



RI Relatório de Investimentos

JULHO/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.

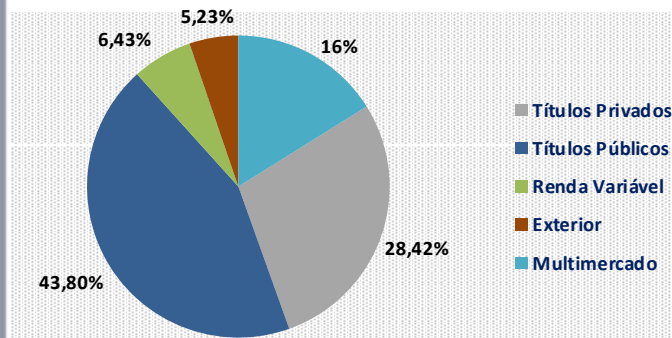
Performance dos Investimentos

Fundos de Investimentos	Patrimônio		Gestor	Rentabilidade					
				1M	12M	24M	36M	48M	60M
ICATU VANG FC FI MULT CRED PRIV JUSPREV ¹	147.356.087,37	35,31%	Icatu Asset Management	1,58%	2,48%	8,73%	11,36%	19,70%	28,42%
SOMMA JUSPREV ATIVO FI MULT CRED PRIV ²	155.111.300,91	37,16%	Somma Investimentos S.A.	0,84%	5,08%	9,03%	11,88%	21,03%	29,00%
SOMMA JUSPREV ALM FI MULT	114.904.476,59	27,53%	Somma Investimentos S.A.	0,42%	16,91%	34,13%	45,50%	59,79%	77,90%
TOTAL JUSPREV	417.371.864,87	100%		0,92%	6,46%	13,96%	17,61%	26,54%	36,22%

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

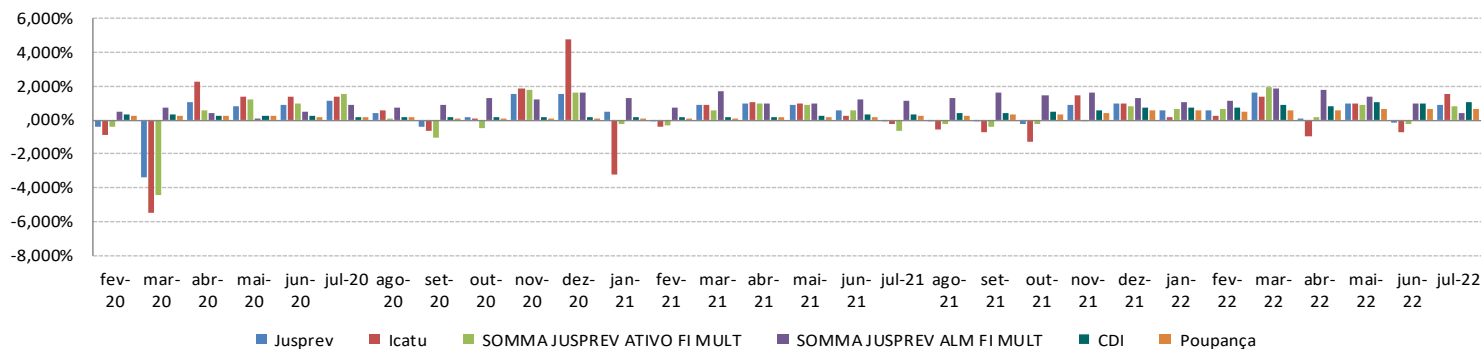


% CDI - FUNDO ICATU	152,64%	26,28%	72,12%	67,52%	81,28%	86,04%
% CDI - FUNDO SULAMÉRICA JUSPREV	81,18%	53,91%	74,61%	70,59%	86,76%	87,78%
% CDI - FUNDO JUSPREV FI MULT	40,49%	179,43%	282,08%	270,49%	246,69%	235,80%
% CDI - JUSPREV CONSOLIDADO	88,70%	68,53%	115,42%	104,70%	109,50%	109,64%
% POUPANÇA - FUNDO ICATU	237,93%	39,50%	105,89%	99,03%	119,09%	125,99%
% POUPANÇA - FUNDO SOMMA JUSPREV ATIVO	126,54%	81,03%	109,54%	103,54%	127,12%	128,54%
% POUPANÇA - FUNDO SOMMA JUSPREV ALM	63,12%	269,69%	414,15%	396,73%	361,44%	345,29%
% POUPANÇA - JUSPREV CONSOLIDADO	138,26%	103,00%	169,46%	153,57%	160,44%	160,54%
Excesso sobre INPC* + 4,35%	1,17%	-7,36%	-13,41%	-16,85%	-17,37%	-18,23%
Excesso sobre INPC* + 6%	1,04%	-8,80%	-16,06%	-20,44%	-21,68%	-23,22%

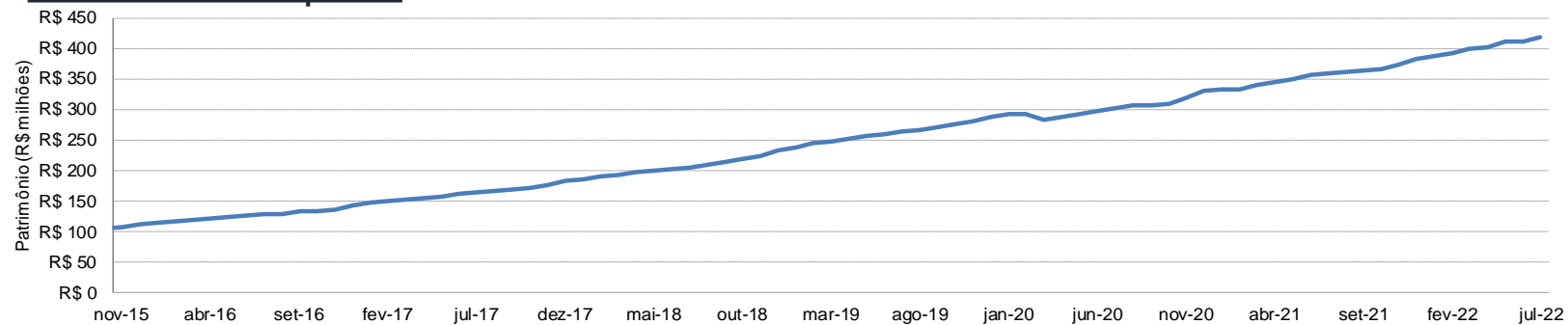
Rentabilidade Mensal Consolidada

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%						4,75%
CDI	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%						6,51%
%CDI	74,03%	78,28%	177,69%	14,67%	95,82%	-14,11%	88,70%						73,03%
POUPANÇA	0,56%	0,50%	0,60%	0,56%	0,65%	0,65%	0,66%						4,27%
%POUPANÇA	96,67%	118,21%	275,65%	22,01%	152,73%	-22,07%	138,26%						111,29%

Rentabilidade Mensal



Patrimônio Líquido



Histórico de Desempenho

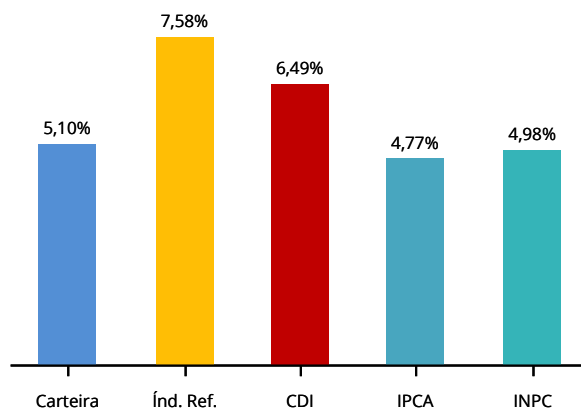
Início Período Considerado	6-ago-08	
	12 meses	Desde o início
Melhor Mês da JUSPREV	1,65%	2,10%
Melhor Mês do INPC + 4,35%	2,09%	2,09%
Melhor Mês do INPC + 6%	2,23%	2,23%
Pior Mês da JUSPREV	-0,21%	-3,41%
Pior Mês do INPC + 4,35%	2,09%	-0,25%
Pior Mês do INPC + 6%	2,23%	-0,12%
% de meses acima de INPC + 4,35%	16,67%	38,32%
% de meses acima de INPC + 6%	16,67%	32,93%
% de meses acima de CDI	25,00%	40,12%
Volatilidade da JUSPREV (a.a.)	-0,11%	0,23%

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: No cenário internacional, o mês foi marcado por indicadores de atividade econômica mais fracos e aumentos de juros por parte dos Banco Centrais. Nos EUA, dados de atividade mostraram acomodação no mês, com o resultado preliminar do PIB do 2º trimestre apresentado queda de 0,9% e representando uma recessão técnica. Em linha, na Zona do Euro, as prévias dos PMI de julho indicaram contração dos setores. Nos EUA, a inflação permaneceu elevada, motivando o FED a prosseguir com o aperto monetário, com um novo aumento de 75 bps nas taxas de juros. Similarmente, na Zona do Euro, a prévia da inflação de julho aumentou em comparação a junho, levando o ECB a elevar as taxas de juros em 50 bps.

Economia Brasileira: No Brasil, o mês ficou marcado pela sanção da PEC dos Benefícios Sociais, que terá um impacto fiscal de R\$ 40 bi, e pelo início das convenções partidárias que oficializam as principais candidaturas para as eleições de 2022. Em relação à inflação, o IPCA-15 apresentou alta de 0,13%, mas desacelerou em comparação a junho, condicionado por reduções nos preços de energia elétrica e combustíveis. Apesar do resultado, a inflação permanece com composição desfavorável, com leituras acima dos níveis pré-pandemia. Com esse cenário, espera-se que o Banco Central encerre o ciclo de aperto de juros na próxima reunião, com um novo aumento de 50 bps.

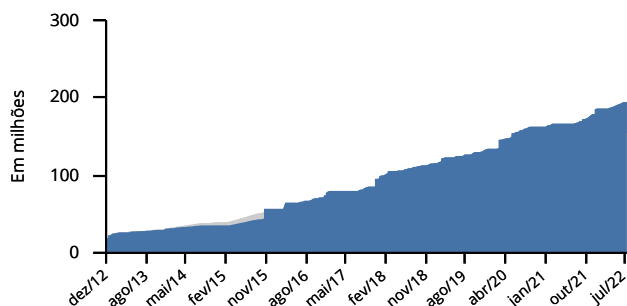
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



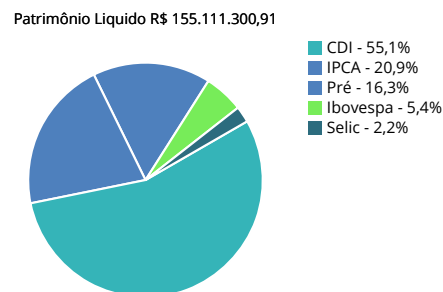
Mês	Ago-21	Set-21	Out-21	Nov-21	Dez-21	Jan-22	Fev-22	Mar-22	Abr-22	Mai-22	Jun-22	Jul-22	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev Ativo	(0,23)	(0,37)	(0,22)	(0,00)	0,81	0,69	0,66	1,98	0,14	0,90	(0,20)	0,84	5,10	5,08	9,03
Índ. Ref.	1,26	1,56	1,50	1,18	1,12	1,03	1,32	2,09	1,36	0,82	0,98	(0,25)	7,58	14,90	31,66
CDI	0,42	0,44	0,48	0,59	0,76	0,73	0,75	0,92	0,83	1,03	1,01	1,03	6,49	9,39	12,05
IPCA	0,87	1,16	1,25	0,95	0,73	0,54	1,01	1,62	1,06	0,47	0,67	(0,68)	4,77	10,07	19,97

Índice de Referência INPC + 4.35% a.a.

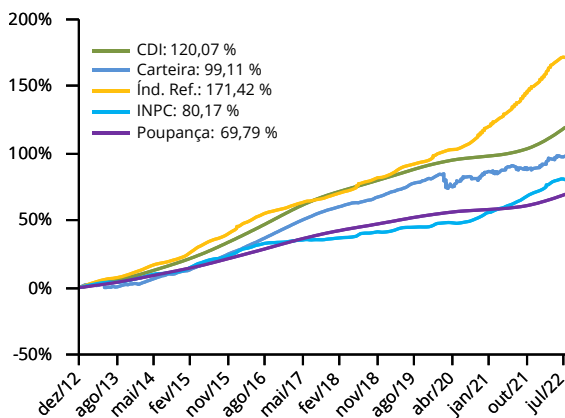
EVOLUÇÃO PATRIMONIAL



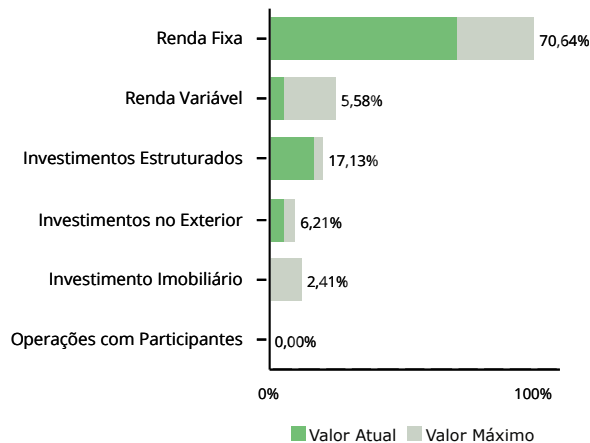
DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





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



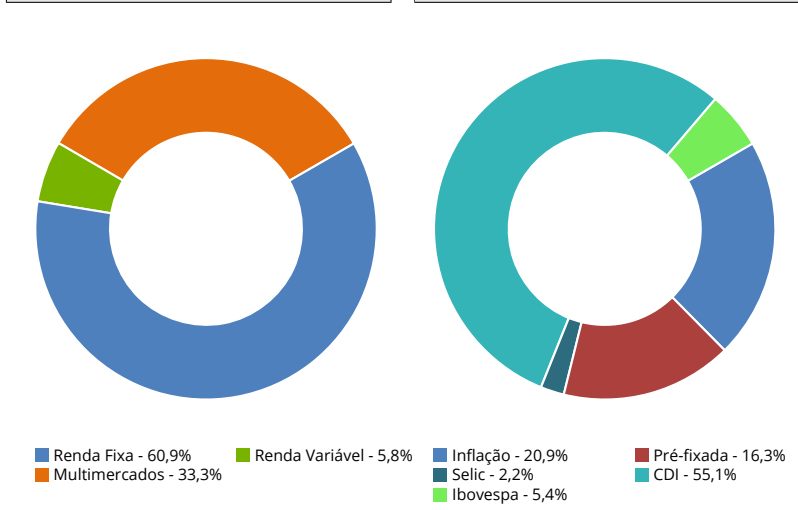
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

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

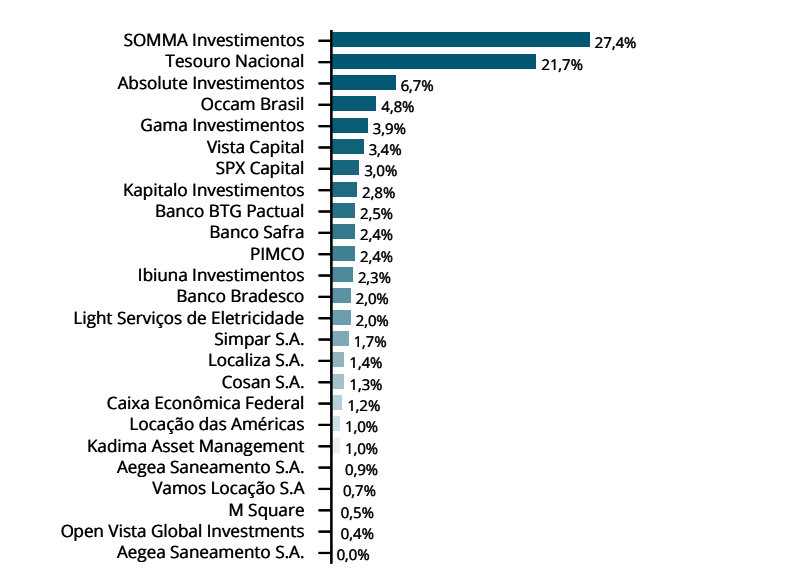


ATIVOS	JULHO-22	%	JUNHO-22	%
RENDA FIXA	64.249.909,48	41,4%	64.186.365,62	41,7%
Compromissada - Títulos Públicos	25.225.201,11	16,3%	28.581.649,84	18,6%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	1.461.954,88	0,9%	1.565.421,14	1,0%
Debênture - Cosan (CSAN33)	2.049.849,53	1,3%	2.074.588,63	1,3%
Debênture - JSL (JSMLB5)	2.600.147,32	1,7%	2.631.438,46	1,7%
Debênture - Light (LIGHD7)	3.131.266,74	2,0%	3.136.240,85	2,0%
Debênture - Localiza (LORTA7)	2.134.267,96	1,4%	2.162.729,63	1,4%
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	1.529.701,28	1,0%	1.551.045,17	1,0%
Debênture - Vamos (VAMO34)	1.045.005,18	0,7%	1.054.534,66	0,7%
Letra Financeira - Banco Bradesco	3.154.332,52	2,0%	3.116.753,90	2,0%
Letra Financeira - Banco Safra	3.778.032,68	2,4%	3.812.563,92	2,5%
Letra Financeira - BTG Pactual	3.823.010,08	2,5%	1.707.502,58	1,1%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	1.900.295,90	1,2%	1.875.985,73	1,2%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	12.416.844,30	8,0%	10.915.911,11	7,1%
FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555	90.874.753,42	58,6%	89.643.026,27	58,3%
Absolute Hiker Institucional FIC RF	5.919.515,04	3,8%	5.866.280,30	3,8%
Absolute Vertex li Fic Multimercado	4.500.635,76	2,9%	4.519.766,63	2,9%
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	3.612.750,43	2,3%	3.688.485,19	2,4%
Kadima IMA-B FIC RF CP	1.519.789,80	1,0%	1.527.148,70	1,0%
Kapitalo K10 FIC FIM	4.378.308,85	2,8%	4.377.420,72	2,8%
Lyxor Bridgewater Core Global Macro FIM IE	6.095.481,71	3,9%	6.135.166,15	4,0%
M SQUARE GLOBAL EQUITY IE FIC FIM	731.868,69	0,5%	680.730,76	0,4%
Occam Institucional li Fic Multimercado	7.478.702,02	4,8%	7.430.131,38	4,8%
Open Vista Tecnologia Global IE FIA	567.501,68	0,4%	507.925,39	0,3%
Pimco Income IE Fi Multimercado	3.670.401,18	2,4%	3.525.782,77	2,3%
SOMMA Institucional FIM	7.465.205,24	4,8%	7.363.245,00	4,8%
SOMMA Real Estate FIC FIM	3.792.276,78	2,4%	3.766.313,06	2,4%
SOMMA Selection FIC FIA	8.428.153,20	5,4%	7.946.936,11	5,2%
SOMMA Torino RF CP	22.808.784,05	14,7%	22.556.168,81	14,7%
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	4.634.471,54	3,0%	4.690.152,50	3,0%
Vista Hedge FIC FIM	5.270.907,45	3,4%	5.061.372,80	3,3%
TESOURARIA	(13.361,93)	0,0%	(10.280,68)	0,0%
Caixa	1.000,00	0,0%	1.000,00	0,0%
Valores a Pagar/Receber	(14.361,93)	0,0%	(11.280,68)	0,0%
TOTAL DA CARTEIRA	155.111.300,97	100%	153.819.111,21	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	29/07/2022	01/08/2022	13,14% a.a.	25.225.201,11	25.225.201,11	-	25.225.201,11	16,26%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	Mercado	24/03/2022	15/07/2025	IPCA + 6,68%	-	1.348.527,35	-	1.348.527,35	0,87%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	Mercado	24/03/2022	15/07/2025	IPCA + 6,68%	-	12.603,06	-	12.603,06	0,01%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	Mercado	24/03/2022	15/07/2025	IPCA + 6,68%	-	100.824,47	-	100.824,47	0,07%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,97%	-	326.135,66	-	326.135,66	0,21%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,97%	-	709.523,98	-	709.523,98	0,46%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,97%	-	505.050,21	-	505.050,21	0,33%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,97%	-	509.139,68	-	509.139,68	0,33%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	18/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,41%	-	837.172,69	-	837.172,69	0,54%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	11/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,60%	-	1.532.325,01	-	1.532.325,01	0,99%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	18/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,41%	-	230.649,62	-	230.649,62	0,15%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,80%	-	1.175.724,68	-	1.175.724,68	0,76%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	16/03/2022	15/10/2026	IPCA + 7%	-	1.091.744,34	-	1.091.744,34	0,70%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,80%	-	95.977,52	-	95.977,52	0,06%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,80%	-	767.820,20	-	767.820,20	0,50%
Debênture - Localiza (LORTA7)	Mercado	11/03/2022	15/03/2031	IPCA + 7,50%	-	2.134.267,96	-	2.134.267,96	1,38%
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	Mercado	11/03/2022	15/09/2031	IPCA + 7,60%	-	1.529.701,28	-	1.529.701,28	0,99%
Debênture - Vamos (VAMO34)	Mercado	12/11/2021	15/10/2031	IPCA + 7,69%	-	1.045.005,18	-	1.045.005,18	0,67%
Letra Financeira - Banco Bradesco	Mercado	14/11/2018	15/03/2024	100% Selic	1.500.000,00	1.558.519,01	-	1.558.519,01	1,00%
Letra Financeira - Banco Bradesco	Mercado	04/08/2017	21/11/2022	115% CDI	1.199.886,19	1.595.813,51	-	1.595.813,51	1,03%
Letra Financeira - Banco Safra	Mercado	24/03/2022	26/03/2029	IPCA + 7,40%	1.600.000,00	1.670.753,14	-	1.670.753,14	1,08%
Letra Financeira - Banco Safra	Mercado	11/03/2022	12/03/2029	IPCA + 7,35%	2.000.000,00	2.107.279,54	-	2.107.279,54	1,36%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	29/10/2021	29/10/2026	IPCA + 7,49%	1.500.000,00	1.712.310,33	-	1.712.310,33	1,10%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	12/07/2022	19/08/2024	IPCA + 7,69%	273.654,04	276.647,09	-	276.647,09	0,18%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	11/07/2022	03/11/2023	IPCA + 6,97%	332.791,10	327.927,64	-	327.927,64	0,21%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	22/07/2022	01/09/2027	CDI + 2,20%	1.500.000,00	1.506.125,02	-	1.506.125,02	0,97%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	Mercado	12/09/2019	30/11/2024	100% Selic	1.800.000,00	1.900.295,90	-	1.900.295,90	1,23%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	04/07/2022	15/05/2025	IPCA + 5,99%	301.675,52	300.963,79	-	300.963,79	0,19%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/06/2022	15/05/2025	IPCA + 5,89%	1.006.366,48	1.003.212,62	-	1.003.212,62	0,65%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	14/03/2022	15/05/2025	IPCA + 5,80%	651.014,31	662.120,33	-	662.120,33	0,43%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/07/2022	15/08/2030	IPCA + 6,26%	1.114.486,11	1.128.988,32	-	1.128.988,32	0,73%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/03/2022	15/05/2025	IPCA + 5,79%	355.473,03	361.156,54	-	361.156,54	0,23%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	23/06/2022	15/05/2025	IPCA + 5,79%	3.003.819,22	2.993.586,46	-	2.993.586,46	1,93%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	27/04/2022	15/05/2035	IPCA + 5,64%	2.910.366,69	2.783.670,07	-	2.783.670,07	1,79%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	05/07/2022	15/05/2025	IPCA + 5,98%	201.233,16	200.642,52	-	200.642,52	0,13%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	09/05/2022	15/05/2035	IPCA + 5,74%	3.111.050,96	2.982.503,65	-	2.982.503,65	1,92%
TOTAL						64.249.909,48	-	64.249.909,48	41,42 %

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	1,1305578	-	5.919.515,04	3,82%		
Absolute Vertex II Fic Multimercado	Absolute Investimentos	D+29	2.092.475,6103136	2,1508665	-	4.500.635,76	2,90%		
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	Ibiuna	D+31	30.330,5490223	119,1125960	-	3.612.750,43	2,33%		
Kadima IMA-B FIC RF CP	Kadima Asset Management	D+5	1.523.503,2502472	0,9975626	-	1.519.789,80	0,98%		
Kapitalo K10 FIC FIM	Kapitalo Investimentos	D+30	2.609.841,1044542	1,6776151	-	4.378.308,85	2,82%		
Lyxor Bridgewater Core Global Macro FIM IE	Gama Investimentos	D+7	5.828.216,8743895	1,0458571	-	6.095.481,71	3,93%		
M SQUARE GLOBAL EQUITY IE FIC FIM	M Square	D+30	472.402,6835328	1,5492475	-	731.868,69	0,47%		

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	2,3367532	-	7.478.702,02	4,82%
Open Vista Tecnologia Global IE FIA	Open Vista	D+6	3.687,6271305	153,8934541	-	567.501,68	0,37%
Pimco Income IE Fi Multimercado	PIMCO	D+1	2.064.135,4764934	1,7781784	-	3.670.401,18	2,37%
SOMMA Institucional FIM	SOMMA Investimentos	D+5	2.569.737,3620829	2,9050460	-	7.465.205,24	4,81%
SOMMA Real Estate FIC FIM	SOMMA Investimentos	D+60	3.740,6045821	1.013,8138628	-	3.792.276,78	2,44%
SOMMA Selection FIC FIA	SOMMA Investimentos	D+37	7.816.800,4562336	1,0782101	-	8.428.153,20	5,43%
SOMMA Torino RF CP	SOMMA Investimentos	D+1	18.180.298,2747200	1,2545880	-	22.808.784,05	14,70%
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	SPX Capital	D+60	1.965.878,6941731	2,3574555	-	4.634.471,54	2,99%
Vista Hedge FIC FIM	Vista Capital	D+16	2.978.777,4241687	1,7694868	-	5.270.907,45	3,40%
TOTAL					-	90.874.753,42	58,59 %

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

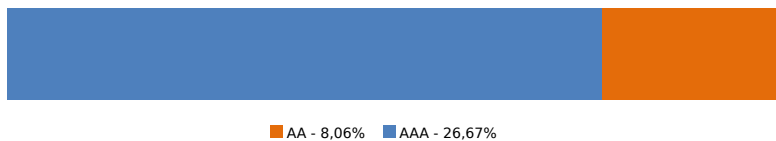
SEGMENTO	MAXIMO	ATUAL	MARGEM
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	70,64%	29,36%
Títulos Públicos Federais	100,00%	42,29%	57,71%
CDI/CDBs	80,00%	0,00%	80,00%
Letras Financeiras de Inst. Financeira	80,00%	9,88%	70,12%
Debêntures	20,00%	17,81%	2,19%
DPGE	20,00%	0,00%	20,00%
FIDC	20,00%	0,66%	19,34%
Outros Ativos de Renda Fixa	20,00%	0,00%	20,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	25,00%	5,58%	19,42%
Ações de Companhias Abertas	25,00%	5,58%	19,42%
SPE	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20,00%	14,72%	5,28%
FIP - Fundo de Investimento em Participações	5,00%	0,00%	5,00%
FIM - Fundos de Investimento Multimercado	15,00%	14,72%	0,28%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	10,00%	6,21%	3,79%
FIE - Fundo de Investimento no Exterior	10,00%	6,21%	3,79%
INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	10,00%	2,41%	7,59%
CCI	10,00%	0,00%	10,00%
CRI	10,00%	0,00%	10,00%
FII - Fundo Investimento Imobiliário	10,00%	2,41%	7,59%
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

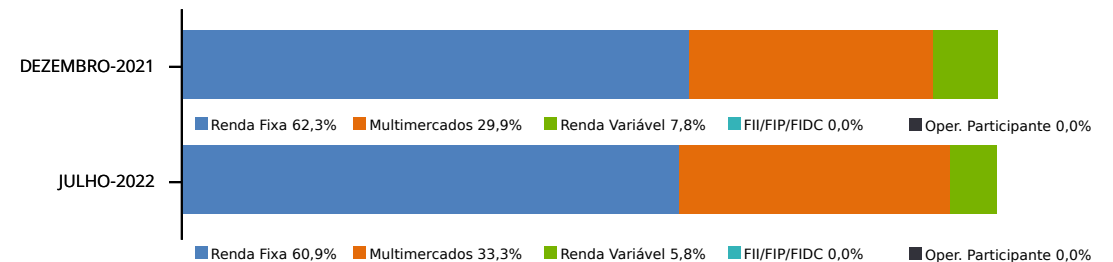
INSTITUIÇÃO/ATIVO	MÁXIMO	ATUAL	AGÊNCIAS DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO			
Segurança Máxima (AAA)	100,00%	26,67%	FITCH	MOODY'S	S&P	AUSTIN
Banco Bradesco	25,00%	2,03%	AAA(bra)	AAA.br	brAAA	-
Banco Safra	25,00%	2,44%	-	AAA.br	brAAA	-
Debênture - Cosan (CSAN33)	25,00%	1,32%	AAA(bra)	AAA.br	-	-
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	25,00%	0,99%	AAA(bra)	-	brAAA	-
Tesouro Nacional	100,00%	19,89%	-	-	brAAA	-
Alta Segurança (AA)	100,00%	8,06%	FITCH	MOODY'S	S&P	AUSTIN
Banco BTG Pactual	25,00%	2,46%	AA(bra)	AAA.br	brAAA	-
Caixa Econômica Federal	25,00%	1,23%	AA(bra)	AAA.br	brAAA	-
Debênture - JSL (JSMLB5)	25,00%	1,68%	AAA(bra)	-	brAA	-
Debênture - Light (LIGHD7)	25,00%	2,02%	AA-(bra)	AA-.br	brAA+	-
Debênture - Vamos (VAMO34)	25,00%	0,67%	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	0,91	-	-	-	-	-
Compromissada - Títulos Públicos	1,03	-	6,49	85,6%	9,38	63,0%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	0,09	-	-	-	-	-
Debênture - Cosan (CSAN33)	-1,19	-	-	-	-	-
Debênture - JSL (JSMLB5)	-1,19	-	-	-	-	-
Debênture - Light (LIGHD7)	-0,16	64,3%	-	-	-	-
Debênture - Localiza (LORTA7)	-1,32	-	-	-	-	-
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	-1,38	-	-	-	-	-
Debênture - Vamos (VAMO34)	-0,90	-	5,48	72,3%	-	-
Kadima IMA-B FIC RF CP	-0,48	-	3,27	43,1%	-	-
Letra Financeira - Banco Bradesco	1,21	-	7,72	101,8%	14,97	100,5%
Letra Financeira - Banco Safra	-0,91	-	-	-	-	-
Letra Financeira - BTG Pactual	-0,59	-	5,34	70,4%	-	-
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	1,30	-	7,73	102,0%	21,73	145,8%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	-1,13	-	-	-	-	-
SOMMA Torino RF CP	1,12	-	7,09	93,5%	-	-

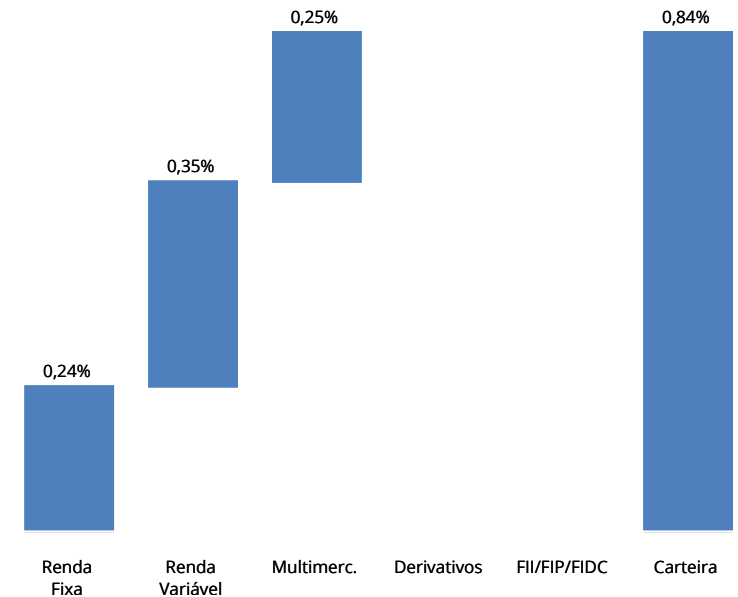
RENTABILIDADE INDICADORES	NO MÊS	NO ANO	EM 12 MESES
	%	%	%
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	-0,25	7,58	14,90
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	-0,25	7,58	14,90
Renda Variável (INPC + 4.35% a.a.)	-0,25	7,58	14,90
Estruturados (INPC + 6.50% a.a.)	-0,08	8,85	17,25
Op. com Participante (CDI)	1,03	6,49	9,39
CDI	1,03	6,49	9,39
IPCA	-0,68	4,77	10,07
INPC	-0,60	4,98	10,12
Ibovespa	4,69	-1,58	-15,30
Dólar	-0,95	-7,03	1,30

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	0,43	6,38	9,59
Renda Variável	5,55	-10,58	6,42
Investimentos Estruturados	0,34	10,67	39,91
Investimentos no Exterior	0,00	0,00	0,00
Operação com participante	0,00	0,00	0,00

COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA

Renda Variável	%	Dif. Bench	%	Dif. Bench	%	Dif. Bench
Open Vista Tecnologia Global IE FIA	11,73	12,0	-34,47	-42,1	-	-
SOMMA Selection FIC FIA	6,06	6,3	-5,94	-13,5	-	-

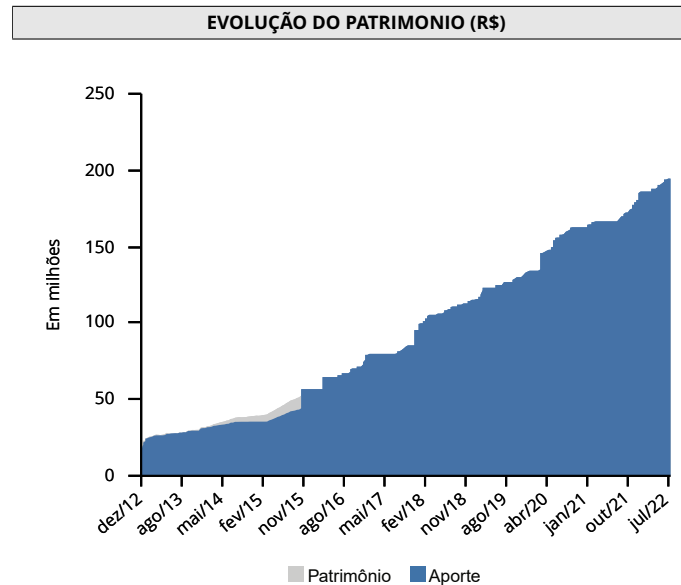
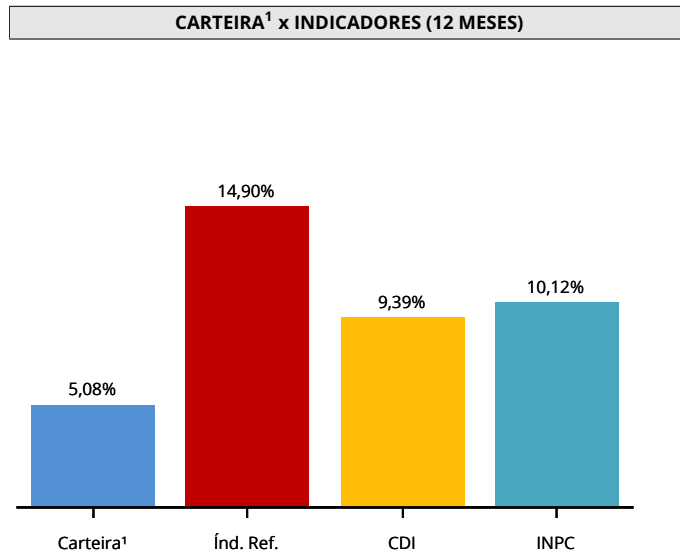
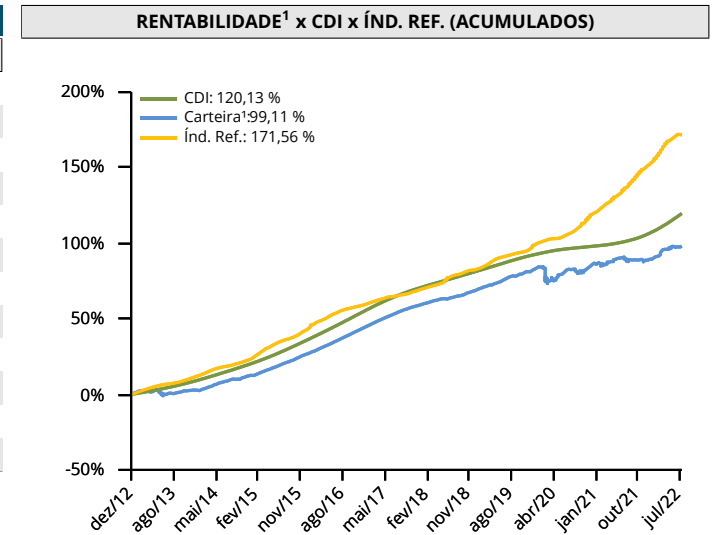
Multimercados	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Absolute Vertex li Fic Multimercado	-0,42	-	13,50	152,5%	18,47	107,1%
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	-2,05	-	-	-	-	-
Kapitalo K10 FIC FIM	0,02	-	12,99	146,8%	-	-
Lyxor Bridgewater Core Global Macro FIM IE	-0,65	-	-13,03	-	-	-
M SQUARE GLOBAL EQUITY IE FIC FIM	7,51	-	-27,29	-	-	-
Occam Institucional li Fic Multimercado	0,65	-	5,38	71,0%	7,66	51,4%
Pimco Income IE Fi Multimercado	4,10	-	-2,02	-	0,62	4,2%
SOMMA Institucional FIM	1,38	-	7,17	81,0%	-	-
SOMMA Real Estate FIC FIM	0,69	-	-	-	-	-
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	-1,19	-	20,16	227,8%	29,15	169,0%
Vista Hedge FIC FIM	4,14	-	20,96	236,8%	-	-



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	-	-	-	-	-	5.601.284,72
Absolute Hiker Institucional FIC RF	366.280,30	53.234,74	-	-	-	-	-	419.515,04
BTG Pactual Crédito Corporativo I FIC FI RF	700.900,35	-	-	-	-	-	-	700.900,35
Compromissada - Títulos Públicos	1.476.862,52	280.350,50	-	-	-	-	-	1.757.213,02
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	47.098,47	1.551,55	-	-	-	-	-	48.650,02
Debênture - CCR (CCRDB1)	4.317,89	-	-	-	-	-	-	4.317,89
Debênture - Cosan (CSAN33)	69.867,11	(24.739,10)	-	-	-	-	-	45.128,01
Debênture - JSL (JSMLB5)	152.183,59	(31.291,14)	-	-	-	-	-	120.892,45
Debênture - Light (LIGHD7)	140.857,83	(4.974,11)	-	-	-	-	-	135.883,72
Debênture - Localiza (LORTA7)	142.296,97	(28.461,67)	-	-	-	-	-	113.835,30
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	94.875,21	(21.343,89)	-	-	-	-	-	73.531,32
Debênture - Vamos (VAMO34)	65.434,57	(9.529,48)	-	-	-	-	-	55.905,09
Kadima IMA-B FIC RF CP	55.485,50	(7.358,90)	-	-	-	-	-	48.126,60
Letra Financeira - Banco Bradesco	190.756,75	37.578,62	-	-	-	-	-	228.335,37
Letra Financeira - Banco Safra	212.563,92	(34.531,24)	-	-	-	-	-	178.032,68
Letra Financeira - BTG Pactual	96.106,35	9.062,07	-	-	-	-	-	105.168,42
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	111.985,64	24.310,17	-	-	-	-	-	136.295,81
Notas do Tesouro Nacional - Série B	77.080,11	(116.461,60)	-	-	-	-	-	(39.381,49)
SOMMA Torino RF CP	1.216.319,88	252.615,24	-	-	-	-	-	1.468.935,12
RENDA VARIÁVEL	(1.876.836,28)	540.793,38	-	-	-	-	-	(1.336.042,90)
Carteira de Ações/Opções/Op. Estruturadas	(347.973,83)	-	-	-	-	-	-	(347.973,83)
Open Vista Tecnologia Global IE FIA	(515.374,40)	59.576,29	-	-	-	-	-	(455.798,11)
SOMMA Selection FIC FIA	(1.013.488,05)	481.217,09	-	-	-	-	-	(532.270,96)
MULTIMERCADOS	2.707.081,29	392.442,69	-	-	-	-	-	3.099.523,98
Absolute Vertex li Fic Multimercado	554.833,46	(19.130,87)	-	-	-	-	-	535.702,59
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	238.485,19	(75.734,76)	-	-	-	-	-	162.750,43
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	-	-	-	-	-	491.524,58
Lyxor Bridgewater Core Global Macro FIM IE	(156.413,83)	(39.684,44)	-	-	-	-	-	(196.098,27)
M SQUARE GLOBAL EQUITY IE FIC FIM	(575.619,90)	51.137,93	-	-	-	-	-	(524.481,97)
Novus Institucional Fic Multimercado	15.447,54	-	-	-	-	-	-	15.447,54
Occam Institucional li Fic Multimercado	233.187,97	48.570,64	-	-	-	-	-	281.758,61
Pimco Income IE Fi Multimercado	(220.226,50)	144.618,41	-	-	-	-	-	(75.608,09)
SOMMA Institucional FIM	313.161,58	101.960,24	-	-	-	-	-	415.121,82
SOMMA Real Estate FIC FIM	16.313,06	25.963,72	-	-	-	-	-	42.276,78
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	808.716,09	(55.680,96)	-	-	-	-	-	753.035,13
Vista Hedge FIC FIM	703.805,99	209.534,65	-	-	-	-	-	913.340,64
TOTAL	6.051.517,97	1.313.247,83	-	-	-	-	-	7.364.765,80

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			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Total	5,10	7,58	67,33%

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)
6,49	4,77	4,98	(1,58)	(7,03)



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
04/07/2022	301.675,52	Compra	Notas do Tesouro Nacional - Série B
05/07/2022	201.233,16	Compra	Notas do Tesouro Nacional - Série B
11/07/2022	332.791,40	Compra	Letra Financeira - BTG Pactual
12/07/2022	273.654,03	Compra	Letra Financeira - BTG Pactual
15/07/2022	-105.017,81	Juros	Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)
21/07/2022	1.114.486,11	Compra	Notas do Tesouro Nacional - Série B
22/07/2022	1.500.000,00	Compra	Letra Financeira - BTG Pactual

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES

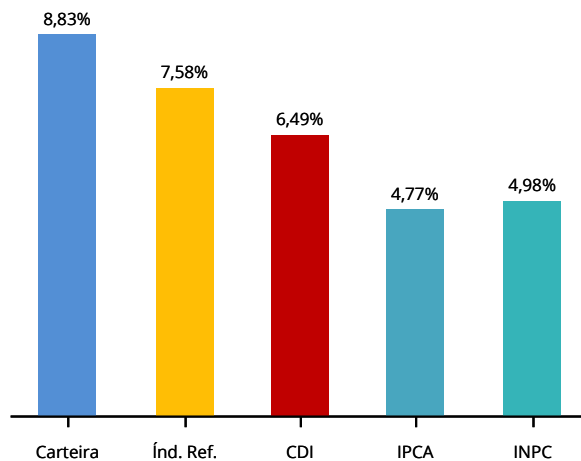
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO
------	-------	----------	-------

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: No cenário internacional, o mês foi marcado por indicadores de atividade econômica mais fracos e aumentos de juros por parte dos Banco Centrais. Nos EUA, dados de atividade mostraram acomodação no mês, com o resultado preliminar do PIB do 2º trimestre apresentado queda de 0,9% e representando uma recessão técnica. Em linha, na Zona do Euro, as prévias dos PMI de julho indicaram contração dos setores. Nos EUA, a inflação permaneceu elevada, motivando o FED a prosseguir com o aperto monetário, com um novo aumento de 75 bps nas taxas de juros. Similarmente, na Zona do Euro, a prévia da inflação de julho aumentou em comparação a junho, levando o ECB a elevar as taxas de juros em 50 bps.

Economia Brasileira: No Brasil, o mês ficou marcado pela sanção da PEC dos Benefícios Sociais, que terá um impacto fiscal de R\$ 40 bi, e pelo início das convenções partidárias que oficializam as principais candidaturas para as eleições de 2022. Em relação à inflação, o IPCA-15 apresentou alta de 0,13%, mas desacelerou em comparação a junho, condicionado por reduções nos preços de energia elétrica e combustíveis. Apesar do resultado, a inflação permanece com composição desfavorável, com leituras acima dos níveis pré-pandemia. Com esse cenário, espera-se que o Banco Central encerre o ciclo de aperto de juros na próxima reunião, com um novo aumento de 50 bps.

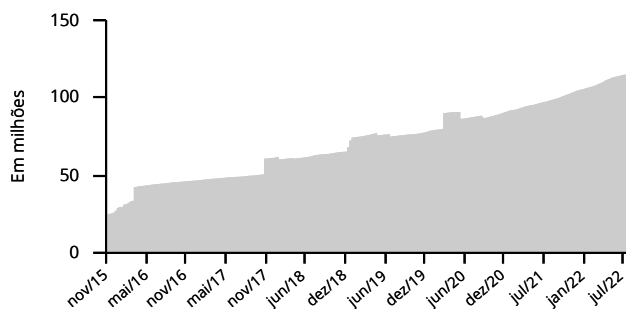
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



Mês	Ago-21	Set-21	Out-21	Nov-21	Dez-21	Jan-22	Fev-22	Mar-22	Abr-22	Mai-22	Jun-22	Jul-22	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev ALM CP	1,30	1,58	1,43	1,63	1,28	1,06	1,12	1,83	1,74	1,41	0,94	0,42	8,83	16,93	34,13
Índ. Ref.	1,26	1,56	1,50	1,18	1,12	1,03	1,32	2,09	1,36	0,82	0,98	(0,25)	7,58	14,90	31,66
CDI	0,42	0,44	0,48	0,59	0,76	0,73	0,75	0,92	0,83	1,03	1,01	1,03	6,49	9,39	12,05
IPCA	0,87	1,16	1,25	0,95	0,73	0,54	1,01	1,62	1,06	0,47	0,67	(0,68)	4,77	10,07	19,97

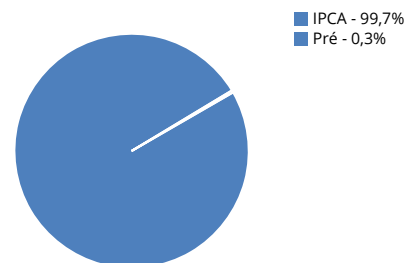
Índice de Referência INPC + 4.35% a.a.

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

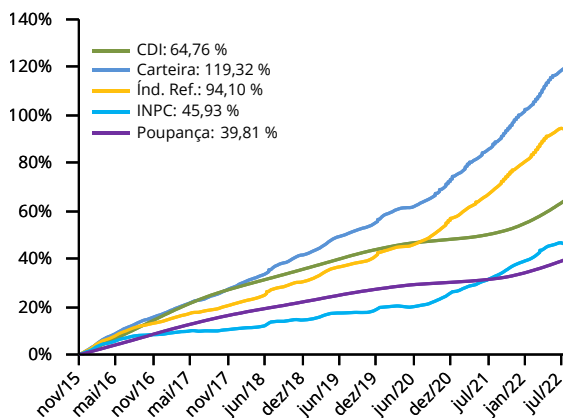


DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO

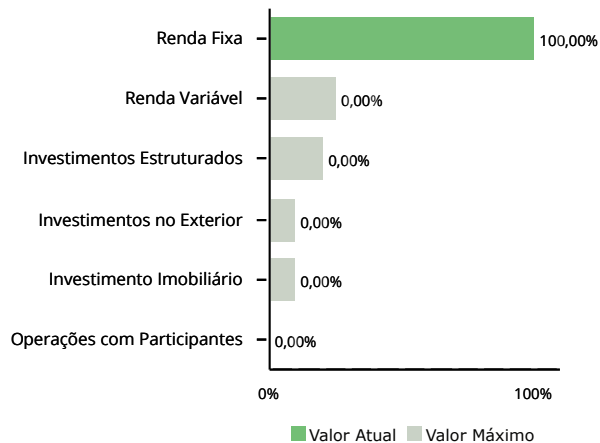
Patrimônio Líquido R\$ 114.904.476,59



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





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



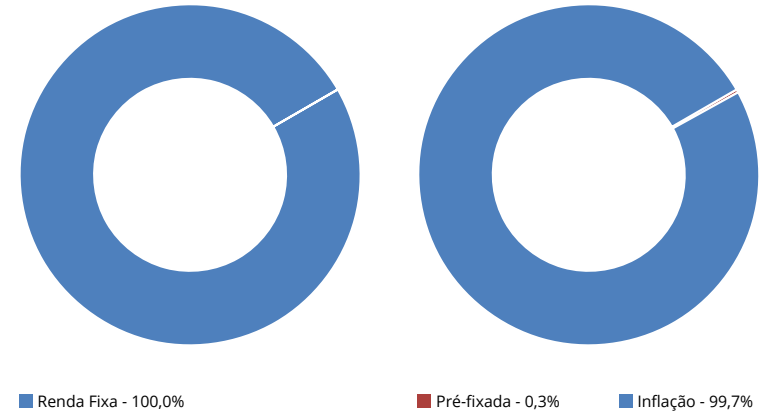
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

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

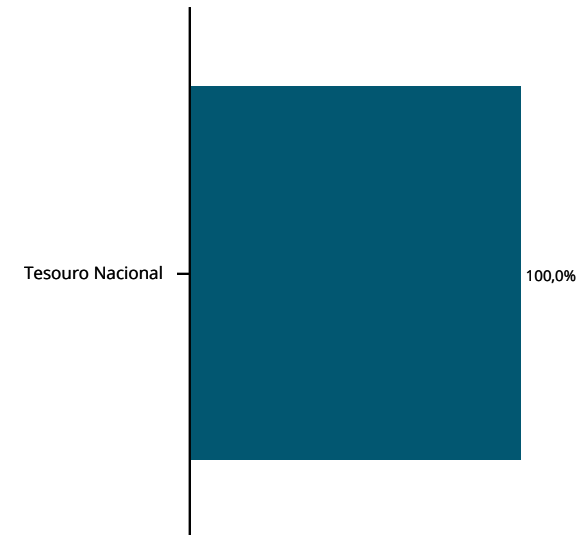


ATIVOS	JULHO-22	%	JUNHO-22	%
RENDA FIXA	114.909.841,19	100,0%	114.427.436,98	100,0%
Compromissada - Títulos Públicos	349.234,16	0,3%	357.509,03	0,3%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	114.560.607,03	99,7%	114.069.927,95	99,7%
TESOURARIA	(5.364,56)	0,0%	(2.449,61)	0,0%
Caixa	1.000,00	0,0%	1.000,00	0,0%
Valores a Pagar/Receber	(6.364,56)	0,0%	(3.449,61)	0,0%
TOTAL DA CARTEIRA	114.904.476,63	100%	114.424.987,37	100%

GRÁFICOS DE DISTRIBUIÇÃO



INSTITUIÇÃO²



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	29/07/2022	01/08/2022	13,14% a.a.	349.234,16	349.234,16	-	349.234,16	0,30%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,28%	1.058.426,68	1.502.202,23	-	1.502.202,23	1,31%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,28%	172.302,01	244.544,54	-	244.544,54	0,21%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	30/12/2015	15/05/2045	IPCA + 7,32%	947.095,85	1.390.926,37	-	1.390.926,37	1,21%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/11/2017	15/05/2035	IPCA + 5,28%	9.842.760,14	12.894.144,73	-	12.894.144,73	11,22%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	19/06/2018	15/05/2055	IPCA + 5,91%	1.261.769,06	1.638.026,65	-	1.638.026,65	1,43%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/03/2016	15/05/2023	IPCA + 6,40%	855.964,59	1.207.552,68	-	1.207.552,68	1,05%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	09/11/2015	15/08/2022	IPCA + 7,43%	4.876.293,27	7.772.517,59	-	7.772.517,59	6,76%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	20/12/2021	15/08/2024	IPCA + 5,38%	1.988.955,26	2.063.641,04	-	2.063.641,04	1,80%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/12/2015	15/08/2022	IPCA + 7,52%	491.090,26	777.222,63	-	777.222,63	0,68%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	20/12/2021	15/08/2026	IPCA + 5,14%	2.026.188,29	2.088.034,03	-	2.088.034,03	1,82%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/12/2015	15/08/2022	IPCA + 7,52%	1.395.730,20	2.208.948,52	-	2.208.948,52	1,92%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	20/12/2021	15/05/2025	IPCA + 5,26%	1.975.667,08	2.046.553,74	-	2.046.553,74	1,78%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/11/2015	15/05/2023	IPCA + 7,38%	1.223.238,40	1.878.522,81	-	1.878.522,81	1,63%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	20/12/2021	15/05/2023	IPCA + 5,80%	1.937.738,72	2.033.023,77	-	2.033.023,77	1,77%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/11/2015	15/05/2023	IPCA + 7,35%	4.953.157,53	7.595.658,14	-	7.595.658,14	6,61%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	25/05/2022	15/08/2024	IPCA + 5,78%	3.031.373,67	3.034.766,23	-	3.034.766,23	2,64%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	18/11/2015	15/05/2023	IPCA + 7,18%	5.118.088,52	8.004.849,66	-	8.004.849,66	6,97%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/03/2016	15/05/2023	IPCA + 6,38%	3.256.186,12	4.589.362,80	-	4.589.362,80	3,99%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	24/12/2018	15/08/2024	IPCA + 4,47%	1.348.172,69	1.641.655,77	-	1.641.655,77	1,43%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	31/05/2017	15/08/2026	IPCA + 5,65%	1.493.159,87	1.980.390,16	-	1.980.390,16	1,72%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	22/08/2018	15/08/2030	IPCA + 5,65%	2.048.893,74	2.650.060,92	-	2.650.060,92	2,31%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/11/2015	15/05/2035	IPCA + 7%	5.062.404,62	7.434.090,23	-	7.434.090,23	6,47%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	14/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,31%	241.312,77	362.360,50	-	362.360,50	0,32%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,44%	860.308,17	1.290.699,16	-	1.290.699,16	1,12%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,34%	121.192,13	180.758,53	-	180.758,53	0,16%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,54%	474.768,52	711.167,22	-	711.167,22	0,62%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	13/01/2016	15/05/2035	IPCA + 7,34%	549.253,50	813.249,45	-	813.249,45	0,71%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/02/2016	15/05/2035	IPCA + 7,40%	1.703.916,03	2.481.988,35	-	2.481.988,35	2,16%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/03/2016	15/05/2055	IPCA + 6,38%	4.095.944,22	5.687.286,33	-	5.687.286,33	4,95%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	28/08/2020	15/08/2050	IPCA + 4%	1.114.803,90	1.353.391,41	-	1.353.391,41	1,18%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/08/2020	15/08/2050	IPCA + 3,90%	1.130.879,32	1.373.631,66	-	1.373.631,66	1,20%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	16/03/2020	15/08/2050	IPCA + 4,45%	10.007.893,59	12.164.905,08	-	12.164.905,08	10,59%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/01/2019	15/08/2050	IPCA + 4,60%	2.378.295,32	2.976.495,33	-	2.976.495,33	2,59%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	16/03/2016	15/08/2050	IPCA + 6,82%	1.153.894,05	1.667.247,53	-	1.667.247,53	1,45%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/01/2019	15/05/2045	IPCA + 4,62%	1.922.501,16	2.399.223,06	-	2.399.223,06	2,09%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	02/01/2019	15/05/2045	IPCA + 4,98%	2.093.975,28	2.629.707,77	-	2.629.707,77	2,29%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	24/12/2018	15/05/2045	IPCA + 5,02%	1.340.943,59	1.686.995,62	-	1.686.995,62	1,47%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,28%	73.843,71	104.804,79	-	104.804,79	0,09%
TOTAL						114.909.841,19	-	114.909.841,19	100,00%

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%	

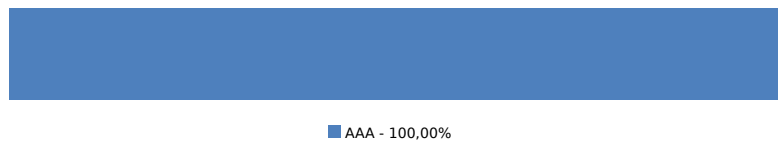
RATINGS ESCALA NACIONAL DE LONGO PRAZO¹

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	-

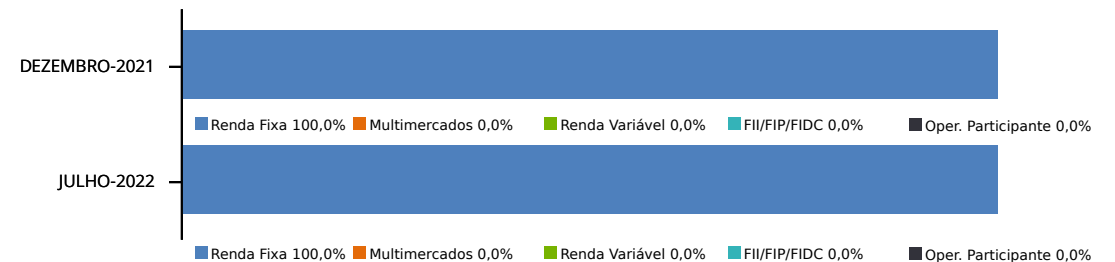
LEGENDA

Nota elevada
Nota rebaixada

RATING DOS ATIVOS



MUTAÇÃO DE INVESTIMENTOS



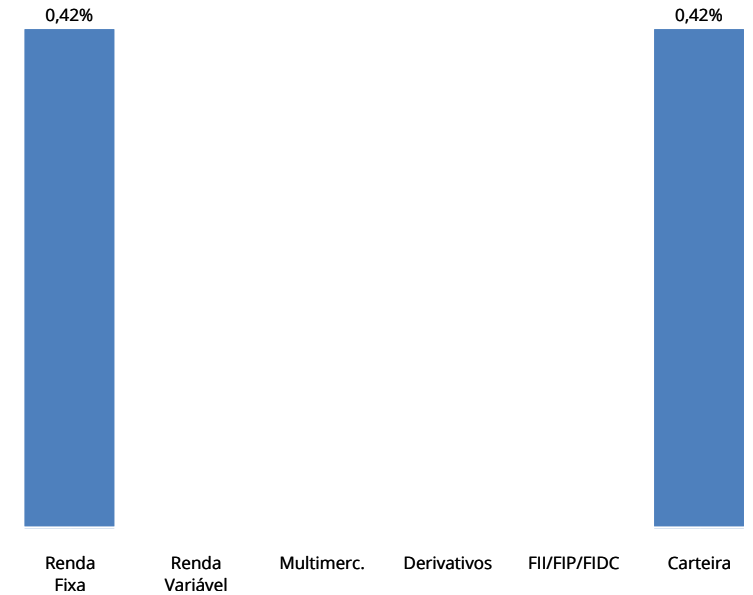
¹Engloba Tesouro Nacional, Bancos, FIDCs e Debêntures

RENTABILIDADE	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES	
	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Renda Fixa						
Compromissada - Títulos Públicos	1,03	-	6,49	85,6%	-	-
Notas do Tesouro Nacional - Série B	0,43	-	8,97	118,3%	17,49	117,4%

RENTABILIDADE INDICADORES	NO MÊS %	NO ANO %	EM 12 MESES %
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	-0,25	7,58	14,90
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	-0,25	7,58	14,90
Op. com Participante (0% CDI)	0,00	0,00	0,00
CDI	1,03	6,49	9,39
IPCA	-0,68	4,77	10,07
INPC	-0,60	4,98	10,12
Ibovespa	4,69	-1,58	-15,30
Dólar	-0,95	-7,03	1,30

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	0,43	8,75	16,72
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

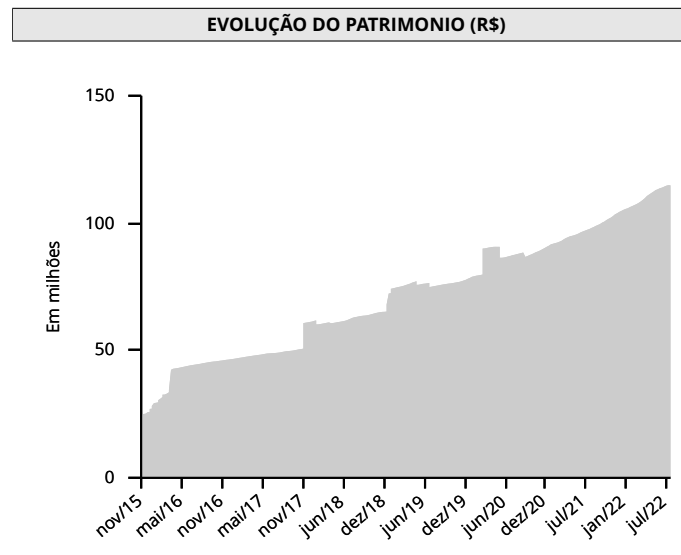
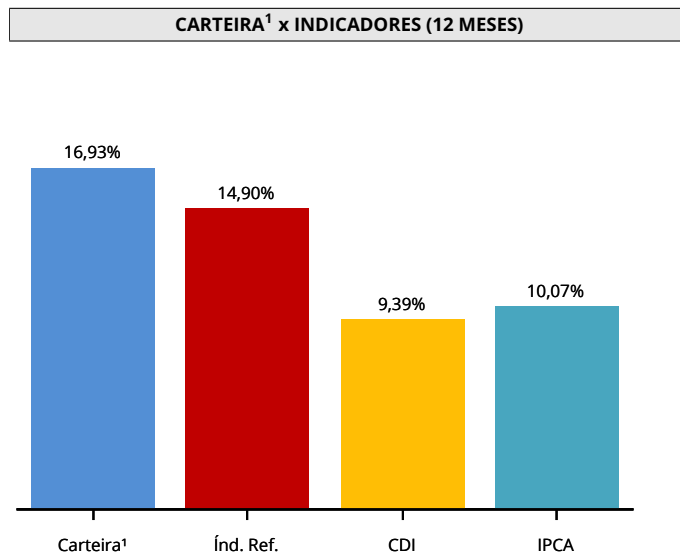
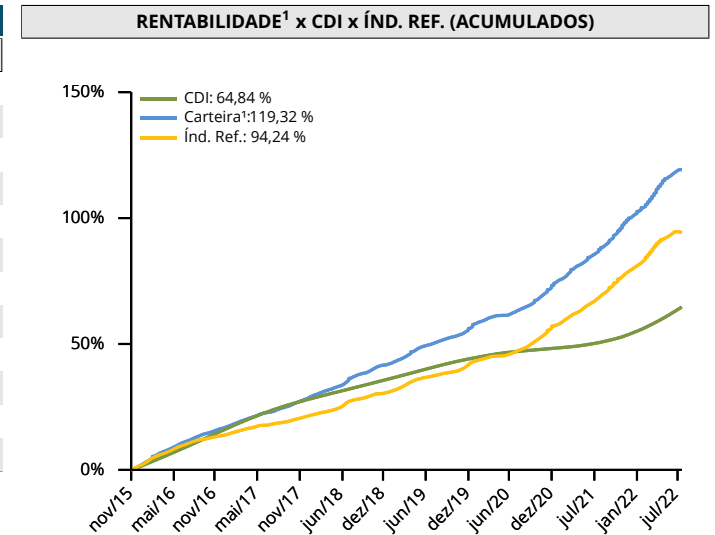
COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA



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	-	-	-	-	-	9.437.302,07
Compromissada - Títulos Públicos	54.198,47	3.618,10	-	-	-	-	-	57.816,57
Notas do Tesouro Nacional - Série B	8.888.806,42	490.679,08	-	-	-	-	-	9.379.485,50
TOTAL	8.943.004,89	494.297,18	-	-	-	-	-	9.437.302,07

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			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Total	8,83	7,58	116,49%

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)
6,49	4,77	4,98	(1,58)	(7,03)



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

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%

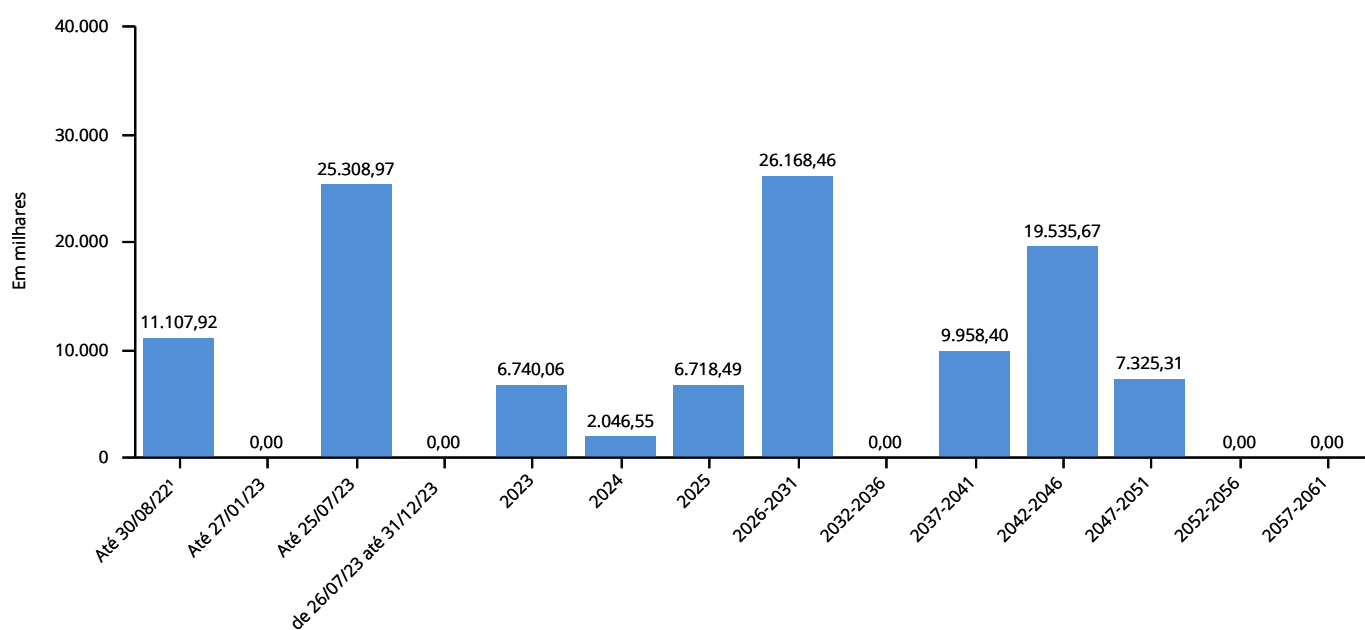
2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	0,83%	0,77%	0,99%	1,27%	0,92%	0,45%	0,70%	0,67%	0,57%	0,54%	0,72%	1,33%	10,22%
Rent. Líquida	0,83%	0,77%	0,99%	1,27%	0,92%	0,45%	0,70%	0,67%	0,57%	0,54%	0,72%	1,33%	10,22%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,47%	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%						8,83%
Rent. Líquida	1,06%	1,12%	1,83%	1,74%	1,41%	0,94%	0,42%						8,83%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%						6,49%
Índice Ref.	1,03%	1,32%	2,09%	1,36%	0,82%	0,98%	-0,25%						7,58%

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

Ao longo do mês de julho, dados de atividade divulgados corroboraram uma desaceleração mais forte que a esperada nos Estados Unidos e na Europa, enquanto a inflação global permaneceu pressionada. Diante da elevada incerteza, os bancos centrais de países desenvolvidos optaram por indicar que ficarão dependentes de dados para conduzir a política monetária. No Brasil, os relevantes impactos baixistas na inflação de curto prazo – oriundos das medidas de redução de impostos – ficaram mais claros e continuaram gerando efeito contrário nas expectativas de inflação de 2023, ao piorarem a percepção fiscal.

Houve continuidade do movimento de desaceleração das commodities globais verificado em junho, diante do aumento das probabilidades de recessão nos Estados Unidos. Com relação à desaceleração da economia chinesa, novos riscos surgiram ao longo do mês, particularmente relacionados a boicotes no setor imobiliário, e as autoridades já assumem que não conseguirão cumprir as metas de crescimento, apesar de manterem o discurso de que continuarão estimulando a economia. A virada do mês foi marcada por tensões entre Taiwan, China e Estados Unidos, elevando o risco de conflitos armados.

Do lado da guerra entre Rússia e Ucrânia, apesar de a ofensiva permanecer na região, um acordo internacional assinado no fim do mês entre os dois países, Turquia e as Nações Unidas, estabeleceu a reabertura dos portos ucranianos para o mar Negro, liberando o escoamento de grãos. Após o acordo, um primeiro navio partiu do porto de Odessa sem contratemplos. O episódio contribui com o movimento recente de desaceleração das commodities.

Os bancos centrais dos principais países desenvolvidos adotaram posturas cautelosas diante do quadro global de incerteza altamente elevada, indicando que ficarão dependentes de dados. Ainda assim, o discurso é duro no combate à inflação, que ainda não mostra sinais claros de desaceleração: núcleos permanecem pressionados e salários acelerando.

Após diversas medidas de redução de impostos para baixar a inflação doméstica, o congresso brasileiro promulgou a PEC que aumenta o valor do programa Auxílio Brasil para R\$ 600,00. A medida populista aumenta de forma relevante o risco fiscal e os dois principais oponentes na disputa da presidência já indicaram que manterão o valor neste patamar, caso vençam a eleição.

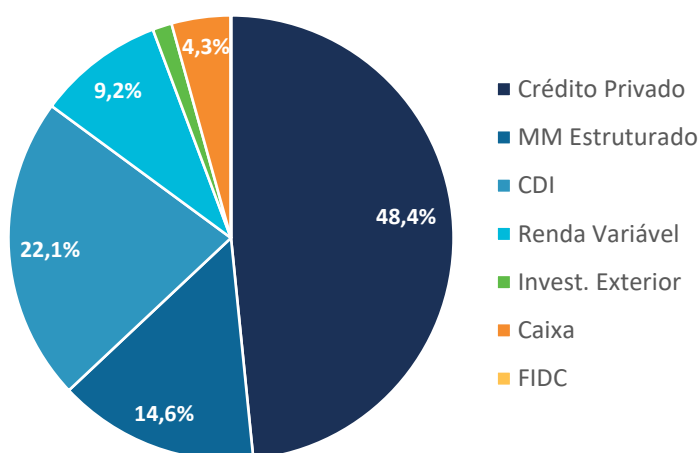
Com a política fiscal indo em direção contrária à política monetária, a consequente deterioração das expectativas deixa o Banco Central do Brasil em posição ainda mais difícil, tornando necessária, na nossa visão, mais uma alta de juros na reunião de setembro. Em outubro, quando 2024 passará a ter peso significativo no horizonte relevante para a política monetária, o Banco Central encontrará espaço para encerrar o ciclo, dada a projeção de 2024 abaixo da meta. Caso o cenário continue se deteriorando, o BC deve optar por manter a taxa de juros em patamar elevado por mais tempo.

Os dados de inflação e atividade globais serão extremamente relevantes para ditar os movimentos dos bancos centrais dos Estados Unidos e da Europa nos próximos meses. No Brasil, o mês de agosto dará início às campanhas eleitorais, que serão o principal tema doméstico a partir de agora, enquanto o banco central prepara o terreno para encerrar o ciclo de alta dos juros.

Composição do fundo

CLASSE	FUNDOS	%PL	
CDI	Icatu Vanguarda Gold FI RF LP	5,2%	22,1%
	Mag Renda Fixa Fundo De Investimento	3,9%	
	Itaú Institucional Optimus RF LP FI	5,0%	
	Icatu Vanguarda Renda Fixa Plus	7,9%	
Crédito Privado	Icatu Vanguarda Crédito Privado Institucional FIRF	31,2%	48,4%
	Arx Vinson FIC FIRF CP	16,2%	
	Icatu Vanguarda Crédito Privado FI RF LP	1,0%	
Multimercado Estruturado	Legacy Capital FICFI MM	2,9%	14,6%
	Nimitz IV FIC FIM	2,8%	
	Icatu Vanguarda Hedge FIM	8,9%	
Invest Exterior	BB Multimercado Schroder IE FI	1,4%	1,4%
Renda Variável	Icatu Vanguarda IBX	1,1%	9,2%
	BOVV11	3,2%	
	Oceana Selection FIC FIA	1,1%	
	Constellation Institucional II FIC FIA	0,7%	
	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	-	4,3%	4,3%

* FIDCs foram herdados da gestão anterior.



RELATÓRIO ICATU VANGUARDA FIC FIM CP JUSPREV JULHO 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%	-	-	-	-	-
Crédito	41,0%	40,7%	40,6%	41,2%	41,3%	42,1%	48,4%	-	-	-	-	-
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%	-	-	-	-	-
Renda Variável	11,4%	11,4%	11,3%	12,3%	12,3%	12,3%	9,2%	-	-	-	-	-
FIDC'S	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,0%	-	-	-	-	-
Invest. Ext.	9,5%	9,4%	9,1%	10,1%	10,0%	3,9%	1,4%	-	-	-	-	-
Caixa	1,2%	1,7%	1,5%	0,9%	1,6%	3,7%	4,3%	-	-	-	-	-

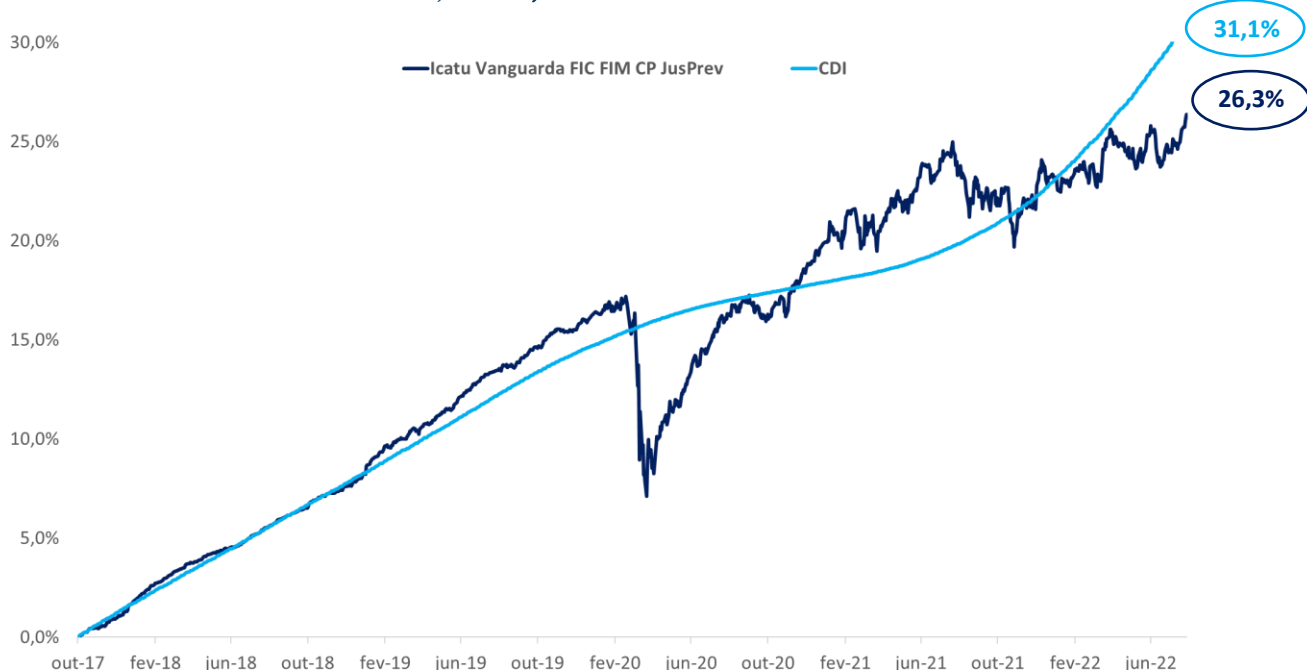
Rentabilidade acumulada do fundo

	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%	-	-	-	-	-	2,58%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	-	-	-	-	-	6,49%
% CDI	23,35%	37,52%	146,94%	-	90,87%	-	152,64%	-	-	-	-	-	39,68%
INPC+4,35%	1,03%	1,32%	2,09%	1,36%	0,82%	0,98%	-0,25%	-	-	-	-	-	7,58%

RELATÓRIO ICATU VANGUARDA FIC FIM CP JUSPREV JULHO 2022

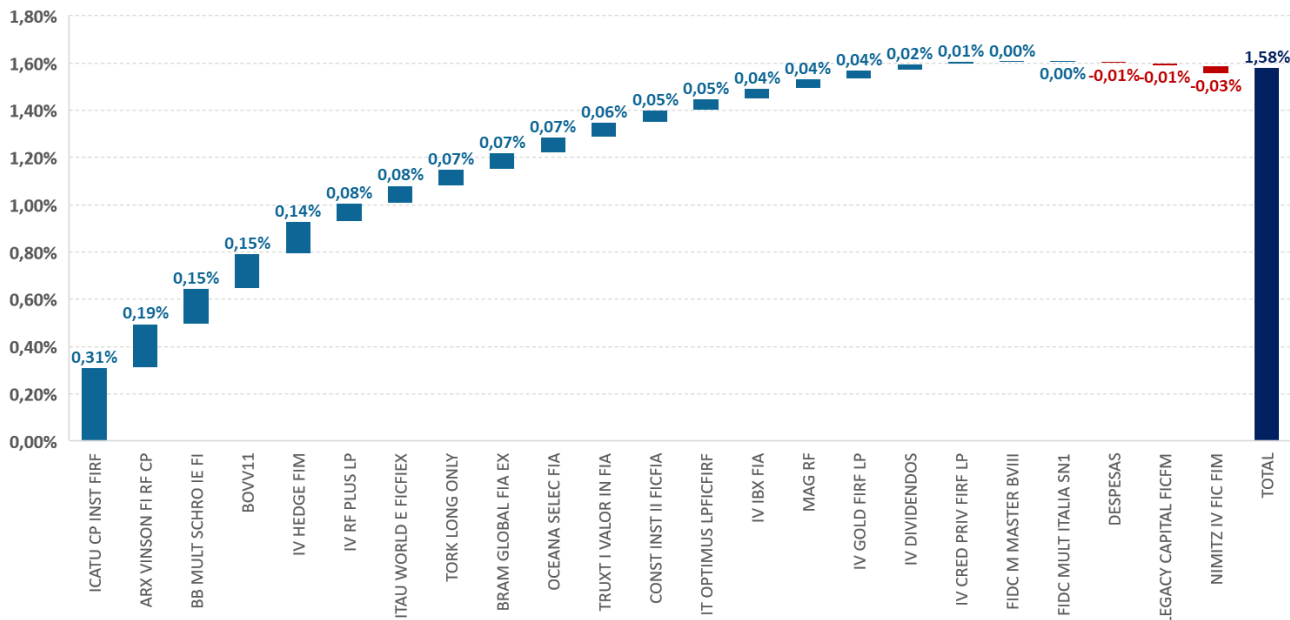


Rentabilidade Individual dos Fundos

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%	-	-	-	-	-	6,71%
Icatu Vanguarda Renda Fixa Plus	0,72%	0,81%	1,13%	0,86%	1,06%	0,97%	0,98%	-	-	-	-	-	6,72%
Icatu Vanguarda Crédito Privado FI RF LP	0,83%	0,84%	1,03%	0,90%	1,14%	1,10%	1,10%	-	-	-	-	-	7,13%
Mag Renda Fixa Fundo De Investimento	0,75%	0,78%	0,97%	0,80%	1,06%	1,02%	1,02%	-	-	-	-	-	6,57%
Icatu Vanguarda CP Institucional FIRF	0,89%	0,90%	0,99%	0,98%	1,19%	1,13%	1,07%	-	-	-	-	-	7,37%
Arx Vinson FIC FIRF CP	0,82%	0,88%	1,11%	0,93%	1,19%	1,21%	1,13%	-	-	-	-	-	7,50%
Itaú Institucional Optimus RF LP FI	0,60%	0,98%	1,43%	1,26%	0,97%	0,98%	0,95%	-	-	-	-	-	7,39%
Icatu Vanguarda Hedge FIM	0,39%	1,33%	1,91%	0,09%	1,22%	0,36%	1,53%	-	-	-	-	-	7,00%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	-	-	-	-	-	6,49%
Mag Inflação Ref IMA-B FIRF LP	-0,82%	0,48%	3,13%	0,84%	1,03%	-0,45%	-0,97%	-	-	-	-	-	3,21%
IMA-B	-0,73%	0,54%	3,07%	0,83%	0,96%	-0,36%	-0,88%	-	-	-	-	-	3,43%
Icatu Vanguarda RF CP Inflação	-0,15%	1,12%	2,86%	1,41%	0,88%	0,19%	0,15%	-	-	-	-	-	6,61%
Icatu Vanguarda Inflação Curta FIRF LP	0,09%	1,05%	2,57%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	6,49%
IMA-B5	0,11%	1,06%	2,61%	1,56%	0,78%	0,33%	0,01%	-	-	-	-	-	6,62%
Icatu Vanguarda Inflação Longa FIRF LP	-1,64%	-0,01%	3,52%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,04%
IMA-B5+	-1,61%	0,01%	3,56%	0,08%	1,16%	-1,10%	-1,84%	-	-	-	-	-	0,16%
Icatu Vanguarda IBX FIA	7,15%	1,42%	5,59%	-10,10%	3,23%	-11,70%	4,31%	-	-	-	-	-	-1,92%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	6,87%	0,74%	5,22%	-8,60%	1,45%	-9,41%	3,85%	-	-	-	-	-	-1,18%
Tork Long Only Institucional FIC FIA	5,57%	0,25%	7,68%	-9,03%	1,98%	-8,40%	6,06%	-	-	-	-	-	2,71%
Oceana Selection FIC FIA	7,05%	-0,04%	6,27%	-8,88%	0,83%	-9,06%	5,97%	-	-	-	-	-	0,70%
JGP Long Only Institucional FIA	3,24%	-3,74%	5,73%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-11,67%
Truxt I Valor Institucional FIC FIA	4,71%	0,47%	5,77%	-8,75%	2,10%	-8,67%	5,69%	-	-	-	-	-	0,08%
Constellation Institucional II FIC FIA	0,34%	-0,57%	4,89%	-12,05%	-0,28%	-11,04%	7,76%	-	-	-	-	-	-12,01%
IBX	6,87%	1,46%	5,96%	-10,11%	3,23%	-11,56%	4,40%	-	-	-	-	-	-1,58%
Itaú Private Multimercado S&P500	-5,29%	-2,18%	4,58%	-8,62%	0,95%	-	-	-	-	-	-	-	-9,27%
US:SP500	-5,26%	-2,90%	3,32%	-8,80%	0,01%	-8,39%	9,11%	-	-	-	-	-	-13,34%
BOVV11	7,14%	1,07%	5,80%	-10,21%	3,41%	-11,52%	4,82%	-	-	-	-	-	-1,33%
IBOV	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%	-	-	-	-	-	-1,58%
BB Multimercado Schroder IE FI	-9,82%	-5,51%	-4,97%	-3,12%	-4,07%	0,42%	4,78%	-	-	-	-	-	-20,81%
Itaú World Equities FIC FIA IE	-10,49%	-4,70%	-4,43%	-3,71%	-5,54%	0,23%	-	-	-	-	-	-	-20,58%
Bradesco Global FIA Exterior	-9,68%	-5,36%	-5,98%	-4,82%	-3,64%	1,03%	-	-	-	-	-	-	-20,99%
MSCI World (Em reais)	-9,95%	-5,21%	-5,69%	-4,85%	-3,93%	0,29%	6,85%	-	-	-	-	-	-21,14%
IVVB11	-11,30%	-5,72%	-4,01%	-4,90%	-4,28%	-	-	-	-	-	-	-	-20,12%
US SP 500 - BRL	-9,05%	-6,85%	-4,75%	-5,31%	-3,86%	1,47%	8,08%	-	-	-	-	-	-19,43%

Atribuição de Performance

Julho/2022



2022

