...	2.222,34	1,13	Títulos Privad...	09/07/2022
Debênture simples - RDORC9	2.197,68	1,12	Debêntures	09/07/2022
Letra Financeira - BANCO INDUSTRIAL DO BRASIL S.A....	2.176,26	1,11	Títulos Privad...	09/07/2022
Cotas de RED FIDC MULTISSETORIAL LP SÊNIOR 13	2.175,29	1,11	Fundos de Inve...	09/07/2022
Debênture simples - JSMLA5	2.154,25	1,10	Debêntures	09/07/2022
Debênture Simples - AERI12	2.153,38	1,10	Debêntures	09/07/2022
Debênture Simples - LIGH1B	2.141,04	1,09	Debêntures	09/07/2022
Debênture não informado - GUAR15	2.139,83	1,09	Debêntures	09/07/2022
Debênture Simples - AMBP12	2.139,81	1,09	Debêntures	09/07/2022
Debênture - BKBR19	2.139,75	1,09	Debêntures	09/07/2022
Debênture Simples - MOVI34	2.122,12	1,08	Debêntures	09/07/2022
Debênture Simples - BRPRA7	2.122,07	1,08	Debêntures	09/07/2022
Debênture simples - MRFGA0	2.119,91	1,08	Debêntures	09/07/2022
Debênture Simples - ARML12	2.114,89	1,08	Debêntures	09/07/2022
Debênture simples - CCROA6	2.111,84	1,08	Debêntures	09/07/2022
Debênture simples - CAEC11	2.109,28	1,07	Debêntures	09/07/2022
Debênture simples - SBSPH0	2.075,49	1,06	Debêntures	09/07/2022
Debênture Simples - VAMO24	2.068,43	1,05	Debêntures	09/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS
S.A.

Taxa de Administração
0,50%

Taxa de Performance
2,00%

Disponibilidade de Resgate
D+31

Quantidade de Cotistas
6

Patrimônio Líquido Fundo
27.085.060,97

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso V, Alínea B

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento

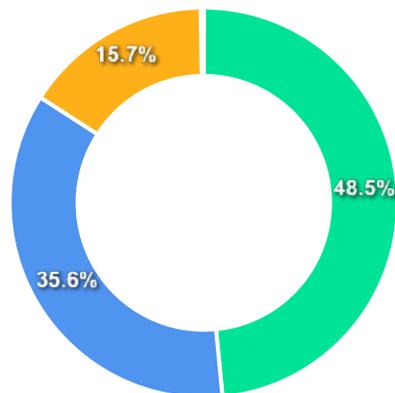
Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros de renda fixa relacionados à variação das taxas de juros ou de índices de preços.

COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,38%	6,06%	2,67%	6,06%	-%	-%	1,60%	3,36%
CDI	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Debêntures	13.248,98	48.49%
Títulos Privados	9.736,11	35.63%
Títulos Federais	4.277,89	15.66%
Operação compromissada	65,56	0.24%
Derivativos	7,87	0.03%
Valores a pagar/receber	-14,06	-0.05%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	3.706,10	13,56	Títulos Federa...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/00...	2.828,80	10,35	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	2.285,64	8,37	Títulos Privad...	04/10/2022
Debênture Simples - LCAMD1	1.808,85	6,62	Debêntures	04/10/2022
Debênture Simples - GRRB24	1.670,03	6,11	Debêntures	04/10/2022
Debênture Simples - ASAB11	1.596,35	5,84	Debêntures	04/10/2022
Debênture simples - VAMO34	1.475,71	5,40	Debêntures	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/00...	1.286,62	4,71	Títulos Privad...	04/10/2022
Debênture simples - AEGP23	1.274,65	4,67	Debêntures	04/10/2022
Debênture simples - MOVI18	1.053,55	3,86	Debêntures	04/10/2022
Debênture Simples - CCRDD1	1.044,83	3,82	Debêntures	04/10/2022
Debênture Simples - OMGE31	1.042,67	3,82	Debêntures	04/10/2022
Debênture Simples - ECCR32	707,48	2,59	Debêntures	04/10/2022
Debênture simples - LORTA7	706,28	2,58	Debêntures	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	648,09	2,37	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	637,40	2,33	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	635,54	2,33	Títulos Privad...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	322,90	1,18	Títulos Privad...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	303,64	1,11	Títulos Federa...	04/10/2022
CDB/ RDB - BANCO PAN (59.285.411/0001-13) - Venc.:...	290,29	1,06	Títulos Privad...	04/10/2022
Debênture simples - BRKMA6	284,59	1,04	Debêntures	04/10/2022
CDB/ RDB - BANCO BTG PACTU (30.306.294/0001-45) - ...	268,62	0,98	Títulos Privad...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	268,14	0,98	Títulos Federa...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/00...	252,43	0,92	Títulos Privad...	04/10/2022
Debênture simples - QUAL16	209,68	0,77	Debêntures	04/10/2022
CDB/ RDB - BANCO BTG PACTU (30.306.294/0001-45) - ...	162,07	0,59	Títulos Privad...	04/10/2022
Debêntures - CEMIG - COMPANHIA ENERGÉTICA MINAS GE...	141,49	0,52	Debêntures	04/10/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+20

Quantidade de Cotistas
1.079

Patrimônio Líquido Fundo
333.342.779,70

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Small Caps

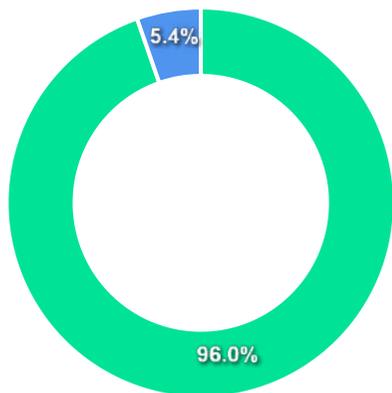
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em ações de emissão de companhias abertas de baixa e média capitalização de mercado e expressivo potencial de valorização no longo prazo, com base em uma gestão ativa e uma diversificação adequada de sua carteira.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,11%	-16,70%	-14,59%	-16,70%	-25,87%	-7,26%	10,70%	22,54%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Ações	335.750,36	96.01%
● Operação compromissada	18.918,48	5.41%
● Valores a pagar/receber	-4.956,53	-1.42%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
VALID ON NM - VLID3	44.619,14	12,76	Ações	07/10/2022
CRUZEIRO EDUON NM - CSED3	41.591,45	11,89	Ações	07/10/2022
CAMIL ON NM - CAML3	38.224,69	10,93	Ações	07/10/2022
DIMED ON - PNVL3	35.211,30	10,07	Ações	07/10/2022
DIRECIONAL ON NM - DIRR3	33.780,16	9,66	Ações	07/10/2022
TUPY ON NM - TUPY3	29.375,48	8,40	Ações	07/10/2022
ENAUTA PART ON NM - ENAT3	23.455,55	6,71	Ações	07/10/2022
FRAS-LE ON N1 - FRAS3	19.242,60	5,50	Ações	07/10/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2024	18.918,48	5,41	Operação compr...	07/10/2022
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - TUPY3	16.780,91	4,80	Ações	07/10/2022
UNICASA ON NM - UCAS3	13.915,20	3,98	Ações	07/10/2022
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - DIRR3	13.743,58	3,93	Ações	07/10/2022
RODOBENSIMOB ON NM - RDNI3	12.608,47	3,61	Ações	07/10/2022
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ENAT3	9.690,71	2,77	Ações	07/10/2022
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CAML3	2.640,20	0,75	Ações	07/10/2022
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PNVL3	652,00	0,19	Ações	07/10/2022
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - FRAS3	218,92	0,06	Ações	07/10/2022
Outros Valores a receber	19,42	0,01	Valores a paga...	07/10/2022
Outras Disponibilidades	10,00	0,00	Valores a paga...	07/10/2022
Outros Valores a pagar	-4.985,95	-1,43	Valores a paga...	07/10/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
5.687

Patrimônio Líquido Fundo
309.475.151,44

Patrimônio Líquido Master
313.294.053,39

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% dos seus recursos em cotas do AZ
QUEST MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 11.977.607/0001-42.

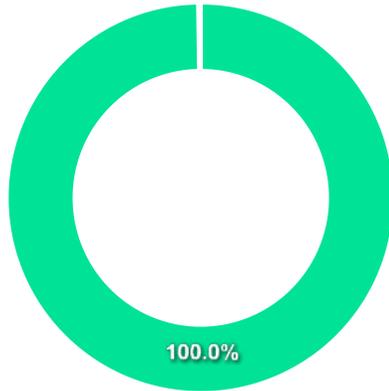
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-12,15%	-7,39%	-17,00%	-7,39%	-28,20%	-9,60%	7,65%	16,11%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de AZ QUEST MASTER FI AÇÕES	327.489,06	99,98	Fundos de Inve...	04/10/2022
Outros Valores a receber	922,22	0,28	Valores a paga...	04/10/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2024	736,36	0,22	Operação compr...	04/10/2022
Outras Disponibilidades	1,00	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a pagar	-1.608,39	-0,49	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	327.489,06	99.98%
● Operação compromissada	736,36	0.22%
● Valores a pagar/receber	-685,17	-0.21%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+30

Quantidade de Cotistas
4.519

Patrimônio Líquido Fundo
1.032.154.255,89

Patrimônio Líquido Master
1.508.361.079,83

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
IBX

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% dos seus recursos em cotas do AZ
QUEST SMALL MID CAPS MASTER FI AÇÕES, CNPJ:
11.403.884/0001-41.

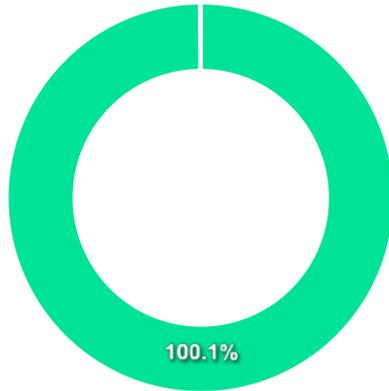
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-11,16%	-11,97%	-17,17%	-11,97%	-29,80%	-3,42%	7,76%	16,34%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,56%	-5,72%	-17,94%	-5,72%	-23,04%	4,91%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de AZ QUEST SMALL MID CAPS MASTER FI AÇÕES	1.085.257,93	100,13	Fundos de Inve...	04/10/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2024	779,94	0,07	Operação compr...	04/10/2022
Outros Valores a receber	280,42	0,03	Valores a paga...	04/10/2022
Outras Disponibilidades	1,00	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a pagar	-2.471,76	-0,23	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	1.085.257,93	100.13%
● Operação compromissada	779,94	0.07%
● Valores a pagar/receber	-2.190,34	-0.20%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BEM DTVM

Gestão
 AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.

Taxa de Administração
 2,00%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+29

Quantidade de Cotistas
 33

Patrimônio Líquido Fundo
 467.445.731,05

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
 Não definido

Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do AZ
 QUEST SMALL MID CAPS MASTER FI AÇÕES, CNPJ:
 11.403.884/0001-41.

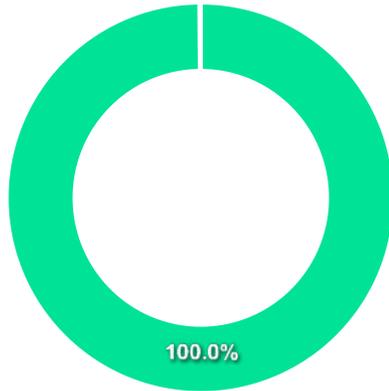
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,73%	-11,30%	-16,44%	-11,30%	-29,34%	-2,88%	7,53%	15,85%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de AZ QUEST SMALL MID CAPS MASTER FI AÇÕES	492.786,11	100,05	Fundos de Inve...	04/10/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2024	621,53	0,13	Operação compr...	04/10/2022
Outros Valores a receber	9,96	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outras Disponibilidades	1,00	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a pagar	-858,82	-0,17	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	492.786,11	100.05%
● Operação compromissada	621,53	0.13%
● Valores a pagar/receber	-847,86	-0.17%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
1,00%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
743

Patrimônio Líquido Fundo
395.433.404,84

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

Classificação ANBIMA
Ações Livre

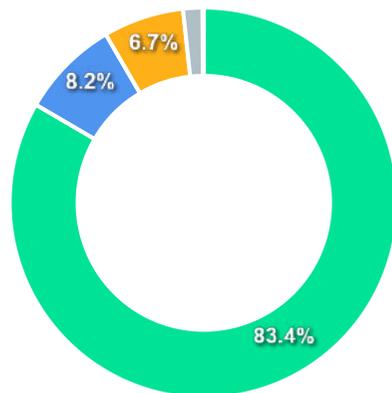
Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento com estratégias de gestão diferenciadas no mercado de renda variável.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-11,05%	-5,03%	-15,73%	-5,03%	-22,86%	2,62%	9,03%	19,03%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	330.099,70	83.38%
Ações	32.438,82	8.19%
Operação compromissada	26.558,57	6.71%
Valores a pagar/receber	6.327,08	1.60%
Outros	479,60	0.12%
Derivativos	0,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB PETROBRAS I FI AÇÕES	64.293,30	16,24	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BB TOP SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	48.743,93	12,31	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BB VALE FI AÇÕES	40.981,87	10,35	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BB ENERGIA FI AÇÕES	32.805,26	8,29	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BB TOP SMALL CAPS FI AÇÕES	28.537,69	7,21	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BB ETF IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BBOV11	28.340,00	7,16	Fundos de Inve...	04/10/2022
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/20...	26.558,57	6,71	Operação compr...	04/10/2022
Cotas de BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	22.414,26	5,66	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BB TOP AÇÕES AGRO FI AÇÕES	21.668,94	5,47	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BB PETROBRAS FI AÇÕES	16.332,12	4,13	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BB TOP EXPORTAÇÃO FI AÇÕES	16.153,23	4,08	Fundos de Inve...	04/10/2022
BRDESCO PN N1 - BBDC4	10.766,31	2,72	Ações	04/10/2022
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	9.551,62	2,41	Ações	04/10/2022
Cotas de BB TOP DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.721,98	1,19	Fundos de Inve...	04/10/2022
Outras Disponibilidades	3.893,96	0,98	Valores a paga...	04/10/2022
VALE ON N1 - VALE3	3.097,72	0,78	Ações	04/10/2022
Cotas de BB TOP AÇÕES CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	2.630,52	0,66	Fundos de Inve...	04/10/2022
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	2.327,35	0,59	Ações	04/10/2022
BRASIL ON NM - BBAS3	2.180,23	0,55	Ações	04/10/2022
Outros Valores a receber	2.000,00	0,51	Valores a paga...	04/10/2022
PETROBRAS ON - PETR3	1.663,92	0,42	Ações	04/10/2022
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	1.545,68	0,39	Ações	04/10/2022
Cotas de BB ASSET EQUIDADE IS FIC AÇÕES	1.442,19	0,36	Fundos de Inve...	04/10/2022
Cotas de BB TOP LONG BIAS FI AÇÕES	1.034,40	0,26	Fundos de Inve...	04/10/2022
Valores a receber / Juros sobre Capital	703,19	0,18	Valores a paga...	04/10/2022
SID NACIONAL ON - CSNA3	655,08	0,17	Ações	04/10/2022
BTGP BANCO UNT - BPAC11	516,05	0,13	Ações	04/10/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S.A. DTVM

Gestão
 BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
 3,00%

Taxa de Performance
 Não possui

Disponibilidade de Resgate
 D+4 ou D+33

Quantidade de Cotistas
 3.782

Patrimônio Líquido Fundo
 1.325.317.998,19

Patrimônio Líquido Master
 1.325.121.841,07

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
 Ibovespa

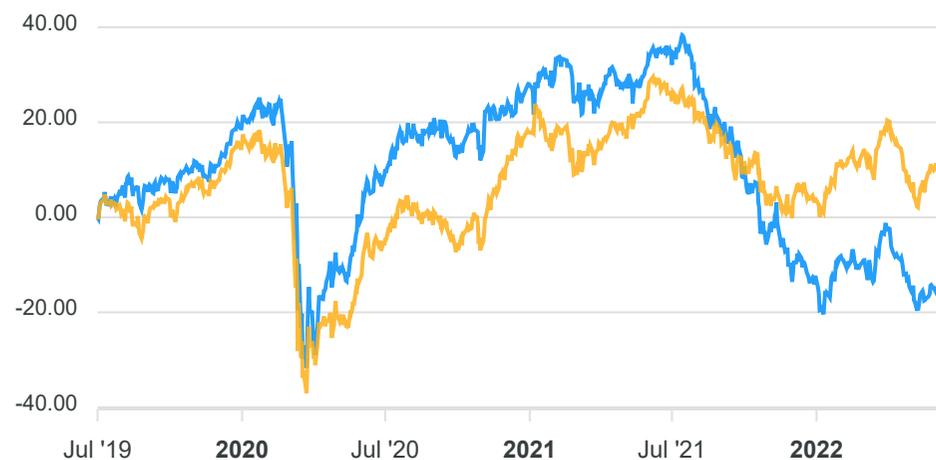
Classificação ANBIMA
 Ações Livre

Política de Investimento
 Aplica seus recursos, preponderantemente, em cotas do BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 17.009.959/0001-90.

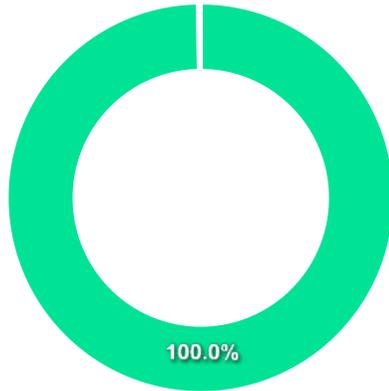
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,74%	-13,21%	-21,02%	-13,21%	-43,33%	-30,33%	9,08%	19,13%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER...	1.434.580,72	100,00	Fundos de Inve...	05/10/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/09/2028	3.708,05	0,26	Operação compr...	05/10/2022
Outros Valores a receber	23,99	0,00	Valores a paga...	05/10/2022
Outros Valores a pagar	-3.744,33	-0,26	Valores a paga...	05/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	1.434.580,72	100.00%
● Operação compromissada	3.708,05	0.26%
● Valores a pagar/receber	-3.720,34	-0.26%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S.A. DTVM

Gestão
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
2,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+3

Quantidade de Cotistas
513

Patrimônio Líquido Fundo
49.171.876,34

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

Classificação ANBIMA
Ações Dividendos

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 18.969.955/0001-17.

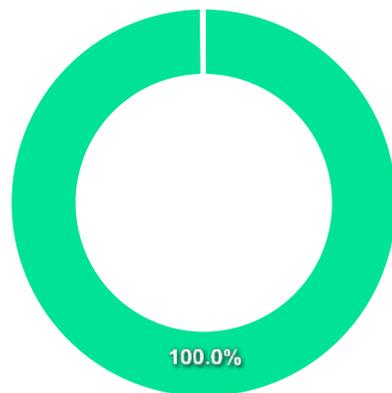
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-9,19%	-1,86%	-12,59%	-1,86%	-22,78%	-8,91%	8,10%	17,07%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI AÇÕES	49.006,32	100,00	Fundos de Inve...	06/10/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/09/2028	82,63	0,17	Operação compr...	06/10/2022
Outros Valores a receber	29,91	0,06	Valores a paga...	06/10/2022
Outros Valores a pagar	-112,23	-0,23	Valores a paga...	06/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	49.006,32	100.00%
● Operação compromissada	82,63	0.17%
● Valores a pagar/receber	-82,31	-0.17%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
CONSTANCIA INVESTIMENTOS LTDA.

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+15

Quantidade de Cotistas
4.289

Patrimônio Líquido Fundo
1.134.872.520,13

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Livre

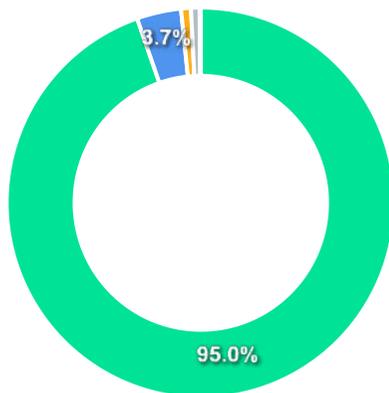
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, no mercado de renda variável, podendo aproveitar oportunidades disponíveis nos mercados de renda fixa, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,77%	-2,44%	-11,90%	-2,44%	-17,59%	6,05%	7,26%	15,29%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Ações	1.078.396,50	95.02%
● Operação compromissada	42.025,24	3.70%
● Valores a pagar/receber	9.324,30	0.82%
● Outros	8.089,42	0.71%
● Títulos Federais	1.180,73	0.10%
● Derivativos	-4.143,67	-0.37%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
CCR SA ON NM - CCRO3	47.476,17	4,18	Ações	09/07/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2027	42.025,24	3,70	Operação compr...	09/07/2022
PETROBRAS PN - PETR4	41.199,54	3,63	Ações	09/07/2022
ENERGIAS BR ON NM - ENBR3	40.155,20	3,54	Ações	09/07/2022
ALUPAR UNT N2 - ALUP11	35.470,67	3,13	Ações	09/07/2022
MINERVA ON NM - BEEF3	26.829,42	2,36	Ações	09/07/2022
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	26.559,44	2,34	Ações	09/07/2022
NEOENERGIA ON ATZ NM - NEOE3	25.293,04	2,23	Ações	09/07/2022
IOCHP-MAXION ON NM - MYPK3	24.991,47	2,20	Ações	09/07/2022
KLABIN S/A UNT N2 - KLBN11	23.389,58	2,06	Ações	09/07/2022
CELUL IRANI ON - RANI3	21.575,92	1,90	Ações	09/07/2022
BRASIL ON NM - BBAS3	20.420,82	1,80	Ações	09/07/2022
VALE ON N1 - VALE3	18.884,60	1,66	Ações	09/07/2022
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	18.287,16	1,61	Ações	09/07/2022
ITAUSA PN N1 - ITSA4	18.206,54	1,60	Ações	09/07/2022
3R PETROLEUMON NM - RRRP3	17.858,98	1,57	Ações	09/07/2022
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	17.816,22	1,57	Ações	09/07/2022
VULCABRAS ON - VULC3	16.944,76	1,49	Ações	09/07/2022
JBS ON NM - JBSS3	16.791,35	1,48	Ações	09/07/2022
ENERGISA UNT N2 - ENGI11	15.350,11	1,35	Ações	09/07/2022
SAO MARTINHO ON NM - SMT03	15.281,42	1,35	Ações	09/07/2022
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	15.214,82	1,34	Ações	09/07/2022
TUPY ON NM - TUPY3	15.130,40	1,33	Ações	09/07/2022
TERRASANTAPAON NM - LAND3	13.856,30	1,22	Ações	09/07/2022
ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	13.740,10	1,21	Ações	09/07/2022
CEMIG PN N1 - CMIG4	13.691,86	1,21	Ações	09/07/2022
ABC BRASIL PN N2 - ABCB4	13.112,41	1,16	Ações	09/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
ICATU VANGUARDA GESTAO DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
4.189

Patrimônio Líquido Fundo
889.058.860,37

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Dividendos

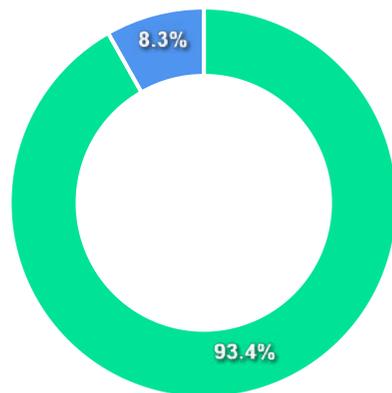
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, no mercado de renda variável, através do investimento em companhias abertas com histórico consistente de distribuição de dividendos e/ ou juros sobre capital próprio.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-9,41%	-4,85%	-16,00%	-4,85%	-24,68%	-11,89%	9,23%	19,43%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Ações	830.126,57	93.37%
● Operação compromissada	74.203,84	8.35%
● Outros	-218,99	-0.02%
● Derivativos	-4.139,68	-0.47%
● Valores a pagar/receber	-10.912,88	-1.23%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
VALE ON N1 - VALE3	152.769,13	17,18	Ações	09/07/2022
PETROBRAS PN - PETR4	108.066,56	12,16	Ações	09/07/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2027	74.203,84	8,35	Operação compr...	09/07/2022
BRDESCO ON N1 - BBDC3	66.123,22	7,44	Ações	09/07/2022
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	60.254,46	6,78	Ações	09/07/2022
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	60.160,17	6,77	Ações	09/07/2022
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	39.712,43	4,47	Ações	09/07/2022
BTGP BANCO UNT - BPAC11	38.571,31	4,34	Ações	09/07/2022
ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	34.176,58	3,84	Ações	09/07/2022
B3 ON NM - B3SA3	33.075,32	3,72	Ações	09/07/2022
ITAUSA PN N1 - ITSA4	28.116,35	3,16	Ações	09/07/2022
VIVARA S.A. ON NM - VIVA3	25.782,34	2,90	Ações	09/07/2022
VIBRA ON NM - VBBR3	21.485,30	2,42	Ações	09/07/2022
OMEGAENERGIAON NM - MEGA3	19.501,18	2,19	Ações	09/07/2022
KLABIN S/A UNT N2 - KLBN11	18.708,25	2,10	Ações	09/07/2022
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	16.753,85	1,88	Ações	09/07/2022
BR MALLS PAR ON NM - BRML3	16.713,17	1,88	Ações	09/07/2022
Outros Valores a receber	16.445,45	1,85	Valores a paga...	09/07/2022
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	16.316,80	1,84	Ações	09/07/2022
GERDAU PN N1 - GGBR4	11.816,11	1,33	Ações	09/07/2022
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	9.808,81	1,10	Ações	09/07/2022
DESKTOP ON NM - DESK3	9.200,96	1,03	Ações	09/07/2022
DASA ON NM - DASA3	8.981,32	1,01	Ações	09/07/2022
WEG ON NM - WEGE3	8.252,40	0,93	Ações	09/07/2022
SUL AMERICA UNT N2 - SULA11	7.281,09	0,82	Ações	09/07/2022
COSAN ON NM - CSAN3	6.550,36	0,74	Ações	09/07/2022
REDE D OR ON NM - RDOR3	6.355,08	0,71	Ações	09/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO DAYCOVAL S.A.

Gestão

META ASSET MANAGEMENT LTDA.

Taxa de Administração

2,50%

Taxa de Performance

20,00%

Disponibilidade de Resgate

D+4

Quantidade de Cotistas

199

Patrimônio Líquido Fundo

233.820.067,07

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)

IBX

Classificação ANBIMA

Ações Índice Ativo

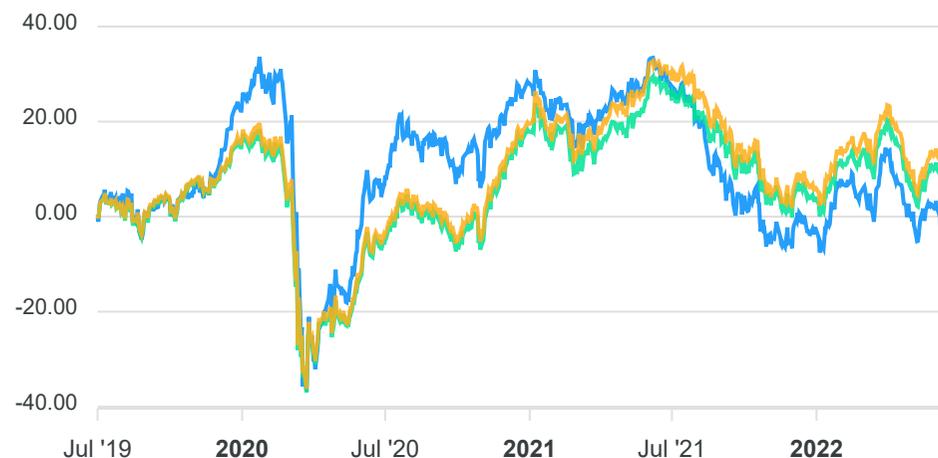
Política de Investimento

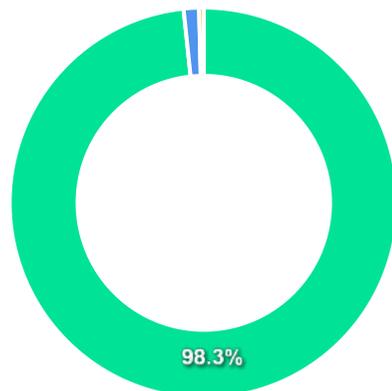
Aplica seus recursos em ações de companhias admitidas à negociação em mercado organizado e/ou em outros ativos financeiros ou modalidades operacionais de renda variável.

COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-14,32%	-10,59%	-22,53%	-10,59%	-31,48%	-18,31%	10,81%	22,78%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,56%	-5,72%	-17,94%	-5,72%	-23,04%	4,91%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Ações	229.916,25	98.33%
● Valores a pagar/receber	2.995,60	1.28%
● Operação compromissada	908,97	0.39%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
VALE ON N1 - VALE3	25.264,80	10,81	Ações	08/07/2022
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	21.989,90	9,40	Ações	08/07/2022
SANTOS BRP ON NM - STBP3	16.952,00	7,25	Ações	08/07/2022
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - MULT3	14.347,62	6,14	Ações	08/07/2022
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	13.847,50	5,92	Ações	08/07/2022
WEG ON NM - WEGE3	13.225,00	5,66	Ações	08/07/2022
LOJAS RENNEN ON NM - LREN3	11.988,60	5,13	Ações	08/07/2022
BTGP BANCO UNT - BPAC11	10.931,90	4,68	Ações	08/07/2022
COSAN ON NM - CSAN3	10.374,00	4,44	Ações	08/07/2022
BRASIL ON NM - BBAS3	10.014,00	4,28	Ações	08/07/2022
3R PETROLEUMON NM - RRRP3	9.666,25	4,13	Ações	08/07/2022
RANDON PART PN N1 - RAP4	9.380,00	4,01	Ações	08/07/2022
NEOENERGIA ON ATZ NM - NEOE3	8.952,00	3,83	Ações	08/07/2022
CBA ON NM - CBAV3	8.106,00	3,47	Ações	08/07/2022
AMERICANAS ON NM - AMER3	8.058,00	3,45	Ações	08/07/2022
ELETOBRAS ON N1 - ELET3	7.392,00	3,16	Ações	08/07/2022
USIMINAS PNA N1 - USIM5	6.487,50	2,77	Ações	08/07/2022
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - CYRE3	6.201,04	2,65	Ações	08/07/2022
PETROBRAS PN - PETR4	5.586,00	2,39	Ações	08/07/2022
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	4.212,00	1,80	Ações	08/07/2022
CYRELA REALT ON NM - CYRE3	3.727,76	1,59	Ações	08/07/2022
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	3.212,38	1,37	Ações	08/07/2022
Outros Valores a receber	1.983,51	0,85	Valores a paga...	08/07/2022
Outros Valores a receber	1.634,82	0,70	Valores a paga...	08/07/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/09/2026	908,97	0,39	Operação compr...	08/07/2022
Valores a receber / DIV/JRS Multiplus	621,79	0,27	Valores a paga...	08/07/2022
Valores a receber / DIV/JRS Cyrella	474,41	0,20	Valores a paga...	08/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO DAYCOVAL S.A.

Gestão
MULTINVEST CAPITAL ADMINISTRADORA DE RECURSOS
LTDA

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+11

Quantidade de Cotistas
210

Patrimônio Líquido Fundo
74.889.811,07

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Livre

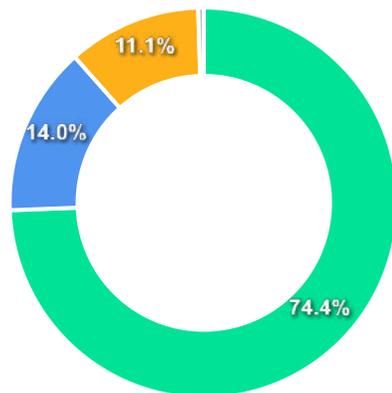
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em ações de companhias admitidas à negociação em mercado organizado e/ou em outros ativos financeiros e modalidades operacionais de renda variável.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-13,32%	-10,33%	-16,25%	-10,33%	-29,15%	-7,56%	9,16%	19,30%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Ações	55.714,89	74.40%
● Fundos de Investimento	10.509,46	14.03%
● Operação compromissada	8.318,84	11.11%
● Valores a pagar/receber	347,01	0.46%
● Derivativos	0,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
VALE ON N1 - VALE3	11.805,55	15,76	Ações	08/07/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/09/2026	8.318,84	11,11	Operação compr...	08/07/2022
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	6.803,27	9,08	Ações	08/07/2022
Cotas de MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	5.847,45	7,81	Fundos de Inve...	08/07/2022
PETROBRAS PN - PETR4	5.401,66	7,21	Ações	08/07/2022
Cotas de MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	4.662,01	6,23	Fundos de Inve...	08/07/2022
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	3.990,11	5,33	Ações	08/07/2022
GERDAU PN N1 - GGBR4	3.864,32	5,16	Ações	08/07/2022
COSAN ON NM - CSAN3	3.811,08	5,09	Ações	08/07/2022
BTGP BANCO UNT - BPAC11	3.259,49	4,35	Ações	08/07/2022
ALIANSCSONAEON NM - ALSO3	2.752,12	3,67	Ações	08/07/2022
VAMOS ON NM - VAMO3	2.457,93	3,28	Ações	08/07/2022
3R PETROLEUMON NM - RRRP3	2.383,17	3,18	Ações	08/07/2022
RAIZEN PN N2 - RAIZ4	2.345,49	3,13	Ações	08/07/2022
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	2.325,65	3,11	Ações	08/07/2022
KLABIN S/A UNT N2 - KLBN11	1.561,46	2,09	Ações	08/07/2022
VIVARA S.A. ON NM - VIVA3	1.472,66	1,97	Ações	08/07/2022
SIMPAR ON NM - SIMH3	1.271,36	1,70	Ações	08/07/2022
Outros Valores a receber	399,55	0,53	Valores a paga...	08/07/2022
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - MULT3	209,58	0,28	Ações	08/07/2022
Valores a receber / DIV/JRS Multiplus	28,55	0,04	Valores a paga...	08/07/2022
Outros Valores a receber	28,39	0,04	Valores a paga...	08/07/2022
Valores a pagar / DIV/JRS Banco do Brasil	13,51	0,02	Valores a paga...	08/07/2022
Outros Valores a receber	9,47	0,01	Valores a paga...	08/07/2022
Outros Valores a receber	3,35	0,00	Valores a paga...	08/07/2022
Valores a receber / DIV/JRS Itaú Unibanco	3,04	0,00	Valores a paga...	08/07/2022
Outros Valores a receber	2,38	0,00	Valores a paga...	08/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO DAYCOVAL S.A.

Gestão

MULTINVEST CAPITAL ADMINISTRADORA DE RECURSOS
LTDA

Taxa de Administração

0,55%

Taxa de Performance

10,00%

Disponibilidade de Resgate

D+1 du

Quantidade de Cotistas

10

Patrimônio Líquido Fundo

9.298.111,20

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)

Não definido

Classificação ANBIMA

Ações Livre

Política de Investimento

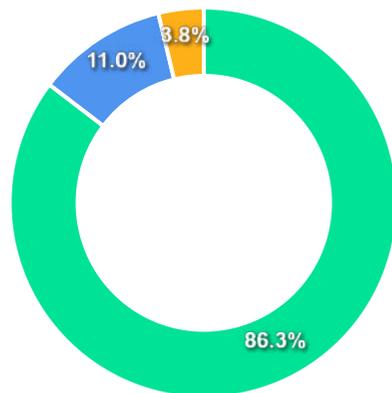
Aplica, no mínimo, 67% em ações admitidas à negociação em mercado organizado, bônus ou recibos de subscrição e certificados de depósito de ações, cotas de fundos de índices de ações e BDRs classificados como nível II e III.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-12,93%	-12,59%	-15,65%	-12,59%	-29,29%	-20,47%	8,50%	17,91%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
● Ações	8.024,49	86.30%
● Operação compromissada	1.022,07	10.99%
● Títulos Federais	354,71	3.81%
● Valores a pagar/receber	-103,14	-1.11%

Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/09/2027	1.022,07	10,99	Operação compr...	08/07/2022
ENEVA ON NM - ENEV3	738,50	7,94	Ações	08/07/2022
SLC AGRICOLA ON NM - SLCE3	637,24	6,85	Ações	08/07/2022
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	553,14	5,95	Ações	08/07/2022
BTGP BANCO UNT - BPAC11	504,21	5,42	Ações	08/07/2022
MOVIDA ON NM - MOVI3	484,16	5,21	Ações	08/07/2022
ABC BRASIL PN N2 - ABCB4	445,42	4,79	Ações	08/07/2022
TOTVS ON NM - TOTS3	416,35	4,48	Ações	08/07/2022
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	401,98	4,32	Ações	08/07/2022
SANTOS BRP ON NM - STBP3	396,42	4,26	Ações	08/07/2022
VAMOS ON NM - VAMO3	371,21	3,99	Ações	08/07/2022
ASSAI ON NM - ASAI3	343,91	3,70	Ações	08/07/2022
LFT - Venc: 01/03/2024	331,15	3,56	Títulos Federa...	08/07/2022
COSAN ON NM - CSAN3	305,76	3,29	Ações	08/07/2022
RAIZEN PN N2 - RAIZ4	293,30	3,15	Ações	08/07/2022
PETRORIO ON NM - PRIO3	281,47	3,03	Ações	08/07/2022
3R PETROLEUMON NM - RRRP3	281,20	3,02	Ações	08/07/2022
KLABIN S/A UNT N2 - KLBN11	220,18	2,37	Ações	08/07/2022
WILSON SONS ON NM - PORT3	213,72	2,30	Ações	08/07/2022
RANDON PART PN N1 - RAP4	212,93	2,29	Ações	08/07/2022
ANIMA ON NM - ANIM3	193,05	2,08	Ações	08/07/2022
MRV ON NM - MRVE3	185,10	1,99	Ações	08/07/2022
AREZZO CO ON NM - ARZZ3	159,97	1,72	Ações	08/07/2022
CBA ON NM - CBAV3	151,70	1,63	Ações	08/07/2022
INTELBRAS ON NM - INTB3	140,85	1,51	Ações	08/07/2022
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	92,74	1,00	Ações	08/07/2022
LFT - Venc: 01/03/2026	23,56	0,25	Títulos Federa...	08/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
OCCAM BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4 ou D+18

Quantidade de Cotistas
2.256

Patrimônio Líquido Fundo
914.122.528,22

Patrimônio Líquido Master
969.621.759,32

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Valor/Crescimento

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% dos seus recursos em cotas do OCCAM FI AÇÕES, CNPJ: 11.616.482/0001-25.

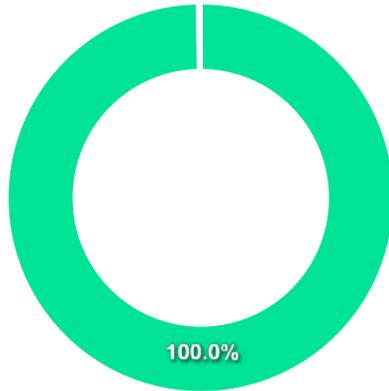
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-8,92%	-4,02%	-14,14%	-4,02%	-19,95%	4,19%	9,17%	19,30%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de OCCAM FI AÇÕES	990.206,77	100,04	Fundos de Inve...	07/10/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2024	2.610,72	0,26	Operação compr...	07/10/2022
Outros Valores a receber	457,24	0,05	Valores a paga...	07/10/2022
Outras Disponibilidades	1,00	0,00	Valores a paga...	07/10/2022
Outros Valores a pagar	-3.427,86	-0,35	Valores a paga...	07/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	990.206,77	100.04%
● Operação compromissada	2.610,72	0.26%
● Valores a pagar/receber	-2.969,63	-0.30%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+13

Quantidade de Cotistas
70

Patrimônio Líquido Fundo
86.737.242,34

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
IBX

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos em oportunidades oferecidas
preponderantemente pelo mercado de renda variável.

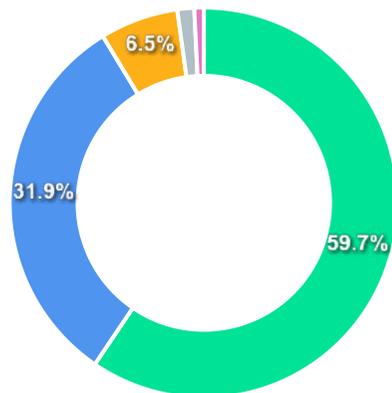
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-9,67%	-2,88%	-14,98%	-2,88%	-28,14%	-12,64%	7,72%	16,27%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,56%	-5,72%	-17,94%	-5,72%	-23,04%	4,91%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	53.573,01	59.67%
Fundos de Investimento	28.632,11	31.89%
Operação compromissada	5.869,54	6.54%
Derivativos	1.262,84	1.41%
Outros	710,09	0.79%
Valores a pagar/receber	-259,86	-0.29%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Mercado Futuro - Posições compradas / FUT WIN/V22	18.215,97	20,29	Outros	05/10/2022
Cotas de ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	15.062,17	16,78	Fundos de Inve...	05/10/2022
Cotas de QUELUZ SELEÇÃO FI AÇÕES	8.477,90	9,44	Fundos de Inve...	05/10/2022
BRDESCO PN N1 - BBDC4	6.101,59	6,80	Ações	05/10/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2024	5.869,54	6,54	Operação compr...	05/10/2022
VALE ON N1 - VALE3	5.590,30	6,23	Ações	05/10/2022
B3 ON NM - B3SA3	5.450,99	6,07	Ações	05/10/2022
Cotas de QLZ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5.092,04	5,67	Fundos de Inve...	05/10/2022
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	4.753,36	5,29	Ações	05/10/2022
BTGP BANCO UNT - BPAC11	4.718,86	5,26	Ações	05/10/2022
PETZ ON NM - PETZ3	4.427,00	4,93	Ações	05/10/2022
PETROBRAS PN - PETR4	3.412,10	3,80	Ações	05/10/2022
HAPVIDA ON NM - HAPV3	2.132,05	2,37	Ações	05/10/2022
SUL AMERICA UNT N2 - SULA11	1.866,28	2,08	Ações	05/10/2022
ASSAI ON NM - ASAI3	1.609,34	1,79	Ações	05/10/2022
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	1.585,59	1,77	Ações	05/10/2022
BRASIL ON NM - BBAS3	1.498,43	1,67	Ações	05/10/2022
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETZ3	1.423,80	1,59	Ações	05/10/2022
LOCALIZA ON NM - RENT3	1.362,31	1,52	Ações	05/10/2022
AMBEV S/A ON - ABEV3	1.282,05	1,43	Ações	05/10/2022
VIBRA ON NM - VBRR3	1.072,95	1,19	Ações	05/10/2022
ITAUSA PN N1 - ITSA4	1.046,90	1,17	Ações	05/10/2022
WEG ON NM - WEGE3	1.009,20	1,12	Ações	05/10/2022
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	863,49	0,96	Ações	05/10/2022
VAMOS ON NM - VAMO3	765,52	0,85	Ações	05/10/2022
Opções - Posições titulares - IBOVL10	765,45	0,85	Derivativos	05/10/2022
Opções - Posições titulares - IBOVV112	523,17	0,58	Derivativos	05/10/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
3.119

Patrimônio Líquido Fundo
306.366.973,83

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Índice Ativo

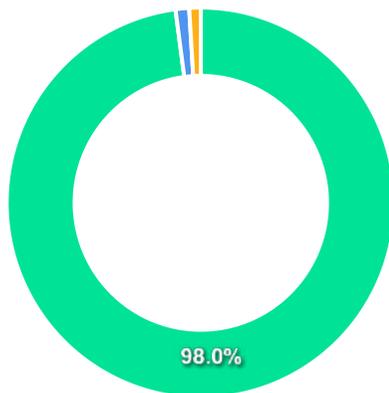
Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 67% em ações admitidas à negociação em mercado organizado, bônus ou recibos de subscrição e certificados de depósito de ações, cotas de fundos de índices de ações e BDRs classificados como nível II e III.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-13,54%	-9,01%	-17,88%	-9,01%	-26,33%	-5,84%	9,21%	19,41%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Ações	300.201,90	97.99%
● Operação compromissada	3.467,79	1.13%
● Valores a pagar/receber	2.937,69	0.96%
● Outros	-240,40	-0.08%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
VALE ON N1 - VALE3	48.232,80	15,74	Ações	09/07/2022
PETROBRAS PN - PETR4	24.578,40	8,02	Ações	09/07/2022
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	18.362,70	5,99	Ações	09/07/2022
PETROBRAS ON - PETR3	15.880,80	5,18	Ações	09/07/2022
BRADESCO PN N1 - BBDC4	15.136,00	4,94	Ações	09/07/2022
B3 ON NM - B3SA3	11.508,00	3,76	Ações	09/07/2022
ELETRORBRAS ON N1 - ELET3	8.778,00	2,87	Ações	09/07/2022
WEG ON NM - WEGE3	8.464,00	2,76	Ações	09/07/2022
BRASIL ON NM - BBAS3	8.345,00	2,72	Ações	09/07/2022
BTGP BANCO UNT - BPAC11	7.362,30	2,40	Ações	09/07/2022
LOCALIZA ON NM - RENT3	6.813,30	2,22	Ações	09/07/2022
ITAUSA PN N1 - ITSA4	6.672,00	2,18	Ações	09/07/2022
JBS ON NM - JBSS3	6.318,00	2,06	Ações	09/07/2022
AMBEV S/A ON - ABEV3	5.360,00	1,75	Ações	09/07/2022
ELETRORBRAS PNB N1 - ELET6	4.670,00	1,52	Ações	09/07/2022
COSAN ON NM - CSAN3	4.550,00	1,49	Ações	09/07/2022
PETRORIO ON NM - PRIO3	4.398,00	1,44	Ações	09/07/2022
HAPVIDA ON NM - HAPV3	4.376,00	1,43	Ações	09/07/2022
VIBRA ON NM - VBRR3	4.177,50	1,36	Ações	09/07/2022
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	4.153,60	1,36	Ações	09/07/2022
Outros Valores a receber	4.101,80	1,34	Valores a paga...	09/07/2022
LOJAS RENNEN ON NM - LREN3	4.071,60	1,33	Ações	09/07/2022
GERDAU PN N1 - GGBR4	4.023,00	1,31	Ações	09/07/2022
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	3.975,20	1,30	Ações	09/07/2022
ENEVA ON NM - ENEV3	3.692,50	1,21	Ações	09/07/2022
BRADESCO ON N1 - BBDC3	3.595,00	1,17	Ações	09/07/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2027	3.467,79	1,13	Operação compr...	09/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+4

Quantidade de Cotistas
5.057

Patrimônio Líquido Fundo
186.106.545,82

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Valor/Crescimento

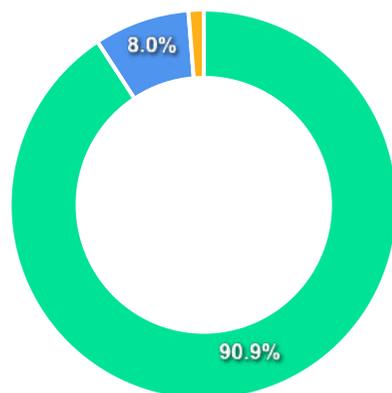
Política de Investimento
Aplica seus recursos no mercado de renda variável, utilizando-se de análise fundamentalista, observando entre outros aspectos, a potencialidade do valor intrínseco das ações selecionadas.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,78%	-12,17%	-16,55%	-12,17%	-33,74%	-18,10%	8,72%	18,37%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Ações	169.092,64	90.86%
● Operação compromissada	14.825,57	7.97%
● Valores a pagar/receber	2.368,64	1.27%
● Outros	-180,30	-0.10%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
VALE ON N1 - VALE3	27.155,83	14,59	Ações	09/07/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2027	14.825,57	7,97	Operação compr...	09/07/2022
PETROBRAS PN - PETR4	12.850,59	6,90	Ações	09/07/2022
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	9.478,33	5,09	Ações	09/07/2022
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	9.133,74	4,91	Ações	09/07/2022
BRADERSCO PN N1 - BBDC4	7.000,40	3,76	Ações	09/07/2022
B3 ON NM - B3SA3	5.508,50	2,96	Ações	09/07/2022
PETROBRAS ON - PETR3	5.442,23	2,92	Ações	09/07/2022
BRASIL ON NM - BBAS3	5.137,18	2,76	Ações	09/07/2022
AMBEV S/A ON - ABEV3	4.743,60	2,55	Ações	09/07/2022
LOCALIZA ON NM - RENT3	4.622,56	2,48	Ações	09/07/2022
BTGP BANCO UNT - BPAC11	4.049,27	2,18	Ações	09/07/2022
ITAUSA PN N1 - ITSA4	3.959,00	2,13	Ações	09/07/2022
JBS ON NM - JBSS3	3.550,72	1,91	Ações	09/07/2022
GERDAU PN N1 - GGBR4	3.345,80	1,80	Ações	09/07/2022
WEG ON NM - WEGE3	3.330,06	1,79	Ações	09/07/2022
ASSAI ON NM - ASAI3	3.304,93	1,78	Ações	09/07/2022
Outros Valores a receber	3.200,96	1,72	Valores a paga...	09/07/2022
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	3.140,41	1,69	Ações	09/07/2022
HYPERMARCAS ON NM - HYPE3	3.119,28	1,68	Ações	09/07/2022
BRADERSCO ON N1 - BBDC3	3.077,32	1,65	Ações	09/07/2022
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	2.818,45	1,51	Ações	09/07/2022
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	2.249,88	1,21	Ações	09/07/2022
AREZZO CO ON NM - ARZZ3	2.246,47	1,21	Ações	09/07/2022
3R PETROLEUMON NM - RRRP3	2.239,06	1,20	Ações	09/07/2022
REDE D OR ON NM - RDOR3	2.005,42	1,08	Ações	09/07/2022
VAMOS ON NM - VAMO3	1.606,61	0,86	Ações	09/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS
S.A.

Taxa de Administração
2,00%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
D+32

Quantidade de Cotistas
301

Patrimônio Líquido Fundo
298.128.210,57

Patrimônio Líquido Master
296.300.560,39

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 8º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
IBX

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do
SULAMÉRICA SELECTION MASTER I FI AÇÕES, CNPJ:
35.587.562/0001-68.

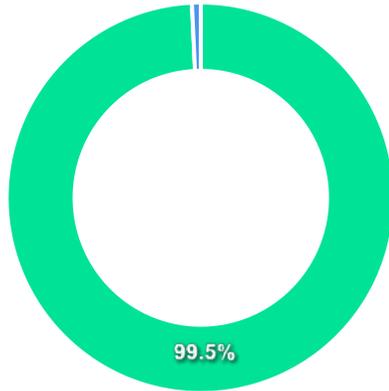
COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-18,46%	-20,48%	-23,33%	-20,48%	-38,81%	-1,76%	10,58%	22,27%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,56%	-5,72%	-17,94%	-5,72%	-23,04%	4,91%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de SULAMÉRICA SELECTION MASTER I FI AÇÕES	340.511,40	99,53	Fundos de Inve...	07/10/2022
Outros Valores a receber	6.635,06	1,94	Valores a paga...	07/10/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2024	2.519,22	0,74	Operação compr...	07/10/2022
Outras Disponibilidades	1,00	0,00	Valores a paga...	07/10/2022
Outros Valores a pagar	-7.550,21	-2,21	Valores a paga...	07/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	340.511,40	99.53%
● Operação compromissada	2.519,22	0.74%
● Valores a pagar/receber	-914,15	-0.27%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS
Administrador SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S.A
Gestão MIRAE ASSET GLOBAL INVESTIMENTOS (BRASIL) GESTAO DE RECURSOS LTDA
Taxa de Administração 0,80%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+6 du
Quantidade de Cotistas 11
Patrimônio Líquido Fundo 13.003.582,98
Patrimônio Líquido Master 14.900.000.000,00

PERFIL DO FUNDO
Enquadramento Resolução Artigo 9º, Inciso II
Indicador de Desempenho (CVM) Ibovespa
Classificação ANBIMA Ações Investimento no Exterior
Política de Investimento Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES, CNPJ: 36.896.616/0001-30.

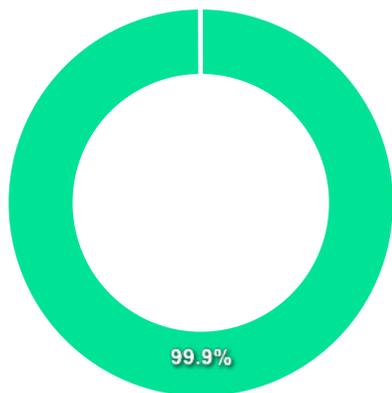
COMPARATIVO 📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-6,37%	-47,50%	-23,22%	-47,50%	-40,63%	-%	15,45%	32,53%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICI...	11.716,36	99,93	Fundos de Inve...	07/10/2022
Outras Disponibilidades	12,93	0,11	Valores a paga...	07/10/2022
Outros Valores a receber	4,09	0,03	Valores a paga...	07/10/2022
Outros Valores a pagar	-8,69	-0,07	Valores a paga...	07/10/2022



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	11.716,36	99.93%
● Valores a pagar/receber	8,32	0.07%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S.A

Gestão
MIRAE ASSET GLOBAL INVESTIMENTOS (BRASIL) GESTAO DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração
0,80%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+6 du

Quantidade de Cotistas
10

Patrimônio Líquido Fundo
15.946.777,45

Patrimônio Líquido Master
6.800.000.000,00

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso II

Indicador de Desempenho (CVM)
Ibovespa

Classificação ANBIMA
Ações Investimento no Exterior

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do CLOU GLOBAL X MIRAE ASSET CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES, CNPJ: 37.439.845/0001-98.

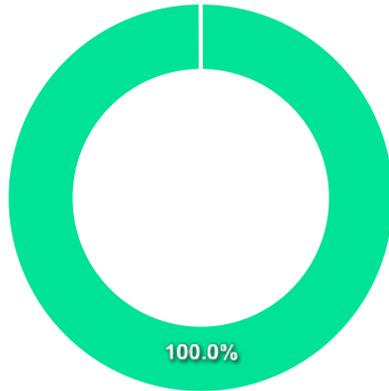
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,20%	-42,28%	-17,90%	-42,28%	-40,62%	-%	22,33%	47,02%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO...	15.835,05	99,98	Fundos de Inve...	07/10/2022
Outras Disponibilidades	10,85	0,07	Valores a paga...	07/10/2022
Outros Valores a receber	4,09	0,03	Valores a paga...	07/10/2022
Outros Valores a pagar	-11,26	-0,07	Valores a paga...	07/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	15.835,05	99.98%
● Valores a pagar/receber	3,68	0.02%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.
Gestão	PLURAL INVESTIMENTOS GESTAO DE RECURSOS LTDA.
Taxa de Administração	0,80%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+6 du
Quantidade de Cotistas	187
Patrimônio Líquido Fundo	179.511.776,28

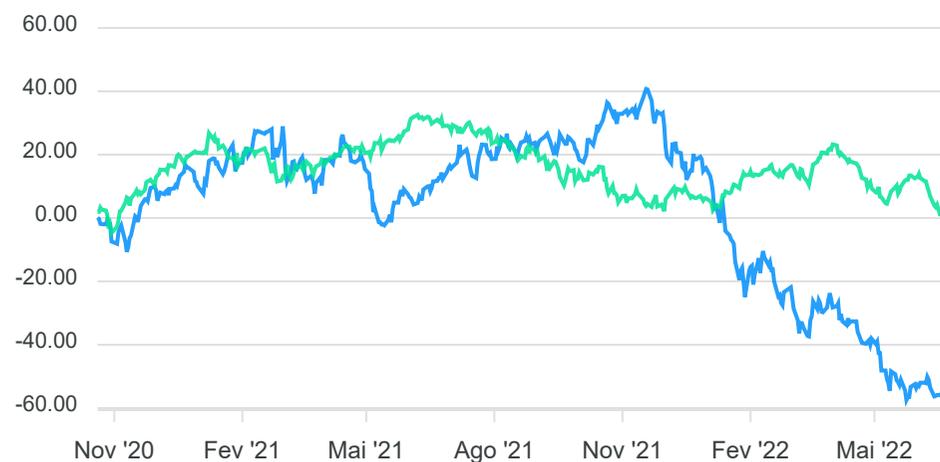
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 9º, Inciso II
Indicador de Desempenho (CVM)	Não definido
Classificação ANBIMA	Ações Investimento no Exterior
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES, CNPJ: 37.331.299/0001-77.

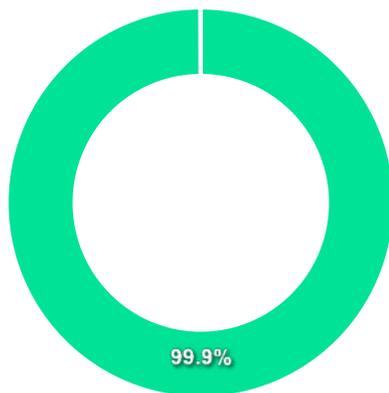
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,05%	-60,02%	-36,07%	-60,02%	-60,24%	-%	29,15%	61,39%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTER...	179.419,99	99,95	Fundos de Inve...	05/07/2022
Outros Valores a receber	281,35	0,16	Valores a paga...	05/07/2022
Outras Disponibilidades	66,20	0,04	Valores a paga...	05/07/2022
Outros Valores a pagar	-255,76	-0,14	Valores a paga...	05/07/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	179.419,99	99.95%
● Valores a pagar/receber	91,79	0.05%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA.

Taxa de Administração
0,85%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+4 du

Quantidade de Cotistas
371

Patrimônio Líquido Fundo
269.329.951,07

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso II

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

Classificação ANBIMA
Ações Investimento no Exterior

Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS
INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES, CNPJ:
37.308.317/0001-08.

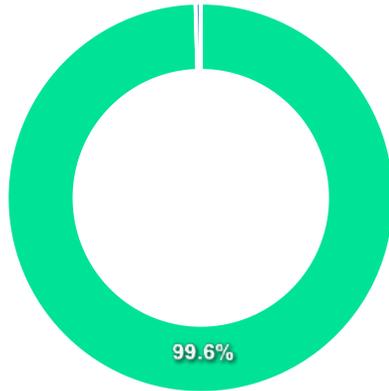
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,33%	-27,32%	-8,82%	-27,32%	-14,58%	-%	10,12%	21,30%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS U...	262.780,15	99,64	Fundos de Inve...	04/10/2022
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2024	1.150,04	0,44	Operação compr...	04/10/2022
Outros Valores a receber	15,45	0,01	Valores a paga...	04/10/2022
Outras Disponibilidades	0,10	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a pagar	-228,15	-0,09	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	262.780,15	99.64%
● Operação compromissada	1.150,04	0.44%
● Valores a pagar/receber	-212,60	-0.08%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
1,00%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+5

Quantidade de Cotistas
17.281

Patrimônio Líquido Fundo
775.941.708,13

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III

Indicador de Desempenho (CVM)
Global BDRX

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento, os quais invistam em recibos de ações de empresas estrangeiras que atendam aos critérios da temática ESG, negociados no Brasil.

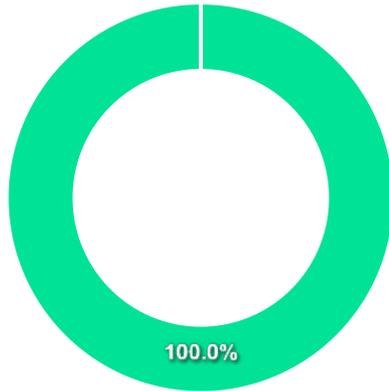
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,02%	-27,37%	-9,82%	-27,37%	-11,10%	9,17%	11,56%	24,34%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,79%	-27,61%	-10,27%	-27,61%	-12,10%	12,50%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	697.916,46	100,00	Fundos de Inve...	04/10/2022
Outros Valores a pagar	0,52	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Outros Valores a receber	0,04	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-4,25	0,00	Valores a paga...	04/10/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-27,69	0,00	Valores a paga...	04/10/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Fundos de Investimento	697.916,46	100.00%
● Valores a pagar/receber	-31,38	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador

BANCO BRADESCO S.A.

Gestão

BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM

Taxa de Administração

0,80%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+5

Quantidade de Cotistas

75

Patrimônio Líquido Fundo

127.248.350,22

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução

Artigo 9º, Inciso III

Indicador de Desempenho (CVM)

Não definido

Classificação ANBIMA

Ações Livre

Política de Investimento

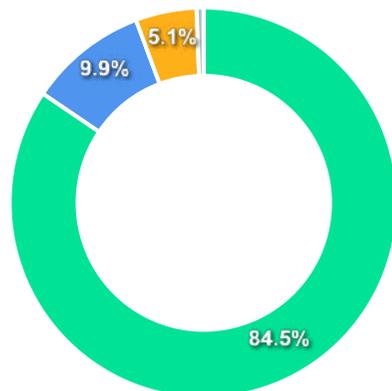
Aplica seus recursos principalmente em BDRs nível I de empresas norte americanas de diversos setores econômicos, selecionadas aquelas com maior liquidez, através de uma gestão ativa de seu portfólio.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,04%	-26,63%	-9,11%	-26,63%	-9,08%	13,90%	11,62%	24,46%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Brazilian Depository Receipts	99.478,43	84.45%
● Investimento no Exterior	11.616,94	9.86%
● Fundos de Investimento	5.989,96	5.09%
● Operação compromissada	679,05	0.58%
● Valores a pagar/receber	26,90	0.02%
● Outros	0,59	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Investimento no Exterior - BGIF US EQUI SEG POR	11.616,94	9,86	Investimento n...	07/10/2022
CORE SP TOTADRN - BITO39	11.213,30	9,52	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - AAPL34	7.516,17	6,38	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - MSFT34	6.260,19	5,31	Brazilian Depo...	07/10/2022
Cotas de ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	5.989,96	5,09	Fundos de Inve...	07/10/2022
CORE SP 500 DRN - BIVB39	5.605,82	4,76	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - AMZO34	3.616,32	3,07	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - TSLA34	2.561,14	2,17	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - GOGL34	2.070,95	1,76	Brazilian Depo...	07/10/2022
ALPHABET DRN C - GOGL35	1.867,97	1,59	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - BERK34	1.739,06	1,48	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - UNHH34	1.708,88	1,45	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - JNJB34	1.552,09	1,32	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - EXXO34	1.266,84	1,08	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - NVDC34	1.103,07	0,94	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - PGO34	1.093,28	0,93	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - JPMC34	1.060,41	0,90	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - VISA34	1.031,93	0,88	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - HOME34	994,89	0,84	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - CHVX34	936,63	0,80	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - T1SO34	921,50	0,78	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - ABBV34	879,79	0,75	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - LILY34	874,26	0,74	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - MSCD34	848,35	0,72	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - PFIZ34	845,42	0,72	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - PEPB34	794,81	0,67	Brazilian Depo...	07/10/2022
Brazilian Depository Receipt - BDR - MRCK34	784,99	0,67	Brazilian Depo...	07/10/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
PLURAL INVESTIMENTOS GESTAO DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
1,95%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+5 du

Quantidade de Cotistas
1.134

Patrimônio Líquido Fundo
25.823.215,23

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 9º, Inciso III

Indicador de Desempenho (CVM)
Global BDRX

Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, no mercado de renda variável, podendo aproveitar oportunidades disponíveis nos mercados de renda fixa, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento.

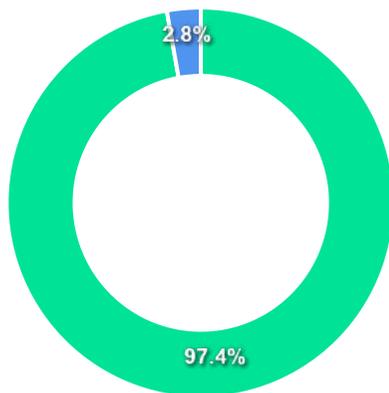
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,39%	-31,09%	-12,86%	-31,09%	-18,77%	-%	11,78%	24,81%
Indicador de Desempenho (CVM)	0,79%	-27,61%	-10,27%	-27,61%	-12,10%	12,50%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Brazilian Depository Receipts	25.156,92	97.42%
● Operação compromissada	727,02	2.82%
● Valores a pagar/receber	-60,73	-0.24%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
MICROSOFT DRN - MSFT34	3.479,37	13,47	Brazilian Depo...	09/07/2022
APPLE DRN - AAPL34	3.198,33	12,39	Brazilian Depo...	09/07/2022
ALPHABET DRN A - GOGL34	3.122,78	12,09	Brazilian Depo...	09/07/2022
AMAZON DRN - AMZO34	2.148,85	8,32	Brazilian Depo...	09/07/2022
JOHNSON & JOHNSO - JNJB34	2.133,04	8,26	Brazilian Depo...	09/07/2022
WALMART INC - WALM34	1.985,04	7,69	Brazilian Depo...	09/07/2022
CONOCOPHILLIPS - COPH34	1.972,79	7,64	Brazilian Depo...	09/07/2022
JPMORGAN DRN - JPMC34	1.625,69	6,30	Brazilian Depo...	09/07/2022
WALT DISNEY DRN - DISB34	1.294,37	5,01	Brazilian Depo...	09/07/2022
GOLDMANSACHS DRN - GSGI34	1.291,41	5,00	Brazilian Depo...	09/07/2022
COCA COLA DRN - COCA34	1.212,19	4,69	Brazilian Depo...	09/07/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2027	727,02	2,82	Operação compr...	09/07/2022
GENERAL MOT DRN - GMCO34	661,22	2,56	Brazilian Depo...	09/07/2022
TESLA INC DRN - TSLA34	523,49	2,03	Brazilian Depo...	09/07/2022
NETFLIX DRN - NFLX34	508,35	1,97	Brazilian Depo...	09/07/2022
Outros Valores a receber	25,42	0,10	Valores a paga...	09/07/2022
Outras Disponibilidades	0,93	0,00	Valores a paga...	09/07/2022
Outros Valores a pagar	-87,08	-0,34	Valores a paga...	09/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS
Administrador

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Gestão

WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA

Taxa de Administração

1,50%

Taxa de Performance

Não possui

Disponibilidade de Resgate

D+5

Quantidade de Cotistas

107.231

Patrimônio Líquido Fundo

1.869.646.059,30

PERFIL DO FUNDO
Enquadramento Resolução

Artigo 9º, Inciso III

Indicador de Desempenho (CVM)

Não definido

Classificação ANBIMA

Ações Livre

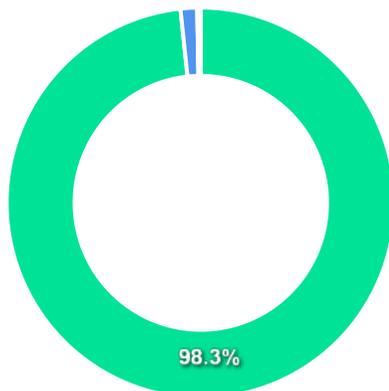
Política de Investimento

Aplica seus recursos, por meio de gestão ativa, principalmente, em Brazilian Depositary Receipts, classificados como Nível I, que apresentem, na visão do administrador, grande potencial de apreciação e perspectiva de crescimento no longo prazo.

COMPARATIVO
 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	-37,02%	-16,57%	-37,02%	-24,11%	-4,05%	14,15%	29,80%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Brazilian Depository Receipts	1.838.214,83	98.32%
● Fundos de Investimento	25.839,05	1.38%
● Operação compromissada	3.558,03	0.19%
● Títulos Federais	1.988,44	0.11%
● Valores a pagar/receber	45,70	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
AMAZON DRN - AMZO34	149.532,53	8,00	Brazilian Depo...	09/07/2022
MICROSOFT DRN - MSFT34	141.955,51	7,59	Brazilian Depo...	09/07/2022
UNITEDHEALTH DRN - UNHH34	104.978,97	5,61	Brazilian Depo...	09/07/2022
VISA INC DRN - VISA34	103.820,85	5,55	Brazilian Depo...	09/07/2022
APPLE DRN - AAPL34	82.911,11	4,43	Brazilian Depo...	09/07/2022
META PLATFORMS, INC - M1TA34	74.397,31	3,98	Brazilian Depo...	09/07/2022
THERMFISCHER DRN - TMOS34	64.912,98	3,47	Brazilian Depo...	09/07/2022
SALESFORCE, INC - SSFO34	63.463,58	3,39	Brazilian Depo...	09/07/2022
NVIDIA COR - NVDC34	58.870,05	3,15	Brazilian Depo...	09/07/2022
UPS DRN - UPSS34	56.201,06	3,01	Brazilian Depo...	09/07/2022
ZOETIS INC DRN - Z1TS34	55.040,26	2,94	Brazilian Depo...	09/07/2022
MONSTER BEVEDRN - M1NS34	52.215,10	2,79	Brazilian Depo...	09/07/2022
PALO ALTO NETWORKS INC - P2AN34	51.617,43	2,76	Brazilian Depo...	09/07/2022
WW GRAINGER DRN - G1WW34	45.916,92	2,46	Brazilian Depo...	09/07/2022
ADOBE INC DRN - ADBE34	44.034,14	2,36	Brazilian Depo...	09/07/2022
EATON CORP PLC - E1TN34	42.987,32	2,30	Brazilian Depo...	09/07/2022
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORPORATION - RYTT34	42.346,22	2,26	Brazilian Depo...	09/07/2022
S&P GLOBAL INC - SPGI34	41.553,33	2,22	Brazilian Depo...	09/07/2022
NIKE INC - NIKE34	36.900,80	1,97	Brazilian Depo...	09/07/2022
TRACTOR SUPPDRN - T1SC34	35.038,78	1,87	Brazilian Depo...	09/07/2022
EQUINIX INC DRN - EQIX34	34.195,19	1,83	Brazilian Depo...	09/07/2022
PAYPAL HOLD DRN - PYPL34	30.355,15	1,62	Brazilian Depo...	09/07/2022
ALCON IN - A2LC34	30.227,52	1,62	Brazilian Depo...	09/07/2022
ATLASSIAN CODRN - T1AM34	28.380,71	1,52	Brazilian Depo...	09/07/2022
INTUITIVE SUDRN - I1SR34	27.816,23	1,49	Brazilian Depo...	09/07/2022
WALT DISNEY DRN - DISB34	27.541,33	1,47	Brazilian Depo...	09/07/2022
ASML HOLDING N - ASML34	27.151,07	1,45	Brazilian Depo...	09/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
 0,85%

Taxa de Performance
 20,00%

Disponibilidade de Resgate
 D+5 du

Quantidade de Cotistas
 100

Patrimônio Líquido Fundo
 118.016.991,27

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
 Artigo 10º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
 CDI

Classificação ANBIMA
 Multimercados Livre

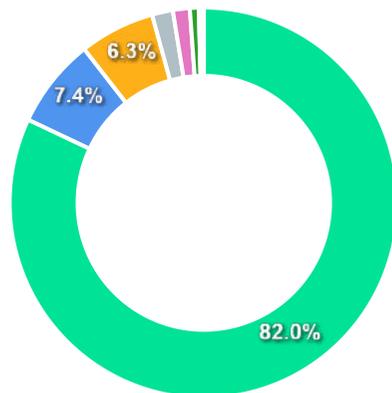
Política de Investimento
 Aplica seus recursos em ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro e de capitais, sem o compromisso de concentração em fator de risco específico.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,03%	5,10%	1,73%	5,10%	5,87%	9,14%	0,71%	1,50%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,01%	5,40%	2,91%	5,40%	8,66%	11,12%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	97.729,69	82.01%
Operação compromissada	8.858,47	7.43%
Fundos de Investimento	7.465,92	6.26%
Investimento no Exterior	2.070,64	1.74%
Debêntures	1.673,14	1.40%
Títulos Privados	882,83	0.74%
Ações	360,58	0.30%
Outros	128,35	0.11%
Valores a pagar/receber	4,33	0.00%
Derivativos	-2,87	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
LFT - Venc.: 01/03/2027	52.532,82	44,08	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	12.618,57	10,59	Títulos Federa...	04/10/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2027	8.858,47	7,43	Operação compr...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/09/2025	8.541,00	7,17	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	6.256,54	5,25	Títulos Federa...	04/10/2022
Cotas de BB TOP MASTER FI MULTIMERCADO LP	4.894,68	4,11	Fundos de Inve...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	4.453,41	3,74	Títulos Federa...	04/10/2022
LFT - Venc.: 01/09/2027	3.821,67	3,21	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	3.228,00	2,71	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	3.006,73	2,52	Títulos Federa...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	2.642,64	2,22	Títulos Federa...	04/10/2022
Cotas de BB TOP DELTA FI MULTIMERCADO	2.494,13	2,09	Fundos de Inve...	04/10/2022
Outros Valores a receber	2.424,72	2,03	Valores a paga...	04/10/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	882,83	0,74	Títulos Privad...	04/10/2022
Investimento no Exterior - LQD US EQUITY	698,13	0,59	Investimento n...	04/10/2022
Investimento no Exterior - BNO US EQUITY	676,50	0,57	Investimento n...	04/10/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	628,32	0,53	Títulos Federa...	04/10/2022
Debênture simples - SBSPG0	605,33	0,51	Debêntures	04/10/2022
Debênture simples - SAPRB1	598,03	0,50	Debêntures	04/10/2022
Debênture não informado - XPVS14	469,78	0,39	Debêntures	04/10/2022
PETROBRAS PN - PETR4	360,58	0,30	Ações	04/10/2022
Outras Disponibilidades	356,81	0,30	Valores a paga...	04/10/2022
Investimento no Exterior - IHE US	355,69	0,30	Investimento n...	04/10/2022
Investimento no Exterior - COTA SOXX US	340,33	0,29	Investimento n...	04/10/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / IND FUTURO B...	119,90	0,10	Outros	04/10/2022
Opções - Posições titulares - OPÇÃO	108,18	0,09	Derivativos	04/10/2022
Cotas de BB FUNDO DE FUNDOS FII - BBFO11	77,11	0,06	Fundos de Inve...	04/10/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S.A. DTVM

Gestão
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+2 du

Quantidade de Cotistas
3.407

Patrimônio Líquido Fundo
393.628.937,87

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 10º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

Classificação ANBIMA
Multimercados Livre

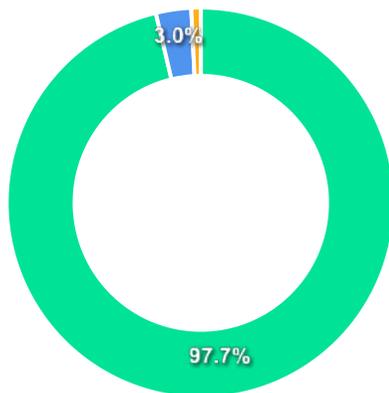
Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, no mercado de derivativos.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-7,82%	-17,49%	-15,04%	-17,49%	-5,39%	33,16%	13,82%	29,10%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	382.322,09	97.74%
Operação compromissada	11.666,18	2.98%
Fundos de Investimento	3.140,65	0.80%
Valores a pagar/receber	-399,71	-0.10%
Outros	-5.582,96	-1.43%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
LFT - Venc.: 01/09/2024	154.126,76	39,40	Títulos Federa...	07/10/2022
LFT - Venc.: 01/03/2025	74.170,87	18,96	Títulos Federa...	07/10/2022
LFT - Venc.: 01/03/2023	48.631,12	12,43	Títulos Federa...	07/10/2022
LFT - Venc.: 01/03/2024	31.980,69	8,18	Títulos Federa...	07/10/2022
LFT - Venc.: 01/09/2026	21.806,19	5,57	Títulos Federa...	07/10/2022
LFT - Venc.: 01/03/2027	20.478,69	5,24	Títulos Federa...	07/10/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	13.453,33	3,44	Títulos Federa...	07/10/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/09/2028	11.666,18	2,98	Operação compr...	07/10/2022
LFT - Venc.: 01/03/2026	11.427,31	2,92	Títulos Federa...	07/10/2022
LFT - Venc.: 01/09/2025	6.247,13	1,60	Títulos Federa...	07/10/2022
Cotas de BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RENDA FIXA R...	3.140,65	0,80	Fundos de Inve...	07/10/2022
Outros Valores a receber	25,22	0,01	Valores a paga...	07/10/2022
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a paga...	07/10/2022
Outros Valores a pagar	-424,93	-0,11	Valores a paga...	07/10/2022
Mercado Futuro - Posições compradas / ISPFZ22	-5.582,96	-1,43	Outros	07/10/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO DAYCOVAL S.A.

Gestão
MULTINVEST CAPITAL ADMINISTRADORA DE RECURSOS
LTDA

Taxa de Administração
1,50%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+11

Quantidade de Cotistas
73

Patrimônio Líquido Fundo
25.347.727,75

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 10º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

Classificação ANBIMA
Multimercados Livre

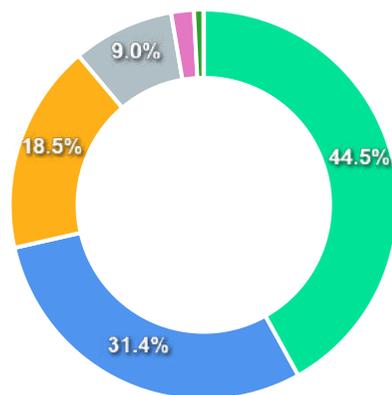
Política de Investimento
Aplica seus recursos em diversas classes de ativos financeiros,
negociados nos mercados interno, sem o compromisso de
concentração em nenhuma classe específica.

COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,36%	1,88%	1,01%	1,88%	-3,24%	0,23%	0,69%	1,45%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	11.291,31	44.55%
Títulos Privados	7.956,61	31.39%
Operação compromissada	4.680,15	18.46%
Fundos de Investimento	2.276,75	8.98%
Debêntures	509,06	2.01%
Ações	209,62	0.83%
Derivativos	9,96	0.04%
Valores a pagar/receber	-290,68	-1.15%
Outros	-1.294,88	-5.11%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2026	4.680,15	18,46	Operação compr...	06/07/2022
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	3.417,60	13,48	Títulos Federa...	06/07/2022
LFT - Venc.: 01/09/2023	3.324,90	13,12	Títulos Federa...	06/07/2022
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	3.142,36	12,40	Títulos Federa...	06/07/2022
Cotas de MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	2.276,75	8,98	Fundos de Inve...	06/07/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	2.041,81	8,06	Títulos Privad...	06/07/2022
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948...	1.709,32	6,74	Títulos Privad...	06/07/2022
Letra Financeira - BANCO BONSUCESSO (71.027.866/00...	1.466,91	5,79	Títulos Privad...	06/07/2022
LFT - Venc: 01/03/2024	1.064,42	4,20	Títulos Federa...	06/07/2022
Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889...	562,93	2,22	Títulos Privad...	06/07/2022
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/00...	552,98	2,18	Títulos Privad...	06/07/2022
Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889...	546,54	2,16	Títulos Privad...	06/07/2022
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/00...	541,04	2,13	Títulos Privad...	06/07/2022
Debênture Simples - LCAMB2	509,06	2,01	Debêntures	06/07/2022
LFT - Venc: 01/09/2025	342,03	1,35	Títulos Federa...	06/07/2022
Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.6...	318,21	1,26	Títulos Privad...	06/07/2022
TRAN PAULIST PN N1 - TRPL4	252,67	1,00	Ações	06/07/2022
ANIMA ON NM - ANIM3	235,17	0,93	Ações	06/07/2022
Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889...	216,85	0,86	Títulos Privad...	06/07/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas - WSP S&P 500 ...	9,96	0,04	Derivativos	06/07/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas / IBOVESVA FRA ...	9,62	0,04	Outros	06/07/2022
Valores a receber / DIV/JRS TPI Telefônica Brasil	8,25	0,03	Valores a paga...	06/07/2022
Outros Valores a receber	4,44	0,02	Valores a paga...	06/07/2022
GRUPO SOMA ON NM - SOMA3	1,84	0,01	Ações	06/07/2022
Outras Disponibilidades	1,00	0,00	Valores a paga...	06/07/2022
Outros Valores a receber	0,42	0,00	Valores a paga...	06/07/2022
Outros Valores a receber	0,34	0,00	Valores a paga...	06/07/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BEM DTVM
Gestão	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA
Taxa de Administração	1,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+3 du
Quantidade de Cotistas	22
Patrimônio Líquido Fundo	120.868.950,78

PERFIL DO FUNDO

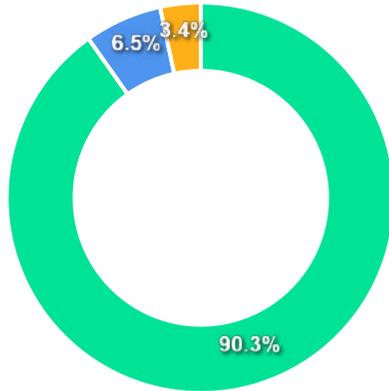
Enquadramento Resolução	Artigo 10º, Inciso I
Indicador de Desempenho (CVM)	Ibovespa
Classificação ANBIMA	Multimercados Livre
Política de Investimento	Aplica seus recursos em diversas classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, renda variável, cambial e derivativos, negociados nos mercados interno, sem o compromisso de concentração em nenhuma classe específica.

COMPARATIVO 📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,97%	-%	-4,75%	-%	-%	-%	2,56%	5,40%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
LTN - Venc: 01/01/2024	76.174,87	63,02	Títulos Federa...	06/07/2022
LTN - Venc: 01/04/2024	33.002,67	27,30	Títulos Federa...	06/07/2022
Opções - Posições titulares / 61359	7.810,60	6,46	Outros	06/07/2022
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2027	4.082,98	3,38	Operação compr...	06/07/2022
Outros Valores a receber	15,63	0,01	Valores a paga...	06/07/2022
Outras Disponibilidades	2,00	0,00	Valores a paga...	06/07/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTJ24	-91,41	-0,08	Derivativos	06/07/2022
Outros Valores a pagar	-128,39	-0,11	Valores a paga...	06/07/2022

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	109.177,54	90.33%
Outros	7.810,60	6.46%
Operação compromissada	4.082,98	3.38%
Derivativos	-91,41	-0.08%
Valores a pagar/receber	-110,76	-0.09%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BEM DTVM

Gestão
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA

Taxa de Administração
1,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+3 du

Quantidade de Cotistas
20

Patrimônio Líquido Fundo
160.450.442,76

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 10º, Inciso I

Indicador de Desempenho (CVM)
Ibovespa

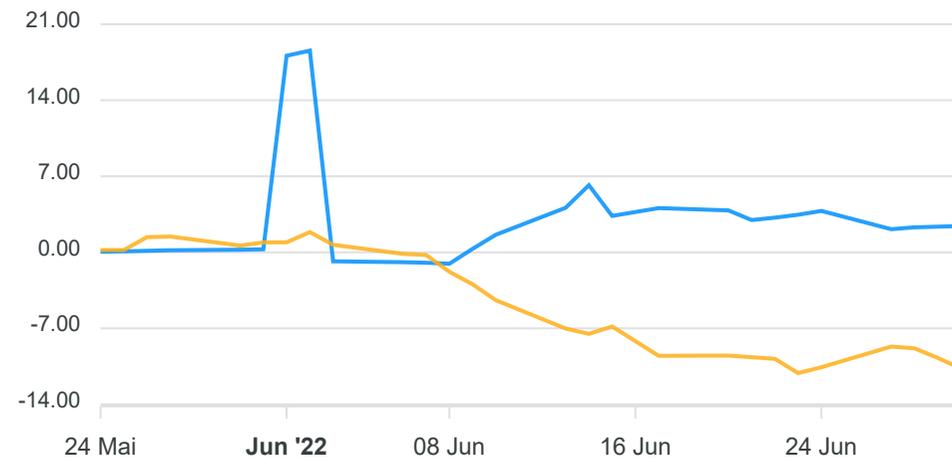
Classificação ANBIMA
Não classificado

Política de Investimento
Aplica seus recursos em diversas classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, renda variável, cambial e derivativos, negociados nos mercados internos, sem o compromisso de concentração em nenhuma classe específica.

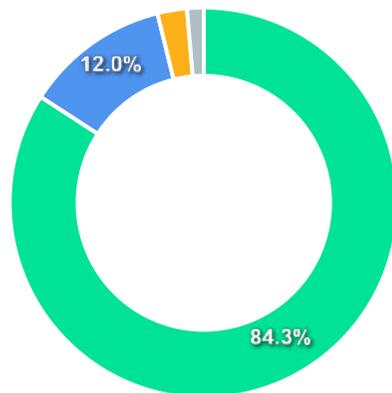
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	2,13%	-%	-%	-%	-%	-%	41,53%	87,46%
Indicador de Desempenho (CVM)	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
LTN - Venc.: 01/07/2024	105.190,20	67,44	Títulos Federa...	08/08/2022
LTN - Venc: 01/04/2024	26.294,89	16,86	Títulos Federa...	08/08/2022
Opções - Posições titulares / 72015	18.790,16	12,05	Outros	08/08/2022
Outras Disponibilidades	4.002,00	2,57	Valores a paga...	08/08/2022
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/202...	2.174,28	1,39	Operação compr...	08/08/2022
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a paga...	08/08/2022
Outros Valores a pagar	-169,07	-0,11	Valores a paga...	08/08/2022
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTN24	-310,36	-0,20	Derivativos	08/08/2022

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
● Títulos Federais	131.485,09	84.30%
● Outros	18.790,16	12.05%
● Valores a pagar/receber	3.832,93	2.46%
● Operação compromissada	2.174,28	1.39%
● Derivativos	-310,36	-0.20%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S.A. DTVM

Gestão
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração
0,00%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
Não se aplica

Quantidade de Cotistas
99

Patrimônio Líquido Fundo
2.138.523.311,79

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 10º, Inciso II

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

Classificação ANBIMA
Fundos de Participações

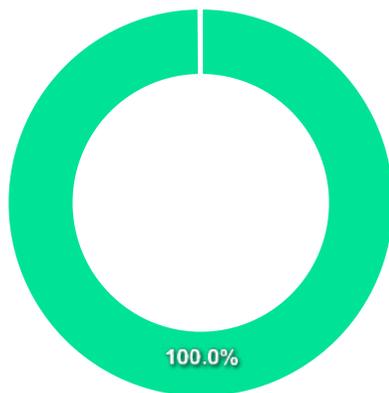
Política de Investimento
Aplica, no mínimo, 90% de seus recursos em valores mobiliários de emissão das companhias alvo.

COMPARATIVO
 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,67%	87,66%	-1,00%	87,66%	77,93%	-%	-%	-%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		

CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Cotas de fundos de renda variável / BTG PACTUAL EC...	2.124.673,50	100,00	Outros	16/08/2022
Cotas de fundos de investimento - Instrução Nº 409...	2.410,42	0,11	Fundos de Inve...	16/08/2022
Outros Valores a pagar	-2.507,75	-0,12	Valores a paga...	16/08/2022



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Outros	2.124.673,50	100.00%
● Fundos de Investimento	2.410,42	0.11%
● Valores a pagar/receber	-2.507,75	-0.12%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BANCO DAYCOVAL S.A.

Gestão
LEGATUS GESTORA DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração
0,23%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
Não se aplica

Quantidade de Cotistas
25

Patrimônio Líquido Fundo
116.607.223,08

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 10º, Inciso II

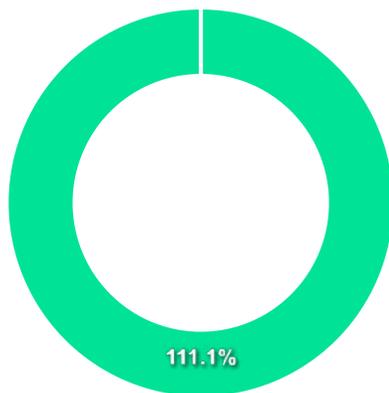
Indicador de Desempenho (CVM)
IPCA + 8,00% ao ano

Classificação ANBIMA
Fundos de Participações

Política de Investimento
Investe no setor imobiliário comercial em atividades de desenvolvimento, administração, exploração de shopping centers, bem como à aquisição ou locação de terrenos para a construção de shopping centers e negociação de suas unidades e lojas.

COMPARATIVO
 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,26%	1,89%	-0,49%	1,89%	-71,21%	-71,72%	-%	-%
Indicador de Desempenho (CVM)	1,32%	9,56%	4,20%	9,63%	20,84%	41,40%		
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		

CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Ações	78.067,01	111.06%
● Valores a pagar/receber	-1.532,24	-2.18%
● Outros	-6.243,02	-8.88%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Ação de Companhia Fechada - USINA INVEST MALLS S.A...	78.067,01	111,06	Ações	22/03/2022
Outras Disponibilidades	0,70	0,00	Valores a paga...	22/03/2022
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-15,03	-0,02	Valores a paga...	22/03/2022
Valores a pagar / LAUDO AVALIA / CNPJ do emissor: ...	-18,00	-0,03	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / Laudo / CNPJ do emissor: 62.232...	-74,10	-0,11	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST0919DAY TXGESTAO / CNPJ do ...	-77,86	-0,11	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST0419PLA TXGESTAO / CNPJ do ...	-105,17	-0,15	Outros	22/03/2022
Outros Valores a pagar	-127,26	-0,18	Valores a paga...	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST0919PLA TXGESTAO / CNPJ do ...	-201,33	-0,29	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST0619PLA TXGESTAO / CNPJ do ...	-225,37	-0,32	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST0519PLA TXGESTAO / CNPJ do ...	-261,30	-0,37	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST FEV/20 FEV2020 / CNPJ do e...	-265,32	-0,38	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST DEZ/19 TXGESTAO / CNPJ do ...	-271,35	-0,39	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST JAN/21 TXGESTAO / CNPJ do ...	-278,12	-0,40	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST0719PLA TXGESTAO / CNPJ do ...	-278,89	-0,40	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST0520 TXGESTAO / CNPJ do emi...	-293,58	-0,42	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST0920 TXGESTAO / CNPJ do emi...	-293,85	-0,42	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST ABR/20 TXGESTAO / CNPJ do ...	-293,95	-0,42	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST0820 TXGESTAO / CNPJ do emi...	-294,29	-0,42	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST0819PLA TXGESTAO / CNPJ do ...	-295,68	-0,42	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST0620 TXGESTAO / CNPJ do emi...	-307,84	-0,44	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST0720 TXGESTAO / CNPJ do emi...	-322,80	-0,46	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST MAR/20 FEV2020 / CNPJ do e...	-323,80	-0,46	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST JAN/20 TXGESTAO / CNPJ do ...	-324,72	-0,46	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / Taxa de Administração	-395,19	-0,56	Valores a paga...	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST1019DAY TXGESTAO / CNPJ do ...	-556,80	-0,79	Outros	22/03/2022
Valores a pagar / TXGST1020 TXGESTAO / CNPJ do emi...	-878,92	-1,25	Outros	22/03/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA

Taxa de Administração
0,30%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
Não se aplica

Quantidade de Cotistas
Não informado

Patrimônio Líquido Fundo
Não informado

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 11º

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

Classificação ANBIMA
FII TVM Gestão Ativa

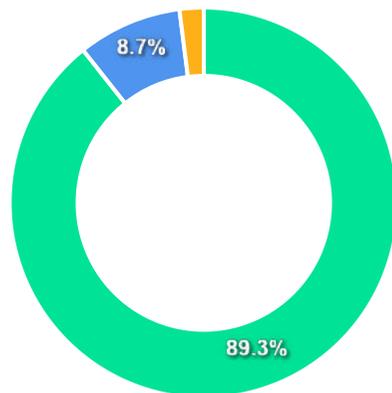
Política de Investimento
Investir em CRI, devendo obedecer a critérios de elegibilidade e de concentração por emissor e por modalidade de ativos. Pode aplicar ainda em LH, LCI, cotas de FII e cotas de fundos de renda fixa e títulos de renda fixa.

COMPARATIVO

30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-%	-%	-%	-%	-%	-%	-%	-%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Títulos Privados	45.706,91	89.31%
● Fundos de Investimento	4.441,50	8.68%
● Valores a pagar/receber	1.029,61	2.01%
● Outros	0,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Certificado de Recebível Imobiliário - TRUE SECURI...	11.619,80	22,68	Títulos Privad...	01/06/2022
Cotas de MILLENIUM FII	4.441,50	8,67	Fundos de Inve...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - BARIGUI SEC...	3.764,65	7,35	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - VIRGO COMPA...	3.358,80	6,56	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - VIRGO COMPA...	3.302,73	6,45	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - VERT SECURI...	3.228,59	6,30	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - CIBRASEC SE...	2.671,41	5,22	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - TRUE SECURI...	1.955,46	3,82	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - TRUE SECURI...	1.947,81	3,80	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - VIRGO COMPA...	1.720,16	3,36	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - PLANETA SEC...	1.490,67	2,91	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - VIRGO COMPA...	1.311,70	2,56	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - PLANETA SEC...	1.254,01	2,45	Títulos Privad...	01/06/2022
Disponibilidades - Títulos Públicos	1.169,40	2,28	Valores a paga...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - TRUE SECURI...	1.051,84	2,05	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - VIRGO COMPA...	1.006,68	1,97	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - TRUE SECURI...	997,99	1,95	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - VIRGO COMPA...	960,87	1,88	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - PLANETA SEC...	943,88	1,84	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - PLANETA SEC...	921,88	1,80	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - BANCO OURIN...	841,89	1,64	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - VIRGO COMPA...	745,39	1,46	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - BARIGUI SEC...	435,03	0,85	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - BARIGUI SEC...	175,68	0,34	Títulos Privad...	01/06/2022
Outras Disponibilidades	6,44	0,01	Valores a paga...	01/06/2022
Disponibilidades / Fundos de Renda Fixa	0,00	0,00	Outros	01/06/2022
Outros Valores a pagar	-1,46	0,00	Valores a paga...	01/06/2022

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
PLANNER CORRETORA DE VALORES S/A

Gestão
ZION GESTAO DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração
1,60%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
Não se aplica

Quantidade de Cotistas
9.439

Patrimônio Líquido Fundo
148.802.863,04

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 11º

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

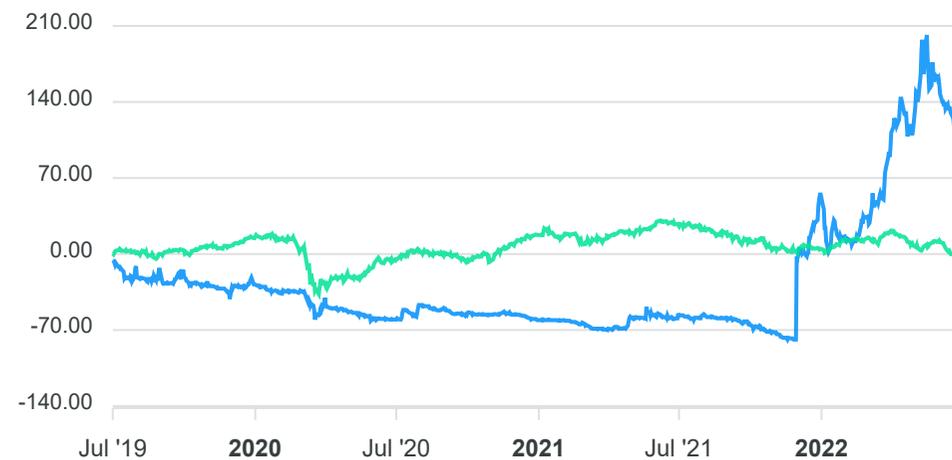
Classificação ANBIMA
FII Renda Gestão Ativa

Política de Investimento
Investir em imóveis e direitos reais sobre imóveis, construídos ou em fase de construção. Pode investir em ações ou cotas de sociedades cujas atividades sejam permitidas a FII, cotas de FII, FIP, FIDC, além de CRI, LH, LCI e outros ativos de renda fixa.

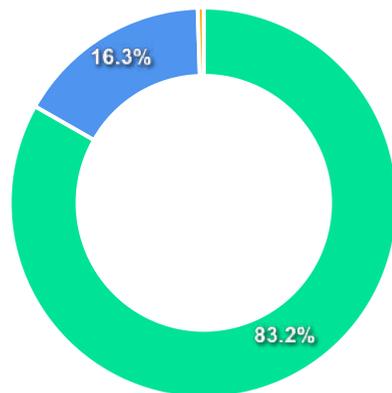
COMPARATIVO

📅 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-10,92%	50,18%	7,22%	50,18%	2,72%	17,18%	15,00%	31,60%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Ações de Sociedades - CORTEL-CORTEL HOLDING S/A-ON...	149.718,33	51,02	Ações	01/06/2022
Ações de Sociedades - TERRA SANTA ADMINISTRADORA -...	80.175,52	27,32	Ações	01/06/2022
Outras Aplicações / CEMITÉRIO MORUMBY	28.604,10	9,75	Outros	01/06/2022
Outras Aplicações / CEMITÉRIO MORUMBY	14.616,50	4,98	Outros	01/06/2022
Outras Aplicações / CEMITÉRIO MORUMBY	1.690,00	0,58	Outros	01/06/2022
Disponibilidades - Títulos Públicos	1.403,91	0,48	Valores a paga...	01/06/2022
Outras Disponibilidades	0,06	0,00	Valores a paga...	01/06/2022
Disponibilidades / Fundos de Renda Fixa	0,00	0,00	Outros	01/06/2022
Imóveis para Renda (acabado) RUA VOLUNTÁRIOS DE S...	0,00	0,00	Imóveis	01/06/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
● Ações	229.893,85	83.23%
● Outros	44.910,60	16.26%
● Valores a pagar/receber	1.403,97	0.51%
● Imóveis	0,00	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
PLANNER CORRETORA DE VALORES S/A

Gestão
QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA

Taxa de Administração
0,14%

Taxa de Performance
20,00%

Disponibilidade de Resgate
S/Info

Quantidade de Cotistas
Não informado

Patrimônio Líquido Fundo
Não informado

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 11º

Indicador de Desempenho (CVM)
Não definido

Classificação ANBIMA
FII Renda Gestão Ativa

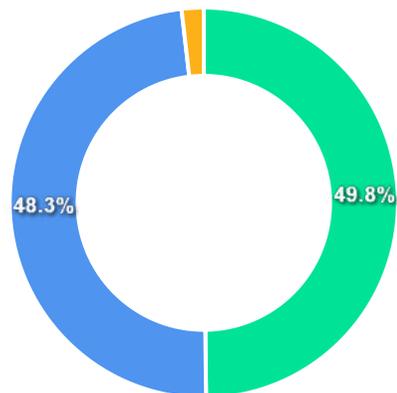
Política de Investimento
Investir em imóveis, observando máximo de 20% do patrimônio em um mesmo imóvel, até 50% em uma mesma macrorregião geográfica, até 35% em uma mesma microrregião geográfica e, havendo 2 imóveis em um mesmo condomínio, até 25% da área locável do condomínio.

COMPARATIVO

 30/06/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-%	-%	-%	-%	-%	-%	-%	-%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-17,88%	-5,99%	-22,29%	3,67%		

CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Disponibilidades - Títulos Privados	28.359,45	101,17	Valores a paga...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - HABITASEC S...	8.740,52	31,18	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - HABITASEC S...	6.356,53	22,68	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - HABITASEC S...	6.259,24	22,33	Títulos Privad...	01/06/2022
Certificado de Recebível Imobiliário - HABITASEC S...	6.169,22	22,01	Títulos Privad...	01/06/2022
LTN	1.044,63	3,73	Títulos Federa...	01/06/2022
Outras Disponibilidades	1,00	0,00	Valores a paga...	01/06/2022

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Valores a pagar/receber	28.360,45	49.82%
Títulos Privados	27.525,51	48.35%
Títulos Federais	1.044,63	1.83%