

2022

Relatório Mensal

Julho

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MPS nº 519 de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V, e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.2, item 3.2.6, aprovado pela Portaria SPREV nº 3030, de 15 de Março de 2021.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
TÍTULOS PÚBLICOS	153.612.270,80	14,98%	0,00		7º I a
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	78.261.208,43	7,63%	6.564.821.510,69	1,19%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.568.443,57	1,13%	5.189.858.068,29	0,22%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.850.043,41	1,64%	4.977.668.769,91	0,34%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.159.617,12	1,77%	551.299.917,80	3,29%	7º I b
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.106.385,98	1,28%	101.482.377,73	12,91%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.123.251,30	1,28%	235.383.228,82	5,58%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.480.734,59	0,44%	6.217.671.822,00	0,07%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	45.852.554,62	4,47%	10.530.457.571,28	0,44%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.535.319,87	3,56%	10.426.166.067,57	0,35%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.322.259,75	1,98%	5.065.234.429,28	0,40%	7º I b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.140.517,55	0,11%	3.323.314.760,57	0,03%	7º III a
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	23.724.404,37	2,31%	808.122.410,04	2,94%	7º III a
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	32.967.175,32	3,22%	1.265.147.070,67	2,61%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	38.817.782,35	3,79%	12.954.528.143,84	0,30%	7º III a
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	5.354.883,71	0,52%	410.715.265,69	1,30%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.061.252,67	1,47%	2.528.329.321,30	0,60%	7º III a
MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA	21.173.730,01	2,07%	593.255.999,38	3,57%	7º III a
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	46.080.993,57	4,49%	693.203.660,92	6,65%	7º III a
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	22.874.855,16	2,23%	705.460.548,71	3,24%	7º III a
MASTER III FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	6.745,25	0,00%	224.046,61	3,01%	7º V a
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	8.266.855,06	0,81%	203.750.137,44	4,06%	7º V b
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	907.926,90	0,09%	26.992.455,44	3,36%	7º V b
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	19.051.006,57	1,86%	320.716.722,34	5,94%	8º I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	13.932.644,35	1,36%	313.170.867,31	4,45%	8º I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9.064.207,34	0,88%	1.538.685.373,47	0,59%	8º I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.764.593,88	1,05%	474.998.563,52	2,27%	8º I

Investimentos

\$ 1.025.259.574,07

Disponibilidades Financeiras

\$ 28.162,02

Total Carteira

\$ 1.025.287.736,09

Governança (Pró Gestão)

📄 NIVEL 2 27/08/2024

[Handwritten signatures and initials]

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	13.111.674,47	1,28%	414.827.443,90	3,16%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.382.028,20	0,52%	1.409.026.324,92	0,38%	8º I
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6.379.859,17	0,62%	49.583.501,56	12,87%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	45.908.036,20	4,48%	1.188.455.182,40	3,86%	8º I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.991.939,15	0,88%	913.956.760,51	0,98%	8º I
META VALOR FI AÇÕES	16.572.160,37	1,62%	241.040.559,68	6,88%	8º I
MULTINVEST FI AÇÕES	5.386.924,59	0,53%	73.733.715,03	7,31%	8º I
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	899.549,01	0,09%	9.851.665,24	9,13%	8º I
OCCAM FIC AÇÕES	17.221.100,15	1,68%	996.020.408,79	1,73%	8º I
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	15.922.837,50	1,55%	89.003.120,73	17,89% ▲	8º I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	49.019.144,39	4,78%	321.106.658,19	15,27% ▲	8º I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	6.655.248,53	0,65%	190.508.393,18	3,49%	8º I
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.774.702,53	0,17%	337.999.855,77	0,53%	8º I
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD ...	9.911.469,98	0,97%	14.900.000.000,00	0,07%	9º II
CLOU GLOBAL X MIRAE ASSET CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXT...	8.990.844,04	0,88%	6.800.000.000,00	0,13%	9º II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	6.736.849,94	0,66%	201.690.946,23	3,34%	9º II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	11.905.217,72	1,16%	286.089.629,20	4,16%	9º II
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	21.424.263,77	2,09%	822.210.804,20	2,61%	9º III
BRADERCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.234.655,91	0,12%	133.628.236,75	0,92%	9º III
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.184.043,84	0,41%	27.967.974,31	14,96%	9º III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.299.384,76	0,52%	1.967.815.796,47	0,27%	9º III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.200.047,22	0,21%	119.066.875,94	1,85%	10º I
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13.835.406,01	1,35%	430.901.170,93	3,21%	10º I
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	1.697.766,07	0,17%	13.546.030,66	12,53%	10º I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	9.730.632,00	0,95%	122.731.667,21	7,93%	10º I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	14.898.955,88	1,45%	155.972.117,32	9,55%	10º I
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL MULTISTRATÉGIA FIP	17.769.621,00	1,73%	2.556.476.338,04	0,70%	10º II

Investimentos

\$ 1.025.259.574,07

Disponibilidades Financeiras

\$ 28.162,02

Total Carteira

\$ 1.025.287.736,09

Governança (Pró Gestão)

📄 NIVEL 2 27/08/2024

X

[Handwritten signatures]

[Handwritten signatures]

[Handwritten mark]

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	3.179.524,28	0,31%	129.821.582,85	2,45%	10º II
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.163.703,56	0,21%	0,00		11º
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	5.245.713,63	0,51%	164.183.928,21	3,20%	11º
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	10.564.606,70	1,03%	0,00		11º

Investimentos

\$ 1.025.259.574,07

Disponibilidades Financeiras

\$ 28.162,02

Total Carteira

\$ 1.025.287.736,09

Governança (Pró Gestão)

📅 NIVEL 2 27/08/2024

[Handwritten signatures and initials in blue ink]

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2022	30/06/2016	A mercado	9,800	4,063,816688	39.825.403,54
NTN-B - 15/08/2022	27/07/2016	A mercado	15,000	4,063,816688	60.957.250,32
NTN-B - 15/08/2022	04/08/2016	A mercado	13,000	4,063,816688	52.829.616,94

Investimentos

\$ 1.025.259.574,07

Disponibilidades Financeiras

\$ 28.162,02

Total Carteira

\$ 1.025.287.736,09

Governança (Pró Gestão)

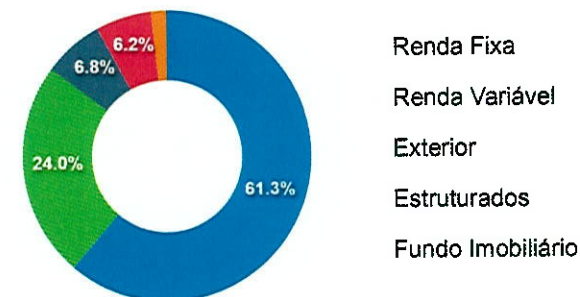
27 NIVEL 2 27/08/2024

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7° I a - Títulos TN SELIC	100,00%	14,98%	153.612.270,80 85,02%
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	25,19%	258.259.818,64 74,81%
7° III a - FI Referenciados RF	70,00%	20,21%	207.195.594,71 49,79%
7° V a - FIDC Cota Sênior	10,00%	0,00%	6.745,25 10,00%
7° V b - Fundos de RF - Crédito Privado	10,00%	0,89%	9.174.781,96 9,11%
8° I - Fundos de Ações	40,00%	24,00%	246.037.656,40 16,00%
9° II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,66%	37.544.381,68 6,34%
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,13%	32.142.348,28 6,87%
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	4,13%	42.362.807,18 5,87%
10° II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	2,04%	20.949.145,28 2,96%
11° - Fundos Imobiliários	10,00%	1,75%	17.974.023,89 8,25%

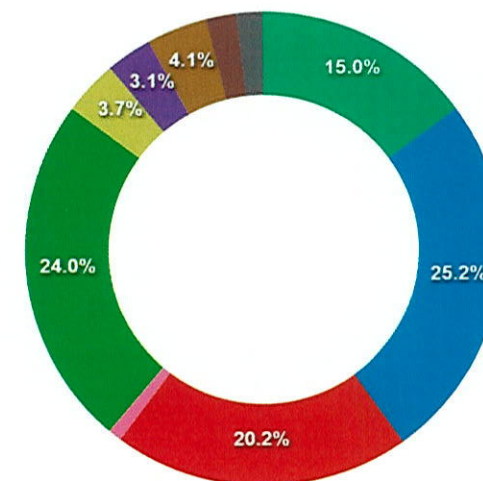
Governança (Pró Gestão)

27/08/2024 NIVEL 2

Segmentos



Artigos

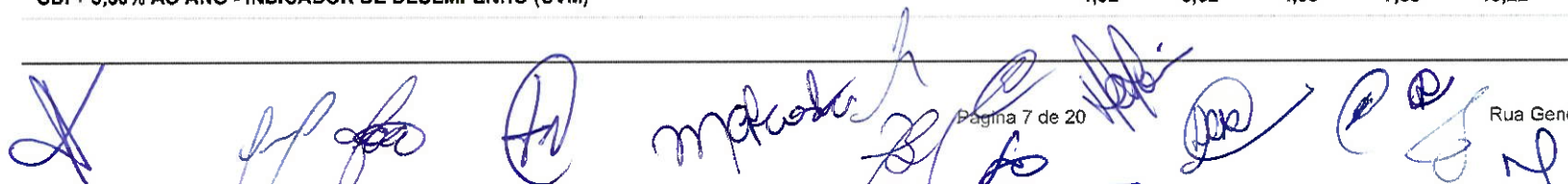


Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom of the page.

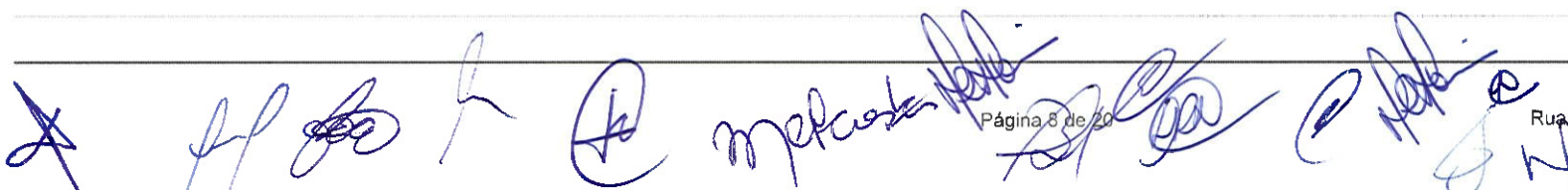
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	14,98%	0,00%	21,16%	61,61%	478.067.503,41
7º I b - FI 100% Títulos TN	25,19%	16,60%	21,16%	61,61%	373.419.955,57
7º III a - FI Referenciados RF	20,21%	2,51%	3,34%	70,00%	510.505.820,55
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	3,34%	20,00%	205.057.547,22
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-6.745,25
7º V b - Fundos de RF - Crêdit...	0,89%	0,00%	3,50%	10,00%	93.353.991,65

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	24,00%	20,63%	23,38%	40,00%	164.077.438,04
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	4,13%	40,00%	410.115.094,44
9º II - Constituídos no Brasil	3,66%	2,63%	3,50%	10,00%	64.984.391,93
9º III - Ações - BDR Nível I	3,13%	2,63%	3,50%	10,00%	70.386.425,33
10º I - Fundos Multimercados	4,13%	4,50%	6,00%	10,00%	60.165.966,43
10º II - Fundos em Participaçõ...	2,04%	0,00%	2,50%	2,50%	4.683.048,12
11º - Fundos Imobiliários	1,75%	0,00%	0,00%	0,00%	-17.974.023,89
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	102.528.773,61

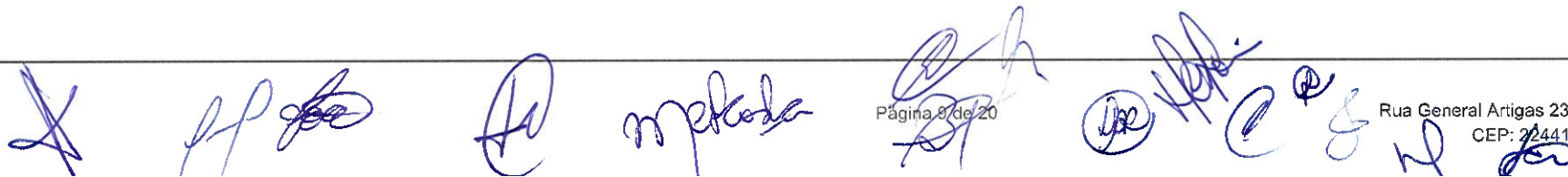
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-15,14	59,25	-15,86	61,61	57,97			
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	10,34	65,70	20,16	120,67	19,22	-3,37	21,73	45,77
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,83	8,10	1,81	7,49	12,03	19,86	0,77	1,63
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50	6,23	3,04	5,00	11,34	21,37	0,25	0,52
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50	6,21	3,02	4,99	11,31	21,28	0,25	0,52
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,12	7,09	3,44	6,26	10,68	16,77	0,05	0,11
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	10,21	-9,07	2,63	-4,08	1,48	38,77	8,98	18,92
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	0,56	2,44	1,04	2,88	-1,41	-0,50	0,62	1,31
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,36	-20,49	4,71	-11,50	-7,30	21,73	10,83	22,80
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	7,67	-21,75	1,61	-11,94	-13,52		11,62	24,46
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	5,13	-0,15	-3,11	-6,46	-15,16	0,40	7,94	16,72
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3,85	1,91	-3,56	-3,21	-16,52	-12,26	7,44	15,66
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,42	-30,46	2,75	-19,28	-21,18	3,29	14,02	29,53
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,78	-7,95	-8,08	-10,24	-23,27	-11,47	5,97	12,57
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	4,33	-8,80	-8,29	-9,85	-25,49	-18,75	9,44	19,87
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	12,36	-55,08	-15,93	-37,50	-56,12		27,24	57,37
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	-0,34	5,70	0,96	6,02			1,82	3,84
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11								
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11								
CDI - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA	1,02	6,57	3,13	5,78	9,94	13,09	0,02	0,05
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,01	6,66	3,18	5,83	9,79	12,43	0,03	0,06
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,65	5,78	1,77	5,02	6,86	9,09	0,84	1,78
CDI + 3,50% AO ANO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)								
	1,32	8,62	4,00	7,55	13,22	20,03		

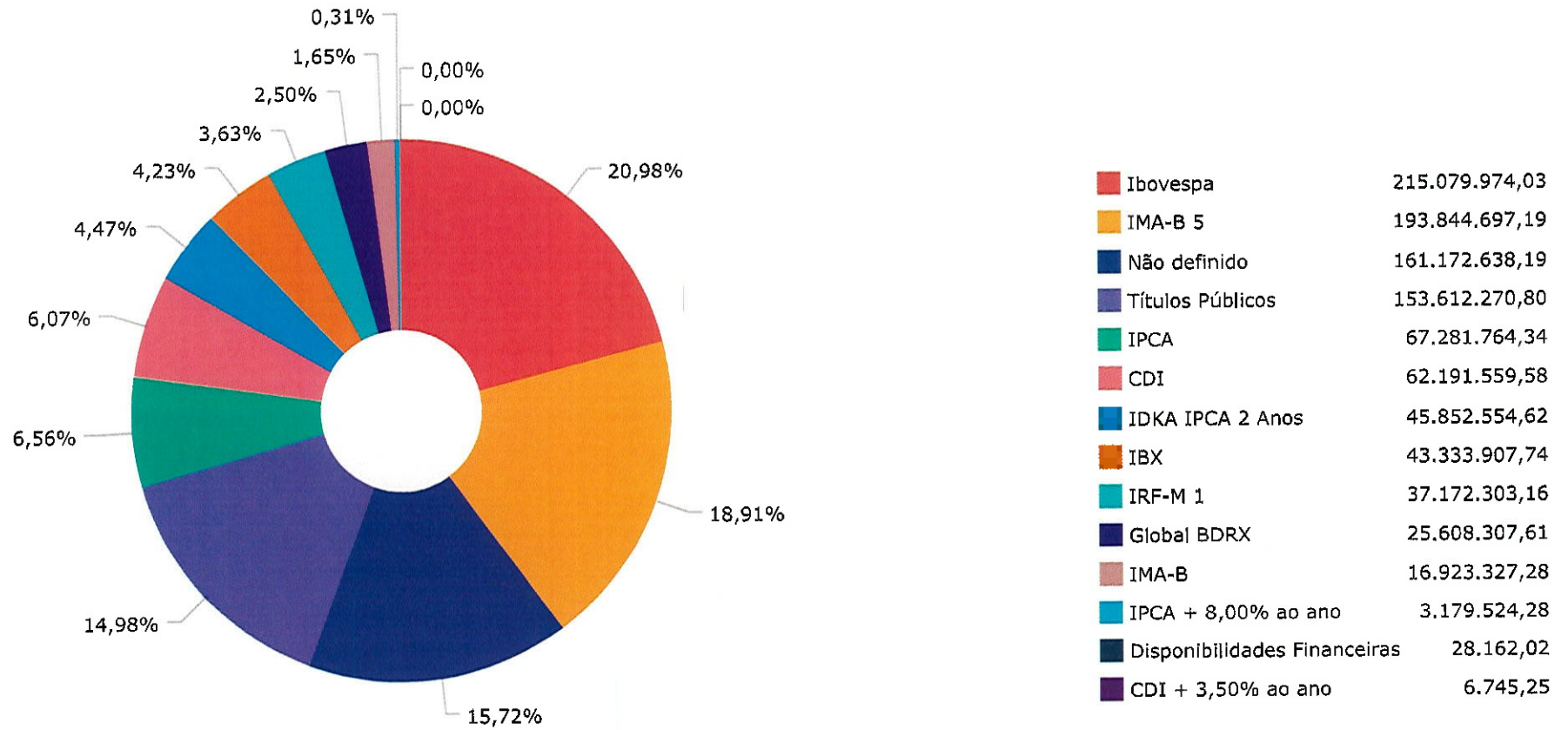


	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3,45	-78,91	-75,55	-79,34	-88,37	-70,89		
GLOBAL BDRX - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	7,65	-22,08	3,82	-13,58	-10,66	19,00		
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	7,74	-21,75	3,70	-12,46	-9,00	16,47	9,83	20,69
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9,33	-24,67	4,69	-15,78	-15,38	10,96	12,54	26,40
IBOVESPA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25		
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4,67	2,12	-4,11	-1,69	-10,02	2,35	6,45	13,59
OCCAM FIC AÇÕES	3,41	-0,75	-2,76	-6,82	-13,67	-1,97	7,13	15,02
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	6,86	-10,99	-1,39	-9,77	-15,05	-6,14	8,01	16,87
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,85	-1,18	-4,55	-7,53	-17,73	-12,32	7,76	16,34
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	4,23	-5,16	-6,69	-11,78	-19,61	-9,35	7,77	16,37
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4,55	-3,18	-5,97	-10,12	-20,97	-13,17	6,81	14,34
MULTINVEST FI AÇÕES	3,12	-7,53	-8,29	-9,32	-25,19	-13,19	7,97	16,80
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	4,41	-8,29	-4,12	-12,50	-28,44	-22,76	7,64	16,09
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVESTIMEN...	10,02	-42,24	-1,03	-26,37	-35,37		15,51	32,66
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,51	-5,83	-3,75	-10,31	-35,56	-30,25	8,55	18,01
CLOU GLOBAL X MIRAE ASSET CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC ...	7,37	-38,02	-3,61	-25,98	-38,69		23,90	50,34
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	-2,79						4,90	10,33
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1,54		-0,19	-2,83			2,08	4,38
IBX - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	4,40	-1,57	-4,69	-7,90	-16,32	1,03		
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2,61	-0,34	-3,54	-6,68	-21,37	-17,91	8,24	17,35
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3,78	-8,64	-8,63	-10,99	-23,76	-12,16	6,00	12,64
META VALOR FI AÇÕES	3,13	-7,78	-10,92	-15,97	-25,15	-23,18	9,08	19,13
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	4,59	-16,84	-14,52	-20,10	-34,18	-7,98	11,11	23,39

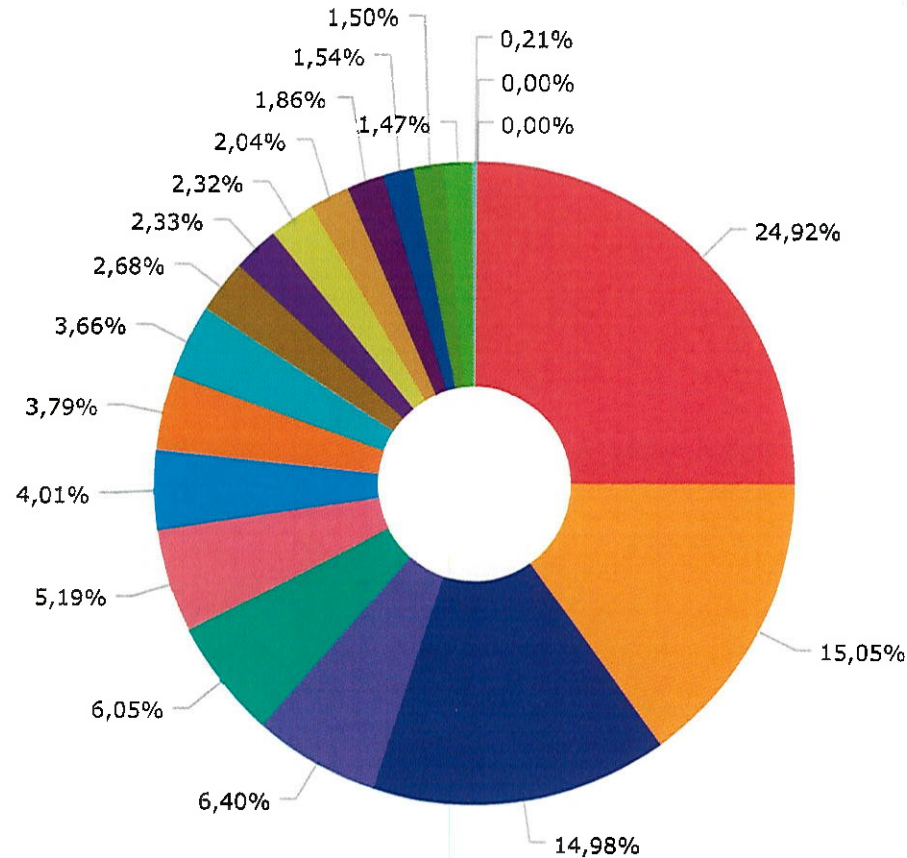


	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IDKA IPCA 2 ANOS - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-0,17	6,66	1,15	6,61	10,11	16,59		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29	6,10	0,78	6,08	9,41	15,38	1,48	3,12
IMA-B - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-0,88	3,43	-0,28	4,20	3,25	5,86		
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,89	3,29	-0,29	4,09	2,96	5,30	2,40	5,05
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,10	3,03	-0,85	4,17	2,64	4,88	2,66	5,60
IMA-B 5 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	0,01	6,62	1,13	6,50	10,04	15,61		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02	6,53	1,12	6,44	9,84	15,08	1,21	2,55
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	6,47	1,09	6,39	9,71	14,96	1,22	2,56
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	-0,01	6,30	1,01	6,22	9,48	14,02	1,25	2,63
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	-0,01	6,49	1,06	6,35	9,38	14,07	1,23	2,59
IPCA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-0,68	4,77	0,46	4,21	10,07	19,97		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,80	6,12	2,60	5,57	9,65	10,96	0,36	0,76
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	-0,55	5,23	0,57	5,41	8,23	13,82	1,91	4,02
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64	4,97	2,04	4,77	6,06	7,29	0,65	1,36
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,79	5,41	2,09	4,71	5,36	6,31	0,99	2,08
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,34	4,43	1,51	4,19	5,32	5,43	1,08	2,28
IPCA + 8,00% AO ANO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	-0,04	9,51	2,41	8,29	18,87	39,93		
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	2,58	4,52	2,25	4,70	-70,42			
IRF-M 1 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)	1,05	6,09	2,96	5,43	8,11	10,26		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03	5,94	2,90	5,30	7,87	9,75	0,25	0,52
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04	5,95	2,91	5,30	7,86	9,57	0,25	0,53

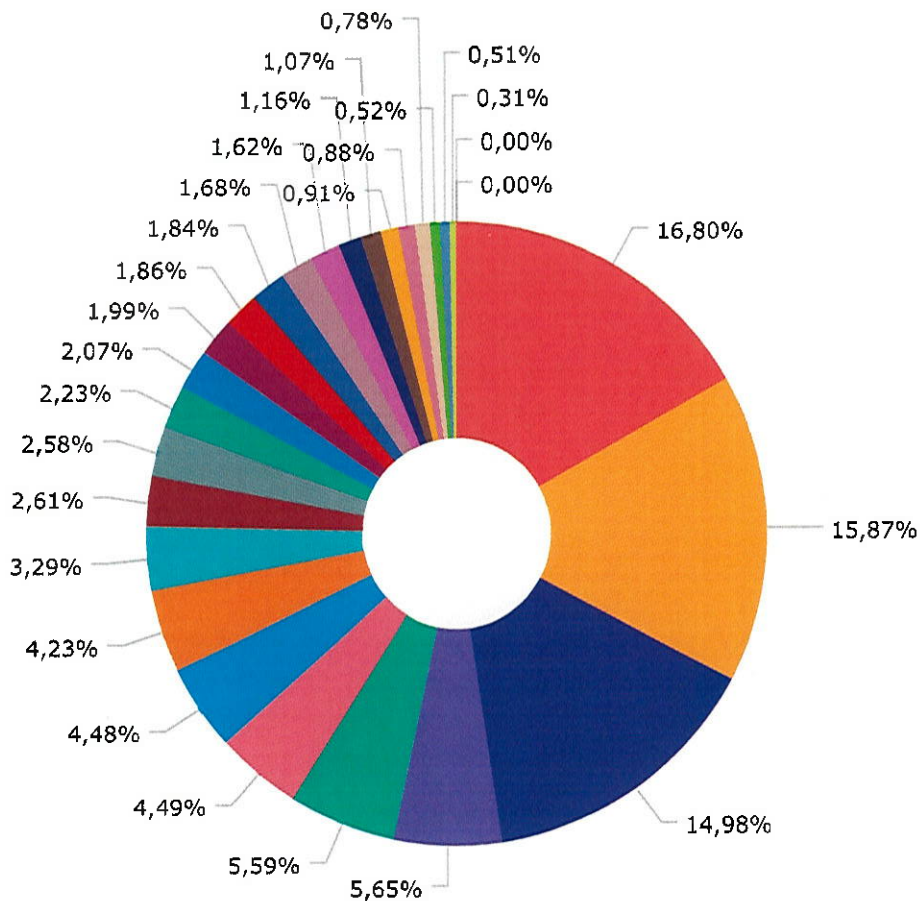




Handwritten signatures and initials at the bottom of the page.

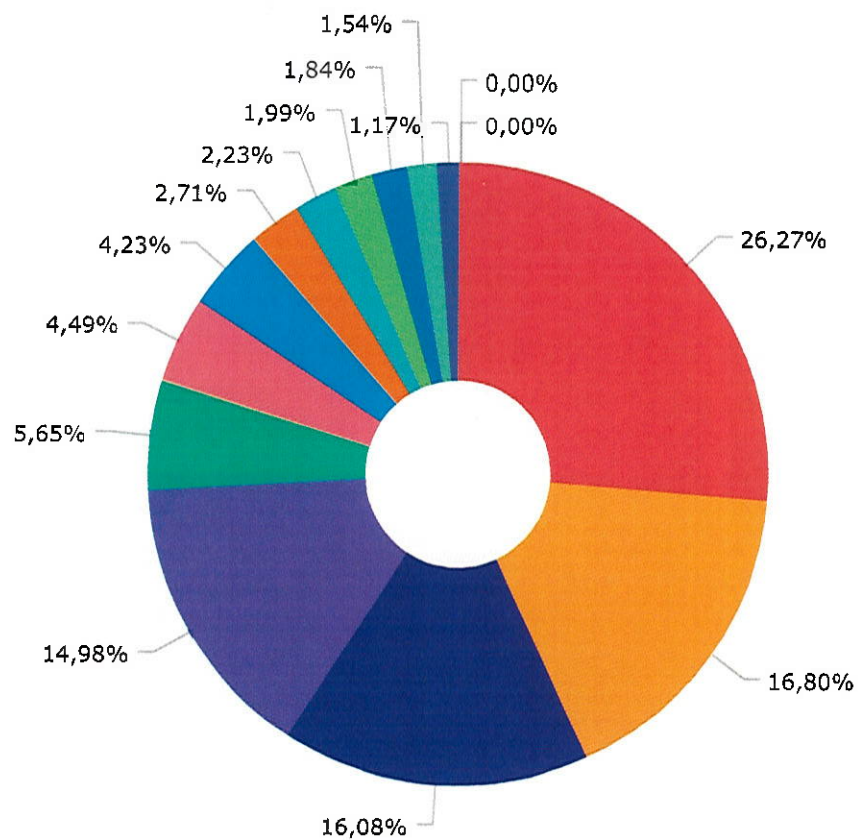


Renda Fixa Indexados	255.470.823,22
Ações Livre	154.289.546,35
Títulos Públicos	153.612.270,80
Ações Índice Ativo	65.591.304,76
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	62.046.463,40
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	53.223.367,13
Não classificado	41.128.593,16
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	38.817.782,35
Ações Investimento no Exterior	37.544.381,68
Multimercados Livre	27.463.851,30
Ações Valor/Crescimento	23.876.348,68
Renda Fixa Duração Livre Soberano	23.780.869,26
Fundos de Participações	20.949.145,28
Ações Small Caps	19.051.006,57
FII Renda Gestão Ativa	15.810.320,33
Ações Dividendos	15.371.798,32
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	15.061.252,67
FII TVM Gestão Ativa	2.163.703,56
Disponibilidades Financeiras	28.162,02
FIDC Outros	6.745,25



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	172.238.288,46
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	162.715.815,54
TESOURO NACIONAL	153.612.270,80
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN...	57.926.235,60
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	57.285.999,45
SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...	46.080.993,57
CONSTANCIA INVESTIMENTOS LTDA.	45.908.036,20
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	43.366.914,38
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	33.761.445,57
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	26.793.291,44
QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINA...	26.487.444,20
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA...	22.874.855,16
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS L...	21.173.730,01
ITAU UNIBANCO S.A.	20.416.136,38
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	19.051.006,57
MIRAE ASSET GLOBAL INVESTIMENT...	18.902.314,02
OCCAM BRASIL GESTAO DE RECURSO...	17.221.100,15
META ASSET MANAGEMENT LTDA.	16.572.160,37
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	11.905.217,72
PLURAL INVESTIMENTOS GESTAO DE...	10.920.893,78
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	9.337.877,96
ICATU VANGUARDA GESTAO DE RECU...	8.991.939,15
MULTINVEST CAPITAL ADMINISTRAD...	7.984.239,67
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPA...	5.299.384,76
ZION GESTAO DE RECURSOS LTDA	5.245.713,63
LEGATUS GESTORA DE RECURSOS LT...	3.179.524,28
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	28.162,02
GENIAL GESTAO LTDA	6.745,25

Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom of the page.

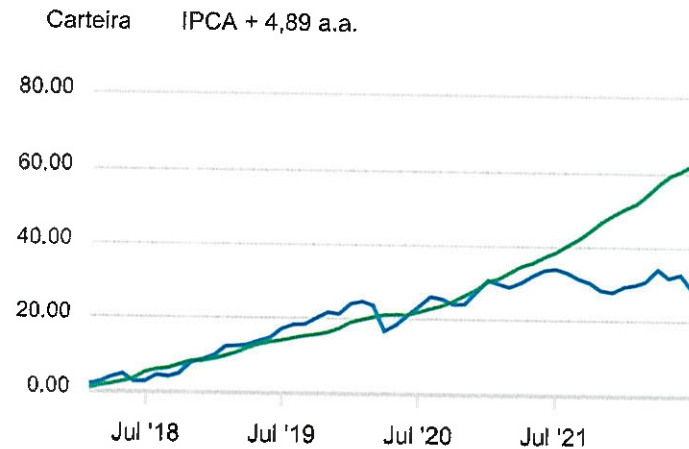
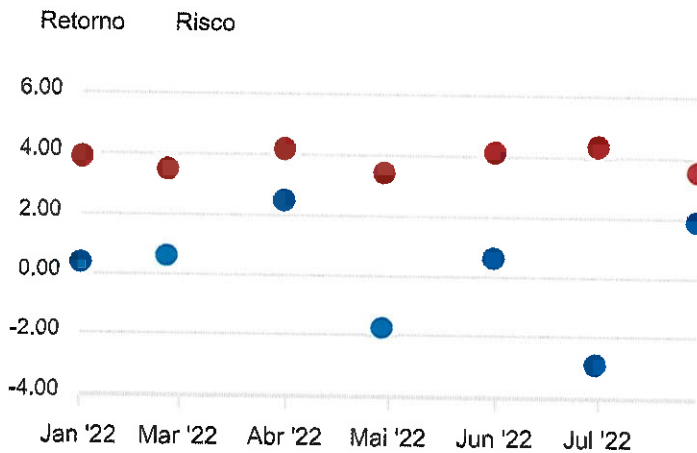


BEM DTVM	269.372.822,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	172.238.288,46
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	164.879.519,10
TESOURO NACIONAL	153.612.270,80
BANCO BRADESCO S.A.	57.926.235,60
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	46.080.993,57
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	43.366.914,38
BANCO DAYCOVAL S.A.	27.735.924,32
INTRAG DTVM LTDA	22.874.855,16
ITAU UNIBANCO S.A.	20.416.136,38
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM S...	18.902.314,02
PLANNER CORRETORA DE VALORES S...	15.810.320,33
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	12.036.234,70
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	28.162,02
GENIAL INVESTIMENTOS CORRETORA...	6.745,25

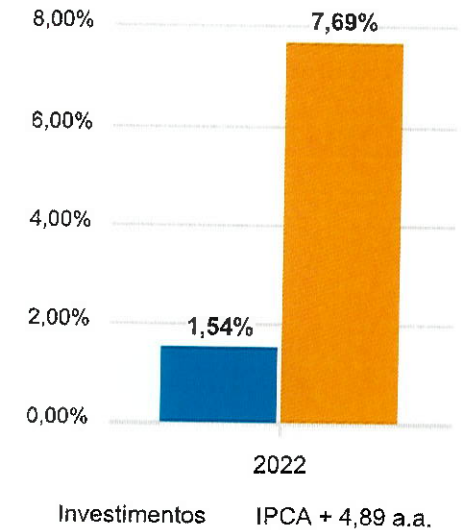
Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom of the page.

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	983.185.970,32	37.179.497,27	30.799.507,72	993.688.912,70	4.122.952,83	0,42% ▲	0,94%	3,92%
Fevereiro	993.688.912,70	12.217.293,39	8.751.027,64	1.003.758.089,94	6.602.911,49	0,66% ▲	1,37%	3,53%
Março	1.003.758.089,94	8.336.000,00	4.395.000,00	1.033.371.700,51	25.672.610,57	2,55% ▲	2,04%	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	-1,71% ▼	1,42%	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	0,68% ▲	0,89%	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	-2,90% ▼	1,07%	4,38%
Julho	1.004.588.375,78	11.893.718,30	10.881.141,28	1.025.259.574,07	19.658.621,27	1,95% ▲	-0,28%	3,58%
Acumulado					15.223.464,98	1,54% ▲	7,69%	

Retorno Acumulado			
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%

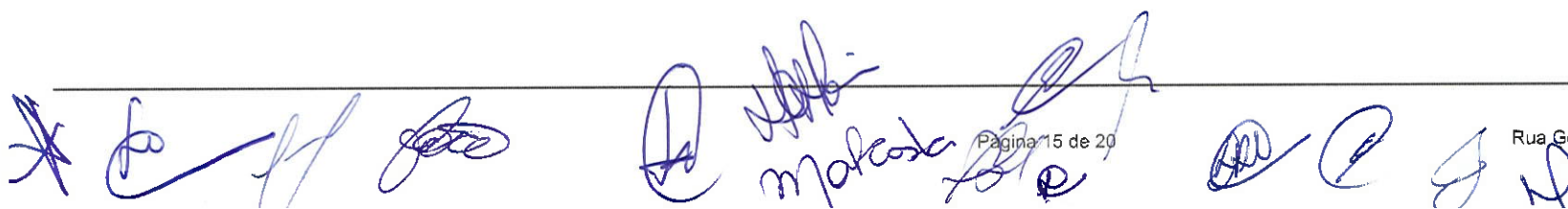


Retorno e Meta Acumulado

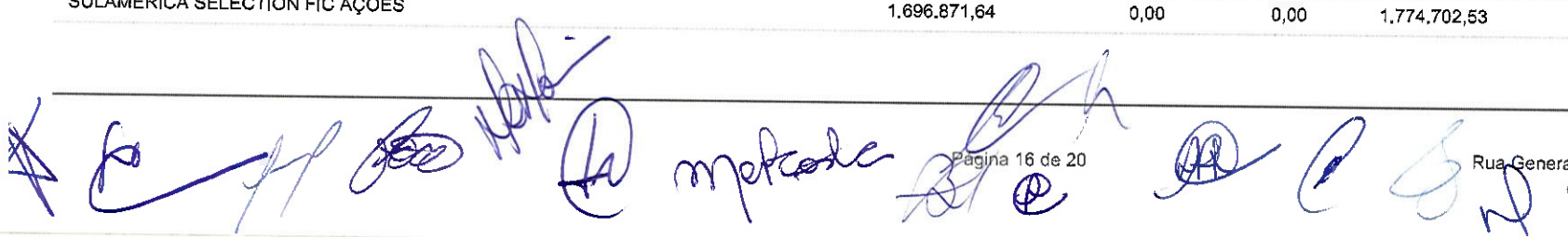


Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom of the page.

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	152.324.245,80	0,00	0,00	153.612.270,80	1.288.025,00	0,85% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.128.785,91	4.500,00	0,00	1.140.517,55	7.231,64	0,64% ▲	0,65%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	78.263.565,25	0,00	0,00	78.261.208,43	-2.356,82	0,00% ▼	1,22%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.671.802,16	0,00	0,00	11.568.443,57	-103.358,59	-0,89% ▼	2,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.676.254,62	0,00	0,00	16.850.043,41	173.788,79	1,04% ▲	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.010.311,81	0,00	0,00	18.159.617,12	149.305,31	0,83% ▲	0,77%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	23.643.519,88	0,00	0,00	23.724.404,37	80.884,49	0,34% ▲	1,08%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	32.971.235,13	0,00	0,00	32.967.175,32	-4.059,81	-0,01% ▼	1,25%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.041.442,50	0,00	0,00	13.106.385,98	64.943,48	0,50% ▲	0,25%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.057.515,00	0,00	0,00	13.123.251,30	65.736,30	0,50% ▲	0,25%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	30.078.047,57	8.875.000,00	480.976,98	38.817.782,35	345.711,76	0,89% ▲	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.459.301,47	0,00	3.014.218,30	4.480.734,59	35.651,42	0,48% ▲	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	45.987.047,66	0,00	0,00	45.852.554,62	-134.493,04	-0,29% ▼	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.527.765,75	0,00	0,00	36.535.319,87	7.554,12	0,02% ▲	1,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	27.438.356,17	0,00	7.385.946,00	20.322.259,75	269.849,58	0,98% ▲	0,25%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	5.414.707,98	0,00	0,00	5.354.883,71	-59.824,27	-1,10% ▼	2,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	14.941.412,12	0,00	0,00	15.061.252,67	119.840,55	0,80% ▲	0,36%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	6.520,37	0,00	0,00	6.745,25	224,88	3,45% ▲	-
MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA	20.959.548,17	0,00	0,00	21.173.730,01	214.181,84	1,02% ▲	0,02%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	46.084.861,49	0,00	0,00	46.080.993,57	-3.867,92	-0,01% ▼	1,23%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	8.175.817,31	0,00	0,00	8.266.855,06	91.037,75	1,11% ▲	0,05%
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	911.041,81	0,00	0,00	907.926,90	-3.114,91	-0,34% ▼	1,82%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	23.000.515,95	0,00	0,00	22.874.855,16	-125.660,79	-0,55% ▼	1,91%
	627.773.621,88	8.879.500,00	10.881.141,28	628.249.211,36	2.477.230,76	0,39%	0,73%



RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	17.828.803,05	0,00	0,00	19.051.006,57	1.222.203,52	6,86% ▲	8,01%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	13.326.094,56	0,00	0,00	13.932.844,35	606.549,79	4,55% ▲	6,81%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8.734.314,13	0,00	0,00	9.064.207,34	329.893,21	3,78% ▲	6,00%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.372.611,43	0,00	0,00	10.764.593,88	391.982,45	3,78% ▲	5,97%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	12.471.776,33	0,00	0,00	13.111.674,47	639.898,14	5,13% ▲	7,94%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.185.848,77	0,00	0,00	2.200.047,22	14.198,45	0,65% ▲	0,84%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.474.635,47	0,00	0,00	2.163.703,56	-310.931,91	-12,56% ▼	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	4.754.285,12	0,00	0,00	5.245.713,63	491.428,51	10,34% ▲	21,73%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.959.988,13	0,00	0,00	5.382.028,20	422.040,07	8,51% ▲	8,55%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6.143.488,22	0,00	0,00	6.379.859,17	236.370,95	3,85% ▲	7,44%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL MULTISTRATÉGIA FIP	14.627.878,28	3.014.218,30	0,00	17.769.621,00	127.524,42	0,72% ▲	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	12.553.862,33	0,00	0,00	13.835.406,01	1.281.543,68	10,21% ▲	8,98%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	43.857.910,91	0,00	0,00	45.908.036,20	2.050.125,29	4,67% ▲	6,45%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.658.321,49	0,00	0,00	8.991.939,15	333.617,66	3,85% ▲	7,76%
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	3.099.608,06	0,00	0,00	3.179.524,28	79.916,22	2,58% ▲	-
META VALOR FI AÇÕES	16.068.525,47	0,00	0,00	16.572.160,37	503.634,90	3,13% ▲	9,08%
MULTINVEST FI AÇÕES	5.223.915,83	0,00	0,00	5.386.924,59	163.008,76	3,12% ▲	7,97%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	1.688.389,58	0,00	0,00	1.697.766,07	9.376,49	0,56% ▲	0,62%
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	862.186,43	0,00	0,00	899.549,01	37.362,58	4,33% ▲	9,44%
OCCAM FIC AÇÕES	16.653.643,60	0,00	0,00	17.221.100,15	567.456,55	3,41% ▲	7,13%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	15.517.467,39	0,00	0,00	15.922.837,50	405.370,11	2,61% ▲	8,24%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	9.582.949,52	0,00	0,00	9.730.632,00	147.682,48	1,54% ▲	2,08%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	15.326.740,55	0,00	0,00	14.898.955,88	-427.784,67	-2,79% ▼	4,90%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	47.029.405,15	0,00	0,00	49.019.144,39	1.989.739,24	4,23% ▲	7,77%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	6.374.052,14	0,00	0,00	6.655.248,53	281.196,39	4,41% ▲	7,64%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.696.871,64	0,00	0,00	1.774.702,53	77.830,89	4,59% ▲	11,11%



RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	10.654.463,85	0,00	0,00	10.564.606,70	-89.857,15	-0,84% ▼	-
-	312.728.037,43	3.014.218,30	0,00	327.323.632,75	11.581.377,02	3,67%	6,85%

[Handwritten signatures and initials in blue ink]

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	19.885.740,33	0,00	0,00	21.424.263,77	1.538.523,44	7,74% ▲	9,83%
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVESTIMEN...	9.008.443,06	0,00	0,00	9.911.469,98	903.026,92	10,02% ▲	15,51%
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.139.374,57	0,00	0,00	1.234.655,91	95.281,34	8,36% ▲	10,83%
CLOU GLOBAL X MIRAE ASSET CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC ...	8.373.373,03	0,00	0,00	8.990.844,04	617.471,01	7,37% ▲	23,90%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	5.995.842,85	0,00	0,00	6.736.849,94	741.007,09	12,36% ▲	27,24%
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.827.022,17	0,00	0,00	4.184.043,84	357.021,67	9,33% ▲	12,54%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	11.057.588,63	0,00	0,00	11.905.217,72	847.629,09	7,67% ▲	11,62%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.799.331,83	0,00	0,00	5.299.384,76	500.052,93	10,42% ▲	14,02%
	64.086.716,47	0,00	0,00	69.686.729,96	5.600.013,49	8,74%	13,87%

[Handwritten signatures and initials in blue ink]

Cenário Econômico

O fechamento de julho, caracterizou-se como sendo de recuperação dos principais índices de mercados, e as carteiras de investimentos que possuíam diversificação, experimentaram bons retornos. No segmento de renda variável, na segunda quinzena do mês, foi de melhor resultado com o Ibovespa fechando em 103 mil pontos, acumulando uma alta no mês de 4,69%. A atenção com a inflação ainda segue como o principal assunto nos debates econômicos, ao redor do mundo, principalmente levando-se em conta o fato de seguir disseminada e resiliente nas principais economias globais. Isso tem provocado um movimento geral dos bancos centrais de elevação na taxa básica de juros das economias, ao redor do mundo, a fim de frear a atividade econômica e reduzir a pressão sobre os preços de mercado trazendo com isso incertezas quanto aos seus limites, e deprimindo parcela de valorização das aquisições de títulos e fundos com carteira formada por títulos públicos federais. Entretanto, isso não tira as boas perspectivas de valorizações dos ativos, tanto no segmento de renda fixa, como no segmento de renda variável nos meses restantes do ano de 2022.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica 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 em relação à Política de Investimentos, demonstra apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2022 ainda não foram integralmente atingidos.

Rentabilidade e Risco (por ativo)

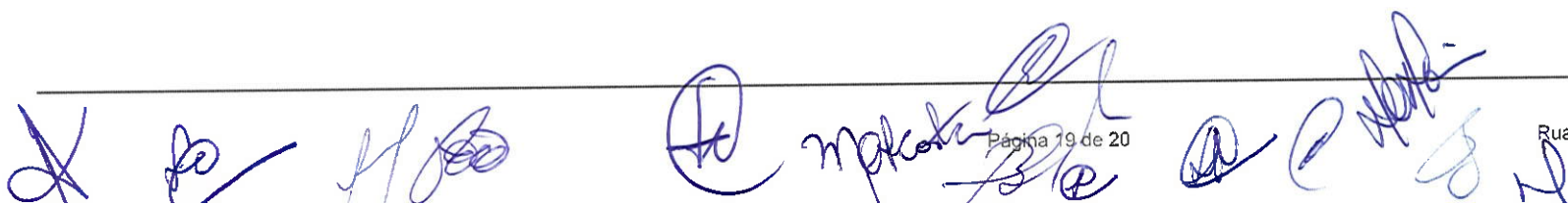
As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, evidencia a qualidade e consistência de seus resultados.

Distribuição por Benchmarks

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscaram replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Distribuição por Classificação ANBIMA

A carteira mantém a alocação em fundos de investimento que seguem as características de estratégias e fatores de risco definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.



Distribuição por Gestoras e Administradoras

A carteira na parcela referente a fundos de investimento, mantem 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 regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

A rentabilidade apresentada no período demonstra recuperação face o aumento das taxas de juros visando a contenção do processo inflacionário. Tal cenário de recuperação da conjuntura econômica interna também favoreceu os mercados de Bolsa e Ativos Reais, proporcionando um resultado consolidado da carteira mais satisfatório.

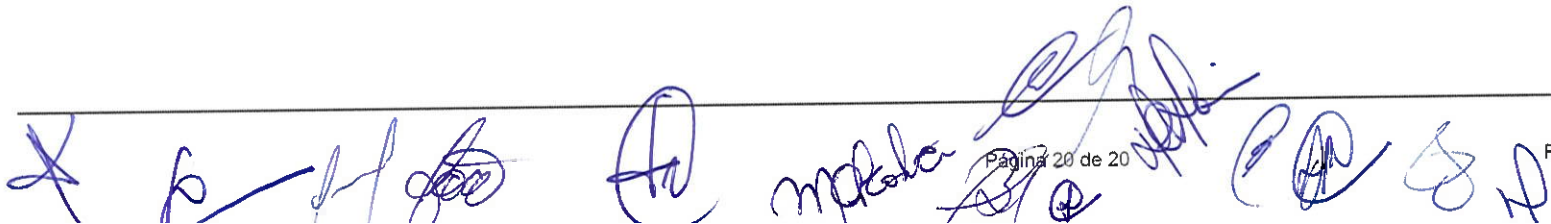
Retorno dos Fundos de Investimentos

A carteira na parcela referente a fundos de investimentos, mantem a concentração em fundos regulados, e em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Tal distribuição fica adequada à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2022, assim como atende os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 16 de agosto de 2022.

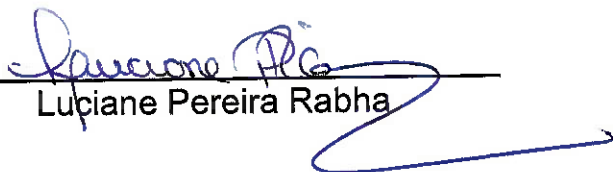


Mais Valia Consultoria Ltda EPP



PARECERNº:001/2022-COMIN/ANGRAPREV

Os membros participantes da 08ª Reunião Ordinária de 2022 do Comitê de Investimentos - COMIN do Instituto de Previdência de Angra dos Reis - ANGRAPREV, ocorrida em 10 de agosto de 2022, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 6º do **DECRETO No 8.534 DE 17 DE OUTUBRO DE 2012, APROVAM** o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de **julho de 2022**.



Luciane Pereira Rabha




Renaldo de Sousa




Jediael Souza Estoduto

PARECER Nº:02/2022-CONSELHOFISCAL-CONFIS

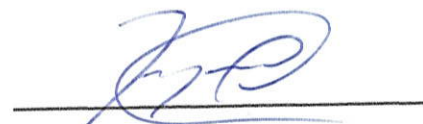
Os membros participantes da 8ª Reunião Ordinária de 2022 do Conselho Fiscal do Instituto de Previdência de Angra dos Reis - ANGRAPREV, ocorrida em 18 de Agosto de 2022, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 2º do Capítulo II,1.2, Inciso II da Lei Municipal nº 2.074, de 29 de dezembro de 2008, após examinarem o **Relatório Mensal de Investimentos, referente ao mês de Julho de 2022**, opinam **FAVORAVELMENTE** pela aprovação, submetendo-o assim, à apreciação dos membros conselheiros do Conselho de Administração do ANGRAPREV.




Alexandra Carla Nóbrega



Edilson Winckler Moreira



Thiago de Siqueira Sousa



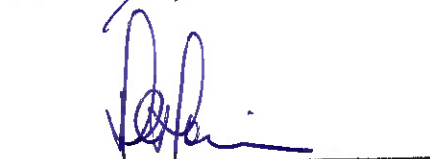
Paulo Henrique da Silva Bullé



Maria Aparecida Lara da Silva



Luciana Fernandes e Silva



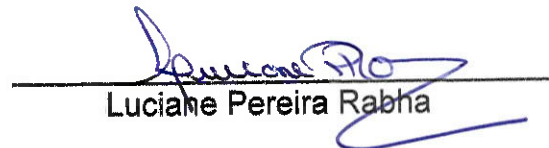
Maria Cecília Moreira Reis

PARECER Nº 03/2022–CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO DO ANGRAPREV

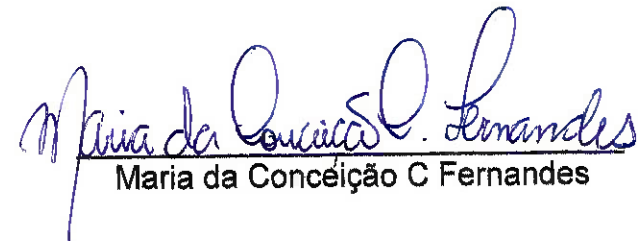
Os membros participantes da 8ª Reunião Ordinária de 2022 do Conselho de Administração do Instituto de Previdência de Angra dos Reis - ANGRAPREV, ocorrida em 22 de Julho de 2022, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 2º do Capítulo II, 1.1, Inciso II da Lei Municipal nº 2.074, de 29 de dezembro de 2008, após examinarem o **Relatório Mensal de Investimentos**, referente ao mês de **JUHO de 2022**, deliberam por sua **APROVAÇÃO** final.



Renaldo de Sousa



Luciane Pereira Rabha



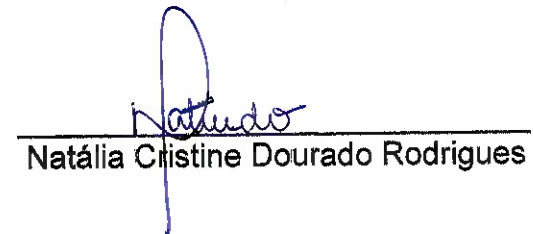
Maria da Conceição C. Fernandes



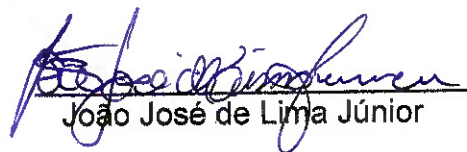
Mauro Ribeiro Garcia



Charlson Haroldo S. Rodrigues



Natália Cristine Dourado Rodrigues



João José de Lima Júnior



Jedrael Souza Estoduto