

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

AGOSTO/2022

- 1 CARTEIRA FUNDO PREVIDENCIÁRIO CAPITALIZADO**
- 2 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**
- 3 DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO**
- 4 DISTRIBUIÇÃO POR NÍVEL DE RISCO**
- 5 VOLATILIDADE NOS ÚLTIMOS 12 MESES**
- 6 VAR HISTÓRICO NOS ÚLTIMOS 12 MESES**
- 7 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA**
- 8 POLÍTICA DE INVESTIMENTOS**
- 9 DISTRIBUIÇÃO POR TIPO DE ATIVO**
- 10 RENTABILIDADES E PERFORMANCE**
- 11 EVOLUÇÃO PATRIMONIAL**
- 12 RENDIMENTOS MENSAIS**
- 13 COMPARATIVO VOLUME ANBIMA**
- 14 MOVIMENTAÇÕES DE RECURSOS**
- 15 TOTAL GERAL DAS CARTEIRAS**

A carteira do Fundo Previdenciário Capitalizado do Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Jaboatão dos Guararapes – JABOATÃO PREV, fechou o mês de agosto de 2022 com um patrimônio de R\$ 527.710.131,23. Como pode ser observado na **Tabela 1**, esse valor está distribuído em 21 fundos de investimentos e 4 Títulos Públicos adquiridos diretamente e marcados na curva, 17 fundos são do segmento de renda fixa, que junto com os títulos somam 96,77% do patrimônio, 2 fundos do segmento de renda variável, representando 3,08% do patrimônio, 1 fundo estruturado, representando -0,01% do patrimônio e 1 fundo imobiliário, representando 0,15% do patrimônio. No mesmo período, o total de disponibilidade financeira foi de R\$ 2.776,70.

1.1 RENDA FIXA

Tabela 1

Fundo	Administrador	Índice de Referência	Classificação de Risco (1 a 5)	% PL JABOATÃO PREV	% PL Fundo Investido	Valor (R\$)	Rentabilidade de mensal	Rentabilidade e anual
NTN-B 2045 24463721	TESOURO NACIONAL	IPCA+6,23%	1,00	3,60%	0,00%	R\$ 19.003.569,78	0,02%	0,02%
NTN-B 2060 24501825	TESOURO NACIONAL	IPC-A + 6,31%	1,00	4,05%	0,00%	R\$ 21.348.332,97	0,03%	0,03%
NTN-B 2060 24745418	TESOURO NACIONAL	IPC-A + 5,941%	1,00	1,36%	0,00%	R\$ 7.155.812,85	0,02%	0,02%
NTN-B 760199 2055	TESOURO NACIONAL	IPCA+5,972%	1,00	0,76%	0,00%	R\$ 3.999.179,73	0,01%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IMA-B	2,00	0,06%	0,28%	R\$ 303.948,75	1,19%	9,35%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRFM1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IRFM-1	1,00	10,19%	0,92%	R\$ 53.753.692,31	1,20%	7,22%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	CDI	2,00	11,25%	0,52%	R\$ 59.356.969,95	1,18%	7,90%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IDKA IPCA 2A	1,00	15,91%	0,92%	R\$ 83.951.096,34	-0,04%	6,17%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	CDI	2,00	0,00%	0,00%	R\$ 2.619,06	1,08%	7,01%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IMA-B	5,00	6,38%	0,58%	R\$ 33.668.056,73	1,08%	4,40%

Tabela 1

Fundo	Administrador	Índice de Referência	Classificação de Risco (1 a 5)	% PL JABOATÃO PREV	% PL Fundo Investido	Valor (R\$)	Rentabilidade de mensal	Rentabilidade e anual
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IMA-B 5	1,00	8,10%	0,65%	R\$ 42.738.902,60	0,01%	6,48%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	CDI	3,00	0,79%	0,18%	R\$ 4.177.509,56	1,29%	9,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CDI	3,00	4,05%	0,15%	R\$ 21.382.499,66	1,19%	7,93%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IMA-B 5	3,00	4,37%	0,24%	R\$ 23.060.407,92	0,05%	6,58%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IRFM-1	2,00	6,00%	0,63%	R\$ 31.647.673,13	1,21%	7,22%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IMA-B	3,00	4,55%	0,62%	R\$ 24.017.133,22	1,20%	4,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IMA-B 5+	3,00	15,07%	6,98%	R\$ 79.524.613,10	2,49%	2,50%

1.1

RENDA FIXA

Tabela 1

Fundo	Administrador	Índice de Referência	Classificação de Risco (1 a 5)	% PL JABOATÃO PREV	% PL Fundo Investido	Valor (R\$)	Rentabilidade de mensal	Rentabilidade e anual
BBIF MASTER FIDC LP	SANTANDER CACEIS (GRUPO SANTANDER)	CDI	5,00	0,18%	3,40%	R\$ 948.989,62	-0,31%	-4,97%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	RJI CORRETORA DE VALORES	IMA-B 5	5,00	0,06%	0,57%	R\$ 305.132,02	-0,12%	2,39%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	RJI CORRETORA DE VALORES	IMA-B 5	5,00	0,06%	0,40%	R\$ 316.490,60	-3,18%	-7,78%
FIC CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IPCA	3,00	0,00%	0,00%	R\$ 0,03	2,12%	7,26%
Renda Fixa				96,77%		R\$ 510.662.629,92		

1.2

RENDA VARIÁVEL

Tabela 1.2

Fundo	Administrador	Índice de Referência	Classificação de Risco (1 a 5)	% PL JABOATÃO PREV	% PL Fundo Investido	Valor (R\$)	Rentabilidade de mensal	Rentabilidade e anual
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IBOVESPA	4,00	1,81%	0,66%	R\$ 9.558.735,90	5,73%	2,04%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	BEM DTVM LTDA	SMLL	4,00	1,27%	0,60%	R\$ 6.713.486,51	5,97%	-3,19%
Renda Variável				3,08%		R\$ 16.272.222,42		

Fundo	Administrador	Índice de Referência	Classificação de Risco (1 a 5)	% PL JABOATÃO PREV	% PL Fundo Investido	Valor (R\$)	Rentabilidade de mensal	Rentabilidade e anual
GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	RJI CORRETORA DE VALORES	IPCA+ 10,50%	5,00	-0,01%	0,00%	-R\$ 26.778,13	-0,26%	-135,12%
Fundos Estruturados				-0,01%		-R\$ 26.778,13		

Tabela 1.2

Fundo	Administrador	Índice de Referência	Classificação de Risco (1 a 5)	% PL JABOATÃO PREV	% PL Fundo Investido	Valor (R\$)	Rentabilidade de mensal	Rentabilidade e anual
HAZ FII - ATCR11	RJI CORRETORA DE VALORES	CDI	5,00	0,15%	1,07%	R\$ 799.280,33	0,14%	3,06%
Fundos Imobiliários				0,15%		R\$ 799.280,33		

Banco	Saldo
CC 22484-7 - BANCO DO BRASIL	R\$ -
CC 71747-9 - BANCO DO BRASIL	R\$ -
CC 00000040-6 CAIXA ECONOMICA	R\$ -
CC 00000098-8 CAIXA ECONOMICA	R\$ -
CC 290000974 - BANCO SANTANDER	R\$ 661,07
CC 290000981 - BANCO SANTANDER	R\$ 2.115,63
Saldo Conta Corrente	R\$ 2.776,70
TOTAL FUNDO PREVIDENCIÁRIO	R\$ 527.710.131,23

2

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Conforme demonstrado na **Tabela 2**, a seguir, os recursos do Fundo Previdenciário Capitalizado estão distribuídos entre seis instituições administradoras de recursos, das quais três são também gestoras de recursos. A maior participação na carteira é do Banco do Brasil com 53,69% dos recursos, seguido pela Caixa Econômica Federal com 34,04%. Juntas estas duas instituições possuem 87,73% dos recursos do fundo.

2.1

FUNDO PREVIDENCIÁRIO CAPITALIZADO - ADMINISTRADORES

Tabela 2

BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$	283.334.021,65	53,69%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	179.632.327,05	34,04%
TESOURO NACIONAL	R\$	51.506.895,33	9,76%
RJI CORRETORA DE VALORES	R\$	1.394.124,82	0,26%
SANTANDER CACEIS (GRUPO SANTANDER)	R\$	948.989,62	0,18%
BEM DTVM LTDA	R\$	6.713.486,51	1,27%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	R\$	4.177.509,56	0,79%
TOTAL	R\$	527.707.354,54	100,00%

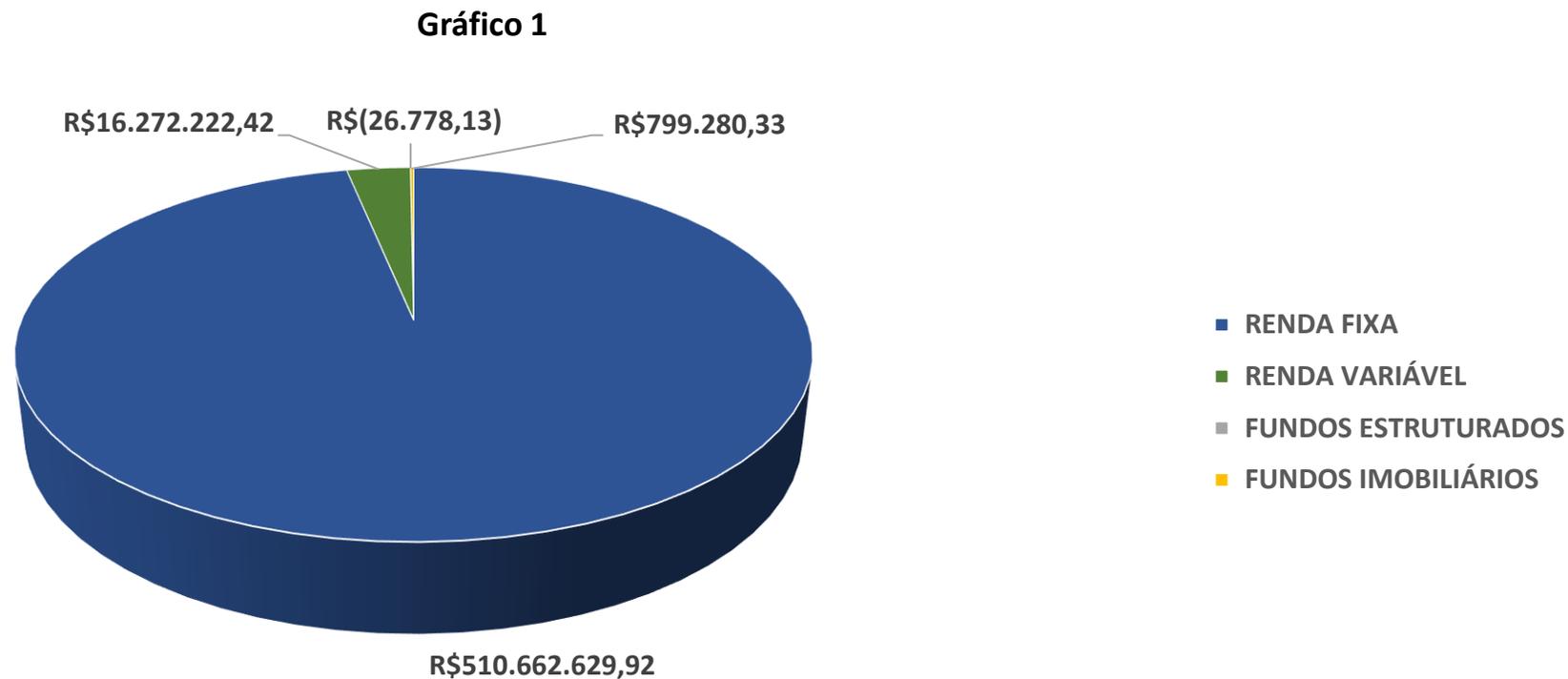
2.2

FUNDO PREVIDENCIÁRIO CAPITALIZADO - GESTORES

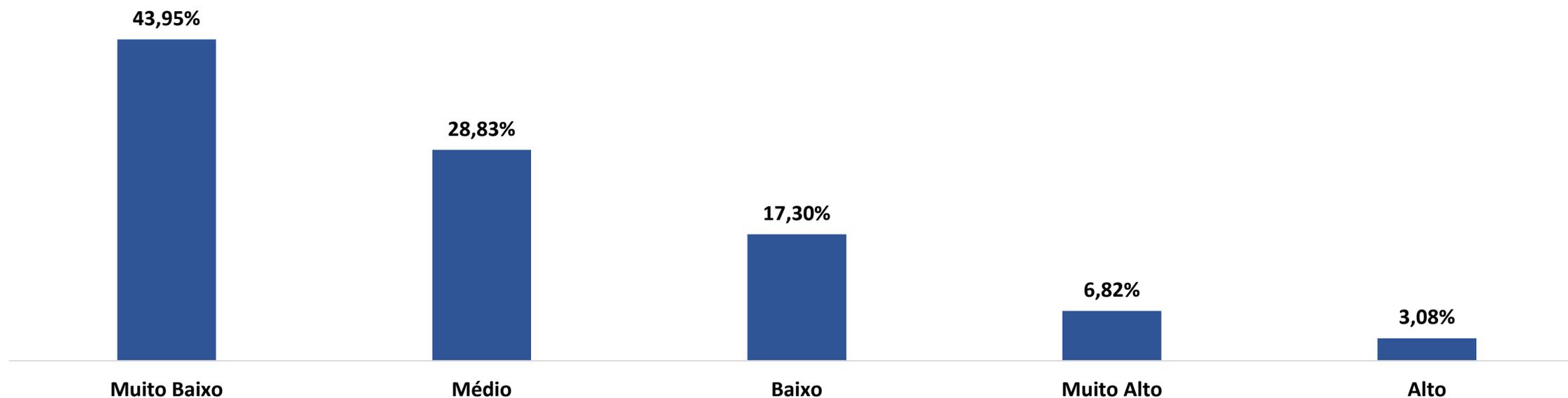
Tabela 2

BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$	283.334.021,65	53,69%
CAIXA DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A	R\$	179.632.327,05	34,04%
TESOURO NACIONAL	R\$	51.506.895,33	9,76%
GRAPHEN INVESTIMENTOS	R\$	799.280,33	0,15%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$	6.713.486,51	1,27%
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT	R\$	4.177.509,56	0,79%
BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	R\$	1.543.834,11	0,29%
TOTAL	R\$	527.707.354,54	100,00%

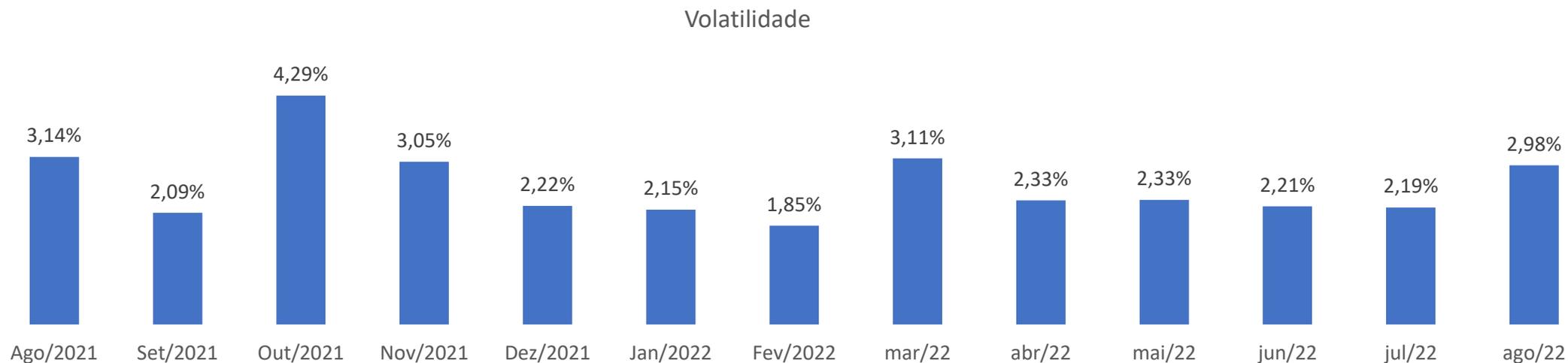
O **Gráfico 1** mostra a distribuição dos recursos do Fundo Previdenciário Capitalizado entre os segmentos de renda fixa e renda variável. Atualmente, o patrimônio do fundo está alocado preponderantemente no segmento de renda fixa, com R\$ 510.662.629,92.



Os administradores classificam o nível de risco dos fundos de investimentos numa escala de 1 a 5, cada número significa um nível de volatilidade, sendo 1 muito baixa, 2 baixa, 3 média, 4 alta e 5 muito alta. A carteira do Fundo Previdenciário Capitalizado tem 90,08% dos recursos alocados em fundos até o nível Médio de volatilidade. Conforme **Gráfico 2**.

Gráfico 2

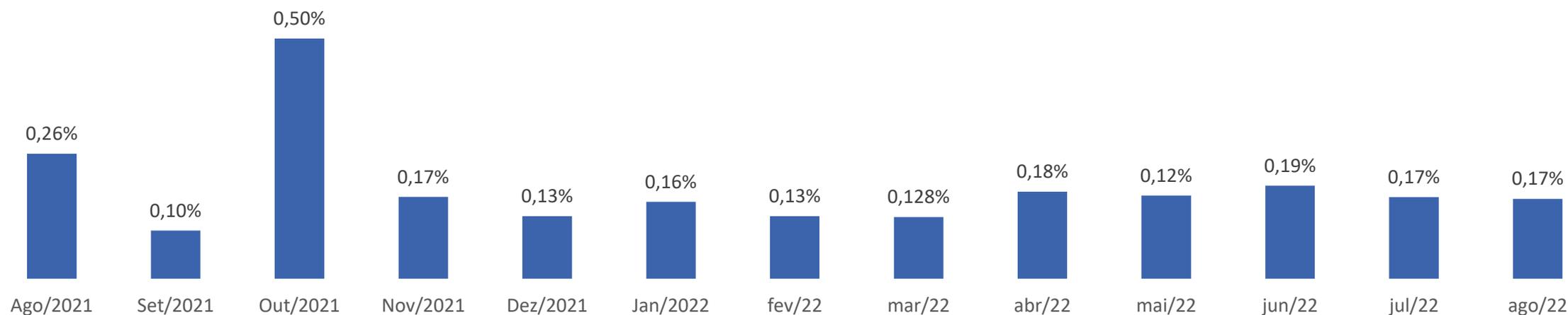
O cálculo da volatilidade de uma carteira permite observar a frequência e intensidade das oscilação no seu valor em um determinado período. O monitoramento desta medida é parte do gerenciamento de risco da carteira do Fundo Previdenciário Capitalizado. Se verificado um aumento significativo e consistente no nível de volatilidade será investigado o motivo e analisada a necessidade de serem feitas alterações nas proporções dos segmentos de aplicações e/ou substituição de ativos. O **Gráfico 3** mostra a volatilidade mensal da carteira nos últimos 12 meses.

Gráfico 3

O VaR (Value at Risk) é uma medida estatística que estima a perda potencial máxima de um investimento para um período de tempo, com um determinado intervalo de confiança. O monitoramento desta medida é parte do gerenciamento de risco da carteira do Fundo Previdenciário Capitalizado. Se verificado um aumento significativo e consistente no VaR da carteira será investigado o motivo e analisada a necessidade de serem feitas alterações nas proporções dos segmentos de aplicações e/ou substituição de ativos. O **Gráfico 4** mostra o VaR Histórico da carteira com periodicidade diária e intervalo de confiança de 95%.

Gráfico 4

VaR Histórico



Cerca de 60% do volume dos recursos do Fundo Previdenciário Capitalizado estão alocados em fundos de títulos públicos que utilizam como índice de referência os sub índices da Anbima. Como mostra o **Gráfico 5**, as maiores posições da carteira do Fundo Capitalizado são os fundos que utilizam como referência o CDI, com 16,42% de participação na carteira, em seguida vêm os fundos com índice de referência IRF-M1, títulos prefixados com prazo de vencimento de até 1 ano e pelos fundos atrelados ao IDKA IPCA 2A, composto por títulos públicos atrelado à inflação, com 16,18% e 15,91% do volume de recursos do fundo.

Gráfico 5



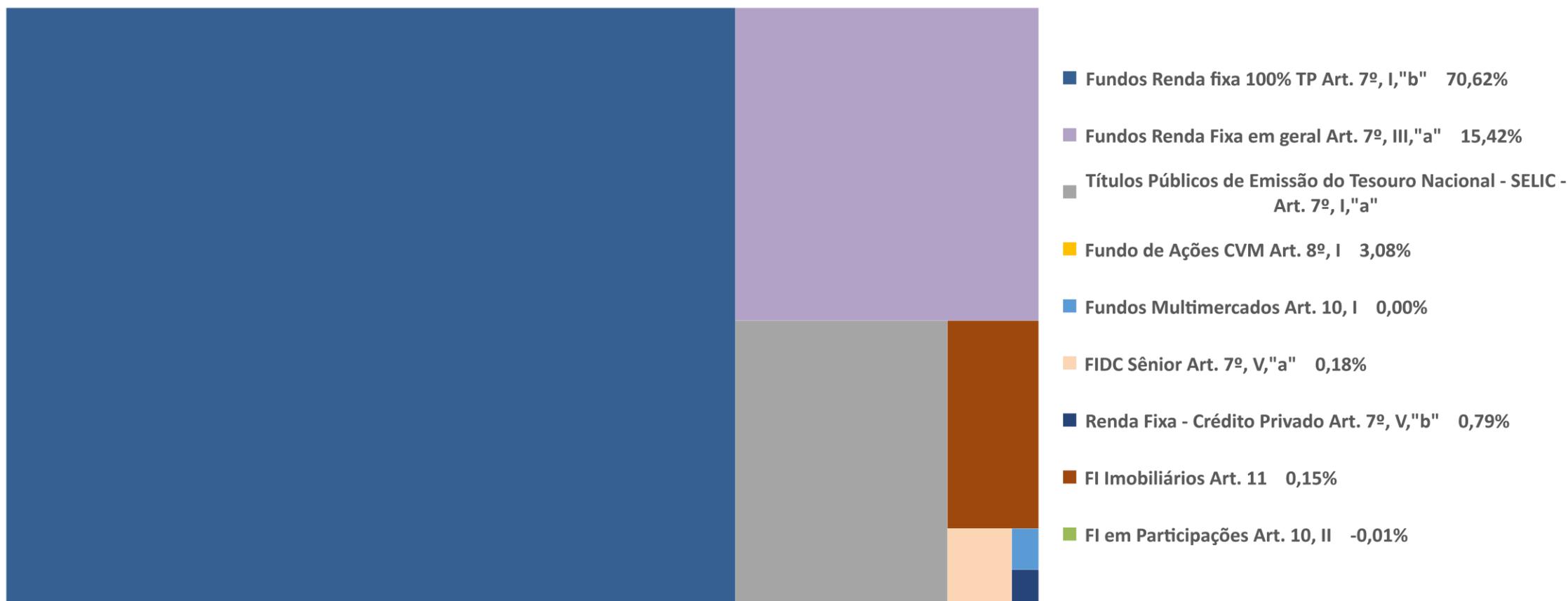
Na **Tabela 3**, pode ser conferida a Política de Investimentos do Fundo Previdenciário Capitalizado para o ano de 2022. Na segunda coluna estão os limites máximos permitidos pela resolução CMN nº 4.963, para cada tipo de ativo da primeira coluna. O limite inferior, a estratégia alvo e o limite superior devem ser definidos pelos RPPS, respeitando os limites da resolução. Na coluna Limite Atual da Carteira, pode ser conferida a adequação da carteira do fundo capitalizado relativa aos limites máximos da Resolução CMN 4.963.

Tipo de Ativo	Limite da Resolução CMN (%)	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)	Limite Atual da Carteira	Limite Atual x Estratégia Alvo	Margem - Estratégia Alvo
Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º, I, "a"	100,00%	0,00%	30,00%	100,00%	0,00%	30,00%	R\$ 158.313.039,37
Fundos Renda fixa 100% TP Art. 7º, I, "b"	100,00%	0,00%	24,00%	100,00%	70,62%	-46,62%	-R\$ 246.015.092,60
ETF 100% TP Art. 7º, I, "c"	100,00%	0,00%	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	R\$ -
Operações compromissadas com lastros em TPF Art. 7º, II	5,00%	0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	R\$ -
Fundos Renda Fixa em geral Art. 7º, III, "a"	60,00%	0,00%	10,00%	60,00%	15,42%	-5,42%	-R\$ 28.592.698,20
Fundo de Índice (ETF) - Renda Fixa Art. 7º, III, "b"	60,00%	0,00%	0,00%	60,00%	0,00%	0,00%	R\$ -
Ativos financeiros de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de instituições financeiras (Lista BACEN) Art. 7º, IV	20,00%	0,00%	0,00%	20,00%	5,00%	-5,00%	-R\$ 26.385.506,56
FIDC Sênior Art. 7º, V, "a"	5,00%	0,00%	0,00%	5,00%	0,18%	-0,18%	-R\$ 948.989,62
Renda Fixa - Crédito Privado Art. 7º, V, "b"	5,00%	0,00%	4,00%	5,00%	0,79%	3,21%	R\$ 16.930.895,69
Fundos de debentures de infraestrutura Art. 7º, V, "c"	5,00%	0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	R\$ -

Fundo de Ações CVM Art. 8º, I	30,00%	0,00%	15,00%	30,00%	3,08%	11,92%	R\$ 62.884.297,27
ETF RV CVM Art. 8º, II	30,00%	0,00%	0,00%	30,00%	0,00%	0,00%	R\$ -
Fundos Multimercados Art. 10, I	10,00%	0,00%	7,80%	20,00%	0,00%	7,80%	R\$ 41.161.390,24
FI em Participações Art. 10, II	5,00%	0,00%	0,02%	20,00%	-0,01%	0,03%	R\$ 132.320,15
FI Ações - Mercado de Acesso Art. 10, III	5,00%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	R\$ -
FI Imobiliários Art. 11	5,00%	0,00%	0,18%	5,00%	0,15%	0,03%	R\$ 150.597,91
Sub Total	0,00%	0,00%	7,82%	0,00%	-0,01%	7,83%	R\$ 41.293.710,39
FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa Art. 9º,I	10,00%	0,00%	3,00%	10,00%	0,00%	3,00%	R\$ 15.831.303,94
FIC Aberto - Investimento no Exterior Art. 9º,II	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	0,00%	3,00%	R\$ 15.831.303,94
Fundo de Ações – BDR Nível I Art. 9º, III	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	0,00%	3,00%	R\$ 15.831.303,94
Sub Total			9,00%		0,00%	9,00%	R\$ 47.493.911,81
Total Geral			100,00%		95,24%		

O **Gráfico 6** mostra a distribuição do patrimônio líquido do Fundo Previdenciário Capitalizado por tipo de ativo definido na Resolução do CMN nº 4.963. O fundo capitalizado tem 78,26% de seus recursos alocados em fundos de investimentos com carteiras compostas exclusivamente por títulos públicos federais.

Gráfico 6



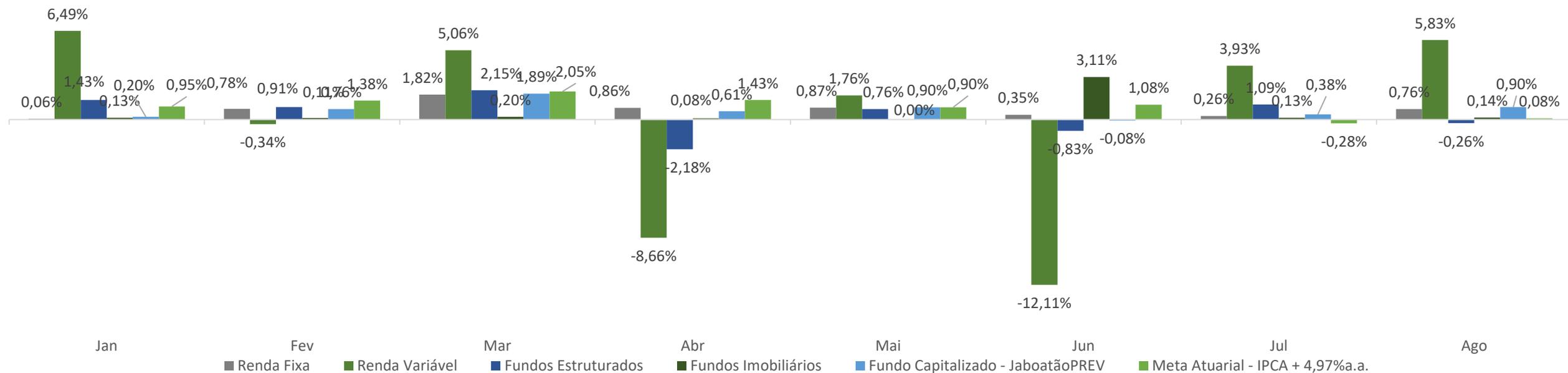
Em agosto as curvas de juros tiveram forte queda, refletindo os dados de inflação, a queda nos preços internacionais do petróleo e o corte nos preços dos combustíveis. Esses fatores juntamente com a percepção do mercado a respeito do fim do ciclo de alta da taxa Selic, ditaram o ritmo dos ativos de renda fixa no mês de. O IPCA registrou deflação de -0,36% no mês e contribuiu para a forte queda na curva de juros. Já a Selic, teve um aumento de 0,5%, indo para 13,75%, em linha com as projeções do mercado. Os indicadores de renda fixa compostos por títulos atrelados à inflação e de vencimentos mais curtos, fecharam o mês de agosto próximo a estabilidade. Já o IMA B e IMA B 5+, índice geral e de prazo superior a 5 anos, respectivamente, tiveram bom desempenho no mês (1,10% e 2,49%). Mais uma vez, o investidor deixou de lado os problemas macroeconômicos globais e os riscos fiscais no mercado doméstico e continuou o rali iniciado no mês anterior. O Ibovespa teve retorno de 6,16% no mês, e no acumulado do ano virou para o campo positivo com 4,48%. **(Gráfico 7)**

No **Gráfico 8** pode ser observado o desempenho do fundo capitalizado em relação a meta atuarial para o ano de 2022. No acumulado do ano, o fundo rentabiliza 5,68% contra uma meta atuarial de 7,83%. Os resultados acumulados por segmento podem ser conferidos no **Gráfico 9**.

O **Gráfico 10** mostra o comparativo, em termos acumulados no ano, entre o retorno do Fundo Previdenciário Capitalizado, a meta atuarial, a inflação medida pelo IPCA, o CDI e o Ibovespa. O IPCA acumulado de 2022 foi 4,39%, a meta atuarial, que tem o IPCA em sua composição, ficou em 7,82%. O Ibovespa fechou o mês de abril com retorno acumulado para o ano de 4,48% e o CDI 7,74%.

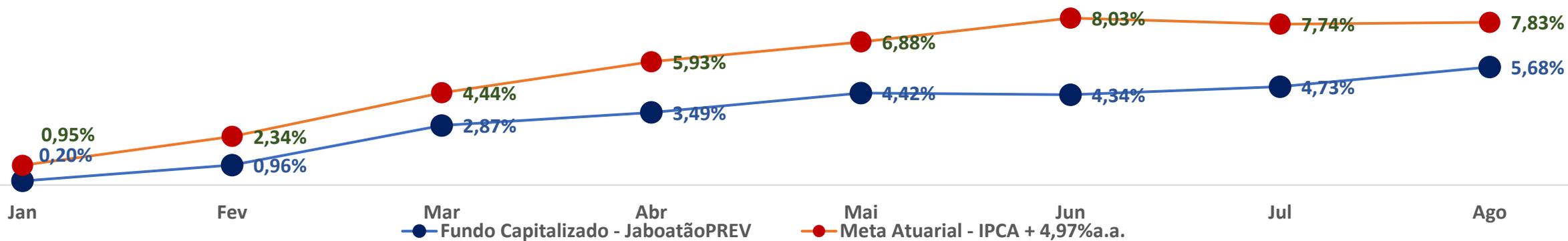
10.1 RENTABILIDADE MENSAL

Gráfico 7



10.2 RENTABILIDADE ACUMULADA

Gráfico 8



10.3 RENTABILIDADE ACUMULADA POR SEGMENTO

Gráfico 9

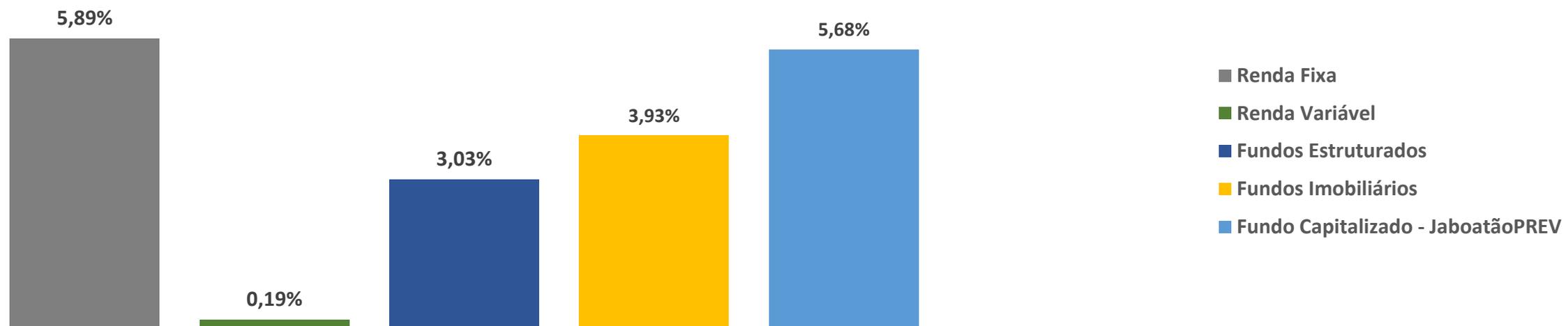
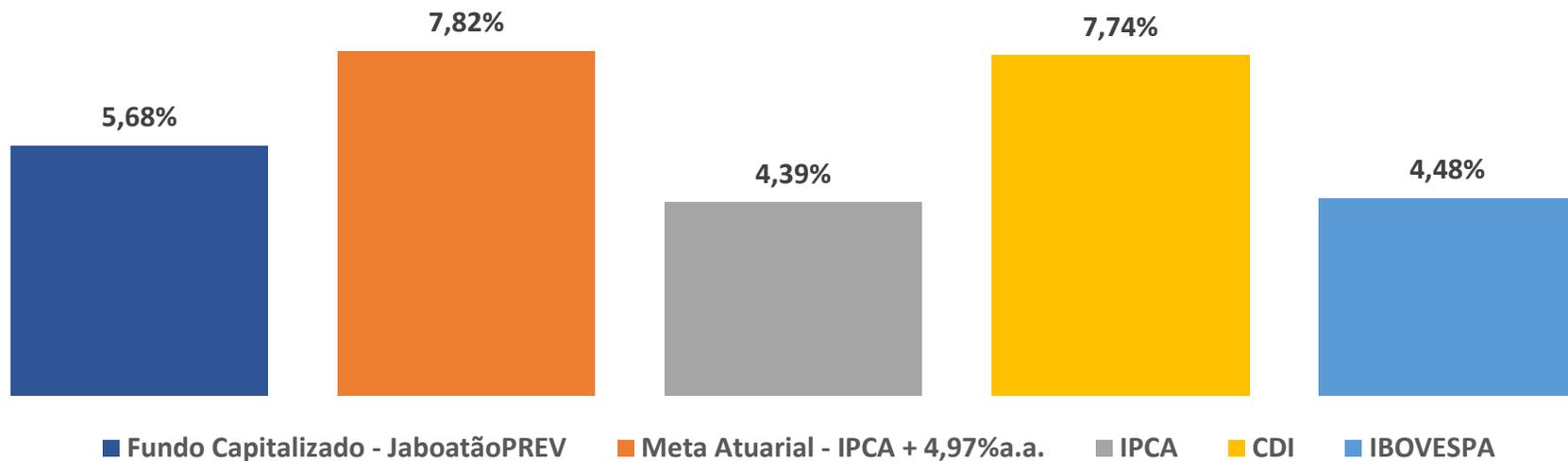
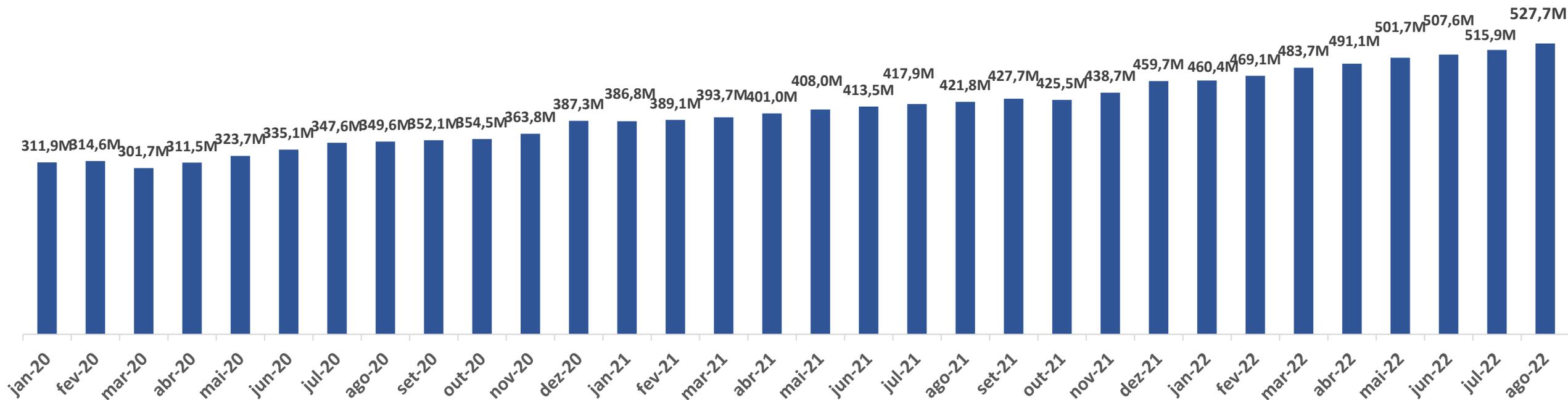


Gráfico 10



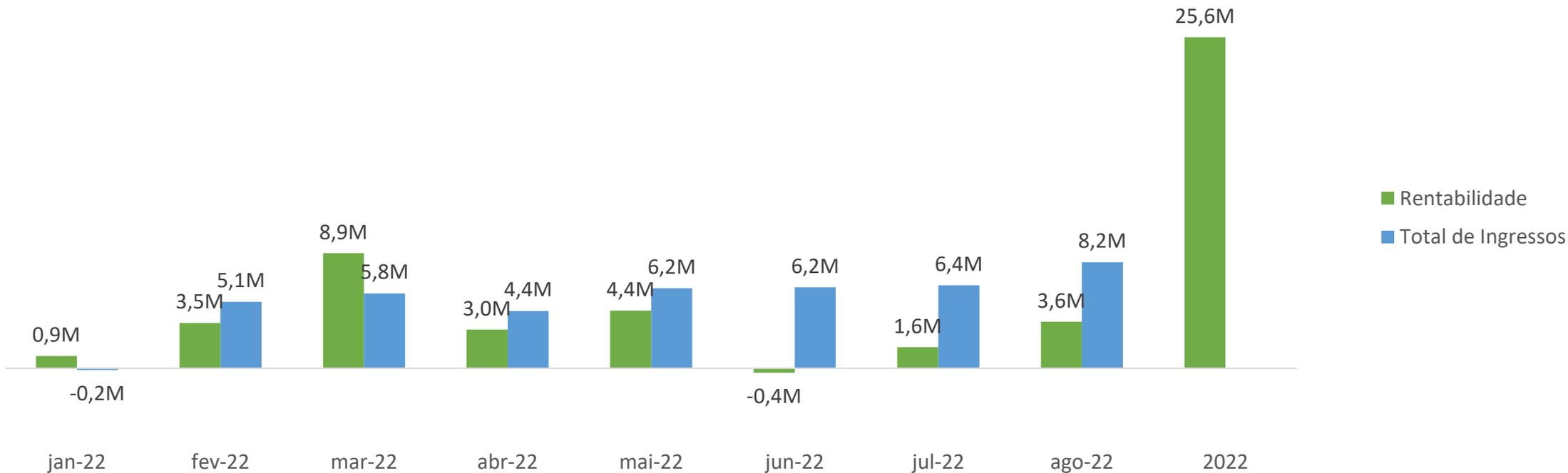
O **Gráfico 11** mostra a evolução patrimonial do Fundo Previdenciário Capitalizado desde janeiro de 2020 até o mês atual. Na comparação do período o fundo teve um aumento de patrimônio da ordem de 215 milhões.

Gráfico 11



No **Gráfico 12** pode ser observado o rendimento mensal e o total de ingressos do Fundo Previdenciário Capitalizado em milhões de reais. No mês de agosto o fundo teve retorno de R\$ R\$ 3.584.222,57 e o total de ingressos foi de R\$ R\$ 8.189.045,07.

Gráfico 12



De acordo com a Resolução nº 4.963, o total das aplicações dos recursos do RPPS em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico. Na **Tabela 4**, a coluna “Volume Aplicado x Volume sob Gestão” mostra os percentuais do valor aplicado pelo Fundo Previdenciário Capitalizado comparado ao total de recursos geridos pelas instituições financeiras. Todos os números desta coluna são inferiores ao limite determinado na norma. A resolução também determina que os RPPS somente poderão alocar recursos em fundos de investimentos cujo administrador do fundo detenha, no máximo, 50% dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social. Na coluna “Volume com RPPS x Volume de Administração” da **Tabela 5**, é mostrado o percentual de recursos oriundos de RPPS em relação ao total de recursos administrados. A Caixa Econômica tem a maior participação relativa de recursos de RPPS com 12,33%.

VOLUME APLICADO X VOLUME SOB GESTÃO ANBIMA

Tabela 4

Gestor de Recursos	Volume Aplicado (A)	% PL JaboatãoPrev	Volume Gestão Anbima (B)	Volume Aplicado x Volume sob Gestão (A/B)	Volume de Gestão Anbima Junto a RPPS (C)	Volume com RPPS x Volume de Gestão (C/B)
	R\$		R\$		R\$	
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	283.334.021,65	53,69%	1.498.767.216.953,06	0,02%	75.241.423.022,67	5,02%
	R\$		R\$		R\$	
CAIXA DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A	179.632.327,05	34,04%	476.040.108.957,84	0,04%	71.134.128.278,56	14,94%
	R\$		R\$		R\$	
GRAPHEN INVESTIMENTOS	799.280,33	0,15%	770.141.692,37	0,10%	553.535.327,51	71,87%
	R\$		R\$		R\$	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	6.713.486,51	1,27%	16.201.568.094,57	0,04%	1.264.931.896,68	7,81%
	R\$		R\$		R\$	
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT	4.177.509,56	0,79%	227.387.588.392,79	0,00%	3.239.634.428,73	1,42%
	R\$		R\$		R\$	
TESOURO NACIONAL	51.506.895,33	9,76%	-	0,00%	-	0,00%

VOLUME APLICADO X VOLUME SOB ADMINISTRAÇÃO ANBIMA

Tabela 5

Administrador de Recursos	Volume Aplicado (A)	% PL JaboatãoPrev	Volume de Administração Anbima (B)	Volume Aplicado x Volume sob Administração (A/B)	Volume de Administração Anbima junto a RPPS ©	Volume com RPPS x Volume de Administração (C/B)
	R\$		R\$		R\$	
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	283.334.021,65	53,69%	1.478.595.864.000,00	0,02%	75.282.292.000,00	5,09%
	R\$		R\$		R\$	
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	179.632.327,05	34,04%	596.162.741.130,00	0,03%	73.514.233.890,00	12,33%
	R\$		R\$		Não Informado	Não Informado
RJI CORRETORA DE VALORES	1.394.124,82	0,26%	7.401.993.099,37	0,02%		
	R\$		R\$		R\$	
SANTANDER CACEIS (GRUPO SANTANDER)	948.989,62	0,18%	383.927.904.998,84	0,00%	3.429.971.401,50	0,89%
	R\$		R\$		R\$	
BEM DTVM LTDA	6.713.486,51	1,27%	392.068.343.640,00	0,00%	8.044.216.740,00	2,05%
	R\$		R\$		R\$	
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	4.177.509,56	0,79%	375.323.814.777,89	0,00%	3.398.116.297,79	0,91%
	R\$		R\$		R\$	
TESOURO NACIONAL	51.506.895,33	9,76%	-	0,00%	-	0,00%

A **Tabela 6**, mostra a composição da carteira de investimentos, as movimentações ocorridas e os rendimentos de cada fundo de investimentos da carteira do fundo capitalizado, no mês de agosto. Já a **Tabela 7**, mostra os mesmos valores para o fundo financeiro.

Tabela 6

Fundo	Saldo Anterior	Aplicações R\$	Resgates R\$	Rendimento Mês R\$	Saldo Atual
NTN-B 2045 24463721	-R\$ 0,00	R\$ 18.999.888,05	R\$	- 3.681,73	R\$ 19.003.569,78
NTN-B 2060 24501825	-R\$ 0,00	R\$ 21.999.243,44	R\$	- 650.910,47	R\$ 21.348.332,97
NTN-B 2060 24745418	-R\$ 0,02	R\$ 7.359.435,23	R\$	- 203.622,36	R\$ 7.155.812,85
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 300.370,20	R\$	- R\$	- 3.578,55	R\$ 303.948,75
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 56.397.415,07	R\$	- 3.320.467,64	-R\$ 676.744,88	R\$ 53.753.692,31
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	R\$ 99.440.869,61	R\$ 303.000,00	-R\$ 41.130.845,64	R\$ 743.945,99	R\$ 59.356.969,95
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 83.988.521,67	R\$	- R\$	- 37.425,33	R\$ 83.951.096,34
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 5.192,55	R\$ 6.595.522,04	-R\$ 6.605.137,06	R\$ 7.041,53	R\$ 2.619,06
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 33.309.628,49	R\$	- R\$	- 358.428,24	R\$ 33.668.056,73
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 42.736.289,51	R\$	- R\$	- 2.613,09	R\$ 42.738.902,60
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	R\$ 4.124.425,28	R\$	- R\$	- 53.084,28	R\$ 4.177.509,56

Fundo	Saldo Anterior	Aplicações R\$	Resgates R\$	Rendimento Mês R\$	Saldo Atual
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 21.131.617,30	R\$	- R\$	- R\$ 250.882,35	R\$ 21.382.499,66
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 23.049.433,95	R\$	- R\$	- R\$ 10.973,97	R\$ 23.060.407,92
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 31.269.099,50	R\$	- R\$	- R\$ 378.573,63	R\$ 31.647.673,13
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	R\$ 23.733.237,27	R\$	- R\$	- R\$ 283.895,95	R\$ 24.017.133,22
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	R\$ 19.628.211,57	R\$ 59.552.446,10	R\$	- R\$ 343.955,43	R\$ 79.524.613,10
BBIF MASTER FIDC LP	R\$ 951.893,79	R\$	- R\$	- -R\$ 2.904,17	R\$ 948.989,62
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	R\$ 305.499,68	R\$	- R\$	- -R\$ 367,66	R\$ 305.132,02
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	R\$ 326.897,58	R\$	-	-R\$ 10.452,38 R\$ 45,39	R\$ 316.490,60
FIC CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LP	R\$ 59.088.209,79	R\$	-	-R\$ 59.552.446,10 R\$ 464.236,33	R\$ 0,03
Total Renda Fixa	R\$ 499.786.812,80	R\$ 118.808.393,89	-R\$ 110.619.348,82	R\$ 2.686.772,05	R\$ 510.662.629,92

MOVIMENTAÇÕES FUNDO PREVIDENCIÁRIO CAPITALIZADO

Fundo	Saldo Anterior	Aplicações R\$	Resgates R\$	Rendimento Mês R\$	Saldo Atual
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	R\$ 9.040.920,44	R\$ -	R\$ -	R\$ 517.815,47	R\$ 9.558.735,90
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	R\$ 6.335.076,11	R\$ -	R\$ -	R\$ 378.410,40	R\$ 6.713.486,51
Total Renda Variável	R\$ 15.375.996,55	R\$ -	R\$ -	R\$ 896.225,87	R\$ 16.272.222,42
Fundo	Saldo Anterior	Aplicações R\$	Resgates R\$	Rendimento Mês R\$	Saldo Atual
GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	-R\$ 26.848,55	R\$ -	R\$ -	R\$ 70,43	-R\$ 26.778,13
NTN-B 760199 2055	-R\$ 0,00	R\$ 3.998.859,03	R\$ -	R\$ 320,71	R\$ 3.999.179,73
Total Fundos Estruturados	-R\$ 26.848,55	R\$ -	R\$ -	R\$ 70,43	-R\$ 26.778,13
Fundo	Saldo Anterior	Aplicações R\$	Resgates R\$	Rendimento Mês R\$	Saldo Atual
HAZ FII - ATCR11	R\$ 798.126,11	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.154,22	R\$ 799.280,33
Total Fundos Imobiliários	R\$ 798.126,11	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.154,22	R\$ 799.280,33

MOVIMENTAÇÕES FUNDO PREVIDENCIÁRIO FINANCEIRO**Tabela 7**

Fundo	Saldo Anterior	Aplicações R\$	Resgates R\$	Rendimento Mês R\$	Saldo Atual
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 1.735.983,04	R\$ 1.165.000,00	R\$ -	-R\$ 3.795,17	R\$ 2.897.187,87
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 1.853,88	R\$ 14.520.822,55	-R\$ 14.534.550,23	R\$ 13.767,51	R\$ 1.893,71
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	R\$ 8.036.607,25	R\$ 14.154.000,00	R\$ 12.610.870,60	-R\$ 25.053.747,04	R\$ 9.747.730,81
BB IRF M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
Total Renda Fixa	R\$ 9.774.444,17	R\$ 29.839.822,55	-R\$ 1.923.679,63	-R\$ 25.043.774,70	R\$ 12.646.812,39

TOTAL GERAL DAS CARTEIRAS**Tabela 8**

O total das carteiras de investimentos do Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Jaboatão dos Guararapes – JABOATÃO PREV, no mês de agosto de 2022, foi de R\$ 540.356.943,63 , conforme **Tabela 8**.

Fundo	Saldo Anterior	Aplicações R\$	Resgates R\$	Rendimento Mês R\$	Saldo Atual
TOTAL FUNDO PREVIDENCIÁRIO	R\$ 515.936.366,83	R\$ 118.808.393,89	-R\$ 110.619.348,82	R\$ 3.584.222,57	R\$ 527.710.131,24
TOTAL FUNDO FINANCEIRO	R\$ 9.774.444,17	R\$ 29.839.822,55	-R\$ 27.145.420,83	R\$ 177.966,50	R\$ 12.646.812,39
TOTAL GERAL DAS CARTEIRAS	R\$ 525.710.811,00	R\$ 148.648.216,44	-R\$ 137.764.769,65	R\$ 3.762.189,07	R\$ 540.356.943,63

