

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2021

Thiago A. O. Santiago
Chefe do Setor de Investimentos
NATAL-PR-REV
Mat. 1.77 725-3

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

INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE NATAL
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/07/2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	90.904.409,17	15,35%	590	1,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	79.009.968,40	13,34%	1.007	0,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	119.241.562,43	20,14%	758	2,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	17.186.842,59	2,90%	661	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	70.499.501,37	11,90%	1.154	1,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	1.638.684,15	0,28%	140	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	19.996.261,05	3,38%	115	4,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.407.656,87	0,24%	165	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.785.179,02	0,30%	984	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	56.214.132,87	9,49%	582	1,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.564.575,80	0,43%	797	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.963.549,73	1,18%	687	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	480.978,81	0,08%	709	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO	D+30 ou...	Não há	7.838.937,26	1,32%	74	1,24%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	6.702.570,45	1,13%	42.261	0,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	23.882.267,04	4,03%	2.778	2,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB ENERGIA FI AÇÕES	D+3	Não há	17.161.758,81	2,90%	15.797	4,84%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	14.031.880,56	2,37%	27.293	1,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	2.982.250,09	0,50%	102	2,39%	Artigo 8º, Inciso III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	4.521.618,98	0,76%	92.859	0,07%	Artigo 8º, Inciso III

Thiago A. O. Santos
Chefe do Setor de Investimentos
NATAL-PR-REV
Mat. 177725-3

INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE NATAL
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/07/2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2021)

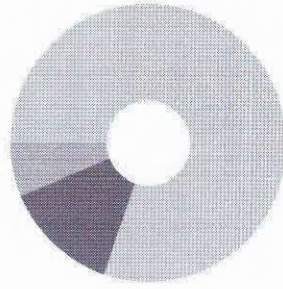
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/Total	Cotistas	% S/PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	3.386.671,36	0,57%	48.558	0,15%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FI - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	7.215.225,20	1,22%		0,30%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL...	D+2 du	Não há	3.898.366,07	0,66%	4.322	3,96%	Artigo 9º - A, Inciso III
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL...	D+2 du	Não há	1.982.698,94	0,33%	3.972	1,49%	Artigo 9º - A, Inciso III
BB AÇÕES ESG FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 du	Não há	30.699.195,73	5,18%	86	1,90%	Artigo 9º - A, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		973.196,23	0,16%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			592.196.742,75				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			973.196,23				Artigo 6º
PL Total			593.169.938,98				

Thiago A. Q. Santiago
Chefe do Setor de Investimentos
NATALPREV

Mat: 177.725-3

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	592.196.742,75
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	100,00%	401.670.065,05	67,83%	40,00%	60,00%	100,00%	190.526.677,70
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	592.196.742,75
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.609.837,14
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	355.318.045,65
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	355.318.045,65
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea 'a'	40,00%	66.223.237,21	11,18%	0,00%	5,00%	40,00%	170.655.459,89
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	236.878.697,10
Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	118.439.348,55
Artigo 7º, Inciso VI, Alinea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	88.829.511,41
Artigo 7º, Inciso VI, Alinea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	88.829.511,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.609.837,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'b'	5,00%	7.838.937,26	1,32%	0,00%	2,00%	5,00%	21.770.899,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.609.837,14
Total Renda Fixa	100,00%	475.732.239,52	80,33%	40,00%	70,00%	570,00%	

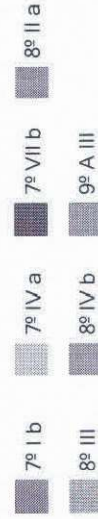
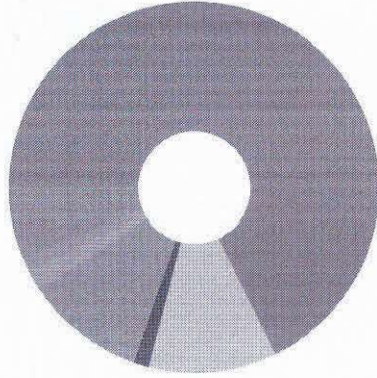


RENDA FIXA 475.732.239,52
RENDA VARIÁVEL 79.884.242,49
EXTERIOR 36.580.260,74

Thiago A. Q. Santiago
Chefe do Setor de Investimentos
NATAL-PR: 11.725.333
Mat: 11.725.333

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alinea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	177.659.022,83
Artigo 8º, Inciso I, Alinea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	177.659.022,83
Artigo 8º, Inciso II, Alinea 'a'	20,00%	61.778.476,86	10,43%	0,00%	14,00%	20,00%	56.660.871,69
Artigo 8º, Inciso II, Alinea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	118.439.348,55
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	10.890.540,43	1,84%	0,00%	5,00%	10,00%	48.329.133,85
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.609.837,14
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'b'	5,00%	7.215.225,20	1,22%	0,00%	2,00%	5,00%	22.394.611,94
Total Renda Variável	30,00%	79.884.242,49	13,49%	0,00%	23,00%	120,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	59.219.674,28
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	59.219.674,28
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	36.580.260,74	6,18%	0,00%	4,00%	10,00%	22.639.413,54
Total Exterior	10,00%	36.580.260,74	6,18%	0,00%	7,00%	30,00%	

Thiago A. Q. Santiago
Chefe do Setor de Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE NATAL

Matr. 111.725-3

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Julho / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	582.715.359,72	98,40	0,03
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	7.215.225,20	1,22	1,98
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL*	2.266.157,83	0,38	0,00

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	401.670.065,05	67,83	40,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	66.223.237,21	11,18	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	7.838.937,26	1,32	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	61.778.476,86	10,43	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	10.890.540,43	1,84	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	7.215.225,20	1,22	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	36.580.260,74	6,18	0,00	10,00

Thiago A. Q. Santiago
Gestor de Investimentos
CNPJ nº 07.043.818/0001-00
NATAL/PREV
Mat. 171 725-3

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1 (Benchmark)								
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	1,00%	0,60%	0,96%	1,99%	7,60%	-	-
	0,16%	0,82%	0,52%	0,79%	1,58%	6,89%	0,23%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)								
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	1,31%	0,59%	1,21%	5,06%	14,34%	-	-
	0,02%	1,19%	0,52%	1,09%	4,79%	13,79%	1,02%	0,02%
IMA-B (Benchmark)								
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,37%	-1,09%	1,10%	-0,24%	2,53%	10,89%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,38%	-1,20%	1,05%	-0,34%	2,27%	10,39%	2,07%	0,06%
	0,66%	2,86%	1,76%	2,56%	6,53%	12,65%	0,42%	0,01%
CDI (Benchmark)								
CAIXA BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36%	1,64%	0,94%	1,49%	2,44%	6,76%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	1,61%	1,00%	1,45%	2,41%	6,22%	0,05%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,25%	1,01%	0,66%	0,93%	1,30%	4,47%	0,01%	0,00%
	0,39%	1,72%	1,01%	1,55%	2,51%	6,34%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)								
BB IPCA III FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,96%	4,76%	2,34%	4,50%	8,99%	11,51%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,07%	0,58%	0,39%	0,49%	4,73%	13,21%	1,11%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	1,97%	1,23%	1,82%	5,59%	13,55%	0,63%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,66%	2,87%	1,77%	2,57%	6,86%	15,53%	0,42%	0,01%
	-0,78%	-0,06%	-0,54%	-0,09%	0,90%	10,67%	1,68%	0,02%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,11%	-0,50%	0,54%	-0,04%	1,16%	-	1,10%	0,04%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	1,50%	0,66%	1,32%	5,61%	14,05%	0,89%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,25%	-0,93%	0,34%	-0,38%	0,55%	7,68%	1,14%	0,03%

Thiago A. O. Santiago
 Chefe do Setor de Investimentos
 NATALPREV
 Matr. 177 725-3

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IEE (Benchmark)	-2,86%	-5,67%	-2,46%	-0,98%	2,12%	17,90%	-	-
BB ENERGIA FI AÇÕES	-3,24%	-7,74%	-2,94%	-2,79%	-0,71%	6,23%	6,43%	0,22%
S&P 500 (Benchmark)	2,27%	17,02%	5,12%	18,34%	34,37%	47,47%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	2,39%	18,08%	5,47%	18,55%	34,02%	-	5,51%	0,14%
Ibovespa (Benchmark)	-3,94%	2,34%	2,44%	5,85%	18,35%	19,63%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,78%	2,87%	2,04%	8,25%	23,66%	34,95%	8,28%	0,24%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-2,32%	2,10%	2,44%	8,14%	24,15%	24,17%	8,21%	0,25%
CDI (Benchmark)	0,36%	1,64%	0,94%	1,49%	2,44%	6,76%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,04%	1,23%	0,84%	1,15%	2,93%	8,53%	0,97%	0,03%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	-0,28%	0,38%	0,89%	-0,11%	2,09%	-	1,92%	0,03%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,33%	1,60%	0,83%	1,34%	3,26%	8,44%	0,08%	0,00%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-0,06%	-0,10%	-	-

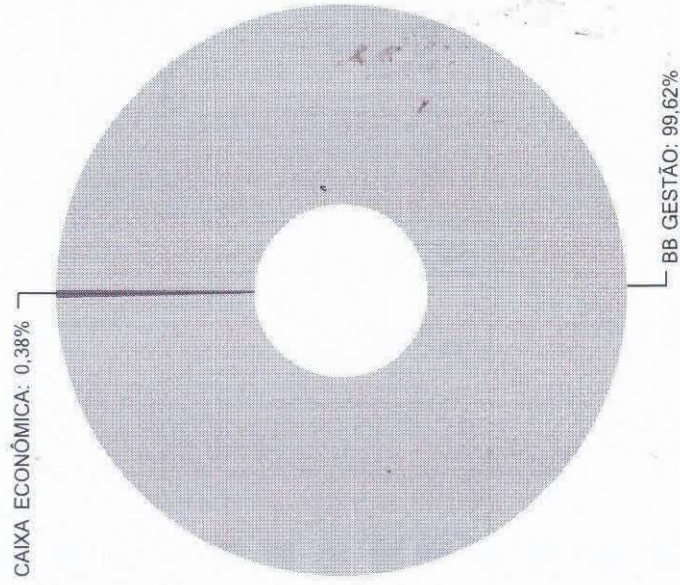
Thiago A. O. Santiago
Chefe do Setor de Investimentos
NATALPREV
Mat 477 725-3

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	5,91%	16,57%	1,55%	9,86%	33,20%	107,01%	-	-
BB AÇÕES ESG FIAÇÕES BDR NÍVEL I	5,34%	14,30%	0,26%	8,77%	29,48%	94,85%	7,26%	0,17%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL I FIC AÇÕES	-8,14%	-6,02%	-8,09%	-9,50%	-	-	10,11%	-
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,19%	10,72%	2,08%	13,22%	-	-	8,53%	-

Thiago A. Q. Santiago
 Chefe do Setor de Investimentos
 NATALP REV
 Matr. 177 725-3

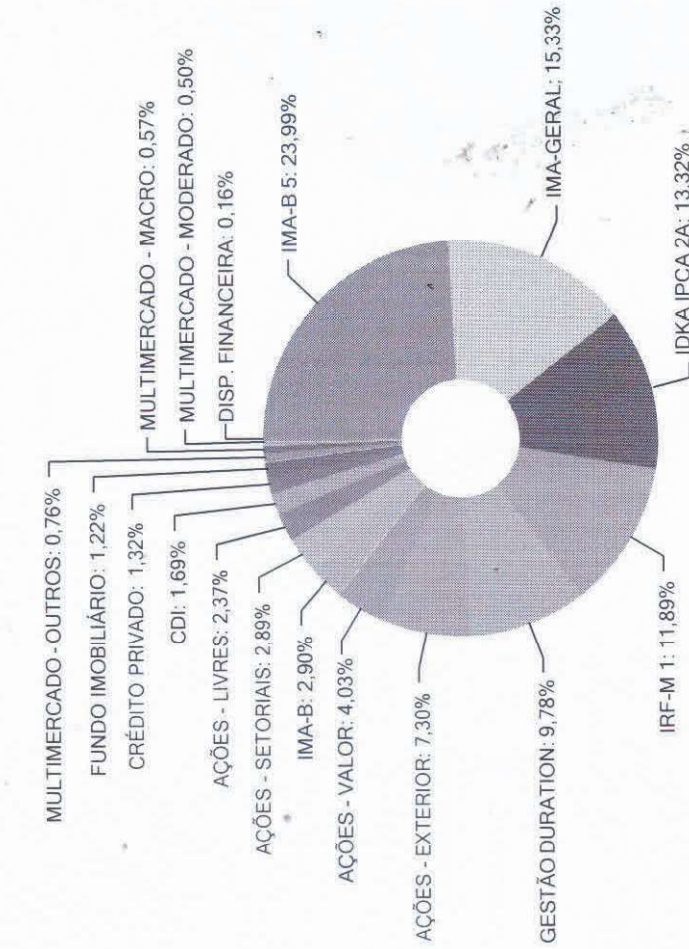
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Julho / 2021)



BB GESTÃO	589.930.584,92
CAIXA ECONÔMICA	2.266.157,83

Thiago A. Q. Santiago
Chefe do Setor de Investimentos
KATIA LPREV
Mat. 17.725-3

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Julho / 2021)



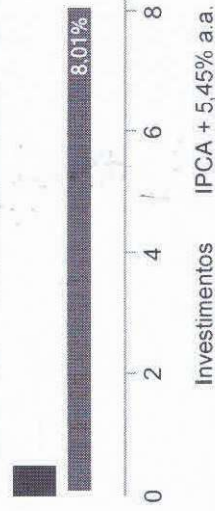
IMA-B 5	142.284.164,50
IMA-GERAL	90.904.409,17
IDKA IPCA 2A	79.009.968,40
IRF-M 1	70.499.501,37
GESTÃO DURATION	57.999.311,89
AÇÕES - EXTERIOR	43.282.831,19
AÇÕES - VALOR	23.882.267,04
IMA-B	17.186.842,59
AÇÕES - SETORIAIS	17.161.758,81
AÇÕES - LIVRES	14.031.880,56
CDI	10.009.104,34
CRÉDITO PRIVADO	7.838.937,26
FUNDO IMOBILIÁRIO	7.215.225,20
MULTIMERCADO - OUTROS	4.521.618,98
MULTIMERCADO - MACRO	3.386.671,36
MULTIMERCADO - MODERADO	2.982.250,09
DISP. FINANCEIRA	973.196,23

Thiago A. Q. Santiago
 Chefe do Setor de Investimentos
 NATALPREV
 Matr. 177.725-3

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	566.355.123,33	6.237.073,91	571.139,15	567.948.431,91	-4.072.626,18	-4.072.626,18	-0,71%	-0,71%	0,67%	0,67%	-105,77%	2,91%
Fevereiro	567.948.431,91	43.318.140,49	40.642.453,07	565.363.453,69	-5.260.665,64	-9.333.291,82	-0,92%	-1,63%	1,24%	1,92%	-84,56%	2,33%
Março	565.363.453,69	134.632.857,52	130.671.299,10	574.182.198,48	4.857.186,37	-4.476.105,45	0,85%	-0,79%	1,42%	3,37%	-23,37%	2,94%
Abril	574.182.198,48	5.881.779,79	2.703.242,43	581.215.416,37	3.854.680,53	-621.424,92	0,67%	-0,13%	0,73%	4,13%	-3,04%	2,09%
Mai	581.215.416,37	3.973.176,70	18.002.366,72	572.090.334,41	4.904.108,06	4.282.683,14	0,84%	0,72%	1,28%	5,46%	13,13%	1,76%
Junho	572.090.334,41	41.480.814,24	22.594.768,92	589.800.554,74	-1.175.824,99	3.106.868,15	-0,20%	0,52%	0,98%	6,49%	7,96%	1,90%
Julho	589.800.554,74	4.026.470,67	1.511.191,21	592.196.742,75	-119.091,45	2.987.766,70	-0,02%	0,50%	1,43%	8,01%	6,20%	2,01%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

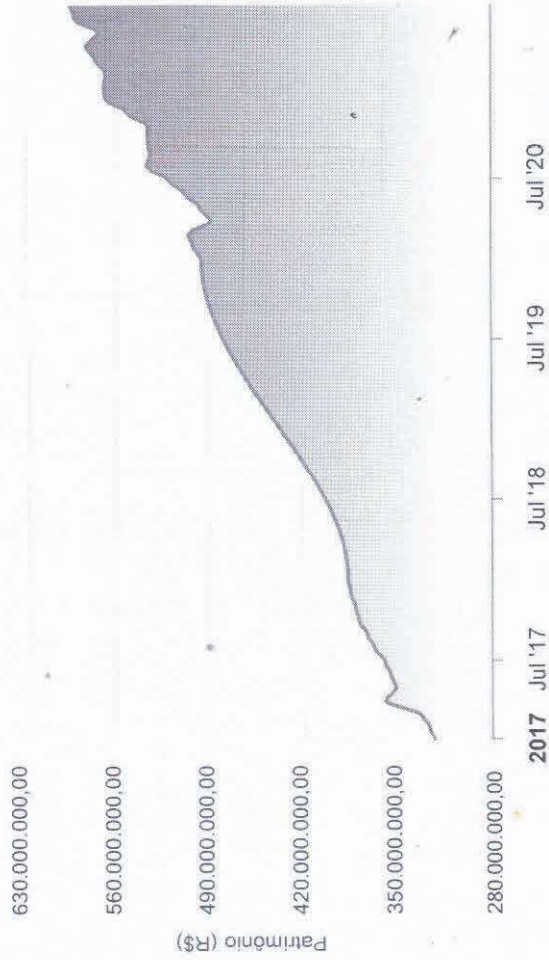


Thiago A. Q. Santiago
Chefe do Setor de Investimentos

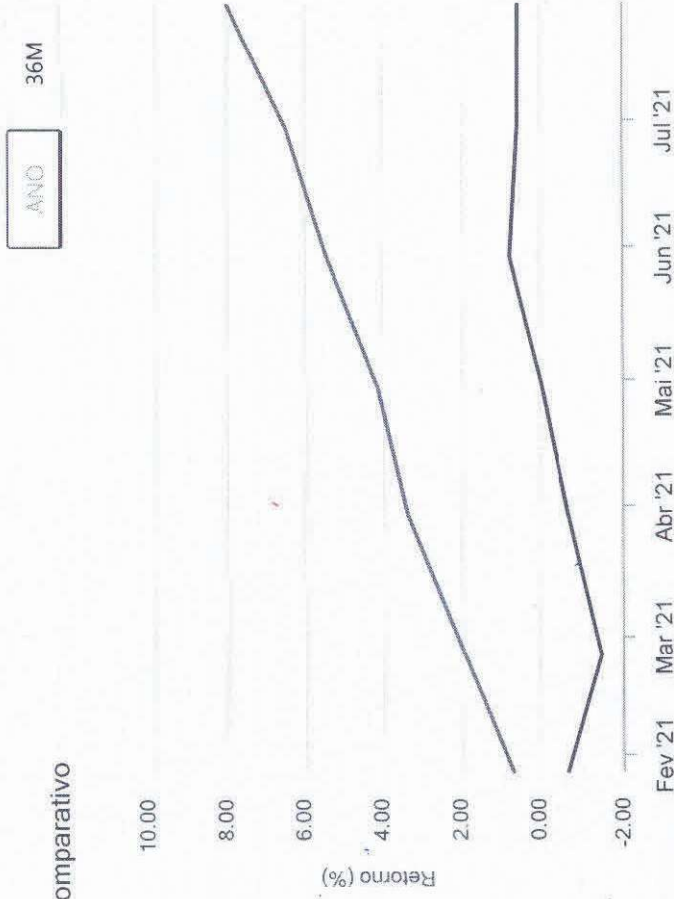
NATAL/PREV
Mat. 177 125-3

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B

IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-
M IRF-M 1

IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

Thiago A. Q. Santiago
 Chefe do Setor de Investimentos

NATAL/PRÉV
 Mat 17 725-3

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENC...	19.865.585,97	0,00	0,00	19.996.261,05	130.675,08	0,66%	0,66%	0,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.398.486,80	0,00	0,00	1.407.656,87	9.170,07	0,66%	0,66%	0,42%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	478.815,78	0,00	0,00	480.978,81	2.163,03	0,45%	0,45%	0,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.632.125,42	0,00	0,00	1.638.684,15	6.558,73	0,40%	0,40%	0,63%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	7.932.340,39	0,00	998.535,14	6.963.549,73	29.744,48	0,37%	0,39%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.435.724,10	635.101,51	512.656,07	2.564.575,80	6.406,26	0,21%	0,25%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	70.383.831,01	0,00	0,00	70.499.501,37	115.670,36	0,16%	0,16%	0,23%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	78.944.081,97	0,00	0,00	79.009.968,40	65.886,43	0,08%	0,08%	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	119.214.640,03	0,00	0,00	119.241.562,43	26.922,40	0,02%	0,02%	1,02%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	7.844.467,74	0,00	0,00	7.838.937,26	-5.530,48	-0,07%	-0,07%	1,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	56.276.696,99	0,00	0,00	56.214.132,87	-62.564,12	-0,11%	-0,11%	1,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	91.131.924,58	0,00	0,00	90.904.409,17	-227.515,41	-0,25%	-0,25%	1,14%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	17.253.014,91	0,00	0,00	17.186.842,59	-66.172,32	-0,38%	-0,38%	2,07%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.799.133,47	0,00	0,00	1.785.179,02	-13.954,45	-0,78%	-0,78%	1,68%
Total Renda Fixa	476.590.869,16	635.101,51	1.511.191,21	475.732.239,52	17.460,06	0,00%		0,90%

Thiago A. Q. Santiago
Chefe do Setor de Investimentos
NATALPREV

Mês 177 725-3

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2021

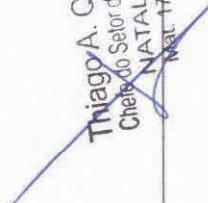
Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIAÇÕES	6.546.085,83	0,00	0,00	6.702.570,45	156.484,62	2,39%	2,39%	5,51%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	7.180.514,76	0,00	0,00	7.215.225,20	34.710,44	0,48%	0,00%	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	4.506.934,44	0,00	0,00	4.521.618,98	14.684,54	0,33%	0,33%	0,08%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	3.391.369,16	0,00	3.386.671,36	-4.697,80	-0,14%	0,04%	0,97%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.990.680,04	0,00	0,00	2.982.250,09	-8.429,95	-0,28%	-0,28%	1,92%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	24.449.179,40	0,00	0,00	23.882.267,04	-566.912,36	-2,32%	-2,32%	8,21%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	14.433.348,30	0,00	0,00	14.031.880,56	-401.467,74	-2,78%	-2,78%	8,28%
BB ENERGIA FIAÇÕES	17.735.738,71	0,00	0,00	17.161.758,81	-573.979,90	-3,24%	-3,24%	6,43%
Total Renda Variável	77.842.481,48	3.391.369,16	0,00	79.884.242,49	-1.349.608,15	-1,66%		6,45%

Thiago A. Q. Santiago
Chefe do Setor de Investimentos
NATALPREV
Mat. 177 725-3

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Julho / 2021)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saído Anterior	Aplicações	Resgates	Saído Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instít	Var - Mês
BB AÇÕES ESG FIAÇÕES BDR NÍVEL I	29.144.466,91	0,00	0,00	30.699.195,73	1.554.728,82	5,33%	5,33%	7,26%
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.978.893,16	0,00	0,00	1.982.698,94	3.805,78	0,19%	0,19%	8,53%
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL I...	4.243.844,03	0,00	0,00	3.898.366,07	-345.477,96	-8,14%	-8,14%	10,11%
Total Exterior	35.367.204,10	0,00	0,00	36.580.260,74	1.213.056,64	3,43%		7,63%


Thiago A. Q. Santiago
 Chefe do Setor de Investimentos
 NATALPREV
 Matr. 177.125-3