

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2022



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

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2022)

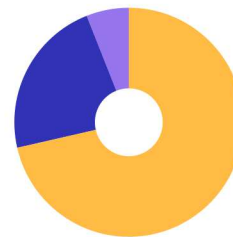
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			45.289.451,66	5,62%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	7.658.569,84	0,95%	1.071	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	147.982.794,31	18,36%	577	2,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	15.672.949,58	1,94%	103	2,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	113.055.128,98	14,03%	776	2,94%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.862.709,31	1,97%	613	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	13.476.307,56	1,67%	38	3,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	97.871.204,68	12,14%	155	9,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	111.655.961,94	13,85%	473	4,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	7.201.157,67	0,89%	115	3,23%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	5.152.874,97	0,64%	13	0,61%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	8.177.067,40	1,01%	5.365	2,44%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	27.301.414,77	3,39%	4.250	1,68%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	3.294.926,86	0,41%	3.523	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.967.253,41	0,37%	477	5,87%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	2.161.791,53	0,27%	167	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.676.252,13	0,46%	3.893	0,38%	Artigo 8º, Inciso I
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.862.388,03	0,60%	1.681	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	30.036.980,53	3,73%	18.281	9,49%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	11.598.199,42	1,44%	68	12,88%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	13.421.017,10	1,67%	66	1,04%	Artigo 9º, Inciso II
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXT...	D+6 du	Não há	5.763.511,73	0,72%	10	35,32%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	20.398.943,26	2,53%	330	7,28%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	8.781.211,18	1,09%	30.947	1,86%	Artigo 9º, Inciso III
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	2.447.990,20	0,30%	29	3,16%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	15.011.282,91	1,86%	22	11,88%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	9.256.770,88	1,15%	127	1,13%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	47.552.749,17	5,90%	35.991	3,87%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRAT...	Não se ...	Não se aplica	392.883,33	0,05%	21	0,22%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	786.505,09	0,10%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BROR11	S/Info	Não se aplica	1.636.518,40	0,20%		0,09%	Artigo 11º
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	S/Info	Não se aplica	789.800,00	0,10%		0,05%	Artigo 11º
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	S/Info	Não se aplica	4.478.000,00	0,56%		0,84%	Artigo 11º
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - ...	S/Info	Não se aplica	4.987,50	0,00%		1,05%	Artigo 11º
BTG PACTUAL FUNDO DE CRI FII - FEXC11	S/Info	Não se aplica	376.816,00	0,05%		0,13%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			806.054.371,35				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 2022)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	45.289.451,66	5,62%	5,00%	9,00%	40,00%	277.132.296,88
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	411.579.664,26	51,06%	30,00%	40,00%	80,00%	233.263.832,82
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	111.655.961,94	13,85%	10,00%	17,00%	60,00%	371.976.660,87
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	16.121.087,43
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	10,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,10%	2,00%	16.121.087,42
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10,00%	7.201.157,67	0,89%	0,00%	2,00%	5,00%	33.101.560,90
Total Renda Fixa	100,00%	575.726.235,54	71,43%	45,00%	69,10%	189,00%	

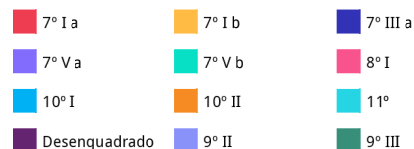
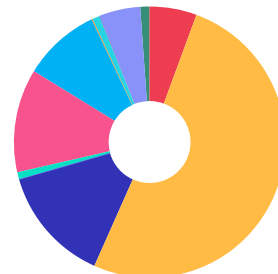


■ RENDA FIXA 575.726.235,54
■ RENDA VARIÁVEL 181.963.452, ■ EXTERIOR 48.364.682

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

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	99.229.149,05	12,31%	10,00%	13,00%	40,00%	223.192.599,49
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	80.605.437,14
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	74.268.793,16	9,21%	5,00%	8,00%	10,00%	6.336.643,98
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	1.179.388,43	0,15%	0,00%	0,20%	0,50%	2.850.883,43
Artigo 11º	10,00%	6.909.305,90	0,86%	0,00%	1,00%	2,00%	9.211.781,53
Desenquadrado - RV	0,00%	376.816,00	0,05%	0,00%	0,00%	0,00%	-376.816,00
Total Renda Variável	40,00%	181.963.452,54	22,57%	15,00%	22,20%	62,50%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	39.583.472,09	4,91%	2,00%	7,00%	10,00%	41.021.965,05
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	8.781.211,18	1,09%	1,00%	1,70%	10,00%	71.824.225,96
Total Exterior	10,00%	48.364.683,27	6,00%	3,00%	8,70%	20,00%	

Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	209.527.166,62	25,99	0,05
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	177.843.592,43	22,06	-
CAIXA DTVM	138.280.787,49	17,16	0,49
WESTERN ASSET	47.552.749,17	5,90	0,10
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	45.289.451,66	5,62	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	35.478.482,17	4,40	0,10
GENIAL INVESTIMENTOS	30.036.980,53	3,73	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	20.398.943,26	2,53	0,24
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	15.672.949,58	1,94	0,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	15.011.282,91	1,86	1,45
SAFRA ASSET MANAGEMENT	13.476.307,56	1,67	0,01
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	11.598.199,42	1,44	-
BANCO J. SAFRA S/A	9.256.770,88	1,15	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	6.556.892,90	0,81	0,00
MIRAE ASSET	5.763.511,73	0,72	-
ARX INVESTIMENTOS	5.152.874,97	0,64	0,01
NAVI CAPITAL	4.862.388,03	0,60	0,37
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIR...	4.478.000,00	0,56	0,00
ICATU VANGUARDA	3.676.252,13	0,46	0,01
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	3.294.926,86	0,41	0,00
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	2.447.990,20	0,30	0,02
BRZ INVESTIMENTOS	392.883,33	0,05	0,02
RB CAPITAL ASSET MANAGEMENT	4.987,50	0,00	0,00
PLURAL	0,02	0,00	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	45.289.451,66	5,62	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	411.579.664,26	51,06	30,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	111.655.961,94	13,85	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,01	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	7.201.157,67	0,89	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	99.229.149,05	12,31	10,00	40,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	39.583.472,09	4,91	2,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	8.781.211,18	1,09	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	74.268.793,16	9,21	5,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	1.179.388,43	0,15	0,00	0,50
Artigo 11º	6.909.305,90	0,86	0,00	2,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,36%	6,28%	-0,07%	4,90%	9,42%	14,98%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,05%	6,17%	0,00%	4,95%	9,27%	14,82%	1,44%	0,04%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,17%	8,53%	1,13%	5,88%	15,25%	33,96%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,50%	7,20%	0,79%	5,80%	9,61%	12,18%	0,70%	0,04%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,00%	6,62%	0,35%	5,38%	9,88%	15,12%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	-0,01%	6,48%	0,31%	5,28%	9,66%	14,64%	1,31%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	1,10%	4,57%	-0,15%	4,78%	5,54%	8,99%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	4,40%	-0,17%	4,65%	5,26%	8,45%	3,18%	0,06%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,08%	4,33%	-0,23%	4,59%	5,17%	8,22%	3,20%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,20%	4,52%	-0,12%	4,77%	5,40%	8,57%	3,19%	0,06%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1,37%	3,95%	-0,12%	4,53%	3,01%	3,70%	3,40%	0,06%
CDI (Benchmark)	1,17%	7,74%	3,25%	6,16%	10,20%	13,18%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,17%	7,85%	3,25%	6,07%	10,38%	12,85%	0,03%	0,01%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,21%	8,09%	3,35%	6,36%	10,86%	14,26%	0,01%	0,01%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,55%	11,58%	2,22%	8,14%	20,14%	45,55%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
S&P 500 (Benchmark)	-4,24%	-17,02%	-4,29%	-9,80%	-12,55%	12,99%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-3,22%	-12,19%	-1,71%	-5,39%	-5,35%	23,41%	8,99%	0,21%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,34%	9,89%	1,62%	6,89%	17,43%	39,05%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-0,22%	9,22%	2,90%	3,92%	3,93%	11,54%	-	-
IDIV (Benchmark)	4,27%	11,21%	-2,58%	5,93%	4,28%	24,51%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	3,56%	8,46%	-2,64%	0,38%	-2,12%	15,39%	6,78%	0,20%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	5,65%	4,40%	-0,60%	-3,02%	-10,44%	-3,01%	8,16%	0,20%
IBX (Benchmark)	6,15%	4,48%	-2,00%	-3,64%	-8,18%	10,99%	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	5,77%	5,42%	-1,96%	-3,86%	-12,04%	-10,85%	9,25%	0,23%
Ibovespa (Benchmark)	6,16%	4,48%	-1,64%	-3,20%	-7,79%	10,22%	-	-
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	7,04%	1,81%	1,00%	-3,50%	-11,73%	-0,35%	8,86%	0,21%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4,76%	6,76%	-1,21%	2,34%	-9,46%	-3,72%	7,49%	0,20%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,74%	-0,42%	2,42%	-3,15%	-26,88%	-25,93%	10,79%	0,27%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	6,84%	3,44%	-1,87%	-3,04%	-10,88%	-5,37%	9,06%	0,22%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,24%	9,74%	6,92%	3,43%	-0,81%	18,95%	9,04%	0,20%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7,39%	0,89%	-2,91%	-6,56%	-6,25%	-	9,20%	0,23%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	2,95%	-	2,48%	2,06%	-	-	2,98%	-
SMLL (Benchmark)	10,90%	-6,34%	-2,42%	-4,48%	-22,25%	-9,05%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,97%	-3,19%	-2,30%	-4,27%	-14,90%	-3,83%	8,25%	0,18%
CDI (Benchmark)	1,17%	7,74%	3,25%	6,16%	10,20%	13,18%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	-3,18%	-12,06%	-1,69%	-5,19%	-5,33%	23,18%	8,90%	0,21%
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	0,47%	10,90%	1,99%	7,64%	19,06%	42,93%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP MULTISTRATÉGIA	-0,05%	-18,22%	-9,12%	-18,33%	-18,38%	28,91%	0,00%	0,11%
IFIX (Benchmark)	5,76%	6,11%	5,52%	8,58%	8,23%	6,98%	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	23,84%	-3,15%	4,03%	2,27%	-9,55%	-19,57%	11,67%	0,34%
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - RBDS11	2,46%	-61,93%	24,59%	-37,50%	-75,00%	-88,50%	32,63%	0,60%
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	12,22%	6,11%	12,80%	10,35%	4,12%	-28,52%	11,20%	0,20%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	7,41%	1,54%	8,77%	5,28%	-2,84%	-19,78%	6,84%	0,18%
BTG PACTUAL FUNDO DE CRI FII - FECC11	-1,85%	-3,78%	-4,84%	-1,12%	-2,67%	-16,96%	4,97%	0,14%

Página 8 de 20

 Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
 Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
 CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
--	-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

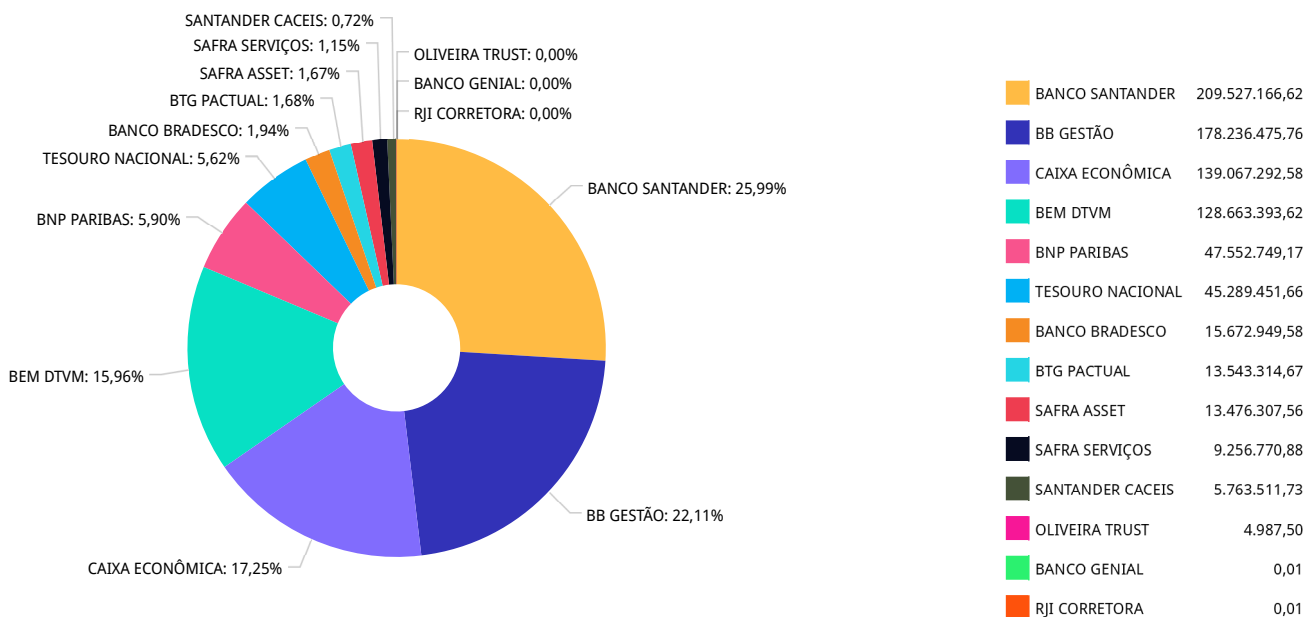
Página 9 de 20

 Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
 Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
 CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

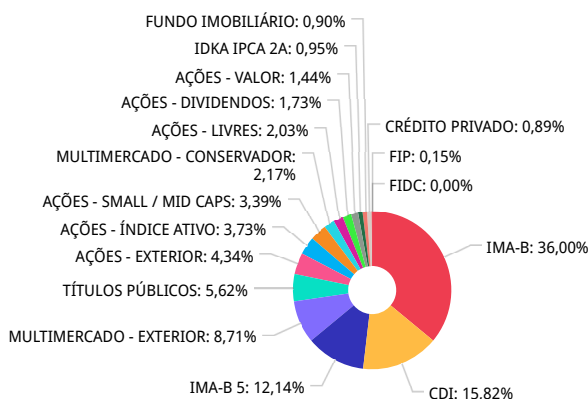
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,05%	-24,45%	5,20%	-10,08%	-15,31%	0,66%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,37%	-13,56%	-5,46%	-8,16%	-10,16%	-	8,53%	0,17%
MSCI WORLD (Benchmark)	-4,51%	-24,55%	3,09%	-11,16%	-15,78%	1,28%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-1,60%	-21,05%	4,86%	-9,20%	-11,14%	11,29%	11,62%	0,18%
Ibovespa (Benchmark)	6,16%	4,48%	-1,64%	-3,20%	-7,79%	10,22%	-	-
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-2,18%	-39,37%	6,29%	-15,79%	-43,73%	-	18,15%	0,30%
MSCI ACWI (Benchmark)	-4,03%	-24,62%	2,86%	-11,55%	-16,72%	-0,77%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	-3,57%	-24,54%	4,16%	-10,13%	-18,25%	3,82%	11,52%	0,19%

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



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



IMA-B	290.187.180,43	CDI	127.518.671,25	IMA-B 5	97.871.204,68
MULTIMERCADO - EXTERIOR	70.230.537,15	TÍTULOS PÚBLICOS	45.289.451,66	AÇÕES - EXTERIOR	34.943.666,17
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	30.036.980,53	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	27.301.414,77	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	17.459.273,11
AÇÕES - LIVRES	16.334.382,29	AÇÕES - DIVIDENDOS	13.958.172,04	AÇÕES - VALOR	11.598.199,42
IDKA IPCA 2A	7.658.569,84	FUNDO IMOBILIÁRIO	7.286.121,90	CRÉDITO PRIVADO	7.201.157,67
FIP	1.179.388,43	FIDC	0,01		

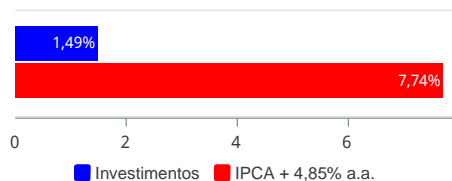
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2022)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/01/2031	02/07/2004	3.100	2.696,277829	9.845,532971	8.358.461,27	30.521.152,21	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/01/2031	07/12/2004	1.500	2.874,269396	9.845,532971	4.311.404,09	14.768.299,46	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

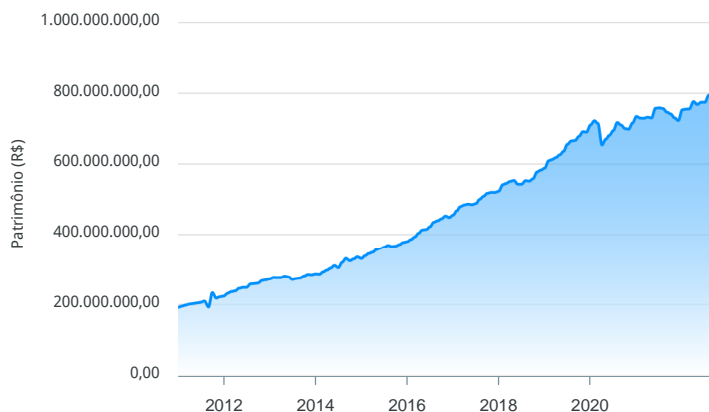
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	748.544.710,08	27.845.000,00	22.666.194,89	750.235.796,61	-3.487.718,58	-3.487.718,58	-0,46%	-0,46%	0,94%	0,94%	-49,35%	3,91%
Fevereiro	750.235.796,61	7.711.000,00	5.715.077,72	750.855.442,41	-1.376.276,48	-4.863.995,06	-0,18%	-0,64%	1,37%	2,32%	-27,77%	4,33%
Março	750.855.442,41	6.331.000,00	5.304.837,91	771.152.875,56	19.271.271,06	14.407.276,00	2,56%	1,90%	2,04%	4,41%	43,12%	4,45%
Abril	771.152.875,56	8.669.000,00	4.785.199,91	762.895.046,85	-12.141.628,80	2.265.647,20	-1,57%	0,31%	1,42%	5,89%	5,18%	4,03%
Mai	762.895.046,85	10.274.755,56	8.243.185,10	769.146.948,44	4.220.331,13	6.485.978,33	0,55%	0,86%	0,89%	6,83%	12,57%	4,32%
Junho	769.146.948,44	22.521.000,00	7.804.952,90	768.687.117,79	-15.175.877,75	-8.689.899,42	-1,94%	-1,09%	1,07%	7,97%	-13,72%	3,92%
Julho	768.687.117,79	12.890.280,00	5.668.024,76	787.608.657,27	11.699.284,24	3.009.384,82	1,51%	0,40%	-0,29%	7,66%	5,19%	3,68%
Agosto	787.608.657,27	7.978.800,00	4.269.737,68	799.953.047,24	8.635.327,65	11.644.712,47	1,09%	1,49%	0,07%	7,74%	19,29%	4,14%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

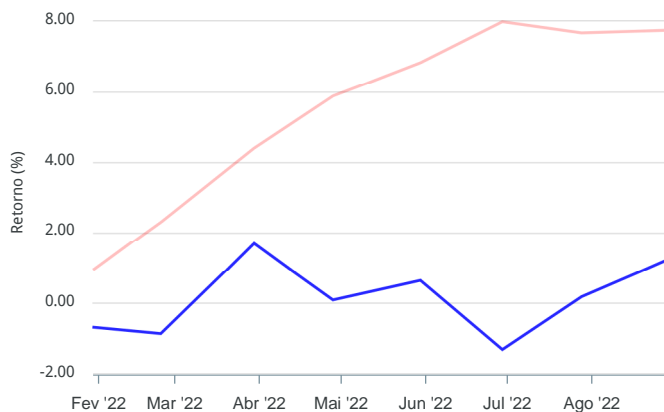


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos
 Meta de Rentabilidade
 CDI
 IMA-B
 IMA-B 5
 IMA-B 5+
 IMA Geral
 IRF-M
 IRF-M 1
 IRF-M 1+
 Ibovespa
 IBX
 SMLL
 IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	13.293.744,57	0,00	0,00	13.476.307,56	182.562,99	1,37%	1,37%	3,40%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	111.718.754,10	0,00	0,00	113.055.128,98	1.336.374,88	1,20%	1,20%	3,19%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	106.827.884,63	7.810.000,00	4.341.424,82	111.655.961,94	1.359.502,13	1,19%	1,21%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.511.424,77	168.800,00	0,00	15.862.709,31	182.484,54	1,16%	1,17%	0,03%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	15.505.650,52	0,00	0,00	15.672.949,58	167.299,06	1,08%	1,08%	3,20%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	146.407.377,82	0,00	0,00	147.982.794,31	1.575.416,49	1,08%	1,08%	3,18%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	7.165.322,43	0,00	0,00	7.201.157,67	35.835,24	0,50%	0,50%	0,70%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	97.877.450,11	0,00	0,00	97.871.204,68	-6.245,43	-0,01%	-0,01%	1,31%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.661.984,02	0,00	0,00	7.658.569,84	-3.414,18	-0,04%	-0,04%	1,44%
TÍTULOS PÚBLICOS	45.520.889,28	0,00	0,00	45.289.451,66	-231.437,62	-0,51%	-	-
Total Renda Fixa	567.490.482,26	7.978.800,00	4.341.424,82	575.726.235,54	4.598.378,10	0,81%		2,02%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	1.321.535,10	0,00	10.925,62	1.636.518,40	325.908,92	24,66%	23,83%	11,67%
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	3.990.360,00	0,00	28.473,11	4.478.000,00	516.113,11	12,93%	12,22%	11,20%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.451.254,91	0,00	0,00	4.862.388,03	411.133,12	9,24%	9,24%	9,04%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFH11	735.350,00	0,00	6.160,00	789.800,00	60.610,00	8,24%	7,40%	6,84%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.798.125,82	0,00	0,00	5.152.874,97	354.749,15	7,39%	7,39%	9,20%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	28.062.787,16	0,00	0,00	30.036.980,53	1.974.193,37	7,03%	7,03%	8,86%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7.653.952,88	0,00	0,00	8.177.067,40	523.114,52	6,83%	6,83%	9,06%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	25.762.551,28	0,00	0,00	27.301.414,77	1.538.863,49	5,97%	5,97%	8,25%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	10.965.207,44	0,00	0,00	11.598.199,42	632.991,98	5,77%	5,77%	9,25%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.116.127,83	0,00	0,00	3.294.926,86	178.799,03	5,74%	5,74%	10,79%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.479.617,25	0,00	0,00	3.676.252,13	196.634,88	5,65%	5,65%	8,16%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.832.407,18	0,00	0,00	2.967.253,41	134.846,23	4,76%	4,76%	7,49%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.087.586,82	0,00	0,00	2.161.791,53	74.204,71	3,55%	3,55%	6,78%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	14.580.759,55	0,00	0,00	15.011.282,91	430.523,36	2,95%	2,95%	2,98%
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - RB...	4.867,80	0,00	0,00	4.987,50	119,70	2,46%	2,46%	32,63%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	2.407.431,62	0,00	0,00	2.447.990,20	40.558,58	1,68%	1,68%	0,86%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	788.198,27	0,00	14.558,95	786.505,09	12.865,77	1,63%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	393.065,14	0,00	0,00	392.883,33	-181,81	-0,05%	-0,05%	0,00%
BTG PACTUAL FUNDO DE CRI FII - FEXC11	383.900,00	0,00	4.620,00	376.816,00	-2.464,00	-0,64%	-1,85%	4,97%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	9.560.952,70	0,00	0,00	9.256.770,88	-304.181,82	-3,18%	-3,18%	8,90%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	49.132.384,59	0,00	0,00	47.552.749,17	-1.579.635,42	-3,22%	-3,22%	8,99%
Total Renda Variável	176.508.423,35	0,00	64.737,68	181.963.452,54	5.519.766,87	3,13%		8,28%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	13.639.779,29	0,00	0,00	13.421.017,10	-218.762,19	-1,60%	-1,60%	11,62%
GLOBAL X CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTER...	5.892.015,15	0,00	0,00	5.763.511,73	-128.503,42	-2,18%	-2,18%	18,15%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	9.087.768,17	0,00	0,00	8.781.211,18	-306.556,99	-3,37%	-3,37%	8,53%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	21.154.106,91	0,00	0,00	20.398.943,26	-755.163,65	-3,57%	-3,57%	11,52%
Total Exterior	49.773.669,52	0,00	0,00	48.364.683,27	-1.408.986,25	-2,83%		11,79%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.