



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Julho 2022

SUMÁRIO

1. Parecer do Comitê de Acompanhamento dos Investimentos Financeiros (CAIF).....	3
2. Relatório de Investimentos.....	4
3. Apresentação.....	5
4. Cenário Econômico.....	5
5. Desempenho e Movimentações.....	6
6. Carteira.....	9
7. Conformidade com a Política de Investimentos.....	10
7.1. Demonstrações Gráficas.....	11
8. Fundos Estressados.....	12
8.1. FIDC MULTISSETORIAL MASTER III.....	12
8.2. PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP.....	12
9. Fundos Estruturados (FIP).....	13
10. Alocação por Instituição.....	14
11. Risco (VaR) dos Fundos na Carteira.....	15
12. Demonstração dos fundos por segmento.....	16
12.1. Renda Fixa.....	16
12.2. Renda Variável.....	18
12.3. Exterior.....	20
13. Agenda Realizada.....	22

1. PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS (CAIF)

Em 02 de Julho de 2019 o IPMJ formalizou sua adesão ao Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios - "Pró Gestão RPPS". Em atendimento ao Manual do Pró Gestão RPPS, apresenta-se o presente relatório, referente ao mês de julho de 2022, que é elaborado mensalmente pela Unidade de Gestão de Investimentos.

O relatório foi apresentado ao Comitê e contém seus respectivos valores registrados pela Contabilidade. Foram analisadas a legalidade e a conformidade com a Política de Investimentos. O relatório reflete que as movimentações financeiras atenderam aos requisitos legais e às previsões da Política de Investimentos e que atende às necessidades da gestão dos investimentos.



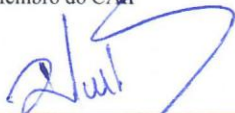
Renata de Souza Santos Esteves
Diretora do Dep. Administrativo-Financeiro - CPA-10



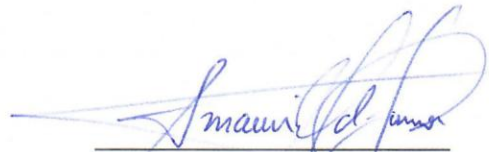
Luís Gustavo Ferreira Bonacina
Assessor da Presidência - CPA-20

AUSÊNCIA
JUSTIFICADA

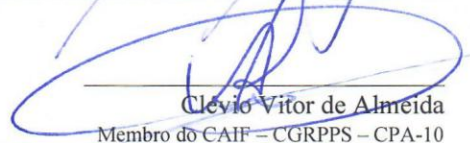
Rafaela Carvalho dos Santos
Membro do CAIF



José Ricardo Vinhas
Membro do CAIF



Amauri Arnaldo Junior
Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos CPA - 10



Clevio Vitor de Almeida
Membro do CAIF - CGRPPS - CPA-10



Victor Adriano Vieira Silva
Membro do CAIF - CGRPPS

2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 24 dias de agosto de 2022 nas dependências do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, situado na Rua Antônio Afonso, nº 513 — Centro, Jacareí – SP — CEP: 12327-270, o Conselho Fiscal — biênio 2021/2023 reuniu-se, para análise do relatório de investimentos referente ao mês de julho de 2022, considerando as explicações dos investimentos, rentabilidade e pormenores constantes no presente documento, pela Diretoria Administrativo - Financeiro deste Instituto, APROVAMOS o relatório de investimentos referente ao mês de julho de 2022.

Jacareí, 24 de agosto de 2022.



AMAURI ARNALDO JUNIOR

PRESIDENTE DO CONSELHO FISCAL



VALDIR DOS SANTOS PEREIRA

MEMBRO DO CONSELHO FISCAL



RAFAELA CARVALHO DOS SANTOS

MEMBRO DO CONSELHO FISCAL

3. APRESENTAÇÃO

Este documento apresenta o relatório mensal de investimentos do Instituto de Previdência do Município de Jacareí – IPMJ para mês de julho de 2022.

4. CENÁRIO ECONÔMICO

As preocupações com o impacto do aperto das condições financeiras globais sobre as expectativas de crescimento se intensificaram em julho, pesando sobre a inflação que continua elevada. Indicadores antecedentes e de alta frequência apontando para uma desaceleração econômica mais rápida do que o esperado, principalmente nos EUA e na Europa, apoiaram essas preocupações e levaram a uma reprecificação das altas de juros esperadas nessas regiões. Curiosamente, o primeiro aumento de juros na Europa em 12 anos e os dois aumentos de 75bps nos EUA desde maio foram interpretados como expectativas de um ciclo de alta completo, com curvas de juros em ambos os países começando a precificar as taxas para este ano. Menor do que há dois meses, e até um corte na taxa no primeiro semestre de 2023.

E espera-se que, após picos de inflação, a taxa de juros desacelere nos países desenvolvidos. Isso ainda exigirá que o mercado tome medidas de aperto adicionais mais drásticas do que o esperado no início de agosto. No curto prazo, no entanto, os temores de uma recessão nos próximos 12 meses parecem ter levado a uma maior volatilidade e até mesmo a uma recuperação em alguns ativos de risco.

No Brasil, o ciclo de alta parece estar chegando ao fim, com as taxas de juros já em território de contração significativa. Afetado principalmente pela queda de 15,48% nos preços da gasolina, o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) recuou 0,68% em julho, após alta de 0,67% no mês anterior. Essa é a menor taxa mensal de toda a série histórica do índice a partir de 1980. Mesmo assim, a taxa de inflação acumulada em 12 meses permaneceu em dois dígitos em 10,07% (IBGE). Apesar disso, apenas duas das nove categorias de gastos (transportes e habitação) caíram de preços durante o mês, e os preços dos alimentos voltaram a acelerar.

Embora o núcleo da inflação permaneça alto e as expectativas de inflação de médio prazo estejam sob pressão, o banco central do Brasil provavelmente confiará no impacto tardio das políticas de aperto implementadas nos últimos 15 meses para manter a inflação no caminho certo na tentativa de convergir para sua meta no médio prazo. Essa situação sugere que, ao final do ciclo, a Selic deve se manter em alta por um longo período de tempo.

Por fim, os ventos contrários do exterior permanecem e os fundamentos do país continuam sendo uma preocupação diante de uma mistura atípica de incertezas no regime macroeconômico (principalmente âncoras fiscais) que entra em vigor a partir de 2023; e o cenário político à medida que as eleições se aproximam da agitação.

Os índices de renda fixa encerraram o mês de julho: IRF-M 1,15 %, IMA-B -0,88 %, IMA-B5 0,01 % e IMA-B5+ -1,84 %, e na renda variável: IBOV 4,69 %, o Índice Small Cap. 5,16 %, IBrX 50 4,54 %.

5. DESEMPENHO E MOVIMENTAÇÕES

O patrimônio do IPMJ no fechamento do mês de julho de 2022 foi de R\$ 628.819.737,77 (seiscentos e vinte e oito milhões e oitocentos e dezenove mil e setecentos e trinta e sete reais e setenta e sete centavos).

A carteira de renda fixa artigo 7º rendeu no mês R\$ 820.615,41 (oitocentos e vinte mil e seiscentos e quinze reais e quarenta e um centavos). Com a carteira de renda variável artigo 8º a rentabilidade foi de R\$ 4.523.574,81 (quatro milhões e quinhentos e vinte e três mil e quinhentos e setenta e quatro reais e oitenta e um centavos). A carteira do exterior artigo 9º rendeu R\$ 3.357.657,20 (três milhões e trezentos e cinquenta e sete mil e seiscentos e cinquenta e sete reais e vinte centavos). A carteira de renda variável artigo 10º rendeu R\$ 4.457.619,45 (quatro milhões e quatrocentos e cinquenta e sete mil e seiscentos e dezenove reais e quarenta e cinco centavos).

Tabela 1 Rendimento Mensal Acumulado

Acumulado 2022	Janeiro	Fevereiro	Março
Art. 7º	R\$ 2.086.069,15	R\$ 1.607.211,24	R\$ 7.894.766,43
Art. 8º	R\$ 6.636.950,68	-R\$ 462.659,01	R\$ 5.526.323,59
Art. 9º	-R\$ 8.637.265,04	-R\$ 3.507.997,08	-R\$ 2.006.104,89
Art. 10º	-R\$ 2.347.184,64	-R\$ 809.110,95	R\$ 2.286.466,64
Cupons	R\$ -	R\$ 2.416.905,19	R\$ -
Amortização	R\$ -	R\$ 2.117.806,90	R\$ -
Total	-R\$ 2.261.429,85	R\$ 1.362.156,29	R\$ 13.701.451,77

Abril	Maio	Junho	Julho	Total
R\$ 6.167.938,86	R\$ 1.877.232,43	R\$ 2.524.615,84	R\$ 820.615,41	R\$ 22.978.449,36
-R\$ 8.656.884,68	R\$ 2.283.458,95	-R\$ 11.337.679,80	R\$ 4.523.574,81	-R\$ 1.486.915,45
-R\$ 4.399.651,62	-R\$ 3.055.404,84	-R\$ 494.594,71	R\$ 3.357.657,20	-R\$ 18.743.360,98
-R\$ 4.583.044,94	R\$ 431.144,30	-R\$ 3.246.961,60	R\$ 4.457.619,45	-R\$ 3.811.071,74
R\$ -	R\$ 2.634.434,71	R\$ -	R\$ -	R\$ 5.051.339,90
R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.117.806,90
-R\$ 11.471.642,39	R\$ 4.170.865,55	-R\$ 12.554.620,27	R\$ 13.159.466,88	R\$ 6.146.950,06

O rendimento acumulado no ano fechou R\$ 6.146.950,06 (seis milhões e cento e quarenta e seis mil e novecentos e cinquenta reais e seis centavos) e no mês de julho de 2022 em R\$ 13.159.466,88 (treze milhões e cento e cinquenta e nove mil e quatrocentos e sessenta e seis reais e oitenta e oito centavos). Por fim, a rentabilidade acumulada da carteira no mês foi de 2,05% e no ano foi de 0,97%, enquanto a meta mensal foi de -0,29% e a meta anual de 8,91%.

Tabela 2 Investimento - Saldo mensal

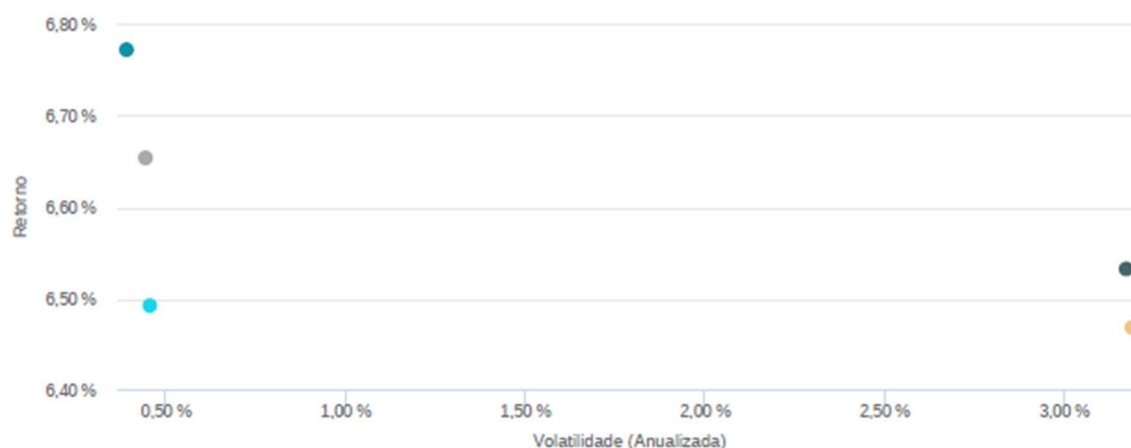
	Art. 7º	Art. 8º	Art. 9º	Art. 10º	TOTAL
JANEIRO	R\$ 386.794.806,56	R\$ 125.575.229,74	R\$ 57.263.568,34	R\$ 59.887.889,09	R\$ 629.521.493,73
FEVEREIRO	R\$ 390.832.814,82	R\$ 125.112.570,53	R\$ 53.755.571,26	R\$ 59.068.788,14	R\$ 628.769.744,75
MARÇO	R\$ 396.035.127,30	R\$ 130.638.894,08	R\$ 51.749.466,38	R\$ 61.355.254,76	R\$ 639.778.742,52
ABRIL	R\$ 408.784.366,36	R\$ 114.928.814,03	R\$ 47.349.814,79	R\$ 56.772.209,82	R\$ 627.835.204,99
MAIO	R\$ 409.007.313,27	R\$ 117.212.272,98	R\$ 44.294.409,94	R\$ 57.203.354,14	R\$ 627.717.350,33
JUNHO	R\$ 413.218.658,62	R\$ 105.874.593,17	R\$ 43.799.815,23	R\$ 53.956.392,54	R\$ 616.849.459,57
JULHO	R\$ 417.566.274,94	R\$ 105.681.978,38	R\$ 47.157.472,45	R\$ 58.414.012,00	R\$ 628.819.737,77

Tabela 3 Relatório Mensal de Investimentos – julho

TIPO DE APLICAÇÃO	Art. 7º	Art. 8º	Art. 9º	Art. 10º	TOTAL
SALDO (m-1)	R\$ 413.218.658,62	R\$ 105.874.593,17	R\$ 43.799.815,23	R\$ 53.956.392,54	R\$ 616.849.459,56
APLICAÇÕES NO MÊS	R\$ 148.218.828,97				R\$ 148.218.828,97
RESGATES NO MÊS	-R\$ 144.691.919,19	-R\$ 4.716.189,61			-R\$ 149.408.108,80
RENDIMENTO NO MÊS	R\$ 820.615,41	R\$ 4.523.574,81	R\$ 3.357.657,20	R\$ 4.457.619,45	R\$ 13.159.466,88
CUPONS E AMORTIZAÇÕES (mês)	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
SALDO ATUAL	R\$ 417.566.274,94	R\$ 105.681.978,38	R\$ 47.157.472,45	R\$ 58.414.012,00	R\$ 628.819.737,77
RENDIMENTO PERCENTUAL	0,20%	4,27%	7,67%	8,26%	2,13%

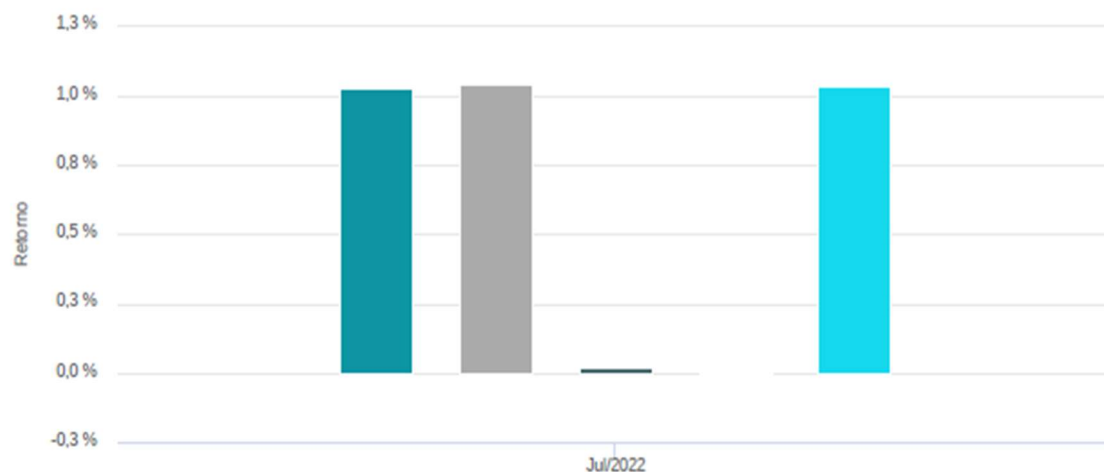
Foram realizadas as aplicações e resgates evidenciadas na ata 367º do CAIF e em conformidade com as recomendações da ALM de 2022, consolidando as seguintes movimentações: Resgate total do fundo CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP, CNPJ: 11.060.913/0001-10, no valor de R\$ 76.844.529,04 (setenta e seis milhões e oitocentos e quarenta e quatro mil e quinhentos e vinte e nove reais e quatro centavos) para alocação no fundo CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA, CNPJ: 23.215.008/0001-70, valor de R\$ 69.289.843,06 (sessenta e nove milhões e duzentos e oitenta e nove mil e oitocentos e quarenta e três reais e seis centavos) em 19/07/2022 e R\$ 7.554.777,11 (sete milhões e quinhentos e cinquenta e quatro mil e setecentos e setenta e sete reais e onze centavos) em 20/07/2022. Em seguida foi realizado resgate total do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI, CNPJ: 03.543.447/0001-03, no valor de R\$ 49.388.199,93 (quarenta e nove milhões e trezentos e oitenta e oito mil, cento e noventa e nove reais e noventa e três centavos), para alocação no fundo BB INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTORENDA FIXA, CNPJ:02.296.928/0001-90, a quantia de R\$ 47.792.458,16 (quarenta e sete milhões e setecentos e noventa e dois mil e quatrocentos e cinquenta e oito reais e dezesseis centavos) no dia 20/07/2022 e R\$ 1.595.741,77 (um milhão e quinhentos e noventa e cinco mil e setecentos e quarenta e um reais e setenta e sete centavos) no dia 21/07/2022. Posteriormente, foi realizado o resgate parcial do fundo PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO, CNPJ: 18.719.154/0001-01, no valor de R\$ 11.000.000,00 (onze milhões de reais) para alocação no fundo SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI, CNPJ: 02.224.354/0001-45, no valor de R\$ 10.999.000,00 (dez milhões e novecentos e noventa e nove mil reais). A seguir, foi realizado o resgate total do fundo XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LPCNPJ: 14.146.491/0001-98, no valor de R\$ 5.460.490,22 (cinco milhões e quatrocentos e sessenta mil e quatrocentos e noventa reais e vinte e dois centavos) para alocação no fundo SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI, CNPJ: 02.224.354/0001-45 no valor de R\$ 5.460.500,00 (cinco milhões e quatrocentos e sessenta mil e quinhentos reais). Seguindo as movimentações, foi realizado o resgate total do fundo BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA, CNPJ: 14.099.976/0001-78, valor de R\$ 4.716.189,61 (quatro milhões e setecentos e dezesseis mil e cento e oitenta e nove reais e sessenta e um centavos) para alocação no fundo SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI, CNPJ: 02.224.354/0001-45, no valor de R\$ 4.716.200,00 (quatro milhões e setecentos e dezesseis mil e duzentos reais)

Risco X Retorno de 01/01/2022 até 31/07/2022 (mensal)



Ativo	Retorno	Volatilidade (Anualizada)
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	6,77%	0,39%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	6,65%	0,44%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6,53%	3,17%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6,47%	3,19%
CDI	6,49%	0,46%

Retorno efetivo mensal de Jul/2022 até Jul/2022 (mensal)



Ativo	Retorno	Retorno YTD*	Mínimo	Máximo
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,03%	6,77%	1,03%	1,03%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,05%	6,65%	1,05%	1,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	6,53%	0,02%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00%	6,47%	0,00%	0,00%
CDI	1,03%	6,49%	1,03%	1,03%

6. CARTEIRA

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS													
Posição: 29/07/2022													
										MÊS	ANO		
DESEMPENHO DA CARTEIRA:										2,05%	0,97%		
META ATUARIAL (IPCA + 4,83%):										-0,29%	8,91%		
RENTABILIDADE DA CARTEIRA x META ATUARIAL:										709,72%	10,87%		
PATRIMÔNIO LÍQUIDO:										R\$ 628.819.737,77			
BANCO / FUNDO	PL do IPMJ	% do PL	LIMITE da Resolução 4963/2021	Política de Investimentos 2022		Amortizações e Cupons	Rentabilidade (R\$)			Rentabilidade dos fundos		Fundo x Meta	
				ALVO	MÁXIMO		Ano (R\$)	Mês (R\$)	Ano (R\$)	Mês	Ano	Mês (%)	Ano (%)
				Art 7º I a 100%	44,50%								
TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN	239.508.775,34	38,09%				5.051.339,90	1.093.693,17	10.980.951,49	0,43%	6,15%	150,30%	69,01%	
TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN (T.A.)	13.664.427,01	2,17%					141.880,50	141.880,50	-0,74%	5,67%	-254,87%	63,65%	
				Art. 7º Ib 100%	6,50%	70%							
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	0,00%					-739.029,01	5.273.554,00	-0,95%	5,50%	-329,81%	61,74%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	0,00	0,00%					-366.259,48	3.270.197,20	-0,74%	5,67%	-254,87%	63,65%	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA (T.A.)	1.060.335,28	0,17%					8.436,96	715.269,19	0,80%	6,12%	277,70%	68,71%	
				Art. 7º III a 60%	6,00%	40%							
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	77.139.891,08	12,27%					295.270,91	35.012,29	0,39%	0,39%	134,70%	4,37%	
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	49.565.401,64	7,88%					177.201,71	177.201,71	0,36%	0,36%	124,71%	4,04%	
SANTANDER RF REFERENCIADO PREMIUM FIC FI	30.365.498,81	4,83%					142.947,39	1.025.191,94	1,04%	6,80%	361,67%	76,33%	
SANTANDER RF REFERENCIADO PREMIUM FIC FI (T.A.)	1.180.114,53	0,19%					12.599,91	109.448,95	1,04%	6,80%	361,67%	76,33%	
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,00	0,00%					-73.080,34	230.750,96	-1,32%	4,41%	-457,26%	49,54%	
				Art. 7º IV 20%	4,00%	20,0%							
				0,000%									
				Art. 7º V a 5%	0,50%	2,0%							
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SENIOR	6.476,84	0,001%					215,95	-24.239,02	3,45%	-78,91%	1194,17%	-886,10%	
				Art. 7º V b 5%	1,50%	5,0%							
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	5.075.354,42	0,807%					126.737,74	1.046.716,63	1,08%	6,94%	373,13%	77,97%	
TOTAL ARTIGO 7º	417.566.274,94					5.051.339,90	820.615,41	22.981.935,84					
				Art. 8º I 30%	18,50%	30%							
OCCAM FIC AÇÕES	27.725.025,40	4,41%					913.573,88	-208.826,68	3,41%	-0,75%	1179,75%	-8,39%	
INDIE FIC AÇÕES	3.106.112,96	0,49%					124.665,35	-780.367,96	4,18%	-20,08%	1447,73%	-225,46%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.835.239,70	0,77%					379.162,81	-299.211,29	8,51%	-5,83%	2946,06%	-65,44%	
TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS MASTER FI AÇÕES	5.935.469,29	0,94%					302.605,05	-64.530,71	5,37%	-1,08%	1860,01%	-12,08%	
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	6.945.800,51	1,10%					340.038,75	-846.738,65	5,15%	-10,87%	1782,27%	-122,01%	
ITAU DUNAMIS FI AÇÕES	11.447.486,62	1,82%					648.487,56	-378.000,34	6,01%	-3,20%	2079,15%	-35,89%	
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	0,00	0,00%					57.249,39	-183.239,98	1,23%	-3,74%	425,45%	-42,00%	
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	33.274.231,77	5,29%					966.388,18	152.059,39	2,99%	0,46%	1035,65%	5,15%	
META VALOR FI AÇÕES	2.133.085,13	0,34%					64.825,35	-180.057,07	3,13%	-7,78%	1085,20%	-87,41%	
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	6.217.227,36	0,99%					548.423,35	340.130,40	9,67%	5,79%	3349,60%	64,98%	
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	4.062.299,66	0,65%					178.155,15	-822.459,88	4,59%	-16,84%	1588,08%	-189,06%	
TOTAL ARTIGO 8º	105.681.978,38					4.523.574,81	-3.271.242,77						
				Art. 9º II	3,00%	10%							
AXA WF FRAM DIGITAL ECONOMY AD FIC FIA	13.860.857,45	2,20%					1.267.755,80	-4.882.937,22	10,07%	-26,05%	3485,55%	-292,52%	
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FIC IE MULTIMERCADO	2.836.153,99	0,45%					215.078,83	-1.558.468,05	8,21%	-35,46%	2841,10%	-398,20%	
MS GLOBAL OPPOR DOL ADVISORY FIC FIA IE	2.317.809,49	0,37%					243.303,37	-1.602.011,72	11,73%	-40,87%	4060,71%	-458,91%	
JP MORGAN CHINA EQUITY DOLAR ADVISORY FIA IE	2.872.506,53	0,46%					-170.848,52	-963.993,46	-5,61%	-25,13%	-1943,69%	-282,14%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.865.977,10	0,30%					205.244,63	-2.288.128,23	12,36%	-55,08%	4278,98%	-618,49%	
SCHRODER SUSTENT AÇÕES GLOBAIS FIC FIA IE	4.989.329,16	0,79%					355.230,84	-1.386.751,31	7,67%	-21,75%	2654,08%	-244,22%	
				Art. 9º III	5,00%	10%							
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	18.414.838,72	2,93%					1.241.892,26	-6.061.070,94	7,23%	-24,76%	2503,84%	-278,06%	
TOTAL ARTIGO 9º¹	47.157.472,45					3.357.657,20	-18.743.360,93						
				Art. 10º I	8,00%	10%							
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	41.717.746,92	6,63%					3.829.751,01	-4.264.131,39	10,11%	-9,27%	3499,75%	-104,13%	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6.048.036,98	0,96%					560.216,57	-603.331,96	10,21%	-9,07%	3534,47%	-101,85%	
				Art. 10º II	2,00%	5,0%							
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	14.827,08	0,002%					-93,78	-13.755,82	-0,63%	-48,13%	-217,60%	-540,39%	
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTISTRATÉGIA FIP	10.633.401,01	1,691%					2.117.806,90	67.745,65	0,64%	4,62%	222,00%	51,84%	
TOTAL ARTIGO 10º	58.414.012,00					2.117.806,90	4.457.619,45	-4.459.227,97					
TOTAL PATRIMÔNIO LÍQUIDO	628.819.737,77												
RENDIMENTO NO MÊS	13.159.466,88												
RENDIMENTO ANUALIZADO¹	6.146.950,06												

¹ Nos rendimentos anualizados constam as aplicações e resgates consolidadas ao longo do ano, bem como o recebimento de cupons e amortizações.

7. CONFORMIDADE COM A POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

A Tabela 4 abaixo apresenta a distribuição do patrimônio em porcentagem de acordo com alocação objetiva definida na política de investimentos e resolução 4.963/2021 e posteriores atualizações.

Tabela 4 Distribuição do Patrimônio, em porcentagem, por resolução 4.963/2021

Enquadramento	Tipo de Ativo	Alocação Objetivo	Limite Superior	Alocado	Total
Art. 7º, I, "a"	Títulos Públicos	44,50%	70%	40,26%	66,40%
Art. 7º, I, "b"	Fundos 100% Títulos Públicos	6,50%	70%	0,17%	
Art. 7º, I, "c"	FI em Índice de Mercado (ETF) de RF	0,00%	20%	0,00%	
Art. 7º, II	Operações Compromissadas	0,00%	1%	0,00%	
Art. 7º, III, "a"	Renda Fixa conforme CVM	6,00%	40%	25,17%	
Art. 7º, III, "b"	ETF RF CVM	0,00%	1%	0,00%	
Art. 7º, IV	Ativos de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de instituições financeiras (BACEN)*	4,00%	20%	0,00%	
Art. 7º, V, "a"	Cota Sênior de FIDC	0,50%	2%	0,00%	
Art. 7º, V, "b"	Renda Fixa "Crédito Privado"	1,50%	5%	0,81%	
Art. 7º, V, "c"	Fundo de Debêntures	0,00%	1%	0,00%	
Art. 8º, I, "a"	Fundos de Ações CVM	18,00%	30%	16,81%	16,81%
Art. 8º, I, "b"	FI em índice de mercado (ETF) de renda variável	0,50%	10%	0,00%	
Art. 9º, I	Renda Fixa - Dívida Externa	0,00%	1%	0,00%	7,50%
Art. 9º, II	Fundos de Investimento no Exterior	3,00%	10%	4,57%	
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	5,00%	10%	2,93%	
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	8,00%	10%	7,60%	9,29%
Art. 10º, II	Fundos de Participações	2,00%	5%	1,69%	
Art. 10º, III	Fundos de Ações - Mercado de Acesso	0,00%	1%	0,00%	
Art. 11º	Fundos de Investimentos Imobiliários	0,50%	5%	0,00%	0,00%
Art. 12º	Empréstimos Consignados	0,00%	1%	0,00%	0,00%

7.1. Demonstrações Gráficas

A seguir, demonstrações gráficas referentes a conformidade com a Política Anual de Investimentos.

Gráfico 1 Demonstração Gráfica Alocação por tipo de ativo

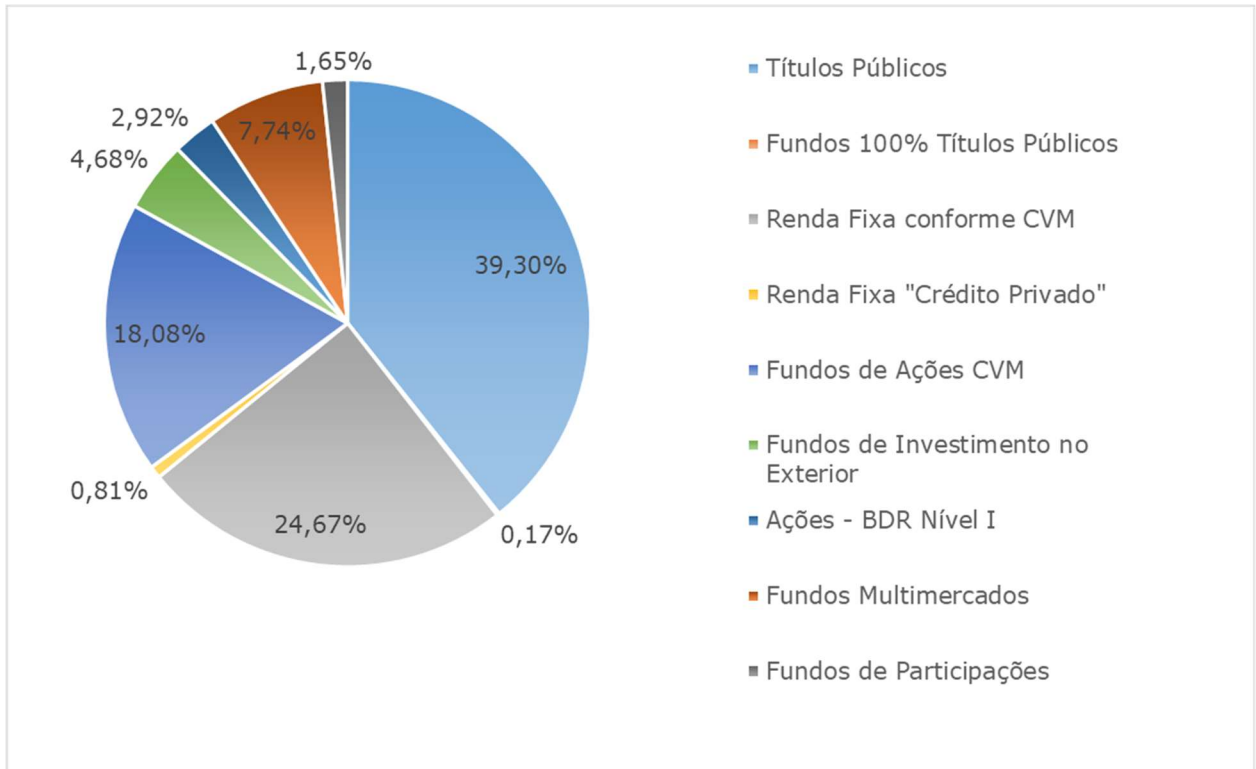
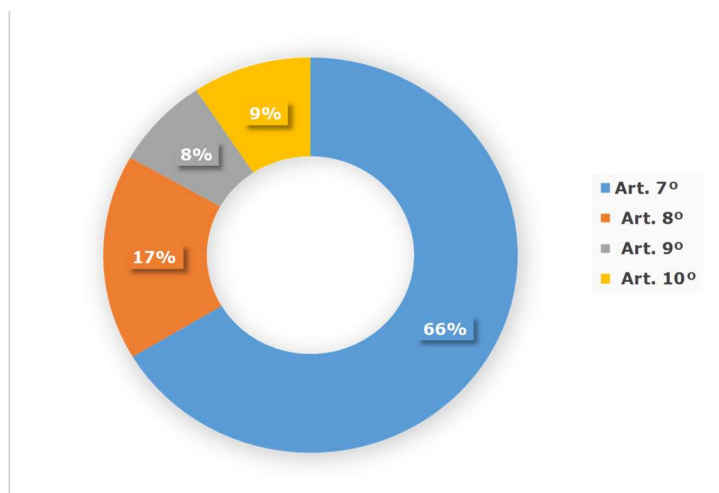


Gráfico 2 Distribuição do Patrimônio por Artigo



8. FUNDOS ESTRESSADOS

Ressalta-se que acompanhamentos completos sobre esses fundos são realizados pelo Gestor de Recursos do Instituto ao longo do ano.

8.1. FIDC MULTISSETORIAL MASTER III

Em julho de 2022, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um prejuízo de R\$ - 453.683,24 e numa somatória junto ao rendimento negativo, R\$ - 1.856.542,18, o total de amortizações já entregue é de R\$ 6.908.769,93. O acompanhamento é realizado de forma mensal, os demais dados se encontram na tabela 5, abaixo.

Tabela 5 Acompanhamento geral FIDC MULTISSETORIAL MASTER III

FIDC	Total Aplicado	Rendimento	Amortizações
TOTAIS :	R\$ 7.368.930,01	-R\$ 1.402.858,94	R\$ 6.908.769,93

8.2. PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP

O Fundo PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP, apresentou até o fim de suas integralizações, em 02/10/2017, um rendimento de R\$ 654.066,90. Em julho de 2022, o fundo apresentava aproximadamente os valores abaixo.

Tabela 6 Acompanhamento geral PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP

PÁTRIA	Total Aplicado	Rendimento Total	Saldo
TOTAIS :	R\$ 2.823.363,14	-R\$ 2.808.441,71	R\$ 14.920,87

No acompanhamento do ano vigente, em julho de 2022, o fundo possuía R\$ 14.920,87 aproximadamente 0,002% do patrimônio do IPMJ.

Tabela 7 Acompanhamento mensal Pátria

	PÁTRIA	
2022	Janeiro	R\$ 41,89
	Fevereiro	-R\$ 293,47
	Março	-R\$ 13.188,62
	Abril	R\$ 26,63
	Maior	R\$ 1.466,93
	Junho	-R\$ 281,40

Em reunião solicitada pelo comitê de investimentos, o representante Victor esclareceu, sobre impacto no valor da cota, o mesmo respondeu que, devido alteração de auditor independente, que deixou de ser PwC PricewaterhouseCoopers Brasil Ltda para EY Building a betterworking world, por uma postura mais conservadora. A EY Building a betterworking world que fez a auditoria em 2020 verificou a correta valorização dos

investimentos, em sua Demonstração Financeira com Parecer do Auditor Independente em 31/12/2020.

No mesmo documento em sua página 25, foi informado no item 19. Eventos subsequentes que no dia 29 de março de 2021, deliberou-se em Assembleia Geral Extraordinária a aprovação da proposta do gestor acerca da prorrogação do prazo de duração do fundo para 31 de dezembro de 2022, com a consequente alteração do item 1.2 do regulamento do fundo, passando a vigorar a seguinte redação: “1.2 O prazo de duração do fundo perdurará até 31 de dezembro de 2022, passando a ser encerrado antecipadamente mediante a liquidação integral de seus ativos e passivos. Esse prazo poderá ser prorrogado mediante proposta do Administrador e deliberação em Assembleia Geral de Quotistas”.

9. FUNDOS ESTRUTURADOS (FIP)

O fundo KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTISTRATÉGIA FIP, apresentava R\$ 10.633.401,01, cerca de 1,667% do patrimônio líquido do Instituto. Tendo-se, os seguintes números:

Tabela 8 Acompanhamento geral KINEA (julho/2022)

KINEA	Total Aplicado	Rendimento Total	Amortizações
TOTAIS :	R\$ 8.017.465,00	R\$ 3.095.844,12	R\$ 3.115.488,50

Abaixo o acompanhamento de rendimentos ao longo do ano:

Tabela 9 Acompanhamento mensal Kinea

		KINEA
2022	Janeiro	R\$ 393.320,06
	Fevereiro	R\$ 235.495,90
	Março	R\$ 57.912,12
	Abril	-R\$ 99.454,90
	Mai	R\$ 5.616,24
	Junho	R\$ 408.078,36
	Julho	R\$ 67.745,66

10. ALOCAÇÃO POR INSTITUIÇÃO

A seguir, serão apresentadas as demonstrações de alocação por instituição no mês.

Tabela 10 Alocação por gestora, em julho

PATRIMÔNIO X GESTORAS (ATUALIZADO: 22/07/2022)		
GESTORES	PL do IPMJ	%
TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN (Selic)	R\$ 253.173.202,35	40,2617%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	R\$ 77.139.891,08	12,2674%
BANCO DO BRASIL S/A	R\$ 49.565.401,64	7,8823%
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM	R\$ 41.717.746,92	6,6343%
NAVI CAPITAL ADM. GESTORA RF LTDA.	R\$ 33.274.231,77	5,2915%
OCCAM BRASIL	R\$ 27.725.008,03	4,4091%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA.	R\$ 19.051.173,47	3,0297%
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	R\$ 31.545.613,34	5,0166%
BANCO J. SAFRA S.A	R\$ 18.414.838,72	2,9285%
ITÁU UNIBANCO S/A.	R\$ 12.507.821,89	1,9891%
KINEA PRIVATE EQUITY INVEST. S.A.	R\$ 10.633.401,01	1,6910%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	R\$ 10.883.276,68	1,7307%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA.	R\$ 6.945.800,51	1,1046%
TARPON INVESTIMENTOS	R\$ 6.217.227,36	0,9887%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS MASTER FI AÇÕES	R\$ 5.935.469,29	0,9439%
SCHRODER INVESTMENT BRASIL LTDA.	R\$ 4.989.329,16	0,7934%
PORTO SEGURO	R\$ 5.075.354,42	0,8071%
BRADESCO	R\$ -	0,0000%
SUL AMÉRICA INVEST. GESTORA REC. S.A.	R\$ 4.062.299,66	0,6460%
INDIE CAPITAL INVESTIMENTOS LTDA.	R\$ 3.106.112,96	0,4940%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 2.836.153,99	0,4510%
META ASSET MANAGEMENT LTDA	R\$ 2.133.085,13	0,3392%
GENIAL INVESTIMENTOS	R\$ 1.865.977,10	0,2967%
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA.	R\$ 14.827,08	0,0024%
BRPP GESTÃO PROD. ESTRUT. LTDA.	R\$ 6.476,84	0,0010%

11. RISCO (VaR) DOS FUNDOS NA CARTEIRA

Tabela 11 Risco (VaR) dos fundos na carteira, em julho

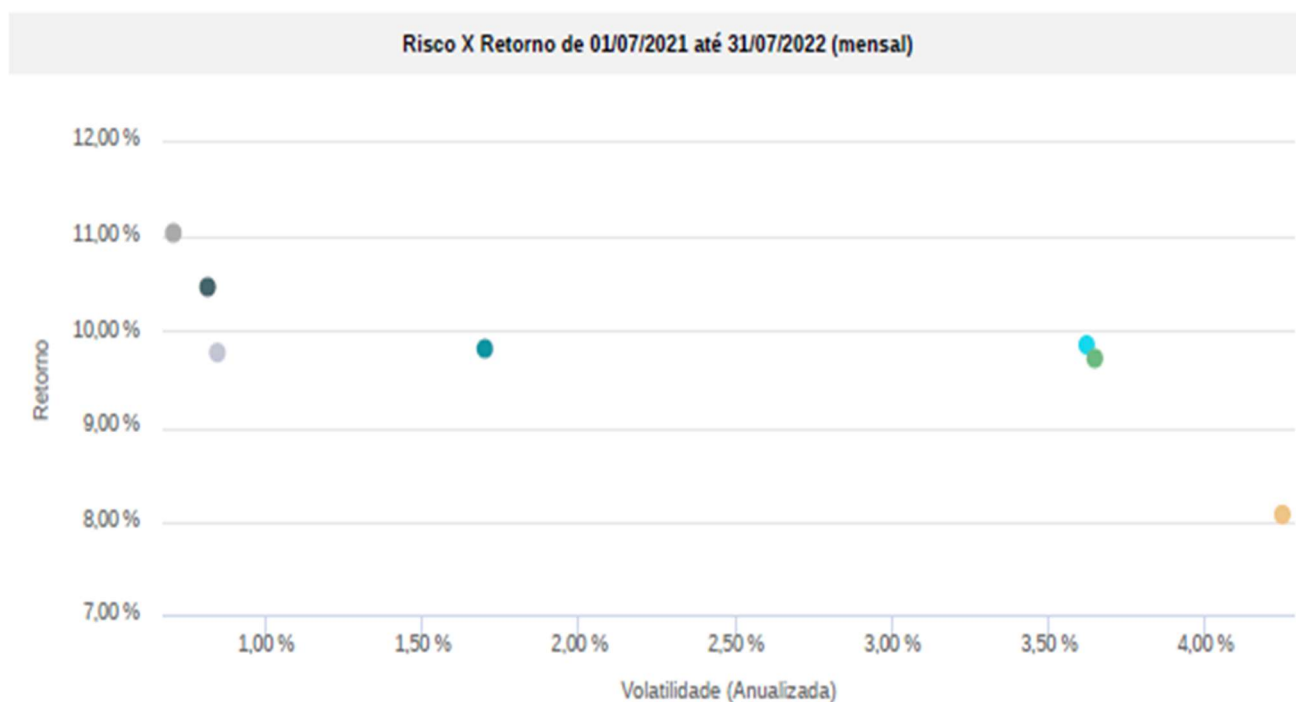
Nome	VaR 95% MV 21 du (12 meses)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	12,26%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,22%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	9,19%
BRADERCO H NILO FI RENDA FIXA	2,56%
BRADERCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	7,93%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,55%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	8,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,21%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,47%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	27,24%
INDIE FIC AÇÕES	8,55%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,36%
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	10,60%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	13,23%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	
META VALOR FI AÇÕES	9,08%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	19,84%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7,20%
OCCAM FIC AÇÕES	7,13%
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	1,62%
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,01%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9,87%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,02%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	11,62%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	11,11%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	11,76%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,44%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8,96%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1,91%

Os Fundos Master III FIDC Multissetorial Sênior e Kinea Private Equity IV Feeder Institucional I FIP Multiestratégia não entram nessa seção devido a sua natureza e seu acompanhamento individual.

12. DEMONSTRAÇÃO DOS FUNDOS POR SEGMENTO

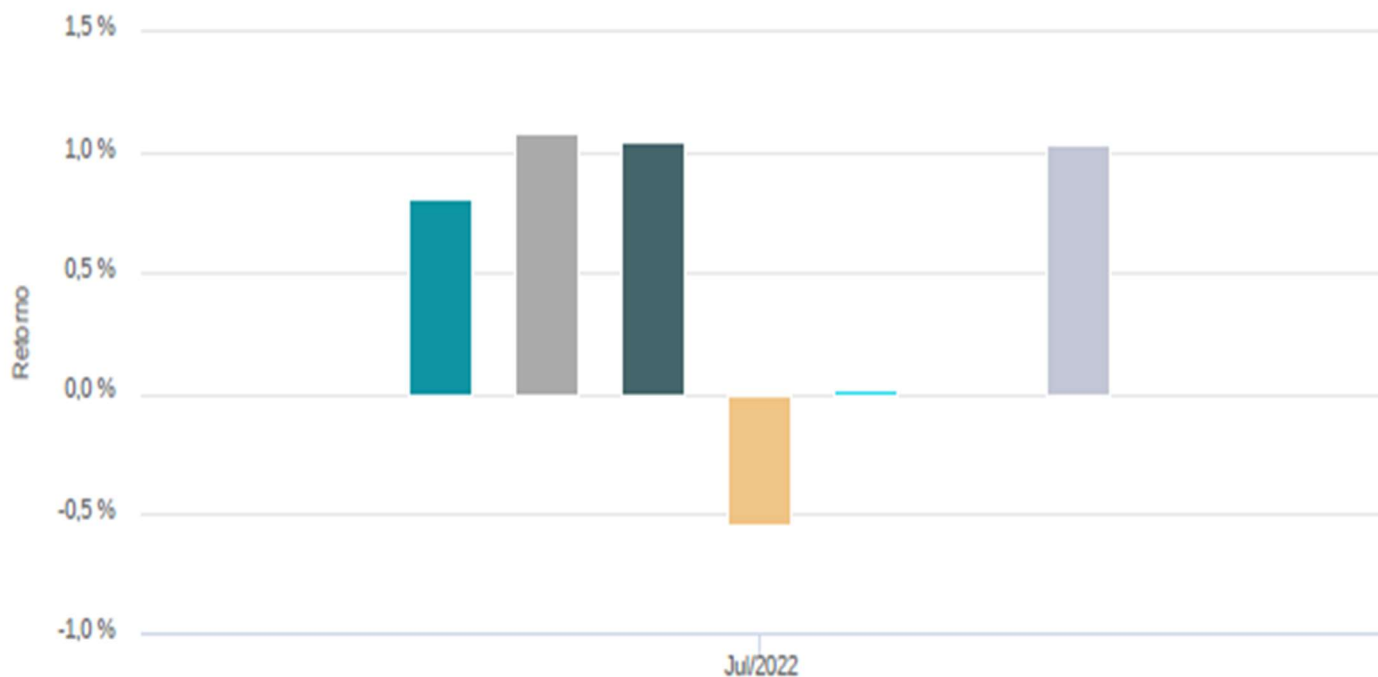
Esta seção retrata a demonstração dos fundos na carteira nos últimos 12 meses e mensal, desta forma, com relação ao retorno efetivo mensal, para um fundo que entrou na carteira após o início deste, deve-se considerar a partir do mês fechado subsequente.

12.1. Renda Fixa



Ativo	Retorno	Volatilidade (Anualizada)
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9,82 %	1,70 %
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	11,05 %	0,71 %
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10,48 %	0,82 %
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	8,08 %	4,25 %
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9,86 %	3,62 %
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	9,73 %	3,65 %
CDI	9,78 %	0,85 %

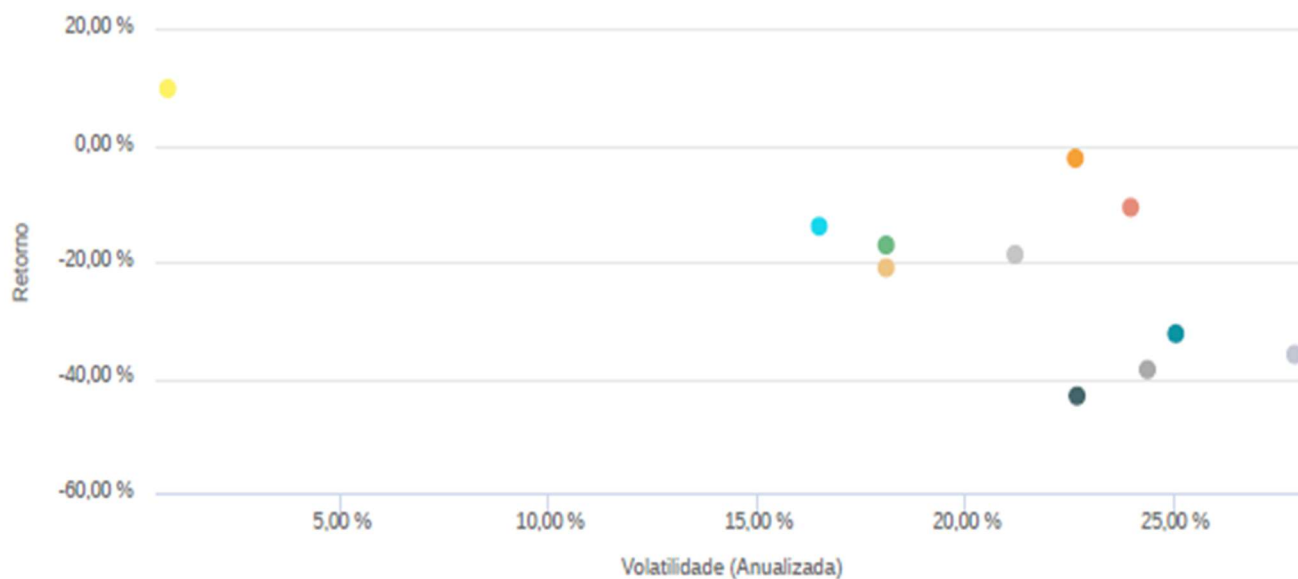
Retorno efetivo mensal de Jul/2022 até Jul/2022 (mensal)



Ativo	Retorno	Retorno YTD*	Mínimo	Máximo
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,80 %	6,12 %	0,80 %	0,80 %
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1,08 %	6,94 %	1,08 %	1,08 %
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,04 %	6,80 %	1,04 %	1,04 %
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	-0,55 %	5,23 %	-0,55 %	-0,55 %
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02 %	6,53 %	0,02 %	0,02 %
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00 %	6,47 %	0,00 %	0,00 %
CDI	1,03 %	6,49 %	1,03 %	1,03 %

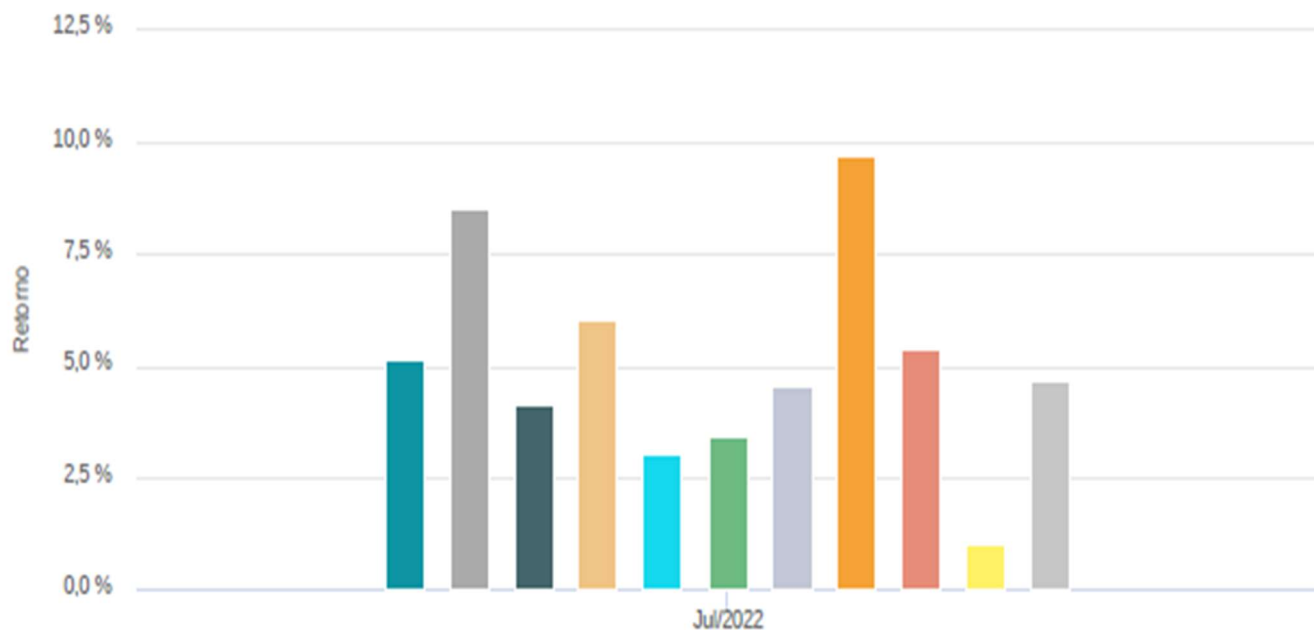
12.2. Renda Variável

Risco X Retorno de 01/07/2021 até 31/07/2022 (mensal)



Ativo	Retorno	Volatilidade (Anualizada)
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-32,50 %	25,03 %
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-38,51 %	24,35 %
INDIE FIC AÇÕES	-43,11 %	22,67 %
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-21,08 %	18,10 %
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-13,84 %	16,48 %
OCCAM FIC AÇÕES	-17,22 %	18,10 %
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	-36,00 %	27,89 %
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-1,96 %	22,61 %
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-10,59 %	23,95 %
CDI	9,78 %	0,85 %
Ibovespa	-18,64 %	21,18 %

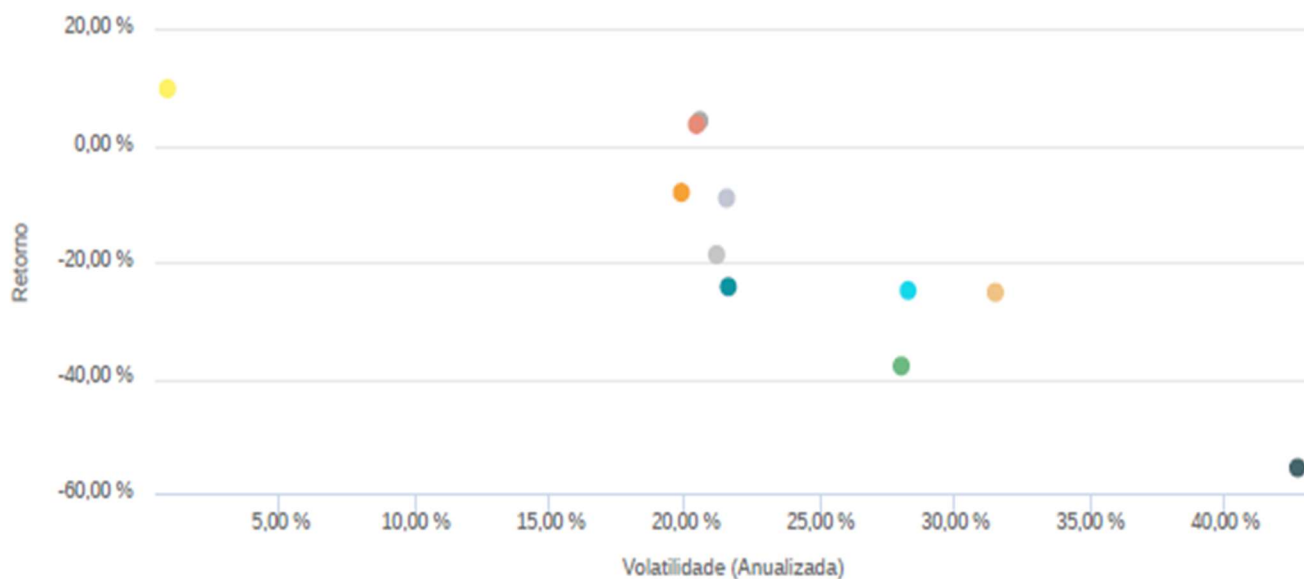
Retorno efetivo mensal de Jul/2022 até Jul/2022 (mensal)



Ativo	Retorno	Retorno YTD*	Mínimo	Máximo
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	5,15 %	-10,87 %	5,15 %	5,15 %
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,51 %	-5,83 %	8,51 %	8,51 %
INDIE FIC AÇÕES	4,18 %	-20,08 %	4,18 %	4,18 %
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6,01 %	-3,20 %	6,01 %	6,01 %
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,99 %	0,46 %	2,99 %	2,99 %
OCCAM FIC AÇÕES	3,41 %	-0,75 %	3,41 %	3,41 %
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	4,59 %	-16,84 %	4,59 %	4,59 %
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	9,67 %	5,79 %	9,67 %	9,67 %
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,37 %	-2,93 %	5,37 %	5,37 %
CDI	1,03 %	6,49 %	1,03 %	1,03 %
Ibovespa	4,69 %	-1,58 %	4,69 %	4,69 %

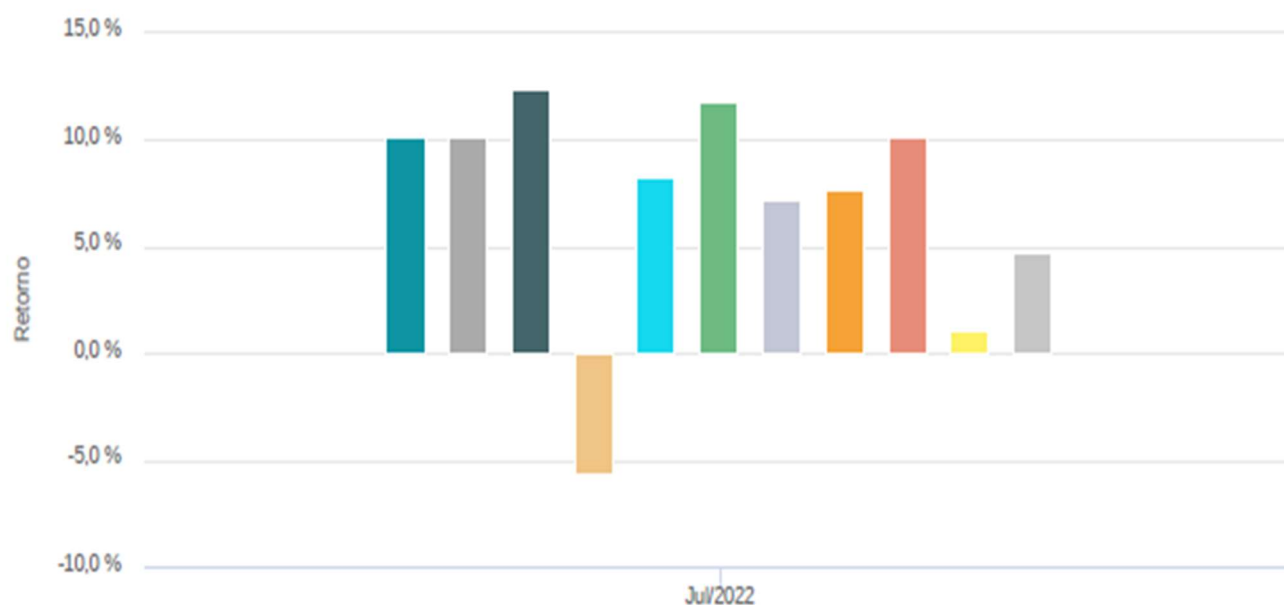
12.3. Exterior

Risco X Retorno de 01/07/2021 até 31/07/2022 (mensal)



Ativo	Retorno	Volatilidade (Anualizada)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-24,36 %	21,60 %
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	4,26 %	20,56 %
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-55,33 %	42,70 %
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-25,14 %	31,52 %
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	-24,87 %	28,29 %
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-37,95 %	28,03 %
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-8,82 %	21,55 %
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-8,03 %	19,86 %
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,68 %	20,45 %
CDI	9,78 %	0,85 %
Ibovespa	-18,64 %	21,18 %

Retorno efetivo mensal de Jul/2022 até Jul/2022 (mensal)



Ativo	Retorno	Retorno YTD*	Mínimo	Máximo
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	10,07 %	-26,05 %	10,07 %	10,07 %
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	10,21 %	-9,07 %	10,21 %	10,21 %
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	12,36 %	-55,08 %	12,36 %	12,36 %
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-5,61 %	-25,13 %	-5,61 %	-5,61 %
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	8,21 %	-35,46 %	8,21 %	8,21 %
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	11,73 %	-40,87 %	11,73 %	11,73 %
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,23 %	-24,76 %	7,23 %	7,23 %
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	7,67 %	-21,75 %	7,67 %	7,67 %
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10,11 %	-9,27 %	10,11 %	10,11 %
CDI	1,03 %	6,49 %	1,03 %	1,03 %
Ibovespa	4,69 %	-1,58 %	4,69 %	4,69 %

13. AGENDA REALIZADA

- **07 de julho:**

10h00: Webinar XP sobre a alteração da Portaria, tendo como orientações sobre o desenquadramento passivo relativo às alocações em fundos de investimento do segmento de investimentos no exterior realizadas até 02 de maio de 2021 por RPPS que deixaram de ser classificados como investidores qualificados por não terem obtido certificação no Pró-Gestão – art. 27, caput, §1º, VI, c/c art. 29, da Resolução CMN nº 4.963, de 2021; art. 6º, §1º, II, “b”, da Portaria MPS nº 509, de 2011, com redação dada pela Portaria SEPRT nº 555, de 2019, arts. 137, 152 e 153 da Portaria MTP nº 1.467, de 2022. Registre-se, portanto, que a opção acerca de melhor momento para a realização do desinvestimento cabe exclusivamente aos responsáveis pela gestão do RPPS, aos quais competem, no escopo de seus deveres de diligência, monitoramento de saída da aplicação, atendendo aos critérios exigidos para a manutenção do equilíbrio financeiro e atuarial do RPPS e os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação à natureza das obrigações e transferência previstos na Resolução CMN nº 4.963, de 2022.

- **13 de julho:**

9h15: Reunião do Comitê de Investimentos em formato presencial, com as seguintes presenças na sala de reuniões do IPMJ: Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Clévio Vitor de Almeida, José Ricardo Vinhas e Victor Adriano Vieira Silva. Ausência justificada de Rafaela Carvalho dos Santos. Participaram da reunião os estagiários em Economia Emyra Yra Erlacher e Matheus Masceno Ferreira

- 1) Análise do Relatório de Investimentos de Junho de 2022;
- 2) Apresentação dos Estudos e Movimentações da Carteira de Investimentos conforme estudos da ALM 2022;
- 3) Credenciamentos;
- 4) Assuntos Diversos.

A reunião registrou o encerramento do mês de junho, com a elaboração do relatório gerencial.

- **19 de julho:**

16h00: Reunião em formato presencial, com os representantes Elder Santana de Andrade e o gestor Fabiano Zimmermann, para apresentação da ASA Investments que é uma gestora de investimentos multiestratégia e contou com a presença de Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e Rossana Vasques - Presidente. A Família de Fundos ASA Alpha conta com diversificação para uma família de fundos completa, gestão ativa, foco na geração de valor, equipe

experiente e conhecimento amplo do mercado. E também a Família de Fundos ASA Small Mid Cap que foca em empresas de baixa e média capitalização buscando maximizar o desempenho do portfólio e gerar retornos acima do SMLL.

- **20 de julho:**

09h00 – 13h00: Circuito BB, localizada na Avenida Paulista, reunião deu início às 10h07 com o José Mauricio Pimentel Baptista, explicando sobre o cenário interno e externo, qual a visão da instituição, às 11h10 o representante comercial Wladimir Macedo, apresentou os fundos de Ima-B 5, Fundos de Vértices e o IDKA 2, que tem como público alvo RPPS, às 12h20 representantes do Tribunal de Contas, Claudia Harumi Matsumoto Miura e a Viviane Cristina Sakamoto de Souza, a palestra se deu para esclarecimento referente a clareza de informações apresentadas, tanto no sistema como nos documentos apresentados aos comitês, apresentar estudos para embasar movimentações e clareza nas informações expressas nas atas, contou com a presença de Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Rossana Vasques – Presidente e Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor de Investimentos e Emyra Yra Erlacher Estagiária de Investimentos.

- **22 de julho:**

10h00: Reunião em formato presencial, com os representantes Bruno Rocha Bonini e Edmilson para apresentação institucional e acompanhamento do fundo SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR Nível I. Também foram apresentados outros fundos de investimentos voltados para RPPS como o SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO e SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA. E a apresentação contou com a presença de Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Rossana Vasques – Presidente e Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor de Investimentos.

- **25 de julho:**

14h00: Reunião em formato on-line, com os representantes do Banco de Brasil, Renata de Moraes Ferreira, Anderson Titonelli de Siqueira e Thiago Gutemberg Silva da Rocha, a apresentação se deu, para esclarecimento de compra direta de TPF no primeiro leilão, quais vértices a casa dispões para cotação e quais as diferenças de rentabilidade do segundo leilão, contou com a presença de Amauri Arnaldo Júnior –

Supervisor de Investimentos e Emyra Yra Erlacher Estagiária de Investimentos.

- **27 de julho:**

9h40 no Formato Presencial, com as seguintes presenças na sala de reuniões: Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Clévio Vitor de Almeida e Victor Adriano Vieira Silva. Ausências justificadas de José Ricardo Vinhas e Rafaela Carvalho dos Santos. Participaram da reunião os estagiários em Economia Emyra Yra Erlacher e Matheus Masceno Ferreira. Pautas da reunião: 1) Credenciamento 2) Análise parcial da carteira até 22/07/2022; 3) Reunião com o representante do fundo PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I e II; 4) Assuntos Diversos. 1) A reunião iniciou-se às 09h40 com a atualização dos credenciamentos SUL AMÉRICA SELECTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES, CNPJ: 34.525.068/0001-06, 178/FUNDO/2022-2, TARPON GT 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES, CNPJ 35.726.741/0001-39, 174/FUNDO/2022-2, TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA, CNPJ 35.098.801/0001-16, 175/GESTOR/2022-2 e DOLAR BILLS AGENTES AUTONOMOS DE INVESTIMENTOS LTDA, CNPJ: 35.796.942/0001-02, 176/DISTRIBUIDOR/2022-2.