



R.I Relatório de Investimentos

AGOSTO/2022

JUSPREV 

Apresentação

A Lâmina de Rentabilidade consolida as informações enviadas pelas Gestoras de Ativos ICATU - Icatu Asset Management e Somma Investimentos S.A. e é disponibilizada mensalmente no site da JUSPREV para que os participantes possam acompanhar o desempenho dos fundos de investimentos. É destinado exclusivamente aos recursos aplicados pela JUSPREV e atende às exigências da Política de Investimentos e da Resolução CMN 4661.

Objetivo

O objetivo do plano é proporcionar valorização superior ao INPC + 4,35% a.a. que é a meta atuarial. A aplicação dos recursos é realizada por meio de fundos de investimento que investem diretamente em títulos e/ou em fundo de renda fixa, renda variável, multimercado e estruturados. A alocação dos recursos respeita os critérios de composição e diversificação definidos na legislação em vigor e estabelecidos no regulamento de cada fundo.

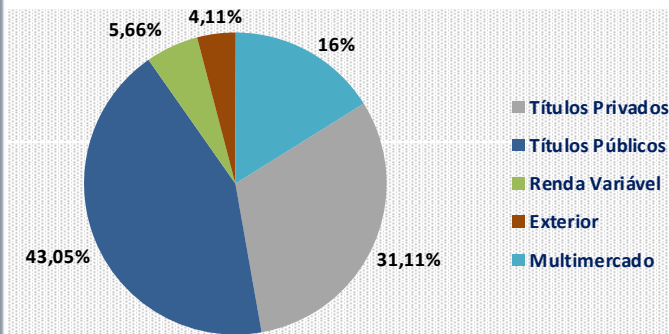
Performance dos Investimentos

Fundos de Investimentos	Patrimônio		Gestor	Rentabilidade					
				1M	12M	24M	36M	48M	60M
ICATU VANG FC FI MULT CRED PRIV JUSPREV ¹	156.850.280,82	37,05%	Icatu Asset Management	1,75%	4,87%	10,01%	12,89%	21,12%	29,43%
SOMMA JUSPREV ATIVO FI MULT CRED PRIV ²	163.453.574,99	38,61%	Somma Investimentos S.A.	1,56%	6,96%	10,68%	13,39%	22,30%	29,84%
SOMMA JUSPREV ALM FI MULT	103.046.591,31	24,34%	Somma Investimentos S.A.	0,00%	15,43%	33,13%	44,53%	58,59%	76,12%
TOTAL JUSPREV	423.350.447,12	100%		1,13%	7,68%	14,82%	18,57%	27,28%	36,54%

¹O Icatu Vanguarda assumiu a Gestão do Fundo a partir de 02/10/2017. Anterior a esta data, a Gestão do Fundo era de responsabilidade do Bradesco Asset Management.

²A Somma Investimentos S.A. assumiu a Gestão do Fundo a partir de 02/08/2021. Anterior a esta data, a Gestão do Fundo era de responsabilidade da Sul América Investimentos Gestora de Recursos S.A.

Composição

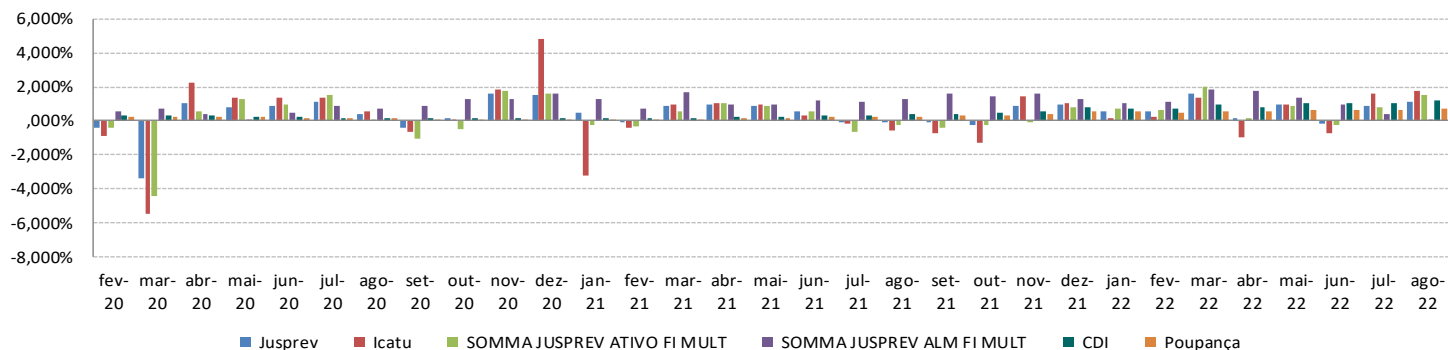


% CDI - FUNDO ICATU	149,31%	47,60%	75,64%	73,23%	84,56%	87,79%
% CDI - FUNDO SULAMÉRICA JUSPREV	133,17%	68,01%	80,77%	76,09%	89,28%	89,02%
% CDI - FUNDO JUSPREV FI MULT	0,16%	150,78%	250,45%	253,07%	234,53%	227,08%
% CDI - JUSPREV CONSOLIDADO	97,01%	75,02%	112,04%	105,53%	109,20%	109,00%
% POUPANÇA - FUNDO ICATU	235,28%	71,65%	112,40%	108,17%	124,46%	129,11%
% POUPANÇA - FUNDO SOMMA JUSPREV ATIVO	209,85%	102,37%	120,03%	112,39%	131,41%	130,92%
% POUPANÇA - FUNDO SOMMA JUSPREV ALM	0,25%	226,96%	372,17%	373,82%	345,19%	333,97%
% POUPANÇA - JUSPREV CONSOLIDADO	152,86%	112,93%	166,49%	155,88%	160,72%	160,31%
Excesso sobre INPC* + 4,35%	1,06%	-5,20%	-12,21%	-15,78%	-16,59%	-17,76%
Excesso sobre INPC* + 6%	0,91%	-6,68%	-14,90%	-19,47%	-20,98%	-22,82%

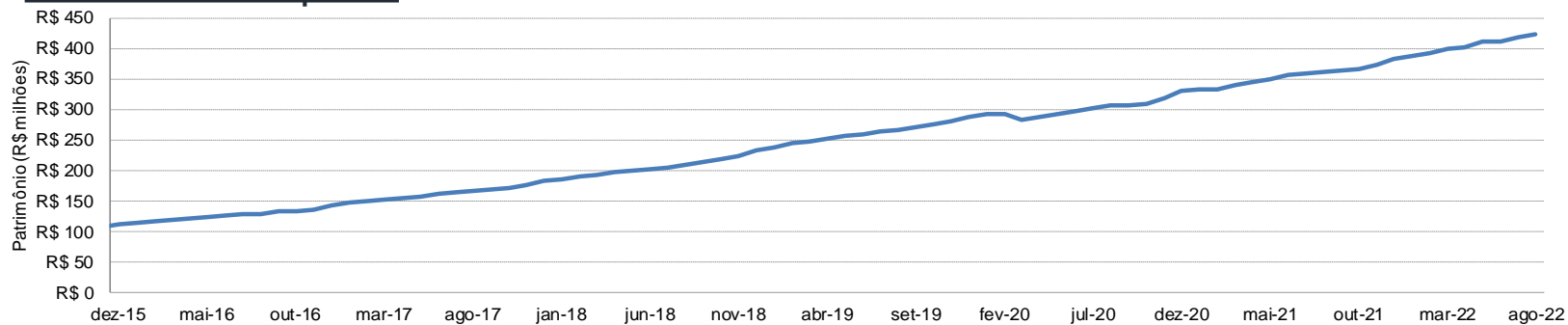
Rentabilidade Mensal Consolidada

2017	1,03%	0,85%	0,97%	0,66%	0,76%	0,73%	0,74%	0,90%	0,56%	0,64%	0,51%	0,68%	9,42%
CDI	1,08%	0,86%	1,05%	0,79%	0,93%	0,81%	0,80%	0,80%	0,64%	0,64%	0,57%	0,54%	9,93%
%CDI	94,73%	98,13%	92,82%	83,88%	82,61%	90,91%	93,25%	111,97%	87,15%	99,74%	90,36%	125,89%	94,89%
POUPANÇA	0,67%	0,53%	0,65%	0,50%	0,58%	0,55%	0,56%	0,55%	0,50%	0,47%	0,43%	0,43%	6,61%
%POUPANÇA	153,17%	159,82%	149,37%	131,74%	132,55%	132,63%	132,13%	162,81%	111,16%	136,78%	120,00%	158,40%	142,39%
2018	0,84%	0,51%	0,59%	0,49%	0,31%	0,65%	0,72%	0,55%	0,40%	0,82%	0,42%	0,48%	6,99%
CDI	0,58%	0,46%	0,53%	0,52%	0,52%	0,52%	0,54%	0,57%	0,47%	0,54%	0,49%	0,49%	6,42%
%CDI	144,68%	109,90%	111,13%	94,03%	60,81%	124,76%	132,23%	96,47%	85,41%	151,03%	85,37%	96,83%	108,84%
POUPANÇA	0,40%	0,40%	0,39%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	4,62%
%POUPANÇA	211,33%	127,94%	153,23%	130,99%	84,71%	173,80%	193,00%	147,22%	107,62%	220,77%	113,41%	128,64%	151,18%
2019	0,91%	0,47%	0,58%	0,76%	0,76%	0,62%	0,58%	0,32%	0,62%	0,61%	0,19%	0,93%	7,60%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,46%	0,48%	0,38%	0,37%	5,96%
%CDI	168,00%	94,56%	122,91%	147,28%	139,19%	132,62%	101,48%	63,31%	133,93%	127,73%	50,01%	248,56%	127,41%
POUPANÇA	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,34%	0,34%	0,32%	0,29%	0,29%	4,26%
%POUPANÇA	245,57%	125,63%	155,11%	205,48%	203,47%	167,36%	155,11%	92,84%	180,87%	194,15%	66,26%	324,40%	178,40%
2020	0,46%	-0,39%	-3,41%	1,05%	0,83%	0,87%	1,16%	0,38%	-0,44%	0,16%	1,57%	1,53%	3,74%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,23%	0,21%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	2,76%
%CDI	122,33%	-133,26%	-1006,90%	368,67%	392,49%	407,64%	599,25%	237,71%	-277,49%	103,71%	1053,37%	929,08%	135,70%
POUPANÇA	0,26%	0,26%	0,26%	0,22%	0,22%	0,17%	0,13%	0,13%	0,12%	0,12%	0,12%	0,12%	2,11%
%POUPANÇA	178,02%	-151,25%	-1316,48%	485,86%	424,69%	499,45%	893,77%	291,70%	-375,82%	140,46%	1358,67%	1318,29%	177,07%
2021	0,43%	-0,10%	0,88%	0,94%	0,89%	0,57%	-0,03%	-0,01%	-0,02%	-0,21%	0,91%	0,95%	5,38%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,31%	0,36%	0,43%	0,44%	0,49%	0,59%	0,77%	4,42%
%CDI	286,43%	-70,64%	437,15%	452,76%	330,82%	186,66%	-8,28%	-2,32%	-3,74%	-43,25%	155,72%	123,34%	121,66%
POUPANÇA	0,12%	0,12%	0,12%	0,16%	0,16%	0,20%	0,24%	0,24%	0,30%	0,36%	0,44%	0,56%	3,06%
%POUPANÇA	369,45%	-82,00%	758,46%	591,71%	562,43%	284,54%	-12,03%	-4,06%	-5,48%	-58,79%	207,09%	169,15%	175,97%
2022	0,54%	0,59%	1,65%	0,12%	0,99%	-0,14%	0,92%	1,13%					5,94%
CDI	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%	1,17%					7,75%
%CDI	74,03%	78,28%	177,69%	14,67%	95,82%	-14,11%	88,70%	97,01%					76,63%
POUPANÇA	0,56%	0,50%	0,60%	0,56%	0,65%	0,65%	0,66%	0,74%					5,04%
%POUPANÇA	96,67%	118,21%	275,65%	22,01%	152,73%	-22,07%	138,26%	152,86%					117,78%

Rentabilidade Mensal



Patrimônio Líquido



Histórico de Desempenho

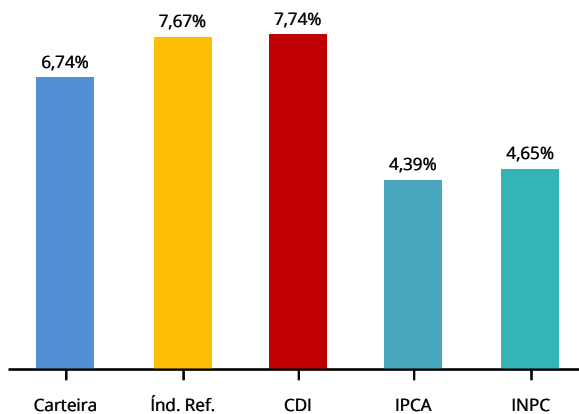
Início Período Considerado	6-ago-08	
	12 meses	Desde o início
Melhor Mês da JUSPREV	1,65%	2,10%
Melhor Mês do INPC + 4,35%	2,09%	2,09%
Melhor Mês do INPC + 6%	2,23%	2,23%
Pior Mês da JUSPREV	-0,21%	-3,41%
Pior Mês do INPC + 4,35%	2,09%	-0,25%
Pior Mês do INPC + 6%	2,23%	-0,12%
% de meses acima de INPC + 4,35%	25,00%	38,69%
% de meses acima de INPC + 6%	25,00%	33,33%
% de meses acima de CDI	25,00%	39,88%
Volatilidade da JUSPREV (a.a.)	-0,11%	0,23%

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: No cenário internacional, o mês ficou marcado por dados que mostraram resiliência da atividade econômica nos EUA. O mercado de trabalho, por exemplo, apresentou resultados acima do esperado. Com atividade resistente e a inflação ainda elevada, espera-se a continuidade do ritmo de aperto monetário, com novo aumento de 75 bps na reunião de setembro. Já na Zona do Euro, a prévia da inflação atingiu 9,1% em agosto, o maior patamar da série histórica. Apesar de dados mais fracos de atividade econômica, espera-se que o BCE continue o movimento de subida de juros na região. Na China, houve o anúncio de novos lockdowns, medidas que devem impactar o crescimento de economia chinesa em 2022, mesmo com novos estímulos do governo.

Economia Brasileira: No cenário doméstico, o mês ficou marcado pelo início das campanhas presidenciais. A expectativa é de uma eleição polarizada, com a decisão em segundo turno entre Lula e Bolsonaro. Também houve a apresentação da LDO 2023, com destaque para a continuidade do Auxílio Emergencial, mas em um valor menor, de R\$ 400. O PIB do 2º trimestre apresentou alta de 1,2% - resultado acima do esperado - em consonância com o bom desempenho da atividade econômica nos primeiros meses do ano. O IPCA-15 apresentou queda de 0,73%, condicionado por deflação em combustíveis e energia elétrica. O resultado da inflação reforça a expectativa da Selic terminando 2022 em 13,75%.

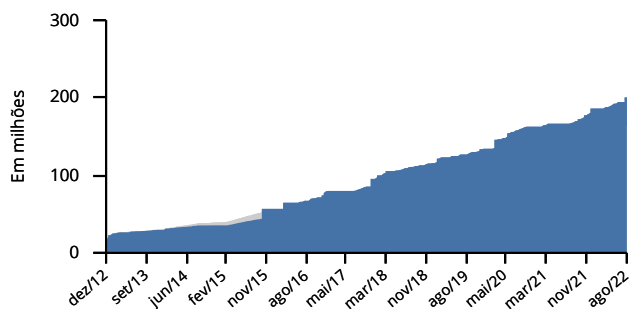
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



Mês	Set-21	Out-21	Nov-21	Dez-21	Jan-22	Fev-22	Mar-22	Abr-22	Mai-22	Jun-22	Jul-22	Ago-22	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev Ativo	(0,37)	(0,22)	(0,00)	0,81	0,69	0,66	1,98	0,14	0,90	(0,20)	0,84	1,56	6,74	6,96	10,68
Índ. Ref.	1,56	1,50	1,18	1,12	1,03	1,32	2,09	1,36	0,82	0,98	(0,25)	0,08	7,67	13,56	30,83
CDI	0,44	0,48	0,59	0,76	0,73	0,75	0,92	0,83	1,03	1,01	1,03	1,17	7,74	10,20	13,18
IPCA	1,16	1,25	0,95	0,73	0,54	1,01	1,62	1,06	0,47	0,67	(0,68)	(0,36)	4,39	8,73	19,25

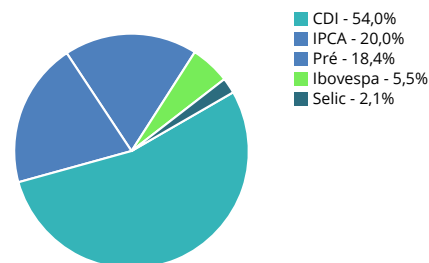
Índice de Referência INPC + 4.35% a.a.

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

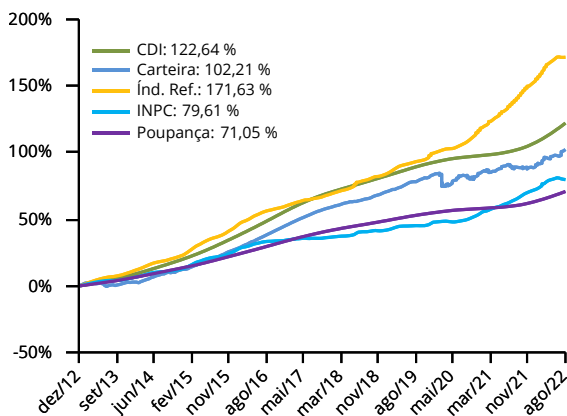


DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO

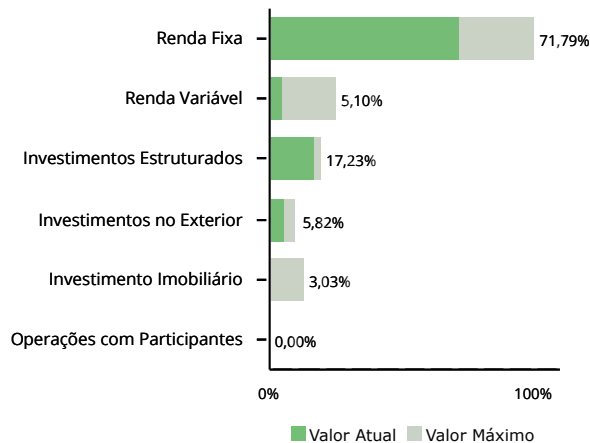
Patrimônio Líquido R\$ 163.453.574,99



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





SOMMA JUSPREV ATIVO FIM CRED PRIV
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
AGOSTO DE 2022

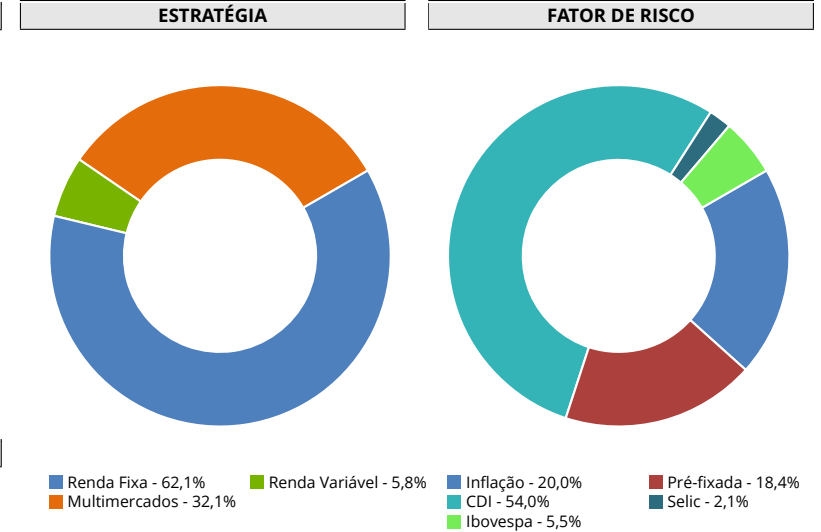
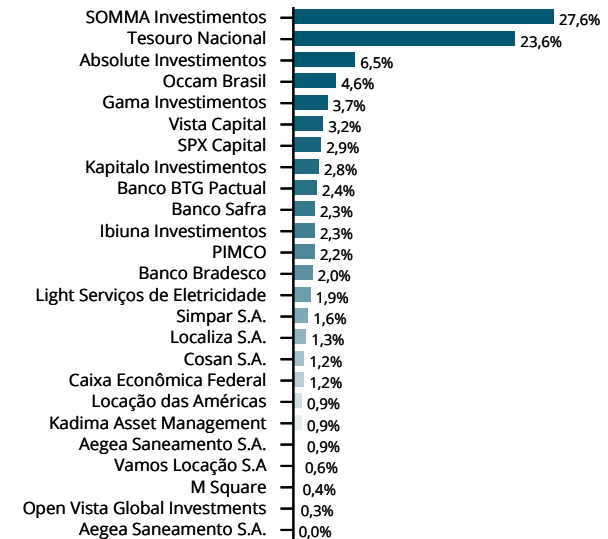


RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

Carteira Consolidada	3
Carteira Detalhada	4
Política de Investimento	6
Análise de Rentabilidade	7
Retorno da Carteira (R\$)	8
Rentabilidade da Carteira (%)	9
Relatório de Movimentações	10



ATIVOS	AGOSTO-22	%	JULHO-22	%
RENDA FIXA	69.347.318,95	42,4%	64.249.909,48	41,4%
Compromissada - Títulos Públicos	30.039.321,57	18,4%	25.225.201,11	16,3%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	1.470.187,51	0,9%	1.461.954,88	0,9%
Debênture - Cosan (CSAN33)	2.013.518,16	1,2%	2.049.849,53	1,3%
Debênture - JSL (JSMLB5)	2.612.799,51	1,6%	2.600.147,32	1,7%
Debênture - Light (LIGHD7)	3.142.470,47	1,9%	3.131.266,74	2,0%
Debênture - Localiza (LORTA7)	2.144.519,06	1,3%	2.134.267,96	1,4%
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	1.548.691,11	0,9%	1.529.701,28	1,0%
Debênture - Vamos (VAMO34)	1.045.614,20	0,6%	1.045.005,18	0,7%
Letra Financeira - Banco Bradesco	3.197.799,96	2,0%	3.154.332,52	2,0%
Letra Financeira - Banco Safra	3.826.511,58	2,3%	3.778.032,68	2,4%
Letra Financeira - BTG Pactual	3.844.831,84	2,4%	3.823.010,08	2,5%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	1.930.221,94	1,2%	1.900.295,90	1,2%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	12.530.832,04	7,7%	12.416.844,30	8,0%
FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555	94.124.780,51	57,6%	90.874.753,42	58,6%
Absolute Hiker Institucional FIC RF	6.024.909,17	3,7%	5.919.515,04	3,8%
Absolute Vertex Ii Fic Multimercado	4.670.644,79	2,9%	4.500.635,76	2,9%
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	3.746.640,59	2,3%	3.612.750,43	2,3%
Kadima IMA-B FIC RF CP	1.529.572,49	0,9%	1.519.789,80	1,0%
Kapitalo K10 FIC FIM	4.496.065,92	2,8%	4.378.308,85	2,8%
Lyxor Bridgewater Core Global Macro FIM IE	6.012.333,28	3,7%	6.095.481,71	3,9%
M SQUARE GLOBAL EQUITY IE FIC FIM	706.642,08	0,4%	731.868,69	0,5%
Occam Institucional Ii Fic Multimercado	7.574.568,91	4,6%	7.478.702,02	4,8%
Open Vista Tecnologia Global IE FIA	552.687,00	0,3%	567.501,68	0,4%
Pimco Income IE Fi Multimercado	3.666.588,95	2,2%	3.670.401,18	2,4%
SOMMA Firenze RF CP	11.568.790,71	7,1%	-	0,0%
SOMMA Institucional FIM	7.621.441,94	4,7%	7.465.205,24	4,8%
SOMMA Real Estate FIC FIM	4.000.934,82	2,4%	3.792.276,78	2,4%
SOMMA Selection FIC FIA	8.913.483,49	5,5%	8.428.153,20	5,4%
SOMMA Torino RF CP	13.042.035,81	8,0%	22.808.784,05	14,7%
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	4.732.585,60	2,9%	4.634.471,54	3,0%
Vista Hedge FIC FIM	5.264.854,96	3,2%	5.270.907,45	3,4%
TESOURARIA	(18.524,38)	0,0%	(13.361,93)	0,0%
Caixa	628,79	0,0%	1.000,00	0,0%
Valores a Pagar/Receber	(19.153,17)	0,0%	(14.361,93)	0,0%
TOTAL DA CARTEIRA	163.453.575,08	100%	155.111.300,97	100%

GRÁFICOS DE DISTRIBUIÇÃO

INSTITUIÇÃO²

¹O saldo deste item não é considerado no somatório do PL.

²Não estão incluídas ações e opções

RENDA FIXA									
Ativo - Emissor	Marcação	Data Aplicação	Data Vencimento	Indexador	Valor Aplicado	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
Compromissada - Títulos Públicos	Mercado	31/08/2022	01/09/2022	13,64% a.a.	30.039.321,57	30.039.321,57	-	30.039.321,57	18,38%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	Mercado	24/03/2022	15/07/2025	IPCA + 6,68%	-	1.356.121,24	-	1.356.121,24	0,83%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	Mercado	24/03/2022	15/07/2025	IPCA + 6,68%	-	12.674,03	-	12.674,03	0,01%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	Mercado	24/03/2022	15/07/2025	IPCA + 6,68%	-	101.392,24	-	101.392,24	0,06%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,97%	-	320.355,26	-	320.355,26	0,20%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,97%	-	496.098,74	-	496.098,74	0,30%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,97%	-	500.115,73	-	500.115,73	0,31%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,97%	-	696.948,43	-	696.948,43	0,43%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	11/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,60%	-	1.539.781,23	-	1.539.781,23	0,94%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	18/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,41%	-	231.771,95	-	231.771,95	0,14%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	18/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,41%	-	841.246,33	-	841.246,33	0,51%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,80%	-	1.179.931,44	-	1.179.931,44	0,72%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	16/03/2022	15/10/2026	IPCA + 7%	-	1.095.650,63	-	1.095.650,63	0,67%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,80%	-	96.320,93	-	96.320,93	0,06%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,80%	-	770.567,47	-	770.567,47	0,47%
Debênture - Localiza (LORTA7)	Mercado	11/03/2022	15/03/2031	IPCA + 7,50%	-	2.144.519,06	-	2.144.519,06	1,31%
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	Mercado	11/03/2022	15/09/2031	IPCA + 7,60%	-	1.548.691,11	-	1.548.691,11	0,95%
Debênture - Vamos (VAMO34)	Mercado	12/11/2021	15/10/2031	IPCA + 7,69%	-	1.045.614,20	-	1.045.614,20	0,64%
Letra Financeira - Banco Bradesco	Mercado	04/08/2017	21/11/2022	115% CDI	1.199.886,19	1.615.316,93	-	1.615.316,93	0,99%
Letra Financeira - Banco Bradesco	Mercado	14/11/2018	15/03/2024	100% Selic	1.500.000,00	1.582.483,03	-	1.582.483,03	0,97%
Letra Financeira - Banco Safra	Mercado	24/03/2022	26/03/2029	IPCA + 7,40%	1.600.000,00	1.691.261,81	-	1.691.261,81	1,03%
Letra Financeira - Banco Safra	Mercado	11/03/2022	12/03/2029	IPCA + 7,35%	2.000.000,00	2.135.249,77	-	2.135.249,77	1,31%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	29/10/2021	29/10/2026	IPCA + 7,49%	1.500.000,00	1.718.534,13	-	1.718.534,13	1,05%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	12/07/2022	19/08/2024	IPCA + 7,69%	273.654,04	276.309,55	-	276.309,55	0,17%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	11/07/2022	03/11/2023	IPCA + 6,97%	332.791,40	328.308,31	-	328.308,31	0,20%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	22/07/2022	01/09/2027	CDI + 2,20%	1.500.000,00	1.521.679,85	-	1.521.679,85	0,93%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	Mercado	12/09/2019	30/11/2024	100% Selic	1.800.000,00	1.930.221,94	-	1.930.221,94	1,18%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/07/2022	15/08/2030	IPCA + 6,26%	1.114.486,11	1.108.816,69	-	1.108.816,69	0,68%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	04/07/2022	15/05/2025	IPCA + 5,99%	301.675,52	301.677,54	-	301.677,54	0,18%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	14/03/2022	15/05/2025	IPCA + 5,80%	651.014,31	663.690,59	-	663.690,59	0,41%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	27/04/2022	15/05/2035	IPCA + 5,64%	2.910.366,69	2.842.114,94	-	2.842.114,94	1,74%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	05/07/2022	15/05/2025	IPCA + 5,98%	201.233,16	201.118,36	-	201.118,36	0,12%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	09/05/2022	15/05/2035	IPCA + 5,74%	3.111.050,96	3.045.123,15	-	3.045.123,15	1,86%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	23/06/2022	15/05/2025	IPCA + 5,79%	3.003.819,22	3.000.685,92	-	3.000.685,92	1,84%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/06/2022	15/05/2025	IPCA + 5,89%	1.006.366,48	1.005.591,80	-	1.005.591,80	0,62%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/03/2022	15/05/2025	IPCA + 5,79%	355.473,03	362.013,05	-	362.013,05	0,22%
TOTAL						69.347.318,95	-	69.347.318,95	42,43 %

FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555									
Nome do Fundo	Gestor	Liquidez	Quantidade de Cotas	Valor da Cota	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL		
Absolute Hiker Institucional FIC RF	Absolute Investimentos	D+4	5.235.924,4238291	1,1506868	-	6.024.909,17	3,69%		
Absolute Vertex II Fic Multimercado	Absolute Investimentos	D+29	2.092.475,6103136	2,2321143	-	4.670.644,79	2,86%		
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	Ibiuna	D+31	30.330,5490223	123,5269624	-	3.746.640,59	2,29%		
Kadima IMA-B FIC RF CP	Kadima Asset Management	D+5	1.523.503,2502472	1,0039837	-	1.529.572,49	0,94%		
Kapitalo K10 FIC FIM	Kapitalo Investimentos	D+30	2.609.841,1044542	1,7227355	-	4.496.065,92	2,75%		
Lyxor Bridgewater Core Global Macro FIM IE	Gama Investimentos	D+7	5.828.216,8743895	1,0315905	-	6.012.333,28	3,68%		
M SQUARE GLOBAL EQUITY IE FIC FIM	M Square	D+30	472.402,6835328	1,4958469	-	706.642,08	0,43%		

FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555							
Nome do Fundo	Gestor	Liquidez	Quantidade de Cotas	Valor da Cota	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
Occam Institucional II Fic Multimercado	Occam Brasil	D+0	3.200.467,2891628	2,3667072	-	7.574.568,91	4,63%
Open Vista Tecnologia Global IE FIA	Open Vista	D+6	3.687,6271305	149,8760539	-	552.687,00	0,34%
Pimco Income IE Fi Multimercado	PIMCO	D+1	2.064.135,4764934	1,7763315	-	3.666.588,95	2,24%
SOMMA Firenze RF CP	SOMMA Investimentos	D+32	11.495.831,2678400	1,0063466	-	11.568.790,71	7,08%
SOMMA Institucional FIM	SOMMA Investimentos	D+5	2.569.737,3620829	2,9658447	-	7.621.441,94	4,66%
SOMMA Real Estate FIC FIM	SOMMA Investimentos	D+60	3.726,9444757	1.073,5160795	-	4.000.934,82	2,45%
SOMMA Selection FIC FIA	SOMMA Investimentos	D+37	7.816.800,4562336	1,1402982	-	8.913.483,49	5,45%
SOMMA Torino RF CP	SOMMA Investimentos	D+1	10.259.625,3977180	1,2712000	-	13.042.035,81	7,98%
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	SPX Capital	D+60	1.965.878,6941731	2,4073640	-	4.732.585,60	2,90%
Vista Hedge FIC FIM	Vista Capital	D+16	2.978.777,4241687	1,7674550	-	5.264.854,96	3,22%
TOTAL					-	94.124.780,51	57,59 %

LIMITE DE ALOCAÇÃO POR ATIVO E SEGMENTO - PI vigente para o ano de 2020

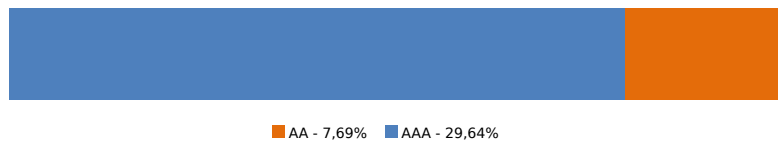
SEGMENTO	MAXIMO	ATUAL	MARGEM
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	71,79%	28,21%
Títulos Públicos Federais	100,00%	43,31%	56,69%
CDI/CDBs	80,00%	0,00%	80,00%
Letras Financeiras de Inst. Financeira	80,00%	9,48%	70,52%
Debêntures	20,00%	18,59%	1,41%
DPGE	20,00%	0,00%	20,00%
FIDC	20,00%	0,41%	19,59%
Outros Ativos de Renda Fixa	20,00%	0,00%	20,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	25,00%	5,10%	19,90%
Ações de Companhias Abertas	25,00%	5,10%	19,90%
SPE	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20,00%	14,20%	5,80%
FIP - Fundo de Investimento em Participações	5,00%	0,00%	5,00%
FIM - Fundos de Investimento Multimercado	15,00%	14,20%	0,80%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	10,00%	5,82%	4,18%
FIE - Fundo de Investimento no Exterior	10,00%	5,82%	4,18%
INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	10,00%	3,03%	6,97%
CCI	10,00%	0,00%	10,00%
CRI	10,00%	0,00%	10,00%
FII - Fundo Investimento Imobiliário	10,00%	3,03%	6,97%
TOTAL EM OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0,00%	0,00%	0,00%
Operações com Participante	0,00%	0,00%	0,00%
Total		100,00%	

RATINGS ESCALA NACIONAL DE LONGO PRAZO¹

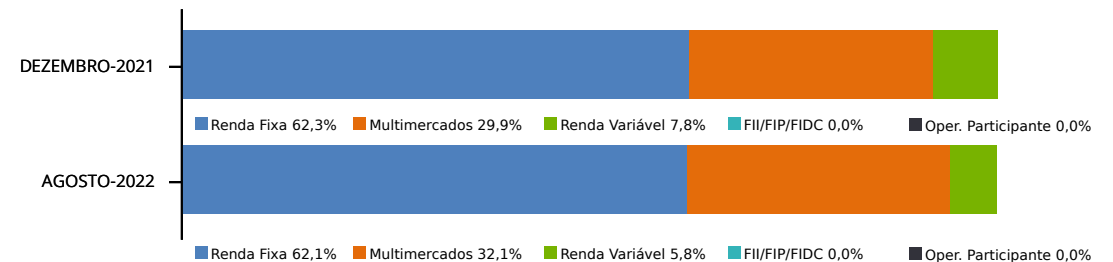
INSTITUIÇÃO/ATIVO	MÁXIMO	ATUAL	AGÊNCIAS DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO			
			FITCH	MOODY'S	S&P	AUSTIN
Segurança Máxima (AAA)	100,00%	29,64%				
Banco Bradesco	25,00%	1,96%	AAA(bra)	AAA.br	brAAA	-
Banco Safra	25,00%	2,34%	-	AAA.br	brAAA	-
Debênture - Cosan (CSAN33)	25,00%	1,23%	AAA(bra)	AAA.br	-	-
Debênture - Localiza (LORTA7)	25,00%	1,31%	AAA(bra)	-	-	-
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	25,00%	0,95%	AAA(bra)	-	brAAA	-
Tesouro Nacional	100,00%	21,85%	-	-	brAAA	-
Alta Segurança (AA)	100,00%	7,69%				
Banco BTG Pactual	25,00%	2,35%	AA(bra)	AAA.br	brAAA	-
Caixa Econômica Federal	25,00%	1,18%	AA(bra)	AAA.br	brAAA	-
Debênture - JSL (JSMLB5)	25,00%	1,60%	AAA(bra)	-	brAA	-
Debênture - Light (LIGHD7)	25,00%	1,92%	AA-(bra)	AA-.br	brAA+	-
Debênture - Vamos (VAMO34)	25,00%	0,64%	AAA(bra)	-	brAA+	-

LEGENDA
Nota elevada
Nota rebaixada

RATING DOS ATIVOS



MUTAÇÃO DE INVESTIMENTOS



¹Engloba Tesouro Nacional, Bancos, FIDCs e Debêntures

RENTABILIDADE	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES	
	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Renda Fixa						
Absolute Hiker Institucional FIC RF	1,78	2.276,9%	-	-	-	-
Compromissada - Títulos Públicos	1,17	1.492,1%	7,73	100,8%	10,19	75,1%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	0,56	720,1%	-	-	-	-
Debênture - Cosan (CSAN33)	1,19	1.519,6%	-	-	-	-
Debênture - JSL (JSMLB5)	0,49	622,3%	-	-	-	-
Debênture - Light (LIGHD7)	0,36	457,5%	-	-	-	-
Debênture - Localiza (LORTA7)	0,48	614,2%	-	-	-	-
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	1,24	1.587,5%	-	-	-	-
Debênture - Vamos (VAMO34)	0,06	74,6%	5,54	72,2%	-	-
Kadima IMA-B FIC RF CP	0,64	823,1%	3,93	51,2%	-	-
Letra Financeira - Banco Bradesco	1,38	1.762,1%	9,20	119,9%	14,11	104,1%
Letra Financeira - Banco Safra	1,28	1.640,9%	-	-	-	-
Letra Financeira - BTG Pactual	0,57	729,9%	5,94	77,4%	-	-
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	1,57	2.013,8%	9,42	122,8%	16,17	119,2%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	1,18	1.502,7%	-	-	-	-
SOMMA Torino RF CP	1,32	1.693,2%	8,51	111,0%	11,48	84,7%

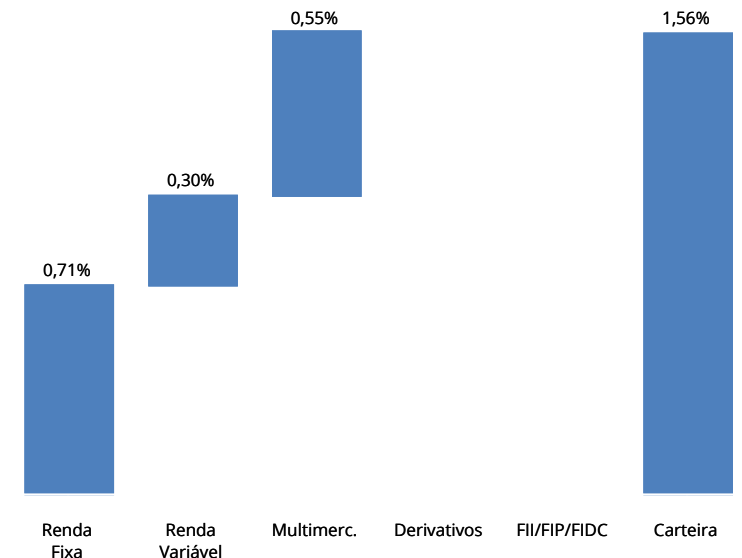
RENTABILIDADE	NO MÊS	NO ANO	EM 12 MESES
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	0,08	7,67	13,56
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	0,08	7,67	13,56
Renda Variável (INPC + 4.35% a.a.)	0,08	7,67	13,56
Estruturados (INPC + 6.50% a.a.)	0,26	9,14	15,90
Op. com Participante (CDI)	1,17	7,74	10,20
CDI	1,17	7,74	10,20
IPCA	-0,36	4,39	8,73
INPC	-0,31	4,65	8,83
Ibovespa	6,16	4,48	-7,79
Dólar	-0,18	-7,19	0,69

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	1,27	7,73	10,47
Renda Variável	5,30	-5,84	-14,02
Investimentos Estruturados	1,59	12,44	41,89
Investimentos no Exterior	0,00	0,00	0,00
Operação com participante	0,00	0,00	0,00

Renda Variável	%	Dif. Bench	%	Dif. Bench	%	Dif. Bench
Open Vista Tecnologia Global IE FIA	-2,61	-2,7	-36,18	-43,9	-	-
SOMMA Selection FIC FIA	5,76	5,7	-0,52	-8,2	7,20	-6,4

Multimercados	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Absolute Vertex Ii Fic Multimercado	3,78	1.427,6%	17,78	194,5%	21,71	136,5%
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	3,71	1.400,6%	-	-	-	-
Kapitalo K10 FIC FIM	2,69	1.016,5%	16,03	175,4%	-	-
Lyxor Bridgewater Core Global Macro FIM IE	-1,36	-	-14,21	-	-	-
M SQUARE GLOBAL EQUITY IE FIC FIM	-3,45	-	-29,80	-	-	-
Occam Institucional Ii Fic Multimercado	1,28	1.639,3%	6,73	87,7%	8,53	62,9%
Pimco Income IE Fi Multimercado	-0,10	-	-2,12	-	-0,19	-
SOMMA Institucional FIM	2,09	791,0%	9,41	103,0%	-	-
SOMMA Real Estate FIC FIM	5,50	7.036,1%	-	-	-	-
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	2,12	800,1%	22,70	248,4%	31,49	198,1%
Vista Hedge FIC FIM	-0,11	-	20,82	227,8%	-	-

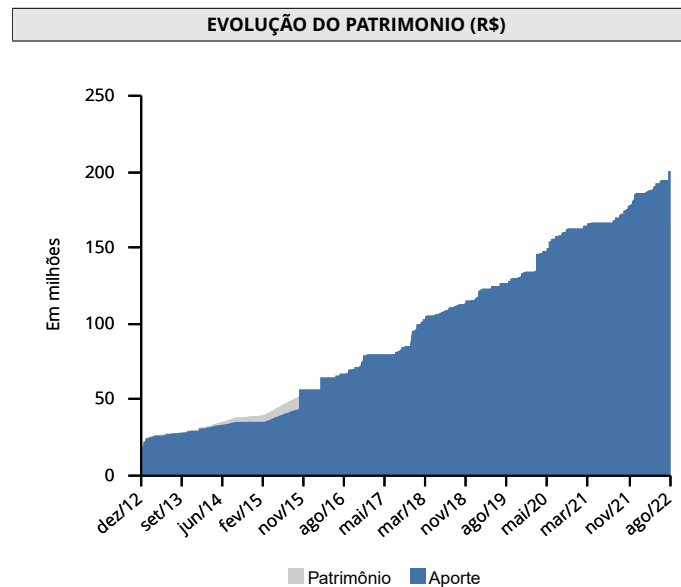
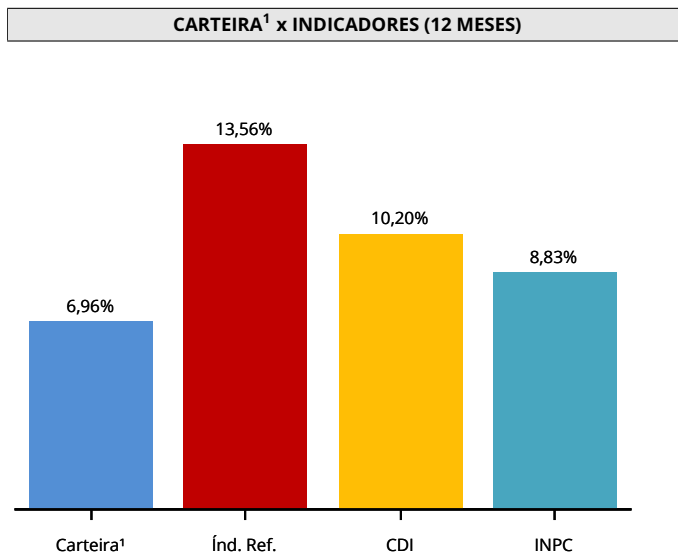
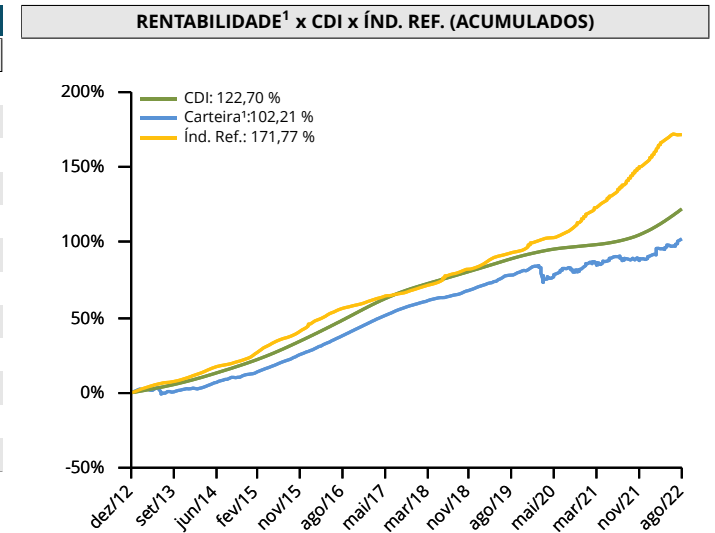
COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA



RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	1º SEM	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	NO ANO
RENDA FIXA	5.221.272,96	380.011,76	1.102.833,55	-	-	-	-	6.704.118,27
Absolute Hiker Institucional FIC RF	366.280,30	53.234,74	105.394,13	-	-	-	-	524.909,17
BTG Pactual Crédito Corporativo I FIC FI RF	700.900,35	-	-	-	-	-	-	700.900,35
Compromissada - Títulos Públicos	1.476.862,52	280.350,50	308.255,19	-	-	-	-	2.065.468,21
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	47.098,47	1.551,55	8.232,63	-	-	-	-	56.882,65
Debênture - CCR (CCRDB1)	4.317,89	-	-	-	-	-	-	4.317,89
Debênture - Cosan (CSAN33)	69.867,11	(24.739,10)	25.336,26	-	-	-	-	70.464,27
Debênture - JSL (JSMLB5)	152.183,59	(31.291,14)	12.652,19	-	-	-	-	133.544,64
Debênture - Light (LIGHD7)	140.857,83	(4.974,11)	11.203,73	-	-	-	-	147.087,45
Debênture - Localiza (LORTA7)	142.296,97	(28.461,67)	10.251,10	-	-	-	-	124.086,40
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	94.875,21	(21.343,89)	18.989,83	-	-	-	-	92.521,15
Debênture - Vamos (VAMO34)	65.434,57	(9.529,48)	609,02	-	-	-	-	56.514,11
Kadima IMA-B FIC RF CP	55.485,50	(7.358,90)	9.782,69	-	-	-	-	57.909,29
Letra Financeira - Banco Bradesco	190.756,75	37.578,62	43.467,44	-	-	-	-	271.802,81
Letra Financeira - Banco Safra	212.563,92	(34.531,24)	48.478,90	-	-	-	-	226.511,58
Letra Financeira - BTG Pactual	96.106,35	9.062,07	21.821,76	-	-	-	-	126.990,18
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	111.985,64	24.310,17	29.926,04	-	-	-	-	166.221,85
Notas do Tesouro Nacional - Série B	77.080,11	(116.461,60)	146.390,17	-	-	-	-	107.008,68
SOMMA Firenze RF CP	-	-	68.790,71	-	-	-	-	68.790,71
SOMMA Torino RF CP	1.216.319,88	252.615,24	233.251,76	-	-	-	-	1.702.186,88
RENDA VARIÁVEL	(1.876.836,28)	540.793,38	470.515,61	-	-	-	-	(865.527,29)
Carteira de Ações/Opções/Op. Estruturadas	(347.973,83)	-	-	-	-	-	-	(347.973,83)
Open Vista Tecnologia Global IE FIA	(515.374,40)	59.576,29	(14.814,68)	-	-	-	-	(470.612,79)
SOMMA Selection FIC FIA	(1.013.488,05)	481.217,09	485.330,29	-	-	-	-	(46.940,67)
MULTIMERCADOS	2.707.081,29	392.442,69	862.292,19	-	-	-	-	3.961.816,17
Absolute Vertex li Fic Multimercado	554.833,46	(19.130,87)	170.009,03	-	-	-	-	705.711,62
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	238.485,19	(75.734,76)	133.890,16	-	-	-	-	296.640,59
Ibiuna Hedge Sth Fic Multimercado	204.744,38	-	-	-	-	-	-	204.744,38
Itaú Distribuidores Hedge Plus Fic Multimercado	80.009,81	-	-	-	-	-	-	80.009,81
Kapitalo K10 FIC FIM	490.636,45	888,13	117.757,07	-	-	-	-	609.281,65
Lyxor Bridgewater Core Global Macro FIM IE	(156.413,83)	(39.684,44)	(83.148,43)	-	-	-	-	(279.246,70)
M SQUARE GLOBAL EQUITY IE FIC FIM	(575.619,90)	51.137,93	(25.226,61)	-	-	-	-	(549.708,58)
Novus Institucional Fic Multimercado	15.447,54	-	-	-	-	-	-	15.447,54
Occam Institucional li Fic Multimercado	233.187,97	48.570,64	95.866,89	-	-	-	-	377.625,50
Pimco Income IE Fi Multimercado	(220.226,50)	144.618,41	(3.812,23)	-	-	-	-	(79.420,32)
SOMMA Institucional FIM	313.161,58	101.960,24	156.236,70	-	-	-	-	571.358,52
SOMMA Real Estate FIC FIM	16.313,06	25.963,72	208.658,04	-	-	-	-	250.934,82
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	808.716,09	(55.680,96)	98.114,06	-	-	-	-	851.149,19
Vista Hedge FIC FIM	703.805,99	209.534,65	(6.052,49)	-	-	-	-	907.288,15
TOTAL	6.051.517,97	1.313.247,83	2.435.641,35	-	-	-	-	9.800.407,15

RESULTADOS DE 2022			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	0,69	1,03	66,87%
Fevereiro	0,66	1,32	50,17%
Março	1,98	2,09	94,64%
Abril	0,14	1,36	10,25%
Mai	0,90	0,82	109,81%
Junho	(0,20)	0,98	-
Julho	0,84	(0,25)	-
Agosto	1,56	0,08	1.991,90%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Total	6,74	7,67	87,94%

INDICADORES DE MERCADO				
CDI	IPCA	INPC	Ibovespa	Dólar
0,73	0,54	0,67	6,98	(4,00)
0,75	1,01	1,00	0,89	(4,07)
0,92	1,62	1,71	6,06	(7,81)
0,83	1,06	1,04	(10,10)	3,83
1,03	0,47	0,45	3,22	(3,87)
1,01	0,67	0,62	(11,50)	10,77
1,03	(0,68)	(0,60)	4,69	(0,95)
1,17	(0,36)	(0,31)	6,16	(0,18)
7,74	4,39	4,65	4,48	(7,19)



RESULTADOS DE 2021			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	(0,26)	0,61	-
Fevereiro	(0,32)	1,13	-
Março	0,54	1,25	42,74%
Abril	1,01	0,72	139,94%
Mai	0,88	1,32	66,81%
Junho	0,58	0,96	60,26%
Julho	(0,60)	1,40	-
Agosto	(0,23)	1,26	-
Setembro	(0,37)	1,56	-
Outubro	(0,22)	1,50	-
Novembro	(0,00)	1,18	-
Dezembro	0,81	1,12	71,76%
Total	1,79	14,93	12,00%

¹A rentabilidade da carteira é baseado na cota Bruta

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO
15/08/2022	-61.667,63	Juros	Debênture - Cosan (CSAN33)
15/08/2022	-32.402,43	Juros	Notas do Tesouro Nacional - Série B
16/08/2022	10.000.000,00	Aplicação	SOMMA Firenze RF CP
16/08/2022	-10.000.000,00	Resgate	SOMMA Torino RF CP
23/08/2022	1.500.000,00	Aplicação	SOMMA Firenze RF CP

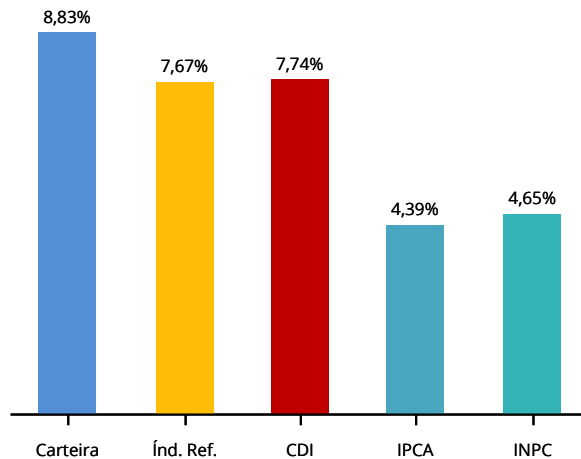
RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: No cenário internacional, o mês ficou marcado por dados que mostraram resiliência da atividade econômica nos EUA. O mercado de trabalho, por exemplo, apresentou resultados acima do esperado. Com atividade resistente e a inflação ainda elevada, espera-se a continuidade do ritmo de aperto monetário, com novo aumento de 75 bps na reunião de setembro. Já na Zona do Euro, a prévia da inflação atingiu 9,1% em agosto, o maior patamar da série histórica. Apesar de dados mais fracos de atividade econômica, espera-se que o BCE continue o movimento de subida de juros na região. Na China, houve o anúncio de novos lockdowns, medidas que devem impactar o crescimento de economia chinesa em 2022, mesmo com novos estímulos do governo.

Economia Brasileira: No cenário doméstico, o mês ficou marcado pelo início das campanhas presidenciais. A expectativa é de uma eleição polarizada, com a decisão em segundo turno entre Lula e Bolsonaro. Também houve a apresentação da LDO 2023, com destaque para a continuidade do Auxílio Emergencial, mas em um valor menor, de R\$ 400. O PIB do 2º trimestre apresentou alta de 1,2% - resultado acima do esperado - em consonância com o bom desempenho da atividade econômica nos primeiros meses do ano. O IPCA-15 apresentou queda de 0,73%, condicionado por deflação em combustíveis e energia elétrica. O resultado da inflação reforça a expectativa da Selic terminando 2022 em 13,75%.

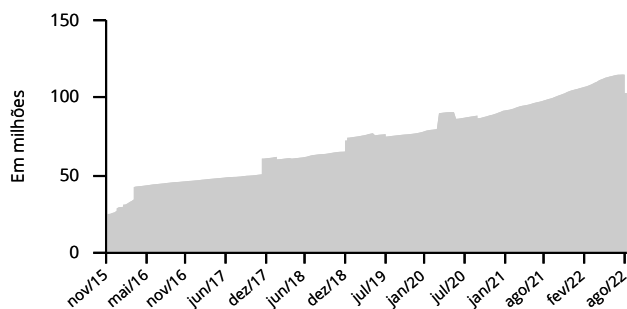
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



Mês	Set-21	Out-21	Nov-21	Dez-21	Jan-22	Fev-22	Mar-22	Abr-22	Mai-22	Jun-22	Jul-22	Ago-22	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev ALM CP	1,58	1,43	1,63	1,28	1,06	1,12	1,83	1,74	1,41	0,94	0,42	0,00	8,83	15,43	33,13
Índ. Ref.	1,56	1,50	1,18	1,12	1,03	1,32	2,09	1,36	0,82	0,98	(0,25)	0,08	7,67	13,56	30,83
CDI	0,44	0,48	0,59	0,76	0,73	0,75	0,92	0,83	1,03	1,01	1,03	1,17	7,74	10,20	13,18
IPCA	1,16	1,25	0,95	0,73	0,54	1,01	1,62	1,06	0,47	0,67	(0,68)	(0,36)	4,39	8,73	19,25

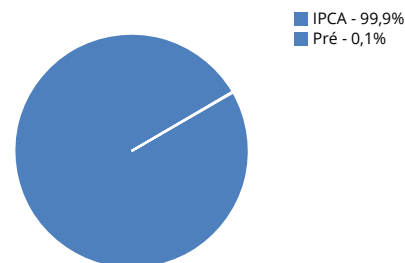
Índice de Referência INPC + 4.35% a.a.

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

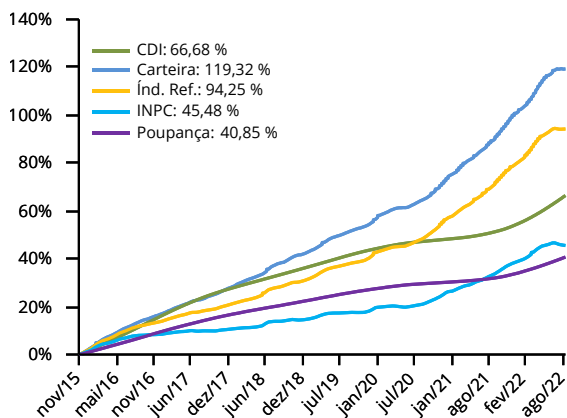


DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO

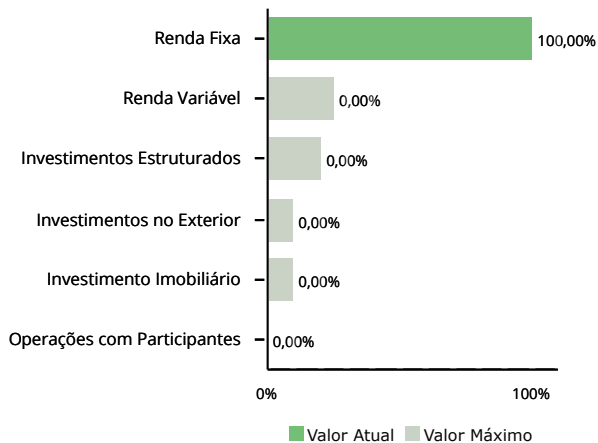
Patrimônio Líquido R\$ 103.046.591,31



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





SOMMA JUSPREV ALM CP
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
AGOSTO DE 2022

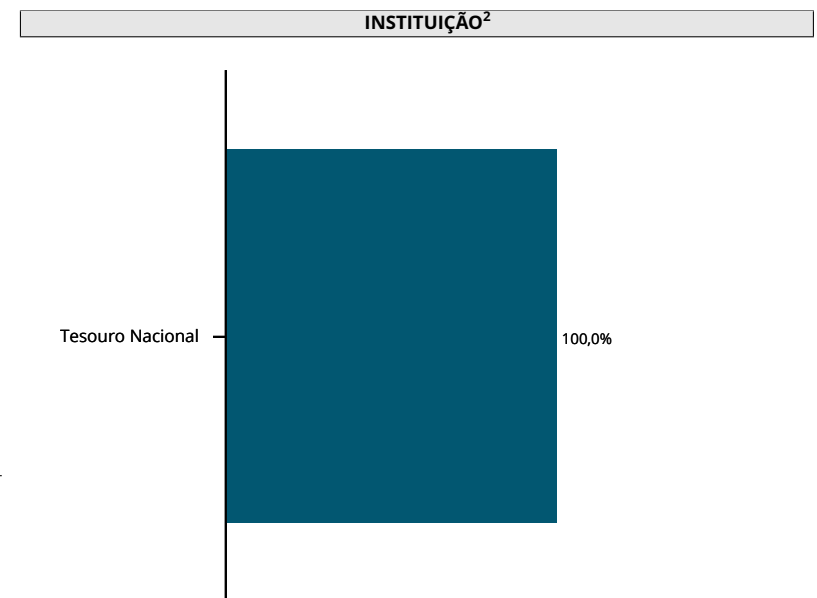
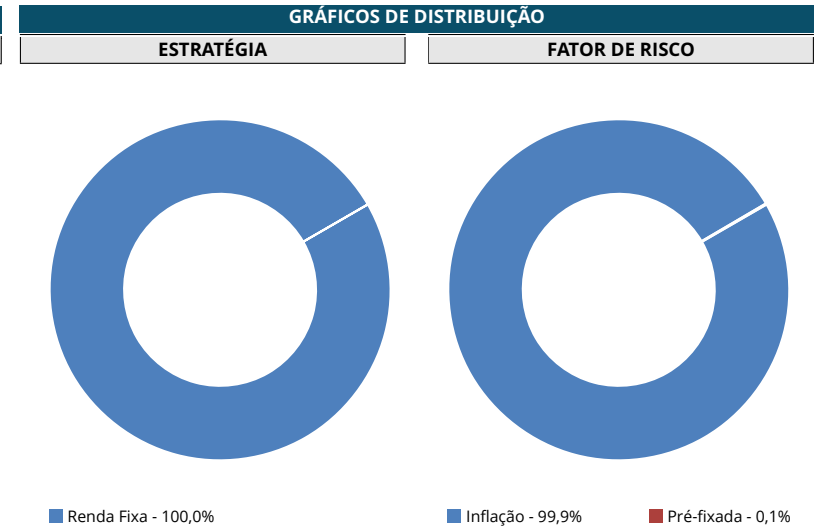


RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

Carteira Consolidada	3
Carteira Detalhada	4
Política de Investimento	5
Análise de Rentabilidade	6
Retorno da Carteira (R\$)	7
Rentabilidade da Carteira (%)	8
Relatório de Movimentações	9



ATIVOS	AGOSTO-22	%	JULHO-22	%
RENDA FIXA	103.054.899,35	100,0%	114.909.841,19	100,0%
Compromissada - Títulos Públicos	116.294,18	0,1%	349.234,16	0,3%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	102.938.605,17	99,9%	114.560.607,03	99,7%
TESOURARIA	(8.308,02)	0,0%	(5.364,56)	0,0%
Caixa	1.000,00	0,0%	1.000,00	0,0%
Valores a Pagar/Receber	(9.308,02)	0,0%	(6.364,56)	0,0%
TOTAL DA CARTEIRA	103.046.591,33	100%	114.904.476,63	100%



¹O saldo deste item não é considerado no somatório do PL.

²Não estão inclusas ações e opções

RENDA FIXA									
Ativo - Emissor	Marcação	Data Aplicação	Data Vencimento	Indexador	Valor Aplicado	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
Compromissada - Títulos Públicos	Mercado	31/08/2022	01/09/2022	13,64% a.a.	116.294,18	116.294,18	-	116.294,18	0,11%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	19/06/2018	15/05/2055	IPCA + 5,91%	1.261.769,06	1.637.648,27	-	1.637.648,27	1,59%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/03/2016	15/05/2023	IPCA + 6,40%	855.964,59	1.207.776,78	-	1.207.776,78	1,17%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	20/12/2021	15/08/2024	IPCA + 5,38%	1.988.955,26	2.001.025,61	-	2.001.025,61	1,94%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	20/12/2021	15/08/2026	IPCA + 5,14%	2.026.188,29	2.033.831,00	-	2.033.831,00	1,97%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/11/2015	15/05/2023	IPCA + 7,38%	1.223.238,40	1.880.449,20	-	1.880.449,20	1,82%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	20/12/2021	15/05/2025	IPCA + 5,26%	1.975.667,08	2.051.407,26	-	2.051.407,26	1,99%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/11/2015	15/05/2023	IPCA + 7,35%	4.953.157,53	7.603.253,36	-	7.603.253,36	7,38%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	20/12/2021	15/05/2023	IPCA + 5,80%	1.937.738,72	2.030.412,38	-	2.030.412,38	1,97%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	18/11/2015	15/05/2023	IPCA + 7,18%	5.118.088,52	8.011.732,37	-	8.011.732,37	7,77%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	25/05/2022	15/08/2024	IPCA + 5,78%	3.031.373,67	2.942.684,72	-	2.942.684,72	2,86%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/03/2016	15/05/2023	IPCA + 6,38%	3.256.186,12	4.590.135,72	-	4.590.135,72	4,45%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	24/12/2018	15/08/2024	IPCA + 4,47%	1.348.172,69	1.593.428,84	-	1.593.428,84	1,55%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	31/05/2017	15/08/2026	IPCA + 5,65%	1.493.159,87	1.923.316,19	-	1.923.316,19	1,87%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	22/08/2018	15/08/2030	IPCA + 5,65%	2.048.893,74	2.574.466,65	-	2.574.466,65	2,50%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/11/2015	15/05/2035	IPCA + 7%	5.062.404,62	7.439.306,22	-	7.439.306,22	7,22%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	14/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,31%	241.312,77	362.710,50	-	362.710,50	0,35%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,44%	860.308,17	1.292.089,02	-	1.292.089,02	1,25%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,34%	121.192,13	180.937,52	-	180.937,52	0,18%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,54%	474.768,52	711.994,34	-	711.994,34	0,69%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	13/01/2016	15/05/2035	IPCA + 7,34%	549.253,50	814.056,43	-	814.056,43	0,79%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/02/2016	15/05/2035	IPCA + 7,40%	1.703.916,03	2.484.575,80	-	2.484.575,80	2,41%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/03/2016	15/05/2055	IPCA + 6,38%	4.095.944,22	5.688.253,14	-	5.688.253,14	5,52%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	28/08/2020	15/08/2050	IPCA + 4%	1.114.803,90	1.321.479,37	-	1.321.479,37	1,28%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/08/2020	15/08/2050	IPCA + 3,90%	1.130.879,32	1.341.563,09	-	1.341.563,09	1,30%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	16/03/2020	15/08/2050	IPCA + 4,45%	10.007.893,59	11.864.833,89	-	11.864.833,89	11,51%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/01/2019	15/08/2050	IPCA + 4,60%	2.378.295,32	2.901.959,06	-	2.901.959,06	2,82%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	16/03/2016	15/08/2050	IPCA + 6,82%	1.153.894,05	1.615.259,72	-	1.615.259,72	1,57%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/01/2019	15/05/2045	IPCA + 4,62%	1.922.501,16	2.395.982,29	-	2.395.982,29	2,33%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	02/01/2019	15/05/2045	IPCA + 4,98%	2.093.975,28	2.626.985,85	-	2.626.985,85	2,55%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	24/12/2018	15/05/2045	IPCA + 5,02%	1.340.943,59	1.685.305,18	-	1.685.305,18	1,64%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,28%	73.843,71	104.903,03	-	104.903,03	0,10%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,28%	1.058.426,68	1.503.610,37	-	1.503.610,37	1,46%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,28%	172.302,01	244.773,77	-	244.773,77	0,24%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	30/12/2015	15/05/2045	IPCA + 7,32%	947.095,85	1.392.280,10	-	1.392.280,10	1,35%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/11/2017	15/05/2035	IPCA + 5,28%	9.842.760,14	12.884.178,13	-	12.884.178,13	12,50%
TOTAL						103.054.899,35	-	103.054.899,35	100,01 %

LIMITE DE ALOCAÇÃO POR ATIVO E SEGMENTO - PI vigente para o ano de 2020

SEGMENTO	MAXIMO	ATUAL	MARGEM
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	100,00%	0,00%
Títulos Públicos Federais	100,00%	100,00%	0,00%
CDI/CDBs	80,00%	0,00%	80,00%
Letras Financeiras de Inst. Financeira	80,00%	0,00%	80,00%
Debêntures	20,00%	0,00%	20,00%
DPGE	20,00%	0,00%	20,00%
FIDC	20,00%	0,00%	20,00%
Outros Ativos de Renda Fixa	20,00%	0,00%	20,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	25,00%	0,00%	25,00%
Ações de Companhias Abertas	25,00%	0,00%	25,00%
SPE	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20,00%	0,00%	20,00%
FIP - Fundo de Investimento em Participações	5,00%	0,00%	5,00%
FIM - Fundos de Investimento Multimercado	15,00%	0,00%	15,00%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	10,00%	0,00%	10,00%
FIE - Fundo de Investimento no Exterior	10,00%	0,00%	10,00%
INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	10,00%	0,00%	10,00%
CCI	10,00%	0,00%	10,00%
CRI	10,00%	0,00%	10,00%
FII - Fundo Investimento Imobiliário	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL EM OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0,00%	0,00%	0,00%
Operações com Participante	0,00%	0,00%	0,00%
Total		100,00%	

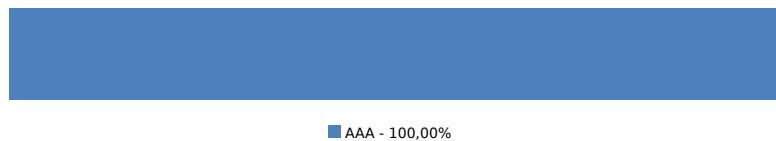
RATINGS ESCALA NACIONAL DE LONGO PRAZO¹

INSTITUIÇÃO/ATIVO	MÁXIMO	ATUAL	AGÊNCIAS DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO			
Segurança Máxima (AAA)	100,00%	100,00%	FITCH	MOODY'S	S&P	AUSTIN
Tesouro Nacional	100,00%	100,00%	-	-	brAAA	-

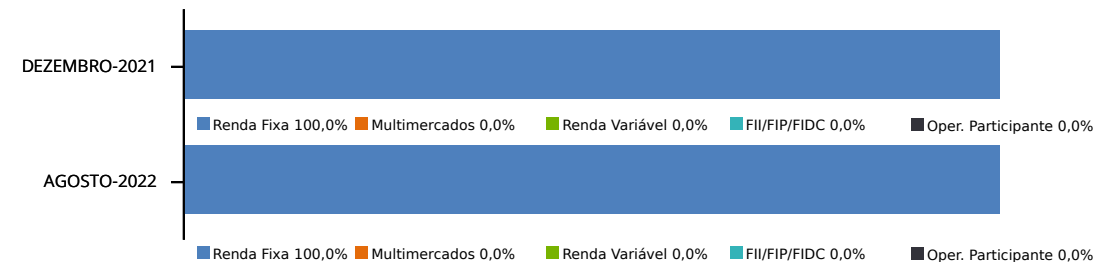
LEGENDA

Nota elevada
Nota rebaixada

RATING DOS ATIVOS



MUTAÇÃO DE INVESTIMENTOS



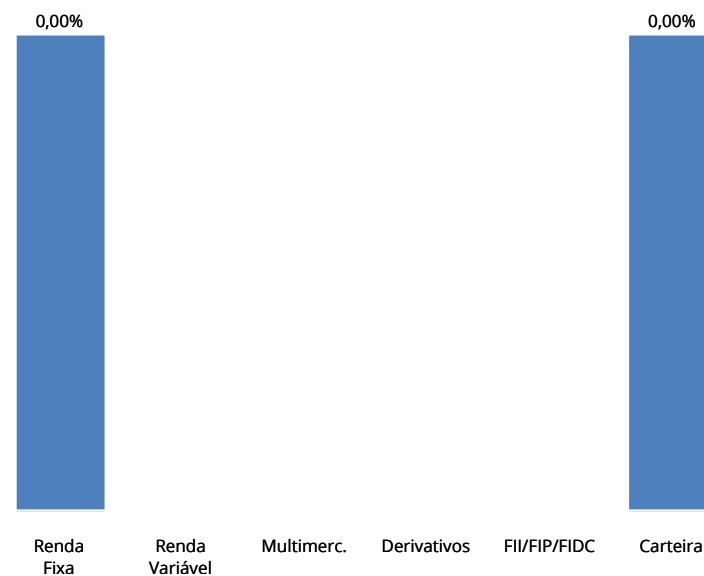
¹Engloba Tesouro Nacional, Bancos, FIDCs e Debêntures

RENTABILIDADE	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES	
	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Renda Fixa						
Compromissada - Títulos Públicos	1,17	1.492,1%	7,73	100,8%	10,19	75,1%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	-0,02	-	8,95	116,7%	15,91	117,3%

RENTABILIDADE INDICADORES	NO MÊS %	NO ANO %	EM 12 MESES %
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	0,08	7,67	13,56
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	0,08	7,67	13,56
Op. com Participante (0% CDI)	0,00	0,00	0,00
CDI	1,17	7,74	10,20
IPCA	-0,36	4,39	8,73
INPC	-0,31	4,65	8,83
Ibovespa	6,16	4,48	-7,79
Dólar	-0,18	-7,19	0,69

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	0,02	8,77	15,27
Renda Variável	0,00	0,00	0,00
Investimentos Estruturados	0,00	0,00	0,00
Investimentos no Exterior	0,00	0,00	0,00
Operação com participante	0,00	0,00	0,00

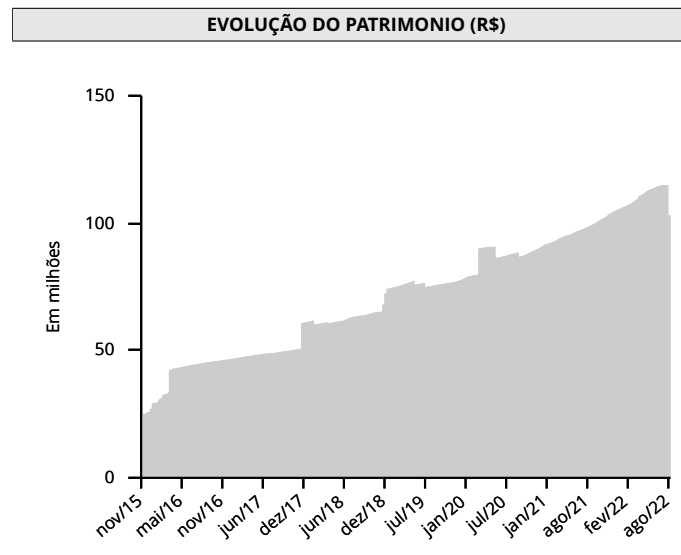
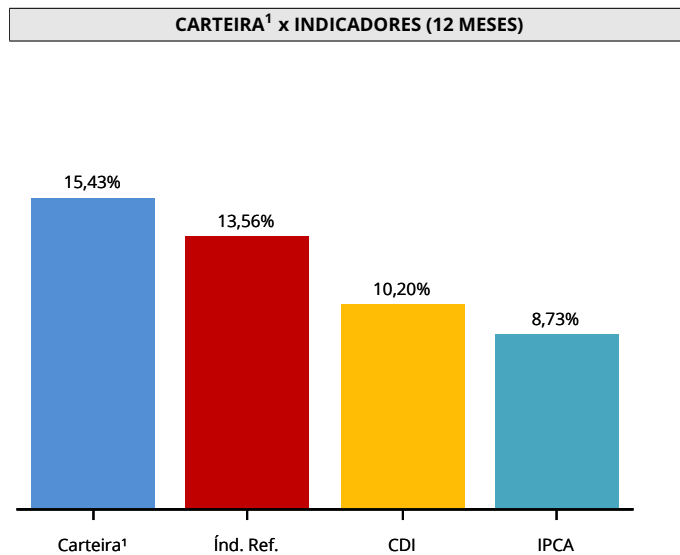
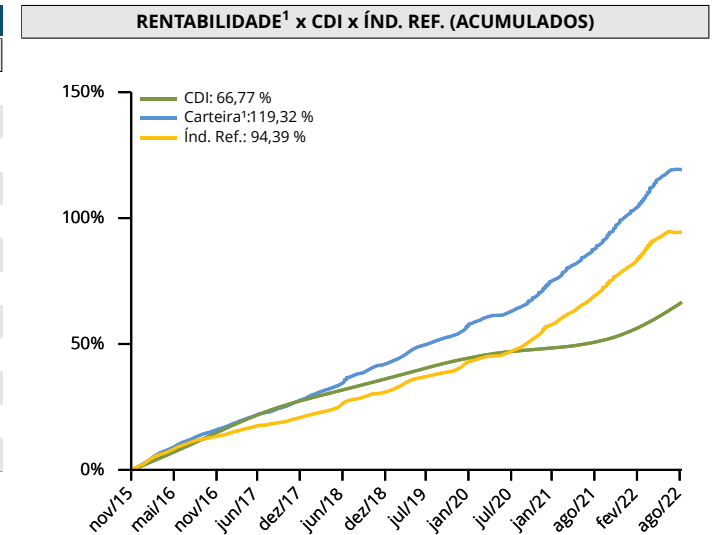
COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA



RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	1º SEM	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	NO ANO
RENDA FIXA	8.943.004,89	494.297,18	17.385,47	-	-	-	-	9.454.687,54
Compromissada - Títulos Públicos	54.198,47	3.618,10	38.669,87	-	-	-	-	96.486,44
Notas do Tesouro Nacional - Série B	8.888.806,42	490.679,08	(21.284,40)	-	-	-	-	9.358.201,10
TOTAL	8.943.004,89	494.297,18	17.385,47	-	-	-	-	9.454.687,54

RESULTADOS DE 2022			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	1,06	1,03	102,68%
Fevereiro	1,12	1,32	84,91%
Março	1,83	2,09	87,80%
Abril	1,74	1,36	127,72%
Mai	1,41	0,82	170,92%
Junho	0,94	0,98	95,86%
Julho	0,42	(0,25)	-
Agosto	0,00	0,08	2,40%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Total	8,83	7,67	115,24%

INDICADORES DE MERCADO				
CDI	IPCA	INPC	Ibovespa	Dólar
0,73	0,54	0,67	6,98	(4,00)
0,75	1,01	1,00	0,89	(4,07)
0,92	1,62	1,71	6,06	(7,81)
0,83	1,06	1,04	(10,10)	3,83
1,03	0,47	0,45	3,22	(3,87)
1,01	0,67	0,62	(11,50)	10,77
1,03	(0,68)	(0,60)	4,69	(0,95)
1,17	(0,36)	(0,31)	6,16	(0,18)
7,74	4,39	4,65	4,48	(7,19)



RESULTADOS DE 2021			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	1,30	0,61	213,01%
Fevereiro	0,76	1,13	67,71%
Março	1,67	1,25	132,94%
Abril	0,94	0,72	130,94%
Mai	0,98	1,32	74,23%
Junho	1,20	0,96	125,12%
Julho	1,15	1,40	82,44%
Agosto	1,30	1,26	103,49%
Setembro	1,58	1,56	101,47%
Outubro	1,43	1,50	95,28%
Novembro	1,63	1,18	138,28%
Dezembro	1,28	1,12	114,22%
Total	16,33	14,93	109,36%

¹A rentabilidade da carteira é baseado na cota Bruta

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES

DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO
15/08/2022	-847.746,16	Juros	Notas do Tesouro Nacional - Série B
15/08/2022	-10.752.971,30	Resgate	Notas do Tesouro Nacional - Série B

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES

DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO
------	-------	----------	-------

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

2017	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	0,98%	0,78%	0,90%	0,67%	0,90%	0,53%	0,45%	1,01%	0,55%	0,92%	0,86%	0,73%	9,68%
Rent. Líquida	0,98%	0,78%	0,90%	0,67%	0,90%	0,53%	0,45%	1,01%	0,55%	0,92%	0,86%	0,73%	9,68%
CDI	1,09%	0,87%	1,05%	0,79%	0,93%	0,81%	0,80%	0,80%	0,64%	0,65%	0,57%	0,54%	9,95%
Índice Ref.	0,79%	0,55%	0,71%	0,38%	0,73%	0,05%	0,53%	0,36%	0,32%	0,73%	0,52%	0,60%	6,45%

2018	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,08%	0,67%	0,76%	0,70%	0,72%	1,40%	1,38%	0,76%	0,58%	1,14%	0,62%	0,38%	10,67%
Rent. Líquida	1,08%	0,67%	0,76%	0,70%	0,72%	1,40%	1,38%	0,76%	0,58%	1,14%	0,62%	0,38%	10,67%
CDI	0,58%	0,47%	0,53%	0,52%	0,52%	0,52%	0,54%	0,57%	0,47%	0,54%	0,49%	0,49%	6,42%
Índice Ref.	0,60%	0,49%	0,43%	0,57%	0,79%	1,79%	0,62%	0,39%	0,62%	0,77%	0,09%	0,48%	7,90%

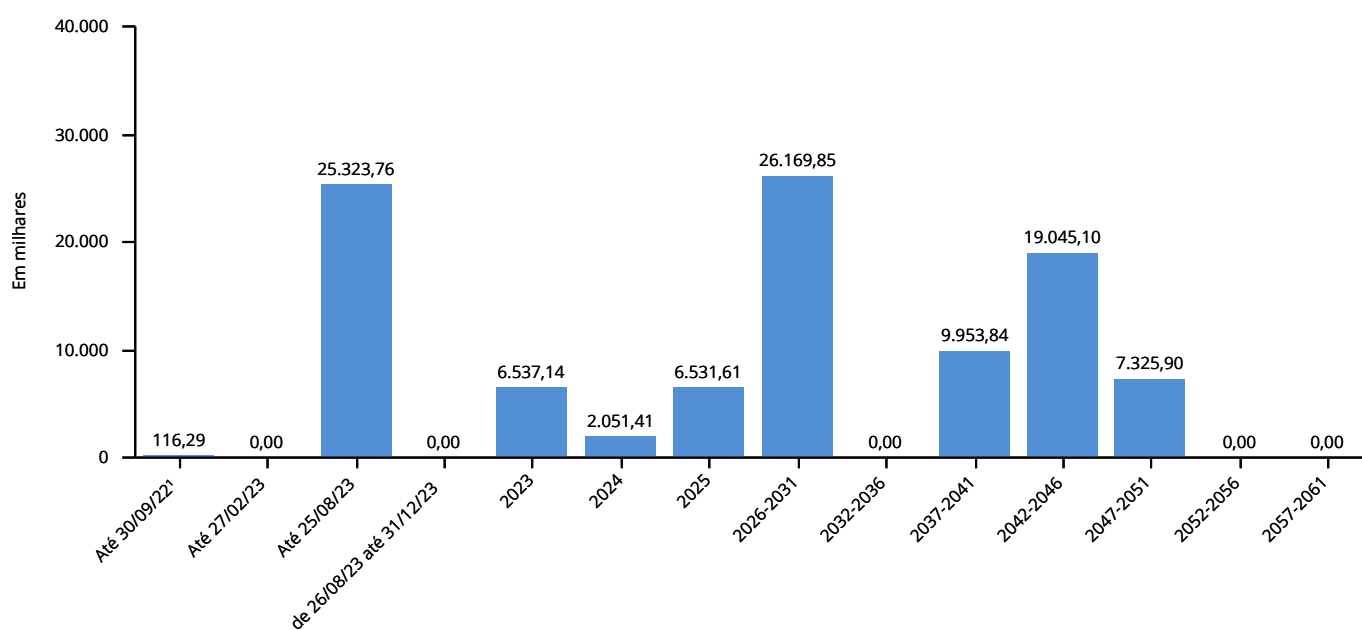
2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	0,83%	0,77%	0,99%	1,27%	0,92%	0,45%	0,70%	0,67%	0,57%	0,54%	0,72%	1,33%	10,22%
Rent. Líquida	0,83%	0,77%	0,99%	1,27%	0,92%	0,45%	0,70%	0,67%	0,57%	0,54%	0,72%	1,33%	10,22%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,47%	0,48%	0,38%	0,38%	5,97%
Índice Ref.	0,73%	0,88%	1,09%	0,96%	0,52%	0,33%	0,49%	0,49%	0,31%	0,43%	0,88%	1,58%	9,04%

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,30%	0,53%	0,76%	0,37%	0,04%	0,47%	0,86%	0,75%	0,87%	1,29%	1,25%	1,64%	10,61%
Rent. Líquida	1,30%	0,53%	0,76%	0,37%	0,04%	0,47%	0,86%	0,75%	0,87%	1,29%	1,25%	1,64%	10,61%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,22%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,15%	0,16%	2,77%
Índice Ref.	0,56%	0,48%	0,55%	0,11%	0,09%	0,66%	0,83%	0,72%	1,23%	1,25%	1,29%	1,84%	10,02%

2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,30%	0,76%	1,67%	0,94%	0,98%	1,20%	1,15%	1,30%	1,58%	1,43%	1,63%	1,28%	16,33%
Rent. Líquida	1,30%	0,76%	1,67%	0,94%	0,98%	1,20%	1,15%	1,30%	1,58%	1,43%	1,63%	1,28%	16,33%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,30%	0,36%	0,42%	0,44%	0,48%	0,59%	0,76%	4,39%
Índice Ref.	0,61%	1,13%	1,25%	0,72%	1,32%	0,96%	1,40%	1,26%	1,56%	1,50%	1,18%	1,12%	14,93%

2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,06%	1,12%	1,83%	1,74%	1,41%	0,94%	0,42%	0,00%					8,83%
Rent. Líquida	1,06%	1,12%	1,83%	1,74%	1,41%	0,94%	0,42%	0,00%					8,83%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%					7,74%
Índice Ref.	1,03%	1,32%	2,09%	1,36%	0,82%	0,98%	-0,25%	0,08%					7,67%

MAPA DE VENCIMENTOS DOS ATIVOS DA CARTEIRA



¹ São considerados títulos e fundos categorizados como a negociação

² Dados de referência calculados com mês anterior

Cenário Econômico

O mês de agosto foi marcado por uma postura mais dura dos bancos centrais desenvolvidos no cenário internacional. Além disso, novos temores em relação à capacidade da Europa de enfrentar o próximo inverno com fornecimento limitado de gás, diante das interrupções pela Rússia, impactaram fortemente os preços de energia por lá. No Brasil, a disputa eleitoral dominou o ambiente no mês.

A situação relacionada ao mercado energético na Europa se deteriorou no mês de agosto, conforme novas interrupções por parte da Rússia no fornecimento de gás natural ocorreram com o país alegando problemas técnicos. Sucessivos pacotes fiscais têm sido adotados pelos países europeus para conter os efeitos deletérios da inflação, grande parte causada pela crise energética, ao passo que a política monetária atua no sentido contrário aos incentivos do governo.

Ao longo do mês, vários membros do ECB indicaram aceleração do ritmo de alta dos juros, diante da persistente aceleração da inflação, com preocupações sobre a espiral dos preços dos salários e expectativas cada vez mais altas em meio ao choque do gás. Ainda que haja consenso sobre a região enfrentar uma recessão em breve, o foco dos bancos centrais desenvolvidos está em combater a inflação e ancorar expectativas.

Os membros do FOMC também endureceram o discurso frente à inflação e as apostas de manutenção do ritmo de alta dos juros por parte do Fed em 75bps aumentaram ao longo do mês. Powell, em Jackson Hole, indicou possível aperto monetário mais prolongado e confirmou que o Fed está dependente de dados.

O Copom de agosto trouxe novidade no que tange ao seu horizonte relevante para a política monetária. Para suavizar os efeitos diretos decorrentes das mudanças tributárias adotadas recentemente, mas incorporar seus impactos secundários, o Copom optou por olhar para a inflação acumulada em doze meses no primeiro trimestre de 2024 e não mais para o ano-calendário. Dessa forma, o Copom acabou antecipando maior participação da inflação de 2024 em seu horizonte relevante, além de sugerir que seu cenário base era de manutenção da Selic em 13,75%.

O início dos debates e sabatinas, juntamente com o aumento da frequência de pesquisas de intenções de votos, trouxe diminuição da diferença de pontos entre Lula e Bolsonaro, aumentando a incerteza. Qualquer que seja o resultado das eleições, o teto de gastos já está ameaçado há um bom tempo e as promessas de campanha indicam que haverá relevante aumento de benefícios ano que vem.

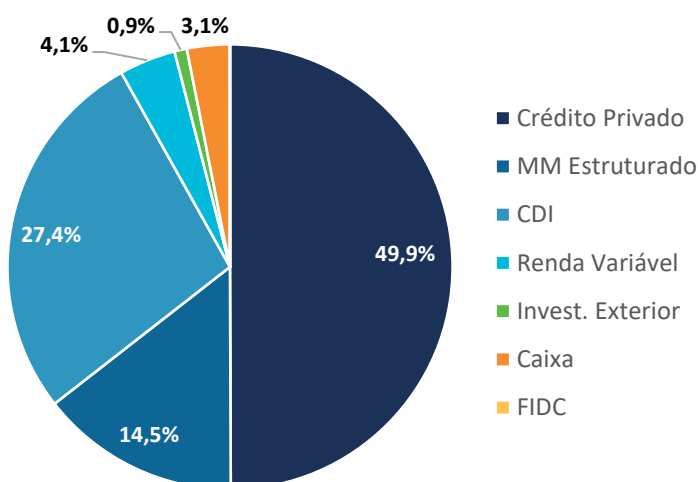
Os mercados entram em setembro com o crescente problema da Europa relacionado à escassez de energia às vésperas das decisões de política monetária do ECB e Fed. No Brasil, com o fim do ciclo de alta de juros, o mercado avalia novas mudanças de tendências das pesquisas eleitorais e fica à espera de informações sobre a âncora fiscal que será adotada pelo novo governo.

RELATÓRIO ICATU VANGUARDA FIC FIM CP JUSPREV AGOSTO 2022

Composição do fundo

CLASSE	FUNDOS	%PL	
CDI	Icatu Vanguarda Gold FI RF LP	7,0%	27,4%
	Mag Renda Fixa Fundo De Investimento	3,7%	
	Itaú Institucional Optimus RF LP FI	4,7%	
	Icatu Vanguarda Renda Fixa Plus	12,0%	
Crédito Privado	Icatu Vanguarda Crédito Privado Institucional FIRF	33,5%	49,9%
	Arx Vinson FIC FIRF CP	15,4%	
	Icatu Vanguarda Crédito Privado FI RF LP	1,0%	
Multimercado Estruturado	Legacy Capital FICFI MM	2,8%	14,5%
	Nimitz IV FIC FIM	2,7%	
	Icatu Vanguarda Hedge FIM	9,1%	
Invest Exterior	BB Multimercado Schroder IE FI	0,9%	0,9%
Renda Variável	Oceana Selection FIC FIA	1,1%	4,1%
	Tork Long Only Institucional FIC FIA	1,2%	
	Truxt I Valor Institucional FIC FIA	1,2%	
	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	0,7%	
FIDC	FIDC Mult. Italia	0,0%	0,0%
Caixa	-	3,1%	3,1%

* FIDCs foram herdados da gestão anterior.



RELATÓRIO ICATU VANGUARDA FIC FIM CP JUSPREV AGOSTO 2022

Alocação	jan/22	fev/22	mar/22	abr/22	mai/22	jun/22	jul/22	ago/22	set/22	out/22	nov/22	dez/22
CDI	13,6%	13,5%	13,5%	21,5%	20,9%	23,0%	22,1%	27,4%	-	-	-	-
Crédito	41,0%	40,7%	40,6%	41,2%	41,3%	42,1%	48,4%	49,9%	-	-	-	-
Pré-Fixado	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Inflação Curta	9,7%	9,7%	10,2%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Inflação IMA B	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Inflação Longa	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Multimercado	13,7%	13,7%	13,8%	13,8%	13,9%	14,9%	14,6%	14,5%	-	-	-	-
Renda Variável	11,4%	11,4%	11,3%	12,3%	12,3%	12,3%	9,2%	4,1%	-	-	-	-
FIDC'S	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,0%	0,0%	-	-	-	-
Invest. Ext.	9,5%	9,4%	9,1%	10,1%	10,0%	3,9%	1,4%	0,9%	-	-	-	-
Caixa	1,2%	1,7%	1,5%	0,9%	1,6%	3,7%	4,3%	3,1%	-	-	-	-

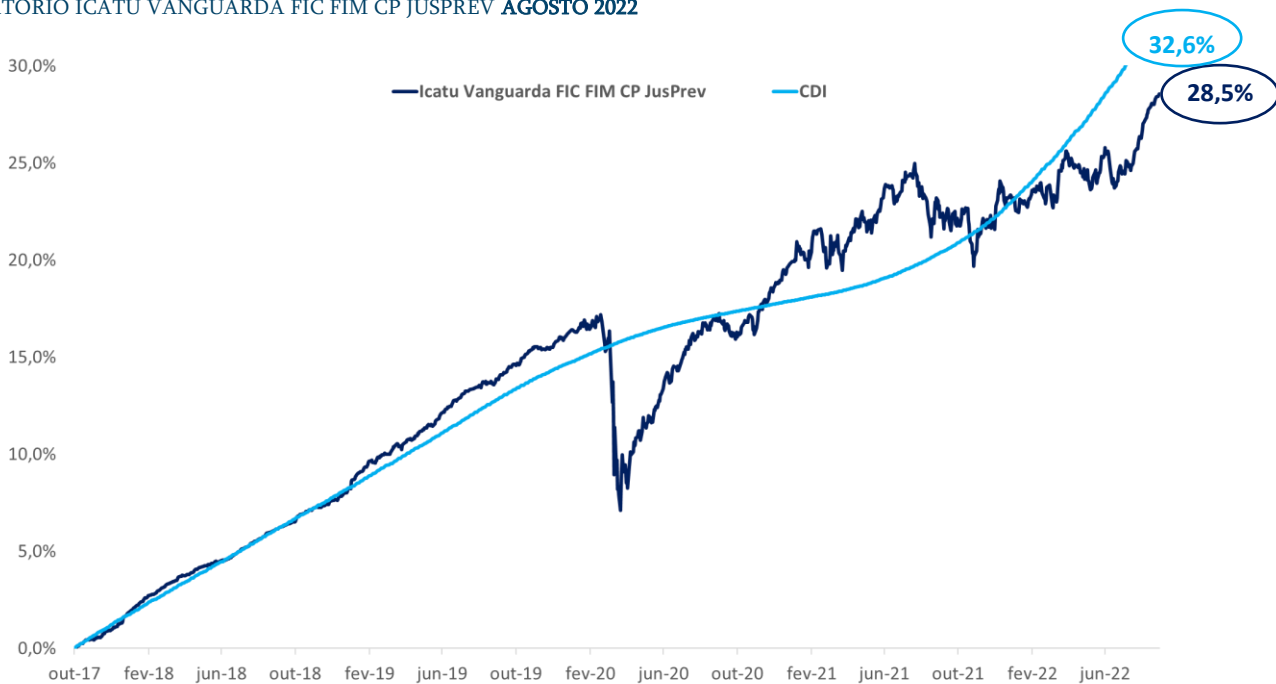
Rentabilidade acumulada do fundo

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2020
Jusprev	0,09%	-0,85%	-5,50%	2,28%	1,38%	1,35%	1,35%	0,56%	-0,67%	0,08%	1,89%	1,32%	3,09%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,22%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,15%	0,16%	2,77%
% CDI	24,63%	-	-	800,64%	579,89%	627,79%	693,43%	349,68%	-	50,96%	1264,75%	799,98%	111,51%
Bench	0,44%	-0,93%	-3,42%	2,23%	1,45%	1,41%	1,28%	0,28%	-0,58%	0,02%	2,11%	1,40%	5,70%

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2021
Jusprev	0,09%	-0,37%	0,93%	1,04%	0,99%	0,29%	-0,20%	-0,58%	-0,69%	-1,28%	1,46%	1,01%	2,71%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,30%	0,36%	0,42%	0,44%	0,48%	0,59%	0,76%	4,40%
% CDI	59,09%	-	471,52%	502,76%	371,41%	94,28%	-	-	-	-	249,65%	131,98%	61,64%
INPC+4,35%	0,61%	1,13%	1,25%	0,72%	1,32%	0,96%	1,40%	1,26%	1,56%	1,50%	1,18%	-	13,66%

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2022
Jusprev	0,17%	0,28%	1,36%	-0,99%	0,94%	-0,76%	1,58%	1,75%	-	-	-	-	4,37%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%	-	-	-	-	7,74%
INPC+4,35%	1,03%	1,32%	2,09%	1,36%	0,82%	0,98%	-0,25%	0,08%	-	-	-	-	7,67%
Bench 2022	0,38%	0,29%	0,89%	-0,97%	0,85%	-0,51%	2,00%	1,30%	-	-	-	-	4,28%

RELATÓRIO ICATU VANGUARDA FIC FIM CP JUSPREV AGOSTO 2022

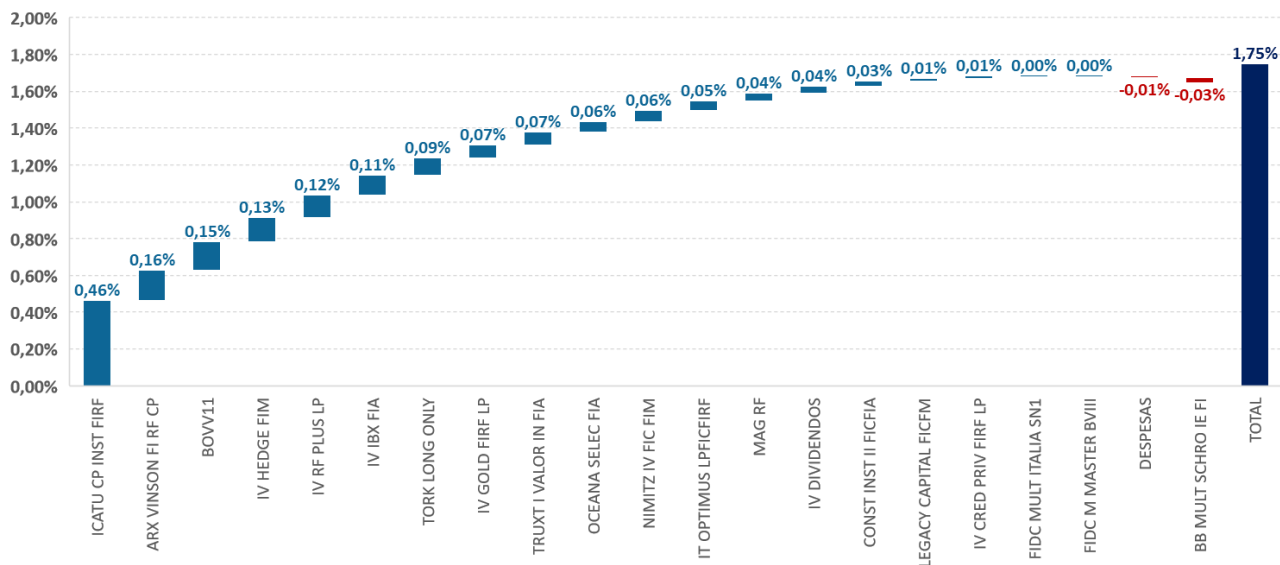


Rentabilidade Individual dos Fundos

FUNDOS	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2022
Icatu Vanguarda Gold FI RF LP	0,79%	0,84%	0,98%	0,77%	1,07%	1,03%	1,03%	1,19%	-	-	-	-	7,97%
Icatu Vanguarda Renda Fixa Plus	0,72%	0,81%	1,13%	0,86%	1,06%	0,97%	0,98%	1,24%	-	-	-	-	8,05%
Icatu Vanguarda Crédito Privado FI RF LP	0,83%	0,84%	1,03%	0,90%	1,14%	1,10%	1,10%	1,27%	-	-	-	-	8,49%
Mag Renda Fixa Fundo De Investimento	0,75%	0,78%	0,97%	0,80%	1,06%	1,02%	1,02%	1,14%	-	-	-	-	7,79%
Icatu Vanguarda CP Institucional FIRF	0,89%	0,90%	0,99%	0,98%	1,19%	1,13%	1,07%	1,47%	-	-	-	-	8,95%
Arx Vinson FIC FIRF CP	0,82%	0,88%	1,11%	0,93%	1,19%	1,21%	1,13%	1,38%	-	-	-	-	8,98%
Itaú Institucional Optimus RF LP FI	0,60%	0,98%	1,43%	1,26%	0,97%	0,98%	0,95%	1,07%	-	-	-	-	8,53%
Legacy Capital FICFI MM	1,39%	4,09%	4,99%	5,15%	1,26%	0,40%	-0,26%	0,51%	-	-	-	-	18,75%
Nimitz IV FIC FIM	2,26%	3,05%	7,33%	3,53%	1,37%	2,38%	-1,20%	2,12%	-	-	-	-	22,62%
Icatu Vanguarda Hedge FIM	0,39%	1,33%	1,91%	0,09%	1,22%	0,36%	1,53%	1,47%	-	-	-	-	8,57%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%	-	-	-	-	7,74%
Icatu Vanguarda IBX FIA	7,15%	1,42%	5,59%	-10,10%	3,23%	-11,70%	4,31%	-	-	-	-	-	4,03%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	6,87%	0,74%	5,22%	-8,60%	1,45%	-9,41%	3,85%	5,65%	-	-	-	-	4,40%
Tork Long Only Institucional FIC FIA	5,57%	0,25%	7,68%	-9,03%	1,98%	-8,40%	6,06%	7,78%	-	-	-	-	10,71%
Oceana Selection FIC FIA	7,05%	-0,04%	6,27%	-8,88%	0,83%	-9,06%	5,97%	5,12%	-	-	-	-	5,85%
Truxt I Valor Institucional FIC FIA	4,71%	0,47%	5,77%	-8,75%	2,10%	-8,67%	5,69%	5,85%	-	-	-	-	5,93%
Constellation Institucional II FIC FIA	0,34%	-0,57%	4,89%	-12,05%	-0,28%	-11,04%	7,76%	-	-	-	-	-	-8,91%
IBX	6,87%	1,46%	5,96%	-10,11%	3,23%	-11,56%	4,40%	6,15%	-	-	-	-	4,48%
BB Multimercado Schroder IE FI	-9,82%	-5,51%	-4,97%	-3,12%	-4,07%	0,42%	4,78%	-2,41%	-	-	-	-	-22,72%
MSCI World (Em reais)	-9,95%	-5,21%	-5,69%	-4,85%	-3,93%	0,29%	6,85%	-3,79%	-	-	-	-	-24,13%

Atribuição de Performance

Agosto/2022



2022

