



LDB
EMPRESAS

JACAREÍ
JANEIRO

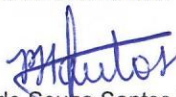


1. PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS.....	3
2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS.....	4
3. Posição de Ativos e Enquadramento	5
4. Rentabilidades por Artigo.....	16
5. Análise de Liquidez	23
6. Alocação por Artigo.....	24
7. Alocação Por Estratégia.....	24
8. Alocação por Gestor	25
9. Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial.....	26
10. Performance dos Fundos	29
11. Cotização e Taxas.....	38
12. Indexadores.....	40
13. Movimentações	42
14. Análise de Risco.....	43
15. ANEXO.....	49
1. Relatório de Cenário Macroeconômico.....	49
2. Agenda realizada.....	50
3. Acompanhamento fundos estressados.....	51
i. FIDC MULSTISETORIAL MASTER III	51
ii. PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	51
iii. Fundos Estruturados (FIP) KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	52

1. PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS

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 janeiro de 2023, 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 requisitos legais e às provisões da Política de Investimentos que atende às necessidades da gestão de investimentos.



Renata de Souza Santos Esteves

Diretora do Dep. Administrativo-Financeiro – CPA 10



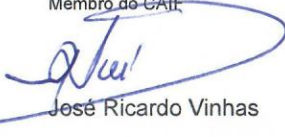
Luis Gustavo Ferreira Bonacina

Assessor da Presidência – CPA 20

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**

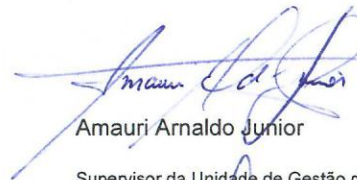
Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do CAIF



José Ricardo Vinhas

Membro do CAIF



Amauri Arnaldo Junior

Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos – CPA 10



Clévid Vitor de Almeida

Membro do CAIF – CGRPPS – CPA 10



Vitor Adriano Vieira Silva

Membro do CAIF – CGRPPS

2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 23 dias do mês de fevereiro de 2023 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 janeiro 2023, considerando as explicações dos investimentos, rentabilidade e pormenores constantes no presente documento, pela Diretoria Administrativo – Financeira deste Instituto APROVAMOS Relatório de Investimentos referente ao mês de janeiro 2023.

Jacareí, 23 de fevereiro de 2023

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**

Amauri Arnaldo Junior

Presidente do Conselho Fiscal



Valdir dos Santos Pereira

Membro do Conselho Fiscal



Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do Conselho Fiscal

3. Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

68,99%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,210000%)	0,66	0,05	1,13	1,13	2.122.939,35	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,300000%)	0,66	0,05	1,14	1,14	2.159.178,43	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,420000%)	0,66	0,05	1,15	1,15	10.714.994,13	1,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,580000%)	0,66	0,05	1,16	1,16	3.213.980,39	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,850000%)	0,66	0,05	1,19	1,19	2.143.873,18	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,860000%)	0,66	0,05	1,19	1,19	10.723.156,05	1,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,930000%)	0,66	0,05	1,19	1,19	5.309.673,05	0,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,560000%)	0,66	0,05	1,25	1,25	2.127.746,95	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,480000%)	0,63	0,05	1,16	1,16	2.128.943,44	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,63	0,05	1,18	1,18	1.038.999,47	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,65	0,04	1,10	1,10	2.159.374,42	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,65	0,04	1,10	1,10	2.155.692,00	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,65	0,04	1,11	1,11	2.154.652,15	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,65	0,05	1,13	1,13	2.142.197,39	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,66	0,05	1,14	1,14	2.142.585,95	0,33

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,66	0,05	1,14	1,14	2.141.489,76	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,65	0,05	1,18	1,18	1.997.069,01	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,65	0,05	1,19	1,19	3.125.306,57	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,65	0,04	1,11	1,11	2.168.665,02	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,65	0,04	1,11	1,11	2.165.962,68	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,65	0,04	1,12	1,12	2.161.703,74	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,285000%)	0,66	0,05	1,14	1,14	2.148.099,11	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,66	0,05	1,14	1,14	2.146.943,52	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,66	0,05	1,15	1,15	2.145.280,97	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,65	0,05	1,18	1,18	5.042.358,70	0,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,65	0,05	1,19	1,19	2.083.042,54	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	2,91	0,05	1,19	1,19	2.003.696,44	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,66	0,05	1,19	1,19	6.121.976,68	0,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,66	0,05	1,19	1,19	1.997.777,80	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	2,99	0,05	1,21	1,21	4.488.743,90	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,66	0,05	1,22	1,22	3.537.302,59	0,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	4,32	0,05	1,23	1,23	2.029.719,03	0,31
TESOURO	NTN-B 150555 (5,000000%)	0,65	0,04	1,11	1,11	2.172.256,14	0,34

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,65	0,04	1,12	1,12	2.167.243,42	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,65	0,04	1,12	1,12	2.162.253,75	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,66	0,05	1,14	1,14	2.150.113,60	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,66	0,05	1,15	1,15	2.150.861,29	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,66	0,05	1,15	1,15	2.148.662,99	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,520000%)	0,66	0,05	1,16	1,16	2.139.855,91	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,65	0,05	1,18	1,18	11.100.428,89	1,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,65	0,05	1,19	1,19	2.081.333,79	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	2,90	0,05	1,19	1,19	4.998.617,79	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,66	0,05	1,19	1,19	2.000.240,81	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,66	0,05	1,19	1,19	16.321.209,85	2,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	3,00	0,05	1,21	1,21	8.972.760,08	1,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,66	0,05	1,22	1,22	8.078.696,62	1,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	4,35	0,05	1,23	1,23	5.079.224,41	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,66	0,00	1,14	1,14	2.160.112,93	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,450000%)	0,66	0,05	1,15	1,15	2.190.318,19	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,66	0,05	1,19	1,19	2.143.431,66	0,33

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,66	0,04	1,12	1,12	2.192.022,34	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,66	0,05	1,13	1,13	2.192.542,08	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,66	0,05	1,13	1,13	2.192.827,71	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,66	0,05	1,16	1,16	2.194.173,98	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,710000%)	0,66	0,05	1,17	1,17	3.209.260,35	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,65	0,04	1,10	1,10	2.205.721,30	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,66	0,05	1,13	1,13	2.195.944,28	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,66	0,05	1,14	1,14	2.197.620,16	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,66	0,05	1,14	1,14	2.194.689,54	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,66	0,05	1,18	1,18	3.214.268,35	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,65	0,04	1,10	1,10	2.212.238,25	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,66	0,04	1,11	1,11	2.207.129,58	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,66	0,05	1,13	1,13	2.198.025,64	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,66	0,05	1,14	1,14	2.199.416,84	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,300000%)	0,66	0,05	1,14	1,14	2.199.940,61	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,66	0,05	1,16	1,16	2.196.177,03	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,835000%)	0,66	0,05	1,18	1,18	3.215.288,42	0,50
TESOURO	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,66	0,04	1,11	1,11	2.221.662,21	0,34

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,66	0,04	1,11	1,11	2.212.309,02	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,66	0,04	1,12	1,12	2.214.289,24	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,66	0,05	1,14	1,14	2.204.542,79	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,310000%)	0,66	0,05	1,14	1,14	2.205.089,78	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,66	0,05	1,15	1,15	2.202.371,36	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,66	0,00	1,18	1,18	2.057.957,27	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,66	0,05	1,19	1,19	3.213.548,62	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,66	0,05	1,22	1,22	3.031.419,04	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,66	0,04	1,11	1,11	2.230.702,76	0,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,66	0,04	1,11	1,11	2.227.934,88	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,66	0,04	1,12	1,12	2.223.497,65	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,66	0,04	1,12	1,12	2.217.562,00	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,66	0,05	1,14	1,14	2.207.098,04	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,66	0,05	1,15	1,15	2.206.110,84	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,66	0,05	1,15	1,15	2.204.855,50	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,510000%)	0,66	0,05	1,16	1,16	2.197.851,95	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,66	0,05	1,18	1,18	8.303.041,20	1,28

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	4,13	0,05	1,19	1,19	3.084.211,21	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,66	0,05	1,19	1,19	2.058.180,98	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,66	0,05	1,19	1,19	11.219.658,67	1,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	4,26	0,05	1,21	1,21	6.672.060,71	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,66	0,05	1,22	1,22	5.557.641,01	0,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	4,40	0,05	1,23	1,23	3.048.205,68	0,47
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,63	0,05	1,17	1,17	299.799.835,40	46,39

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	1,10	1,10	61.786.105,11	9,56	5.523.368.108,50	1,12
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,06	1,05	1,05	31.480.447,61	4,87	3.079.266.604,87	1,02
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,20	0,05	0,82	0,82	31.522.545,63	4,88	2.450.304.068,66	1,29
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,37	0,05	1,01	1,01	124.789.098,35	19,31		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	1,31	0,06	0,87	0,87	5.087.095,65	0,79		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 7,00% a.a	2,92	0,05	1,29	1,29	5.577.443,56	0,86		
Sub-total Artigo 7º IV			2,79	0,06	1,09	1,09	10.664.539,21	1,65		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLURAL	GENIAL	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	143,89	4,80	4,80	4,80	7.842,89	0,00	271.301,34	2,89
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			143,89	4,80	4,80	4,80	7.842,89	0,00		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,07	0,05	1,15	1,15	3.140.346,10	0,49	5.539.153.970,83	0,06
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	3,45	0,02	-0,06	-0,06	2.052.109,21	0,32	730.379.196,35	0,28
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,43	0,05	0,39	0,39	5.393.614,74	0,83	4.779.095.048,50	0,11
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,47	0,05	0,52	0,52	10.586.070,05	1,64		
Renda Fixa			0,81	0,05	1,11	1,11	445.847.385,90	68,99		

RENDA VARIÁVEL
14,68%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SUL AMERICA	BEM	SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	27,94	1,88	8,33	8,33	4.436.240,47	0,69	348.474.955,85	1,27
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	25,51	0,92	4,90	4,90	2.383.465,70	0,37	236.322.350,81	1,01
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	25,96	1,02	5,35	5,35	7.215.818,37	1,12	281.615.427,86	2,56
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	22,40	0,50	4,66	4,66	5.122.436,15	0,79	1.435.098.805,67	0,36
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,34	0,86	1,94	1,94	25.865.396,11	4,00	734.828.330,05	3,52
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,57	0,32	2,75	2,75	30.000.670,68	4,64	998.511.222,29	3,00
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22,97	1,01	-0,92	-0,92	2.936.754,00	0,45	195.752.326,80	1,50
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	26,41	1,80	3,50	3,50	3.318.850,75	0,51	468.521.482,83	0,71
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	21,47	0,87	2,35	2,35	6.905.555,69	1,07	605.756.791,52	1,14
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	21,31	0,37	3,37	3,37	6.660.254,27	1,03	215.029.630,06	3,10
Sub-total Artigo 8º I			19,49	0,73	3,05	3,05	94.845.442,19	14,68		
Renda Variável			19,21	0,73	3,05	3,05	94.845.442,19	14,68		

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR
7,04%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	32,62	1,01	11,98	11,98	13.474.897,80	2,09	230.832.362,56	5,84
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	56,97	-1,62	11,38	11,38	1.726.049,02	0,27	183.613.336,38	0,94
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	26,62	-2,10	2,45	2,45	2.889.695,11	0,45	98.001.511,63	2,95
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	32,59	-2,32	2,45	2,45	2.503.543,84	0,39	61.408.050,29	4,08
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	40,19	-0,96	11,00	11,00	2.381.629,55	0,37	588.945.660,50	0,40
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	26,22	-1,15	1,74	1,74	5.043.506,55	0,78	286.065.832,19	1,76
Sub-total Artigo 9º II			24,47	-0,34	7,97	7,97	28.019.321,87	4,34		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	26,69	0,62	2,55	2,55	17.472.097,17	2,70	888.058.003,28	1,97
Sub-total Artigo 9º III			26,69	0,62	2,55	2,55	17.472.097,17	2,70		
Investimentos no Exterior			23,53	0,02	5,82	5,82	45.491.419,04	7,04		

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS
9,30%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	12,44	0,40	1,92	1,92	6.876.730,05	1,06	46.139.970,70	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	24,03	1,40	6,49	6,49	16.131.675,60	2,50	925.450.668,91	1,74
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	23,86	1,40	6,38	6,38	26.704.772,14	4,13	494.455.251,27	5,40
Sub-total Artigo 10º I			23,36	1,26	5,78	5,78	49.713.177,79	7,69		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	45,21	-6,40	-6,40	-6,40	10.364.047,41	1,60	330.613.066,51	3,13
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	117,28	0,70	0,70	0,70	15.382,18	0,00	2.507.814,62	0,61
Sub-total Artigo 10º II			45,16	-6,39	-6,39	-6,39	10.379.429,59	1,61		
Investimentos Estruturados			20,65	-0,15	3,45	3,45	60.092.607,38	9,30		
Total			5,42	0,13	1,93	1,93	646.276.854,51	100,00		

1. Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	299.799.835,40	46,39	0,00	43,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	124.789.098,35	19,31	0,00	12,50	40,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	10.664.539,21	1,65	0,00	2,50	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	7.842,89	0,00	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	10.586.070,05	1,64	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	445.847.385,90	68,99					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	94.845.442,19	14,68	0,00	14,50	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	94.845.442,19	14,68					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	28.019.321,87	4,34	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	17.472.097,17	2,70	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	45.491.419,04	7,04					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	49.713.177,79	7,69	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	10.379.429,59	1,61	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	60.092.607,38	9,30					15,00
Total		646.276.854,51	100,00					

4. Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,17 104,18	1,17 104,18	3,10 93,88	3,72 55,43	11,72 91,51	3.468.044,76	3.468.044,76
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,01 90,33	1,01 90,33	3,21 97,09	6,71 100,06	13,74 107,27	1.198.897,01	1.198.897,01
Artigo 7º IV % do CDI	1,09 97,26	1,09 97,26	3,28 99,38			115.258,53	115.258,53
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	4,80 427,72	4,80 427,72	3,17 96,00	21,09 314,44	-74,98 -585,39	359,55	359,55
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,52 46,72	0,52 46,72	2,48 75,05	6,21 92,64	12,69 99,08	55.271,97	55.271,97
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,05 -0,32	3,05 -0,32	-7,10 -4,86	7,89 -2,06	-0,17 -1,32	2.804.191,54	2.804.191,54
Artigo 9º II % do CDI	7,97 709,82	7,97 709,82	10,21 309,06	-2,52 -37,52	-21,42 -167,23	2.069.146,69	2.069.146,69
Artigo 9º III % do CDI	2,55 227,22	2,55 227,22	4,16 126,06	-5,12 -76,32	-19,13 -149,37	434.858,51	434.858,51
Artigo 10º I % do CDI	5,78 514,20	5,78 514,20	6,33 191,71	2,78 41,47	-1,60 -12,49	2.714.684,54	2.714.684,54
Artigo 10º II % do CDI	-6,39 -568,60	-6,39 -568,60	-8,25 -249,69	-7,49 -111,64	14,27 111,44	-708.180,89	-708.180,89
JACAREÍ (Total)						12.152.532,21	12.152.532,21

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150523 (5,210000%)	2.099.166,47	0,00	0,00	0,00	2.122.939,35	23.772,88	23.772,88
NTN-B 150523 (5,300000%)	2.134.839,07	0,00	0,00	0,00	2.159.178,43	24.339,36	24.339,36
NTN-B 150523 (5,420000%)	10.593.166,57	0,00	0,00	0,00	10.714.994,13	121.827,56	121.827,56
NTN-B 150523 (5,580000%)	3.177.016,53	0,00	0,00	0,00	3.213.980,39	36.963,86	36.963,86
NTN-B 150523 (5,850000%)	2.118.743,20	0,00	0,00	0,00	2.143.873,18	25.129,98	25.129,98

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150523 (5,860000%)	10.597.376,29	0,00	0,00	0,00	10.723.156,05	125.779,76	125.779,76
NTN-B 150523 (5,930000%)	5.247.090,67	0,00	0,00	0,00	5.309.673,05	62.582,38	62.582,38
NTN-B 150523 (6,560000%)	2.101.579,61	0,00	0,00	0,00	2.127.746,95	26.167,34	26.167,34
NTN-B 150525 (5,480000%)	2.104.632,25	0,00	0,00	0,00	2.128.943,44	24.311,19	24.311,19
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.026.854,19	0,00	0,00	0,00	1.038.999,47	12.145,28	12.145,28
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.135.815,05	0,00	0,00	0,00	2.159.374,42	23.559,37	23.559,37
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.132.136,55	0,00	0,00	0,00	2.155.692,00	23.555,45	23.555,45
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.131.056,42	0,00	0,00	0,00	2.154.652,15	23.595,73	23.595,73
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.118.233,28	0,00	0,00	0,00	2.142.197,39	23.964,11	23.964,11
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.118.453,77	0,00	0,00	0,00	2.142.585,95	24.132,18	24.132,18
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.117.316,02	0,00	0,00	0,00	2.141.489,76	24.173,74	24.173,74
NTN-B 150535 (5,837000%)	1.973.682,11	0,00	0,00	0,00	1.997.069,01	23.386,90	23.386,90
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.088.660,20	0,00	0,00	0,00	3.125.306,57	36.646,37	36.646,37
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.144.808,52	0,00	0,00	0,00	2.168.665,02	23.856,50	23.856,50
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.142.118,94	0,00	0,00	0,00	2.165.962,68	23.843,74	23.843,74
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.137.818,16	0,00	0,00	0,00	2.161.703,74	23.885,58	23.885,58
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.123.912,19	0,00	0,00	0,00	2.148.099,11	24.186,92	24.186,92
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.122.673,97	0,00	0,00	0,00	2.146.943,52	24.269,55	24.269,55
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.120.959,58	0,00	0,00	0,00	2.145.280,97	24.321,39	24.321,39
NTN-B 150545 (5,831000%)	4.983.332,46	0,00	0,00	0,00	5.042.358,70	59.026,24	59.026,24
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.058.609,03	0,00	0,00	0,00	2.083.042,54	24.433,51	24.433,51
NTN-B 150545 (5,897000%)	1.980.132,84	0,00	0,00	0,00	2.003.696,44	23.563,60	23.563,60
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.049.893,43	0,00	0,00	0,00	6.121.976,68	72.083,25	72.083,25
NTN-B 150545 (5,922000%)	1.974.244,79	0,00	0,00	0,00	1.997.777,80	23.533,01	23.533,01
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.435.070,18	0,00	0,00	0,00	4.488.743,90	53.673,72	53.673,72
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.494.672,33	0,00	0,00	0,00	3.537.302,59	42.630,26	42.630,26
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.005.020,73	0,00	0,00	0,00	2.029.719,03	24.698,30	24.698,30
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.148.305,83	0,00	0,00	0,00	2.172.256,14	23.950,31	23.950,31
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.143.294,41	0,00	0,00	0,00	2.167.243,42	23.949,01	23.949,01

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.138.307,68	0,00	0,00	0,00	2.162.253,75	23.946,07	23.946,07
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.125.851,71	0,00	0,00	0,00	2.150.113,60	24.261,89	24.261,89
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.126.494,46	0,00	0,00	0,00	2.150.861,29	24.366,83	24.366,83
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.124.231,17	0,00	0,00	0,00	2.148.662,99	24.431,82	24.431,82
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.115.349,60	0,00	0,00	0,00	2.139.855,91	24.506,31	24.506,31
NTN-B 150555 (5,831200%)	10.970.487,74	0,00	0,00	0,00	11.100.428,89	129.941,15	129.941,15
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.056.920,84	0,00	0,00	0,00	2.081.333,79	24.412,95	24.412,95
NTN-B 150555 (5,897000%)	4.939.835,85	0,00	0,00	0,00	4.998.617,79	58.781,94	58.781,94
NTN-B 150555 (5,927000%)	1.976.669,74	0,00	0,00	0,00	2.000.240,81	23.571,07	23.571,07
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.128.572,77	0,00	0,00	0,00	16.321.209,85	192.637,08	192.637,08
NTN-B 150555 (6,140000%)	8.865.469,40	0,00	0,00	0,00	8.972.760,08	107.290,68	107.290,68
NTN-B 150555 (6,261000%)	7.981.296,69	0,00	0,00	0,00	8.078.696,62	97.399,93	97.399,93
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.017.419,72	0,00	0,00	0,00	5.079.224,41	61.804,69	61.804,69
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.135.684,43	0,00	0,00	0,00	2.160.112,93	24.428,50	24.428,50
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.165.361,64	0,00	0,00	0,00	2.190.318,19	24.956,55	24.956,55
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.118.200,25	0,00	0,00	0,00	2.143.431,66	25.231,41	25.231,41
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.167.836,19	0,00	0,00	0,00	2.192.022,34	24.186,15	24.186,15
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.168.134,70	0,00	0,00	0,00	2.192.542,08	24.407,38	24.407,38
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.168.306,94	0,00	0,00	0,00	2.192.827,71	24.520,77	24.520,77
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.169.100,24	0,00	0,00	0,00	2.194.173,98	25.073,74	25.073,74
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.172.009,23	0,00	0,00	0,00	3.209.260,35	37.251,12	37.251,12
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.181.673,03	0,00	0,00	0,00	2.205.721,30	24.048,27	24.048,27
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.171.505,51	0,00	0,00	0,00	2.195.944,28	24.438,77	24.438,77
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.172.956,18	0,00	0,00	0,00	2.197.620,16	24.663,98	24.663,98
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.170.006,49	0,00	0,00	0,00	2.194.689,54	24.683,05	24.683,05
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.176.698,34	0,00	0,00	0,00	3.214.268,35	37.570,01	37.570,01
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.188.102,56	0,00	0,00	0,00	2.212.238,25	24.135,69	24.135,69
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.182.976,63	0,00	0,00	0,00	2.207.129,58	24.152,95	24.152,95
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.173.468,88	0,00	0,00	0,00	2.198.025,64	24.556,76	24.556,76

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.174.679,74	0,00	0,00	0,00	2.199.416,84	24.737,10	24.737,10
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.175.144,06	0,00	0,00	0,00	2.199.940,61	24.796,55	24.796,55
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.171.062,64	0,00	0,00	0,00	2.196.177,03	25.114,39	25.114,39
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.177.639,58	0,00	0,00	0,00	3.215.288,42	37.648,84	37.648,84
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.197.258,35	0,00	0,00	0,00	2.221.662,21	24.403,86	24.403,86
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.187.972,78	0,00	0,00	0,00	2.212.309,02	24.336,24	24.336,24
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.189.839,06	0,00	0,00	0,00	2.214.289,24	24.450,18	24.450,18
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.179.740,05	0,00	0,00	0,00	2.204.542,79	24.802,74	24.802,74
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.180.215,89	0,00	0,00	0,00	2.205.089,78	24.873,89	24.873,89
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.177.436,40	0,00	0,00	0,00	2.202.371,36	24.934,96	24.934,96
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.033.856,65	0,00	0,00	0,00	2.057.957,27	24.100,62	24.100,62
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.175.870,45	0,00	0,00	0,00	3.213.548,62	37.678,17	37.678,17
NTN-B 150840 (6,220000%)	2.994.975,81	0,00	0,00	0,00	3.031.419,04	36.443,23	36.443,23
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.206.217,40	0,00	0,00	0,00	2.230.702,76	24.485,36	24.485,36
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.203.406,06	0,00	0,00	0,00	2.227.934,88	24.528,82	24.528,82
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.198.964,03	0,00	0,00	0,00	2.223.497,65	24.533,62	24.533,62
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.193.029,95	0,00	0,00	0,00	2.217.562,00	24.532,05	24.532,05
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.182.228,98	0,00	0,00	0,00	2.207.098,04	24.869,06	24.869,06
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.181.136,11	0,00	0,00	0,00	2.206.110,84	24.974,73	24.974,73
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.179.804,68	0,00	0,00	0,00	2.204.855,50	25.050,82	25.050,82
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.172.699,14	0,00	0,00	0,00	2.197.851,95	25.152,81	25.152,81
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.205.850,08	0,00	0,00	0,00	8.303.041,20	97.191,12	97.191,12
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.047.942,18	0,00	0,00	0,00	3.084.211,21	36.269,03	36.269,03
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.033.938,30	0,00	0,00	0,00	2.058.180,98	24.242,68	24.242,68
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.087.233,45	0,00	0,00	0,00	11.219.658,67	132.425,22	132.425,22
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.592.279,20	0,00	0,00	0,00	6.672.060,71	79.781,51	79.781,51
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.490.641,26	0,00	0,00	0,00	5.557.641,01	66.999,75	66.999,75
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.011.114,11	0,00	0,00	0,00	3.048.205,68	37.091,57	37.091,57
					299.799.835,40	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB INSTITUCIONAL FI RF	31.266.258,45	0,00	0,00	0,00	31.522.545,63	256.287,18	256.287,18
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	61.113.916,75	0,00	0,00	0,00	61.786.105,11	672.188,36	672.188,36
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	25.674.170,96	9.260.000,00	-3.724.144,82	0,00	31.480.447,61	270.421,47	270.421,47
					124.789.098,35	0,00	0,00

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a	5.506.223,10	0,00	0,00	0,00	5.577.443,56	71.220,46	71.220,46
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.043.057,58	0,00	0,00	0,00	5.087.095,65	44.038,07	44.038,07
					10.664.539,21	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	7.483,34	0,00	0,00	0,00	7.842,89	359,55	359,55
					7.842,89	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	3.104.620,53	0,00	0,00	0,00	3.140.346,10	35.725,57	35.725,57
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	2.053.412,84	0,00	0,00	0,00	2.052.109,21	-1.303,63	-1.303,63
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	5.372.764,71	0,00	0,00	0,00	5.393.614,74	20.850,03	20.850,03
					10.586.070,05	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	6.849.444,21	0,00	0,00	0,00	7.215.818,37	366.374,16	366.374,16
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.894.454,11	0,00	0,00	0,00	5.122.436,15	227.982,04	227.982,04

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	2.964.099,21	0,00	0,00	0,00	2.936.754,00	-27.345,21	-27.345,21
INDIE FIC FIA	3.206.466,82	0,00	0,00	0,00	3.318.850,75	112.383,93	112.383,93
META VALOR FI DE AÇÕES	2.272.132,34	0,00	0,00	0,00	2.383.465,70	111.333,36	111.333,36
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	25.372.613,84	0,00	0,00	0,00	25.865.396,11	492.782,27	492.782,27
OCCAM FIC FIA	29.196.577,53	0,00	0,00	0,00	30.000.670,68	804.093,15	804.093,15
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	4.095.199,03	0,00	0,00	0,00	4.436.240,47	341.041,44	341.041,44
TARPON GT 30 FIC FIA	6.747.031,77	0,00	0,00	0,00	6.905.555,69	158.523,92	158.523,92
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	6.443.231,79	0,00	0,00	0,00	6.660.254,27	217.022,48	217.022,48
					94.845.442,19	0,00	0,00

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	12.033.623,38	0,00	0,00	0,00	13.474.897,80	1.441.274,42	1.441.274,42
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.549.641,12	0,00	0,00	0,00	1.726.049,02	176.407,90	176.407,90
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.820.677,55	0,00	0,00	0,00	2.889.695,11	69.017,56	69.017,56
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.443.605,37	0,00	0,00	0,00	2.503.543,84	59.938,47	59.938,47
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.145.590,41	0,00	0,00	0,00	2.381.629,55	236.039,14	236.039,14
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	4.957.037,35	0,00	0,00	0,00	5.043.506,55	86.469,20	86.469,20
					28.019.321,87	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	17.037.238,66	0,00	0,00	0,00	17.472.097,17	434.858,51	434.858,51
					17.472.097,17	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	25.103.049,60	0,00	0,00	0,00	26.704.772,14	1.601.722,54	1.601.722,54
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	6.747.341,01	0,00	0,00	0,00	6.876.730,05	129.389,04	129.389,04
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	15.148.102,64	0,00	0,00	0,00	16.131.675,60	983.572,96	983.572,96
					49.713.177,79	0,00	0,00

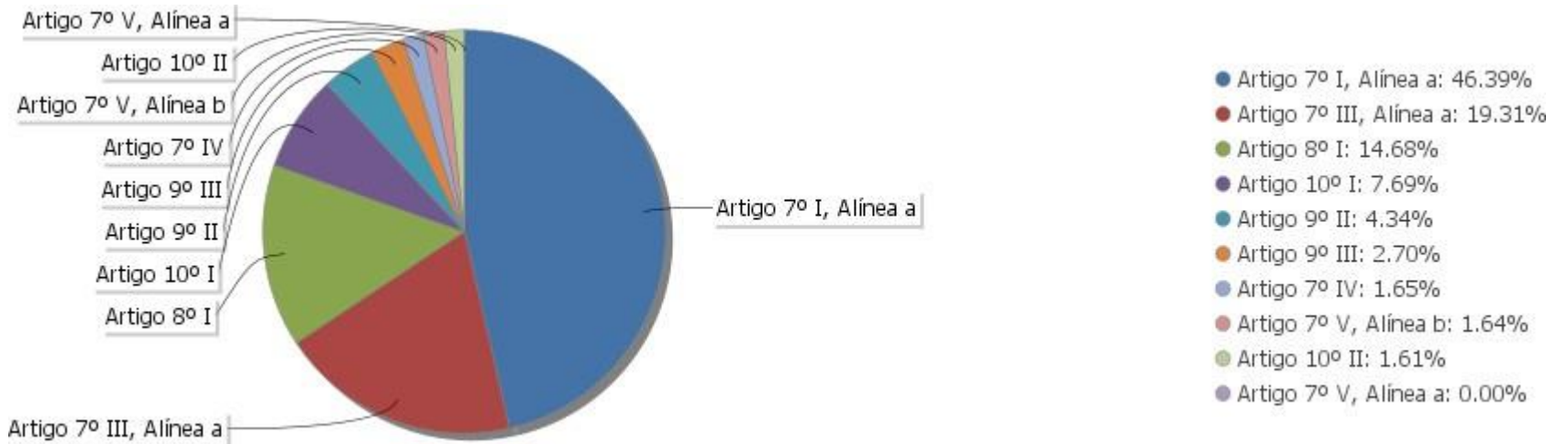
Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	11.072.335,30	0,00	0,00	0,00	10.364.047,41	-708.287,89	-708.287,89
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	15.275,18	0,00	0,00	0,00	15.382,18	107,00	107,00
					10.379.429,59	0,00	0,00

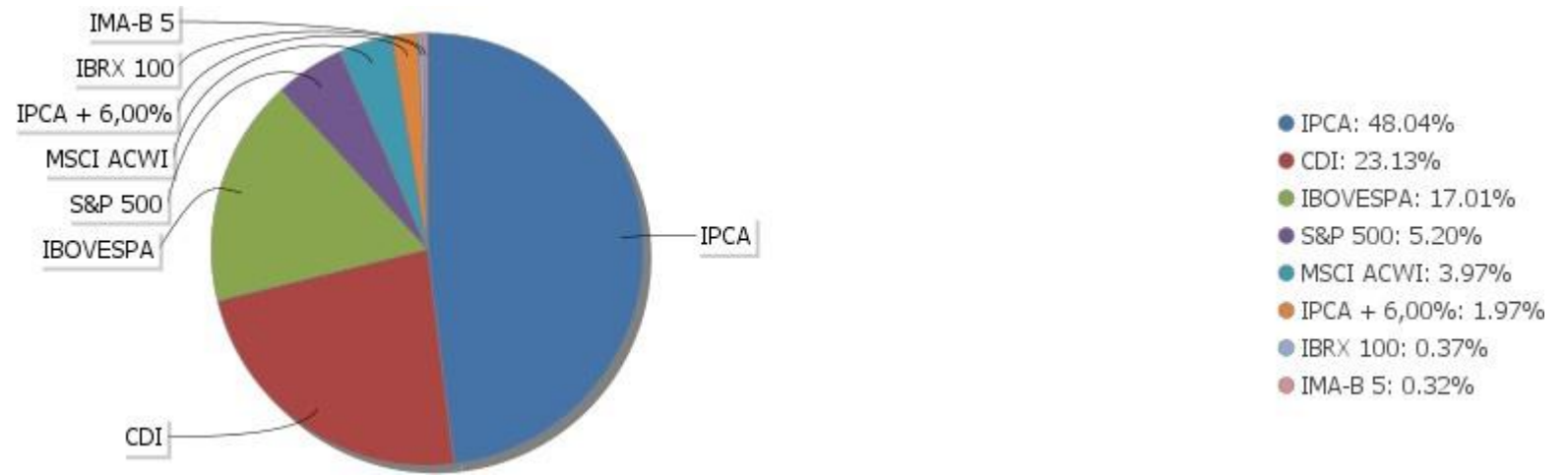
5. Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	270.202.945,05	41,81	270.202.945,05	41,81
de 31 a 365 dias	93.761.028,97	14,51	363.963.974,02	56,32
acima de 365 dias	282.312.880,49	43,68	646.276.854,51	100,00

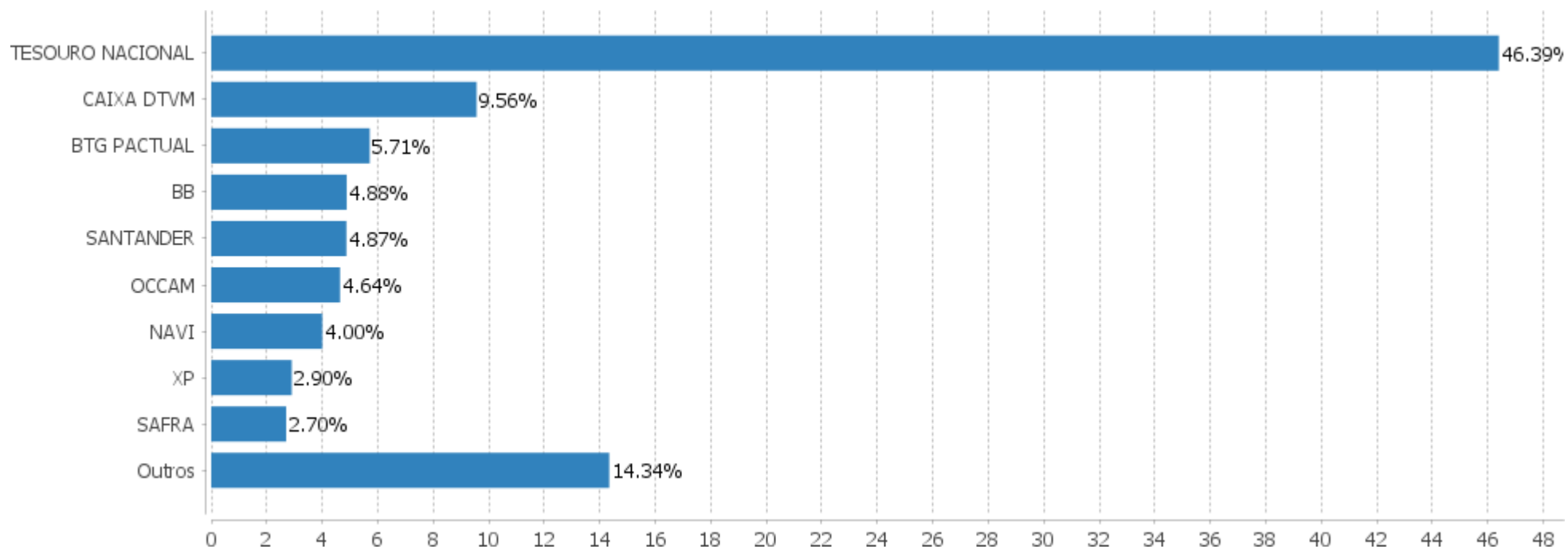
6. Alocação por Artigo



7. Alocação Por Estratégia



8. Alocação por Gestor



9. Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

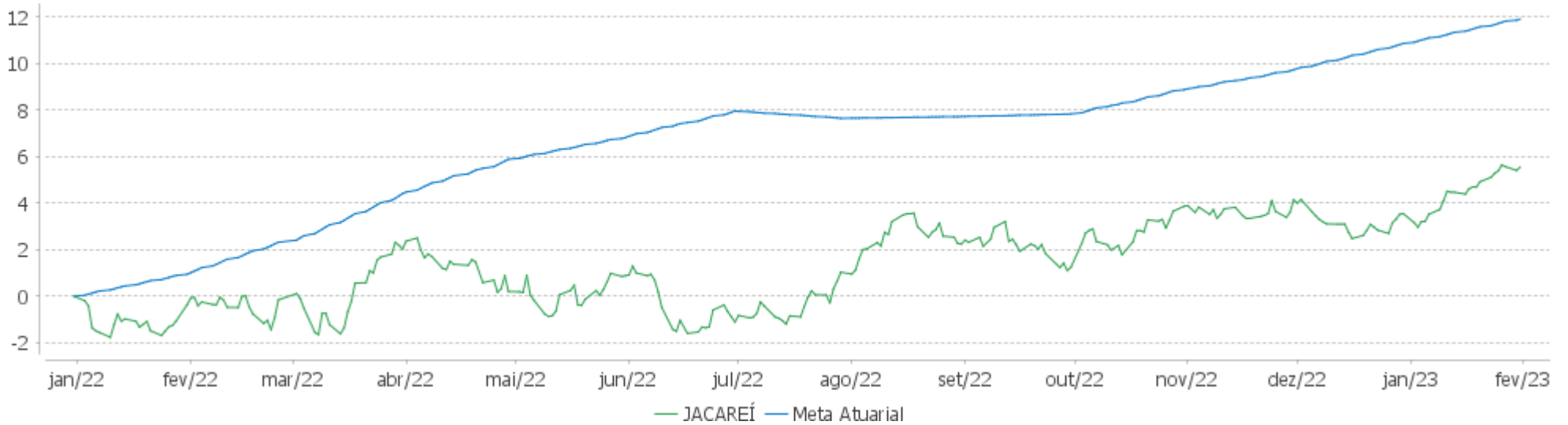
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,93												1,93
IPCA + 5,11%	0,97												0,97
p.p. indexador	0,97												0,97
2022	-0,37	0,22	2,19	-1,79	0,68	-1,97	2,16	1,20	-0,98	2,60	0,26	-0,57	3,55
IPCA + 4,83%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,88	1,07	-0,29	0,07	0,10	0,97	0,79	1,04	10,87
p.p. indexador	-1,31	-1,15	0,15	-3,21	-0,20	-3,04	2,44	1,13	-1,08	1,63	-0,53	-1,61	-7,33

Performance Sobre a Meta Atuarial

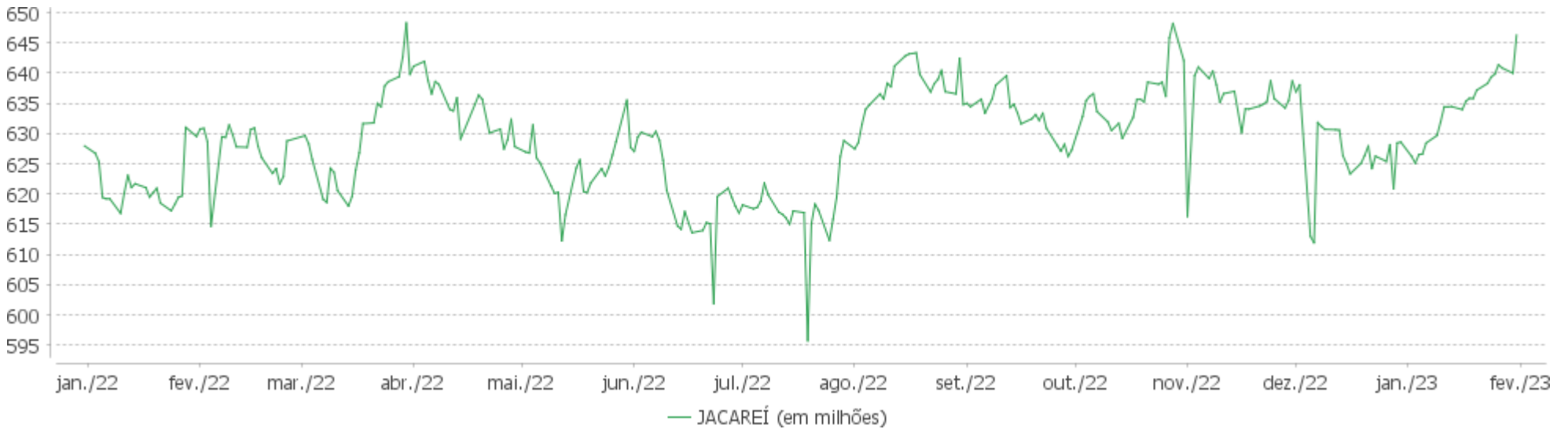
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	5	38,46	03 meses	1,61	2,82	-1,20	3,63
Meses abaixo - Meta Atuarial	8	61,54	06 meses	4,48	3,99	0,49	4,56
			12 meses	5,94	10,91	-4,97	5,42
			24 meses				
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	2,60	2022-10	Desde 31/12/2021	5,55	11,95	-6,40	5,44
Menor rentabilidade da Carteira	-1,97	2022-06					

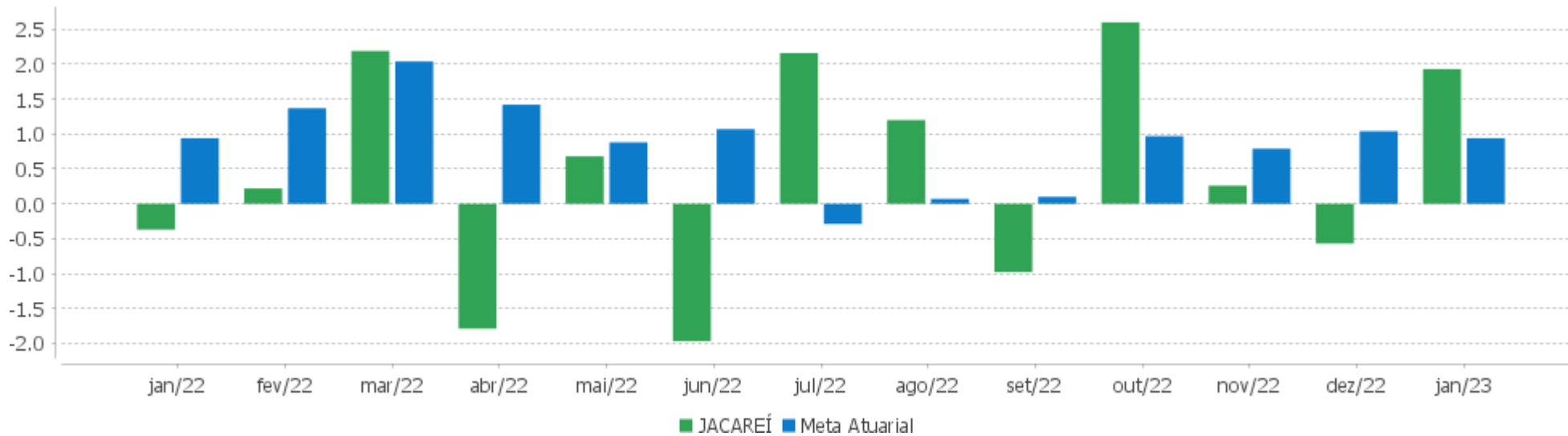
Evolução



Patrimônio Líquido



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



10. Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,87 0,34	0,87 0,34					
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	1,29 0,76	1,29 0,76	3,45 1,88				
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	0,39 34,55	0,39 34,55	2,68 81,01	6,27 93,49	12,75 99,55	20,70 112,19	23,22 108,22
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	-0,06 -1,46	-0,06 -1,46	0,58 -1,43	4,01 -0,40	11,05 -0,14	15,87 -0,41	23,93 -1,13
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	1,15 102,44	1,15 102,44	3,42 103,41	6,95 103,69	13,52 105,53	20,31 110,04	21,98 102,42
NTN-B 150523 (5,930000%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,19 1,62	3,88 2,37	12,08 6,30		
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	1,21 0,68	1,21 0,68	3,24 1,67	0,95 -0,56	5,85 0,07		
NTN-B 150523 (6,560000%) Var. IPCA p.p.	1,25 0,72	1,25 0,72	3,34 1,78	4,19 2,69	12,74 6,97		
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,18 1,61	0,92 -0,58	5,80 0,03		
NTN-B 150523 (5,210000%) Var. IPCA p.p.	1,13 0,60	1,13 0,60	3,01 1,44	3,52 2,01	11,32 5,54		
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	1,16 0,63	1,16 0,63	3,08 1,51	3,65 2,15	11,60 5,83		
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	1,13 0,60	1,13 0,60	2,99 1,42	3,47 1,97	11,23 5,45		
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,17 1,60	3,84 2,34	12,00 6,23		
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,19 1,62	3,89 2,38	12,10 6,33		
NTN-B 150545 (5,915000%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,18 1,62	3,87 2,36	12,06 6,29		
NTN-B 150850 (5,831200%) Var. IPCA p.p.	1,18 0,65	1,18 0,65	3,16 1,60	3,83 2,32	11,97 6,20		
NTN-B 150826 (5,190000%)	1,13	1,13	3,00	3,51	11,30		

Fundo Variação da Estratégia	1ª Mês	2ª Mês	3ª Mês	4ª Mês	5ª Mês	6ª Mês
Var. IPCA p.p.	0,60	0,60	1,44	2,00	5,52	
NTN-B 150840 (5,837000%)	1,18	1,18	3,17	3,83	11,98	
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,60	2,33	6,21	
NTN-B 150830 (5,270000%)	1,14	1,14	3,02	3,55	11,38	
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,46	2,04	5,61	
NTN-B 150545 (4,970000%)	1,11	1,11	2,95	3,40	11,06	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,38	1,89	5,29	
NTN-B 150840 (4,950000%)	1,11	1,11	2,94	3,39	11,04	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,38	1,88	5,27	
NTN-B 150850 (4,980000%)	1,11	1,11	2,95	3,40	11,07	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,38	1,90	5,30	
NTN-B 150555 (5,927000%)	1,19	1,19	3,19	3,87	12,08	
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,62	2,37	6,30	
NTN-B 150850 (5,360000%)	1,15	1,15	3,05	3,59	11,48	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,48	2,09	5,70	
NTN-B 150545 (5,922000%)	1,19	1,19	3,19	3,87	12,07	
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,62	2,37	6,30	
NTN-B 150840 (5,020000%)	1,12	1,12	2,96	3,42	11,12	
Var. IPCA p.p.	0,59	0,59	1,39	1,92	5,34	
NTN-B 150535 (4,910000%)	1,11	1,11	2,93	3,37	11,00	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,37	1,86	5,22	
NTN-B 150555 (5,370000%)	1,15	1,15	3,05	3,60	11,49	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,48	2,09	5,71	
NTN-B 150850 (4,940000%)	1,11	1,11	2,94	3,38	11,03	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,37	1,88	5,26	
NTN-B 150826 (5,490000%)	1,16	1,16	3,08	3,66	11,61	
Var. IPCA p.p.	0,63	0,63	1,51	2,15	5,84	
NTN-B 150840 (4,970000%)	1,11	1,11	2,95	3,40	11,06	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,38	1,89	5,29	
NTN-B 150850 (6,261000%)	1,22	1,22	3,27	4,04	12,43	
Var. IPCA p.p.	0,69	0,69	1,70	2,54	6,65	
NTN-B 150555 (5,000000%)	1,11	1,11	2,96	3,41	11,09	
Var. IPCA p.p.	0,59	0,59	1,39	1,91	5,32	
NTN-B 150535 (5,320000%)	1,14	1,14	3,04	3,57	11,43	
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,47	2,07	5,66	
NTN-B 150850 (5,010000%)	1,12	1,12	2,96	3,42	11,10	

Fundo Variação da Estratégia	1ª Mês	2ª Mês	3ª Mês	4ª Mês	5ª Mês	6ª Mês	7ª Mês	8ª Mês	9ª Mês	10ª Mês	11ª Mês	12ª Mês
Var. IPCA p.p.	0,59	0,59	1,39	1,91	5,33							
NTN-B 150545 (6,256000%)	1,22	1,22	3,27	4,04	12,42							
Var. IPCA p.p.	0,69	0,69	1,70	2,53	6,65							
NTN-B 150555 (6,261000%)	1,22	1,22	3,27	4,04	12,43							
Var. IPCA p.p.	0,69	0,69	1,70	2,54	6,65							
NTN-B 150523 (5,300000%)	1,14	1,14	3,03	3,56	11,41							
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,46	2,06	5,64							
NTN-B 150555 (5,520000%)	1,16	1,16	3,09	3,67	11,64							
Var. IPCA p.p.	0,63	0,63	1,52	2,17	5,87							
NTN-B 150555 (5,860000%)	1,19	1,19	3,17	3,84	12,00							
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,60	2,34	6,23							
NTN-B 150545 (5,380000%)	1,15	1,15	3,05	3,60	11,50							
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,48	2,10	5,72							
NTN-B 150826 (5,009000%)	1,12	1,12	2,96	3,42	11,10							
Var. IPCA p.p.	0,59	0,59	1,39	1,91	5,33							
NTN-B 150545 (6,400000%)	1,23	1,23	0,21	0,99	5,92							
Var. IPCA p.p.	0,70	0,70	-1,36	-0,52	0,15							
NTN-B 150535 (5,855000%)	1,19	1,19	3,17	3,84	12,00							
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,60	2,33	6,22							
NTN-B 150555 (5,831200%)	1,18	1,18	3,16	3,83	11,97							
Var. IPCA p.p.	0,65	0,65	1,60	2,32	6,20							
NTN-B 150828 (4,850000%)	1,10	1,10	2,92	3,34	10,94							
Var. IPCA p.p.	0,57	0,57	1,35	1,83	5,16							
NTN-B 150555 (6,400000%)	1,23	1,23	0,18	0,97	5,88							
Var. IPCA p.p.	0,70	0,70	-1,38	-0,54	0,10							
NTN-B 150545 (5,831000%)	1,18	1,18	3,16	3,83	11,97							
Var. IPCA p.p.	0,65	0,65	1,60	2,32	6,20							
NTN-B 150828 (5,240000%)	1,14	1,14	3,02	3,53	11,35							
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,45	2,03	5,57							
NTN-B 150545 (5,340000%)	1,14	1,14	3,04	3,58	11,45							
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,47	2,08	5,68							
NTN-B 150523 (5,850000%)	1,19	1,19	3,17	3,84	11,99							
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,60	2,33	6,22							
NTN-B 150850 (5,921000%)	1,19	1,19	3,19	3,87	12,07							
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,62	2,37	6,29							
NTN-B 150523 (5,420000%)	1,15	1,15	3,06	3,62	11,54							

Fundo Variação da Estratégia	1ª Mês	2ª Mês	3ª Mês	4ª Mês	5ª Mês	6ª Mês
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,49	2,12	5,76	
NTN-B 150535 (4,860000%)	1,10	1,10	2,92	3,34	10,95	
Var. IPCA p.p.	0,57	0,57	1,35	1,84	5,17	
NTN-B 150826 (5,710000%)	1,17	1,17	3,13	3,77	11,85	
Var. IPCA p.p.	0,64	0,64	1,57	2,26	6,07	
NTN-B 150555 (6,140000%)	1,21	1,21	3,24	3,98	9,02	
Var. IPCA p.p.	0,68	0,68	1,67	2,48	3,25	
NTN-B 150828 (5,270000%)	1,14	1,14	3,02	3,55	11,38	
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,46	2,04	5,61	
NTN-B 150535 (5,290000%)	1,14	1,14	3,03	3,56	11,40	
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,46	2,05	5,63	
NTN-B 150830 (5,835000%)	1,18	1,18	3,16	3,83	11,98	
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,60	2,32	6,20	
NTN-B 150555 (5,315000%)	1,14	1,14	3,04	3,57	11,43	
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,47	2,06	5,65	
NTN-B 150535 (5,837000%)	1,18	1,18	3,16	3,83	11,98	
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,60	2,33	6,21	
NTN-B 150830 (5,300000%)	1,14	1,14	3,03	3,56	11,41	
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,46	2,06	5,64	
NTN-B 150830 (5,500000%)	1,16	1,16	3,08	3,66	11,62	
Var. IPCA p.p.	0,63	0,63	1,51	2,16	5,85	
NTN-B 150545 (5,285000%)	1,14	1,14	3,03	3,55	11,40	
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,46	2,05	5,62	
NTN-B 150523 (5,580000%)	1,16	1,16	3,10	3,70	11,71	
Var. IPCA p.p.	0,63	0,63	1,53	2,20	5,93	
NTN-B 150824 (5,450000%)	1,15	1,15	3,07	3,64	11,57	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,50	2,13	5,80	
NTN-B 150830 (5,178300%)	1,13	1,13	3,00	3,50	11,28	
Var. IPCA p.p.	0,60	0,60	1,43	2,00	5,51	
NTN-B 150545 (5,030000%)	1,12	1,12	2,96	3,43	11,13	
Var. IPCA p.p.	0,59	0,59	1,40	1,92	5,35	
NTN-B 150545 (5,897000%)	1,19	1,19	3,18	3,86	8,87	
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,61	2,36	3,10	
NTN-B 150850 (6,400000%)	1,23	1,23	3,30	0,97	5,89	
Var. IPCA p.p.	0,70	0,70	1,74	-0,53	0,12	
NTN-B 150824 (5,912000%)	1,19	1,19	3,18	3,87	12,06	

Fundo Variação da Estratégia	1ª Mês	2ª Mês	3ª Mês	4ª Mês	5ª Mês	6ª Mês	7ª Mês	8ª Mês	9ª Mês	10ª Mês	11ª Mês	12ª Mês
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,62	2,36	6,28							
NTN-B 150850 (5,045000%)	1,12	1,12	2,97	3,43	11,14							
Var. IPCA p.p.	0,59	0,59	1,40	1,93	5,37							
NTN-B 150555 (5,030000%)	1,12	1,12	2,96	3,43	11,13							
Var. IPCA p.p.	0,59	0,59	1,40	1,92	5,35							
NTN-B 150840 (5,274000%)	1,14	1,14	3,03	3,55	11,38							
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,46	2,04	5,61							
NTN-B 150826 (5,130000%)	1,13	1,13	2,99	3,48	11,23							
Var. IPCA p.p.	0,60	0,60	1,42	1,97	5,46							
NTN-B 150840 (5,360000%)	1,15	1,15	3,05	3,59	11,48							
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,48	2,09	5,70							
NTN-B 150850 (5,410000%)	1,15	1,15	3,06	3,62	11,53							
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,49	2,11	5,75							
NTN-B 150840 (5,855000%)	1,19	1,19	3,17	3,84	12,00							
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,60	2,33	6,22							
NTN-B 150545 (4,980000%)	1,11	1,11	2,95	3,40	11,07							
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,38	1,90	5,30							
NTN-B 150830 (4,860000%)	1,10	1,10	2,92	3,34	10,95							
Var. IPCA p.p.	0,57	0,57	1,35	1,84	5,17							
NTN-B 150840 (5,310000%)	1,14	1,14	3,03	3,57	11,42							
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,47	2,06	5,65							
NTN-B 150824 (5,345000%)	1,14	1,14	3,04	3,58	11,46							
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,48	2,08	5,69							
NTN-B 150545 (6,140000%)	1,21	1,21	3,24	3,98	9,03							
Var. IPCA p.p.	0,68	0,68	1,67	2,48	3,26							
NTN-B 150830 (4,900000%)	1,11	1,11	2,93	3,36	10,99							
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,36	1,86	5,21							
NTN-B 150850 (5,295500%)	1,14	1,14	3,03	3,56	11,41							
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,46	2,06	5,63							
NTN-B 150535 (4,880000%)	1,10	1,10	2,93	3,35	10,97							
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,36	1,85	5,19							
NTN-B 150555 (5,420000%)	1,15	1,15	3,06	3,62	11,54							
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,49	2,12	5,76							
NTN-B 150850 (5,510000%)	1,16	1,16	3,08	3,67	11,63							
Var. IPCA p.p.	0,63	0,63	1,52	2,16	5,86							
NTN-B 150555 (5,897000%)	1,19	1,19	3,18	3,86	8,88							

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,61	2,36	3,10		
NTN-B 150840 (6,220000%) Var. IPCA p.p.	1,22 0,69	1,22 0,69	3,26 1,69	4,02 2,52	12,39 6,61		
NTN-B 150523 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,17 1,60	3,84 2,34	12,00 6,23		
NTN-B 150555 (5,060000%) Var. IPCA p.p.	1,12 0,59	1,12 0,59	2,97 1,40	3,44 1,94	11,16 5,38		
NTN-B 150555 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,19 1,62	3,89 2,38	12,10 6,33		
NTN-B 150828 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	1,18 0,65	1,18 0,65	3,16 1,59	3,82 2,31	11,95 6,18		
NTN-B 150525 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	1,18 0,65	1,18 0,65	3,16 1,59	3,82 2,31	11,95 6,18		
NTN-B 150535 (5,196100%) Var. IPCA p.p.	1,13 0,60	1,13 0,60	3,01 1,44	3,51 2,01	11,30 5,53		
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III % do CDI	4,80 427,74	4,80 427,74	3,17 96,00	21,09 314,44	-74,98 -585,39	595,35 3.226,34	17.204,95 80.188,51
BB INSTITUCIONAL FI RF % do CDI	0,82 72,97	0,82 72,97	3,01 91,24	6,54 97,51	12,78 99,75	18,94 102,64	21,62 100,78
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,10 97,91	1,10 97,91	3,28 99,25	6,76 100,84	13,04 101,79	18,94 102,66	21,83 101,76
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,05 93,43	1,05 93,43	3,27 98,98	6,80 101,32	13,16 102,70	19,54 105,91	21,82 101,69
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,66 1,29	4,66 1,29	-6,75 -4,50	5,94 -4,01	-4,99 -6,14	-31,52 -30,10	-28,05 -27,76
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,35 -1,02	2,35 -1,02	-12,51 -10,26	11,07 1,12	15,94 14,79	41,78 43,21	66,97 67,26
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,37 0,00	3,37 0,00	-0,28 1,97	12,21 2,26	12,43 11,28	52,08 53,50	
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,94 -1,43	1,94 -1,43	-6,92 -4,68	8,01 -1,94	1,86 0,71	8,00 9,43	9,42 9,71
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,92 -4,29	-0,92 -4,29	-12,38 -10,13	5,94 -4,02	-2,18 -3,32	16,23 17,66	
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,33 4,96	8,33 4,96	-9,29 -7,05	9,21 -0,75	-12,74 -13,89	-13,29 -11,87	-14,98 -14,69

INDIE FIC FIA

3,50

3,50

-9,66

6,85

-17,85

-34,54

-31,20

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,14	0,14	-7,42	-3,10	-19,00	-33,11	-30,91
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,75 -0,61	2,75 -0,61	-5,24 -2,99	8,21 -1,74	0,82 -0,32	-3,26 -1,84	0,13 0,42
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	5,35 1,98	5,35 1,98	-8,96 -6,72	3,89 -6,06	-12,30 -13,45	-19,42 -18,00	-24,90 -24,61
META VALOR FI DE AÇÕES Var. IBRX 100 p.p.	4,90 1,39	4,90 1,39	-6,65 -4,31	11,74 2,35	-6,11 -6,86	-16,49 -15,11	-20,24 -20,49
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	2,55 -0,82	2,55 -0,82	4,16 6,41	-5,12 -15,07	-19,13 -20,28	-7,86 -6,43	29,10 29,39
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	2,45 -2,22	2,45 -2,22	14,68 7,42	0,60 0,67	-11,75 2,22	-32,72 -26,63	
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,74 -2,93	1,74 -2,93	10,26 3,01	1,09 1,16	-10,98 2,99	-4,37 1,72	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	11,98 7,31	11,98 7,31	10,07 2,81	-2,78 -2,71	-20,91 -6,93	-17,38 -11,29	15,14 -23,48
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	11,38 6,71	11,38 6,71	-1,91 -9,17	-7,50 -7,42	-42,19 -28,21	-58,97 -52,88	
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	2,45 -2,22	2,45 -2,22	10,97 3,72	-11,73 -11,65	-27,97 -13,99	-39,93 -33,84	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	11,00 9,96	11,00 9,96	14,94 11,85	2,75 -1,80	-26,03 -38,15	-37,52 -68,71	14,56 -30,73
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	1,92 -1,85	1,92 -1,85					
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	6,49 578,02	6,49 578,02	7,43 225,01	3,30 49,22	-1,13 -8,82	24,33 131,84	38,73 180,52
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	6,38 2,61	6,38 2,61	7,48 5,35	7,64 10,64	3,25 17,32	31,03 28,82	
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	-6,40 -7,44	-6,40 -7,44	-8,26 -11,34	-7,51 -12,06	12,60 0,48	44,41 13,23	59,51 14,22
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	0,70 62,36	0,70 62,36	1,16 35,01	3,74 55,81	-43,43 -339,04	94,27 510,89	-99,28 -462,74
JACAREÍ Var. IPCA + 4,83% p.p.	1,93 0,97	1,93 0,97	1,61 -1,25	4,48 0,37	5,94 -5,24		
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29

11. Cotação e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BB INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+1 du	D+0	D+5 du	D+7 du	Cobrança semestral, no último dia útil de dezembro e junho ou no resgate total ou parcial das cotas, o que ocorrer primeiro	2,00
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	D+0	D+0	D+0	D+0		0,35
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2 du		
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	Não se aplica	Não se aplica				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+2		
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	D+0	D+0	D+5 du	D+6 du		0,40
INDIE FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBX_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro e Julho	1,34
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+1 du	D+1 du	D+6 du		
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Não se aplica	Não se aplica				
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
META VALOR FI DE AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,50
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	-	1,50
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	-	3,00
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO			D+0	D+0		0,40
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	Não se aplica	Não se aplica				
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3		
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA			D+30	D+32	-	2,00
TARPON GT 30 FIC FIA	D+1 du	D+1 du	D+30	D+32	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro	
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1	D+1	D+30	D+32	-	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00

12. Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,10	1,10	3,25	6,75	12,54	16,51	20,51	28,48	37,42
IRF-M 1+	0,72	0,72	0,90	6,13	8,73	4,24	10,25	25,21	40,80
IRF-M TOTAL	0,84	0,84	1,65	6,17	9,82	8,42	13,75	26,79	40,53
IMA-B 5	1,40	1,40	2,01	4,40	11,19	16,27	25,06	40,14	54,28
IMA-B 5+	-1,26	-1,26	-3,59	1,84	3,66	-3,05	0,52	22,96	44,15
IMA-B TOTAL	-0,00	-0,00	-0,99	2,84	7,15	5,93	11,46	31,65	50,23
IMA-GERAL TOTAL	0,70	0,70	1,42	5,19	10,20	11,76	16,79	30,01	43,27
IDKA 2	1,44	1,44	1,90	3,99	10,86	16,26	25,79	39,66	54,03
IDKA 20	-4,58	-4,58	-9,69	-0,34	-3,60	-17,66	-17,08	6,23	30,85
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,69

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29	16,47	33,58
IBRX 100	3,51	3,51	-2,34	9,39	0,75	-1,38	0,24	19,26	37,61
IBRX 50	3,38	3,38	-1,47	10,88	1,52	0,57	3,26	18,48	34,15
SMALL CAP	2,92	2,92	-11,39	3,51	-15,47	-24,13	-27,55	5,24	19,33
Índice Consumo - ICON			-16,42	-6,37	-24,84	-42,47	-44,77	-20,86	-20,70
Índice Dividendos - IDIV	5,89	5,89	5,00	11,84	10,99	17,61	12,30	42,62	69,29

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,77	3,77	2,13	-2,99	-14,07	2,21	50,95	110,51	132,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,60	-1,60	-5,69	0,25	1,59	-2,03	-8,32	17,07	23,45

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,67	4,67	7,25	-0,08	-13,97	-6,09	38,62	84,31	93,01

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	0,53	1,57	1,50	5,77	16,75	22,08	27,19	32,00
INPC	0,46	0,46	1,54	1,37	5,71	16,92	23,38	28,69	33,29
IGPM	0,21	0,21	0,09	-2,50	3,79	21,34	52,54	64,45	75,53
SELIC	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,70

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	0,87	2,58	3,55	10,01	26,28	37,25	48,75	60,49
IPCA + 5,00%	0,96	0,96	2,83	4,05	11,06	28,72	41,24	54,54	68,33
IPCA + 5,50%	1,00	1,00	2,96	4,30	11,59	29,95	43,26	57,50	72,37
IPCA + 5,89%	1,03	1,03	3,06	4,50	12,00	30,91	44,84	59,84	75,57
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29	60,50	76,48
INPC + 4,00%	0,80	0,80	2,55	3,41	9,94	26,46	38,73	50,51	62,06
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85	62,40	78,20

13. Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	12/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	277.000,00	0,00	1.244,65622688	222,5514114000
2	12/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	31.000,00	139,29365716	222,5514114000
3	13/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	13,47747414	222,5936380000
4	20/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	12.000,00	53,80652393	223,0212830000
5	20/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,48387699	223,0212830000
6	25/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	54.000,00	241,76375210	223,3585454000
7	25/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	113.000,00	505,91303681	223,3585454000
8	26/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,94964847	223,4724644000
9	27/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	72.000,00	322,02219563	223,5870725000
10	30/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	103.000,00	0,00	460,44818427	223,6950943000
11	30/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	31.000,00	138,58149235	223,6950943000
12	31/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	8.514.000,00	0,00	38.038,04977214	223,8285099000
13	31/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.188.343,55	14.244,58194099	223,8285099000
14	31/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	112.856,10	504,20788688	223,8285099000
15	31/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	103.945,17	464,39647052	223,8285099000
16	31/01/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	366.000,00	0,00	1.635,18043418	223,8285099000
Total			9.260.000,00	3.724.144,82		

14. Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 12.429.305,10 Value-At-Risk: 1,92%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
JACAREÍ		1,92	1,92			646.276.854,51	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,09%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,210000%)		0,14	0,00	0,17			2.122.939,35	0,33
NTN-B 150523 (5,300000%)		0,14	0,00	0,17			2.159.178,43	0,33
NTN-B 150523 (5,420000%)		0,14	0,00	0,17			10.714.994,13	1,66
NTN-B 150523 (5,580000%)		0,14	0,00	0,17			3.213.980,39	0,50
NTN-B 150523 (5,850000%)		0,14	-0,00	0,17			2.143.873,18	0,33
NTN-B 150523 (5,860000%)		0,14	-0,00	0,17			10.723.156,05	1,66
NTN-B 150523 (5,930000%)		0,14	0,00	0,17			5.309.673,05	0,82
NTN-B 150523 (6,560000%)		0,14	-0,00	0,17			2.127.746,95	0,33
NTN-B 150525 (5,480000%)		0,14	0,00	0,16			2.128.943,44	0,33
NTN-B 150525 (5,810000%)		0,14	0,00	0,16			1.038.999,47	0,16
NTN-B 150535 (4,860000%)		0,14	0,00	0,17			2.159.374,42	0,33
NTN-B 150535 (4,880000%)		0,14	0,00	0,17			2.155.692,00	0,33
NTN-B 150535 (4,910000%)		0,14	0,00	0,17			2.154.652,15	0,33
NTN-B 150535 (5,196100%)		0,14	0,00	0,17			2.142.197,39	0,33
NTN-B 150535 (5,290000%)		0,14	0,00	0,17			2.142.585,95	0,33
NTN-B 150535 (5,320000%)		0,14	0,00	0,17			2.141.489,76	0,33
NTN-B 150535 (5,837000%)		0,14	0,00	0,17			1.997.069,01	0,31
NTN-B 150535 (5,855000%)		0,14	0,00	0,17			3.125.306,57	0,48
NTN-B 150545 (4,970000%)		0,14	0,00	0,17			2.168.665,02	0,34
NTN-B 150545 (4,980000%)		0,14	0,00	0,17			2.165.962,68	0,34

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (5,030000%)		0,14	0,00	0,17			2.161.703,74	0,33
NTN-B 150545 (5,285000%)		0,14	0,00	0,17			2.148.099,11	0,33
NTN-B 150545 (5,340000%)		0,14	0,00	0,17			2.146.943,52	0,33
NTN-B 150545 (5,380000%)		0,14	0,00	0,17			2.145.280,97	0,33
NTN-B 150545 (5,831000%)		0,14	0,00	0,17			5.042.358,70	0,78
NTN-B 150545 (5,860000%)		0,14	0,00	0,17			2.083.042,54	0,32
NTN-B 150545 (5,897000%)		0,14	0,00	0,16			2.003.696,44	0,31
NTN-B 150545 (5,915000%)		0,14	0,00	0,17			6.121.976,68	0,95
NTN-B 150545 (5,922000%)		0,14	0,00	0,17			1.997.777,80	0,31
NTN-B 150545 (6,140000%)		0,14	0,00	0,16			4.488.743,90	0,69
NTN-B 150545 (6,256000%)		0,14	0,00	0,17			3.537.302,59	0,55
NTN-B 150545 (6,400000%)		0,21	0,00	0,25			2.029.719,03	0,31
NTN-B 150555 (5,000000%)		0,14	0,00	0,17			2.172.256,14	0,34
NTN-B 150555 (5,030000%)		0,14	0,00	0,17			2.167.243,42	0,34
NTN-B 150555 (5,060000%)		0,14	0,00	0,17			2.162.253,75	0,33
NTN-B 150555 (5,315000%)		0,14	0,00	0,17			2.150.113,60	0,33
NTN-B 150555 (5,370000%)		0,14	0,00	0,17			2.150.861,29	0,33
NTN-B 150555 (5,420000%)		0,14	0,00	0,17			2.148.662,99	0,33
NTN-B 150555 (5,520000%)		0,14	0,00	0,17			2.139.855,91	0,33
NTN-B 150555 (5,831200%)		0,14	0,00	0,17			11.100.428,89	1,72
NTN-B 150555 (5,860000%)		0,14	0,00	0,17			2.081.333,79	0,32
NTN-B 150555 (5,897000%)		0,14	0,00	0,16			4.998.617,79	0,77
NTN-B 150555 (5,927000%)		0,14	0,00	0,17			2.000.240,81	0,31
NTN-B 150555 (5,950000%)		0,14	0,00	0,17			16.321.209,85	2,53
NTN-B 150555 (6,140000%)		0,14	0,00	0,16			8.972.760,08	1,39
NTN-B 150555 (6,261000%)		0,14	0,00	0,17			8.078.696,62	1,25
NTN-B 150555 (6,400000%)		0,21	0,00	0,25			5.079.224,41	0,79
NTN-B 150824 (5,345000%)		0,18	0,00	0,20			2.160.112,93	0,33
NTN-B 150824 (5,450000%)		0,14	0,00	0,17			2.190.318,19	0,34
NTN-B 150824 (5,912000%)		0,14	0,00	0,17			2.143.431,66	0,33

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,009000%)		0,14	0,00	0,17			2.192.022,34	0,34
NTN-B 150826 (5,130000%)		0,14	0,00	0,17			2.192.542,08	0,34
NTN-B 150826 (5,190000%)		0,14	0,00	0,17			2.192.827,71	0,34
NTN-B 150826 (5,490000%)		0,14	0,00	0,17			2.194.173,98	0,34
NTN-B 150826 (5,710000%)		0,14	0,00	0,17			3.209.260,35	0,50
NTN-B 150828 (4,850000%)		0,14	0,00	0,17			2.205.721,30	0,34
NTN-B 150828 (5,125600%)		0,14	0,00	0,17			2.195.944,28	0,34
NTN-B 150828 (5,240000%)		0,14	0,00	0,17			2.197.620,16	0,34
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,14	0,00	0,17			2.194.689,54	0,34
NTN-B 150828 (5,810000%)		0,14	0,00	0,17			3.214.268,35	0,50
NTN-B 150830 (4,860000%)		0,14	0,00	0,17			2.212.238,25	0,34
NTN-B 150830 (4,900000%)		0,14	0,00	0,17			2.207.129,58	0,34
NTN-B 150830 (5,178300%)		0,14	0,00	0,17			2.198.025,64	0,34
NTN-B 150830 (5,270000%)		0,14	0,00	0,17			2.199.416,84	0,34
NTN-B 150830 (5,300000%)		0,14	0,00	0,17			2.199.940,61	0,34
NTN-B 150830 (5,500000%)		0,14	0,00	0,17			2.196.177,03	0,34
NTN-B 150830 (5,835000%)		0,14	0,00	0,17			3.215.288,42	0,50
NTN-B 150840 (4,950000%)		0,14	0,00	0,17			2.221.662,21	0,34
NTN-B 150840 (4,970000%)		0,14	0,00	0,17			2.212.309,02	0,34
NTN-B 150840 (5,020000%)		0,14	0,00	0,17			2.214.289,24	0,34
NTN-B 150840 (5,274000%)		0,14	0,00	0,17			2.204.542,79	0,34
NTN-B 150840 (5,310000%)		0,14	0,00	0,17			2.205.089,78	0,34
NTN-B 150840 (5,360000%)		0,14	0,00	0,17			2.202.371,36	0,34
NTN-B 150840 (5,837000%)		0,18	0,00	0,20			2.057.957,27	0,32
NTN-B 150840 (5,855000%)		0,14	0,00	0,17			3.213.548,62	0,50
NTN-B 150840 (6,220000%)		0,14	0,00	0,17			3.031.419,04	0,47
NTN-B 150850 (4,940000%)		0,14	0,00	0,17			2.230.702,76	0,35
NTN-B 150850 (4,980000%)		0,14	0,00	0,17			2.227.934,88	0,34
NTN-B 150850 (5,010000%)		0,14	0,00	0,17			2.223.497,65	0,34
NTN-B 150850 (5,045000%)		0,14	0,00	0,17			2.217.562,00	0,34

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,295500%)		0,14	0,00	0,17			2.207.098,04	0,34
NTN-B 150850 (5,360000%)		0,14	0,00	0,17			2.206.110,84	0,34
NTN-B 150850 (5,410000%)		0,14	0,00	0,17			2.204.855,50	0,34
NTN-B 150850 (5,510000%)		0,14	0,00	0,17			2.197.851,95	0,34
NTN-B 150850 (5,831200%)		0,14	0,00	0,17			8.303.041,20	1,28
NTN-B 150850 (5,897000%)		0,14	0,00	0,16			3.084.211,21	0,48
NTN-B 150850 (5,921000%)		0,14	0,00	0,17			2.058.180,98	0,32
NTN-B 150850 (5,950000%)		0,14	0,00	0,17			11.219.658,67	1,74
NTN-B 150850 (6,140000%)		0,14	0,00	0,16			6.672.060,71	1,03
NTN-B 150850 (6,261000%)		0,14	0,00	0,17			5.557.641,01	0,86
NTN-B 150850 (6,400000%)		0,14	0,00	0,16			3.048.205,68	0,47
Sub-total	0,51	0,13	0,00		0,09	1,17	299.799.835,40	46,39

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,02	-0,00	0,02			61.786.105,11	9,56
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,04	-0,00	0,04			31.480.447,61	4,87
BB INSTITUCIONAL FI RF		0,05	0,00	0,05			31.522.545,63	4,88
Sub-total	0,17	0,02	-0,00		-0,65	1,01	124.789.098,35	19,31

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a		0,19	0,00	0,23			5.087.095,65	0,79
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a		1,22	0,00	1,22			5.577.443,56	0,86
Sub-total	0,52	0,65	0,00		-0,06	1,09	10.664.539,21	1,65

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III		0,60	-0,00	0,60			7.842,89	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	15,88	0,60	-0,00		0,23	4,80	7.842,89	0,00

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV		0,01	0,00	0,01			3.140.346,10	0,49
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV		1,57	0,00	0,71			2.052.109,21	0,32
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,08	-0,00	0,08			5.393.614,74	0,83
Sub-total	1,00	0,31	0,00		-0,60	0,52	10.586.070,05	1,64

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,13%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA		15,50	0,08	8,43			4.436.240,47	0,69
META VALOR FI DE AÇÕES		14,56	0,04	5,45			2.383.465,70	0,37
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		16,35	0,12	8,25			7.215.818,37	1,12
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,98	0,06	5,28			5.122.436,15	0,79
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		11,09	0,32	4,33			25.865.396,11	4,00
OCCAM FIC FIA		10,76	0,36	2,44			30.000.670,68	4,64
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		12,70	0,04	5,84			2.936.754,00	0,45
INDIE FIC FIA		14,05	0,05	5,87			3.318.850,75	0,51
TARPON GT 30 FIC FIA		11,64	0,08	7,11			6.905.555,69	1,07
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA		9,37	0,05	7,61			6.660.254,27	1,03
Sub-total	18,79	11,13	1,20		0,10	3,05	94.845.442,19	14,68

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,42%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI		5,03	0,01	14,86			6.876.730,05	1,06

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MULTIMERCADO								
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		10,77	0,20	10,77			16.131.675,60	2,50
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		10,60	0,31	8,38			26.704.772,14	4,13
Sub-total	13,63	8,98	0,52		0,34	5,78	49.713.177,79	7,69

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME		0,40	-0,00	0,43			10.364.047,41	1,60
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		0,09	0,00	0,09			15.382,18	0,00
Sub-total	22,34	0,40	-0,00		-0,34	-6,39	10.379.429,59	1,61

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,35%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		12,71	0,16	9,37			13.474.897,80	2,09
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		24,33	0,01	20,81			1.726.049,02	0,27
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		11,49	-0,02	13,09			2.889.695,11	0,45
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		14,96	-0,01	14,57			2.503.543,84	0,39
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		19,50	-0,00	19,49			2.381.629,55	0,37
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		11,40	-0,02	11,21			5.043.506,55	0,78
Sub-total	17,56	10,42	0,12		0,39	7,97	28.019.321,87	4,34

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		11,87	0,08	19,06			17.472.097,17	2,70
Sub-total	17,16	11,87	0,08		0,08	2,55	17.472.097,17	2,70

15. ANEXO

1. Relatório de Cenário Macroeconômico

No mês de janeiro, os mercados globais caminharam na direção positiva, com desaceleração dos indicadores de inflação, divulgações mais construtivas de crescimento econômico e reabertura da economia chinesa. Também, em destaque, a queda acentuada do preço do gás natural sugere que a crise energética na Europa pode estar perdendo força.

Nos EUA, a inflação (CPI) vem passando por descompressão, sem surpresas negativas em relação às projeções. Fica reforçada, assim, a premissa de desaceleração consistente da inflação, trazendo uma redução no risco da inflação levar o Fed a realizar movimentos de alta mais agressivos nos juros.

Na Zona do Euro, é apresentada uma situação menos desfavorável. A tensão geopolítica e as dificuldades no mercado energético não tiveram um efeito negativo tão intenso quanto o esperado. Adicionalmente, nota-se uma descompressão importante no mercado energético, que reduz o risco de um impacto muito negativo. Esse contexto suporta um aumento das projeções de crescimento do PIB na região.

Na China, vai se consolidando o processo de reabertura mais célere da economia, diante da ampla flexibilização da política de contenção do Covid-19. Isso levou a uma relevante mudança nas perspectivas para a atividade, trazendo um cenário de PIB mais forte. Ainda que o curto prazo deva ficar marcado por dados mais modestos, em virtude do rápido aumento de casos de Covid-19, o fator dominante nos próximos meses deverá ser o efeito expansionista advindo da reabertura da economia.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos. Assim, no mês de janeiro de 2023, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, subiram +7,10% e +6,18%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam queda de -9,62% e -9,72%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, subiram +4,67% e +3,77%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Acumulando retornos negativos de -13,97% e -14,07% no ano.

Localmente, a curva de juros teve alta, refletindo as incertezas no cenário fiscal e levando a uma alta da expectativa de inflação. Adicionalmente, o movimento de deterioração das expectativas inflacionárias foi amplificado pelo início de discussões sobre alteração das metas de inflação, iniciada pelo presidente da república em uma entrevista. Teoricamente, a alteração da meta de inflação sugerida abriria espaço para uma política monetária menos restritiva. Desta forma, o cenário para a convergência se tornou ainda mais desafiador para o Banco Central.

Para a inflação, apesar de estarmos num momento ainda muito desafiador em termos de convergência do IPCA para a meta, a trajetória de desaceleração prossegue, apresentando uma composição qualitativa mais favorável, tanto de bens quanto de serviços. O Copom, em sua primeira reunião do ano, manteve a Selic em 13,75%, adotando um discurso ainda mais conservador do que o observado na sua reunião de dezembro passado, enfatizando a questão das expectativas. Uma vez que, conforme Boletim Focus, as expectativas de inflação não estão ancoradas em relação às metas.

Aqui, somente a título de exemplo da “Estrutura a Termo das Taxas de Juros - ETTJ” para o IPCA, estimada e divulgada pela ANBIMA para o fechamento de 03.02.2023, e apresentada no item 3 deste relatório como “Taxa de Juros Real”, a taxa de juros real com vencimento para 9 anos apresentava taxa de retorno estimada em 6,45% a.a., continuando acima da taxa máxima pré-fixada de 4,90% limitada pela SPREV para o ano de 2023. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo o movimento dos índices internacionais e ainda sendo beneficiado pelo movimento de reabertura da China, o que vem ajudando os mercados emergentes. Apresentando um retorno positivo de +3,37% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo de +1,15% nos últimos 12 meses.

Os índices de renda fixa encerraram o mês de janeiro: IRF-M 0,84%, IMA-B -0,00%, IMA-B 5 1,40% e IMA-B 5+ -1,26%, e na renda variável: IBOV 3,37%, o Índice Small Cap. 2,92%, IBRX 50 3,38%.

2. Agenda realizada

12 de janeiro:

Reunião com Daniel Varejão representante do fundo PORTO SEGURO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO, realizado de forma on-line. Nesta reunião foi informado sobre os impactos ocorrido na carteira de investimentos referente ao rombo das Lojas Americanas. De acordo com Varejão o fundo possuía menos de 1% dos papéis comprados e os impactos foram quase que nulos. Informações relevantes estão no material enviado por e-mail e disponibilizado. Participaram da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos.

Reunião com Eduardo Reichert representante da XP Investimentos. Participaram da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e Rossana Vasques – Presidente do IPMJ.

18 de janeiro:

9h00: Ata da tricentésima septuagésima oitava (378ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, ocorrida em 18 de janeiro de 2023, tendo início às 9h20 em formato presencial na sala de reuniões do IPMJ, com as seguintes presenças: 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, Victor Adriano Vieira Silva. Ausências justificadas de Rafaela Carvalho dos Santos, Clévio Vitor de Almeida e José Ricardo Vinhas. Participou da reunião a estagiária Julia Victoria Jesus Simões. Pautas da reunião: 1) Análise do Relatório de Investimentos e carteira fechada de dezembro de 2022; 2) Discussão e propostas da atualização da Resolução dos Credenciamentos na área de Investimentos conforme a Portaria 1.467/2022; 3) Apresentação do novo modelo de Relatório de Investimentos elaborado pela Consultoria Financeira para o ano de 2023; 4) Assuntos Diversos.

19 de janeiro:

14h30: Reunião com Lucas de Oliveira, Especialista em Investimentos e representante do Banco do Brasil. A pauta da reunião foi a apresentação do fundo BB RF Ativa Plus como estratégia de diversificação da carteira de investimentos do IPMJ. Material da reunião contendo estratégia do fundo, comparativo fundo RF Ativa x CDI, comparativo fundo RF Ativa x Crédito Privado CDI e correlação dos Ativos foram enviados por e-mail. Participaram da reunião Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos e Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos.

25 de janeiro:

10h00: Reunião com Bernardo Guimarães, CFP Institucional do Banco BTG Pactual. A pauta da reunião foi se existiria impactos no rating de gestão e nas Letras Financeiras emitidas pelo banco BTG Pactual, referente ao rombo das Lojas Americanas. De acordo com Bernardo Guimarães não houve nenhum impacto no Banco BTG Pactual, que continuou sendo enquadrado pelo Banco Central no segmento S1, mantendo sua capacidade e notas de rating em gestão brAAA (S&P) e AAA.br (Moddys). Participou da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos.

26 de janeiro:

11h00: Call de atualização na estrutura de gestão da Trígono Capital. A reunião ocorreu de forma on-line via aplicativo “Teams” e foi informado o desligamento do senhor Vinícius Lima da estrutura da atual gestão, não havendo alterações nas estratégias dos fundos, bem como dos gestores. Participaram da reunião Amauri Arnaldo Junior, Luís Gustavo Ferreira Bonacina e Rossana Vasques.

31 de janeiro à 02 de fevereiro:

Curso preparatório para a nova certificação de dirigentes, gestor de recursos, comitê de investimentos e conselheiros na cidade de Taboão da Serra. Participaram da reunião Amauri Arnaldo Junior, Sandra Pereira Rossi, Marcia Aparecida de Siqueira Arnaldo e Rossana Vasques. Realização do evento foi em parceria com a ABCPREV Consultoria e a GRID Investimentos.

3. Acompanhamento fundos estressados

i. FIDC MULSTISETORIAL MASTER III

Em janeiro de 2023, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um prejuízo de R\$ 452.317,19 (quatrocentos e cinquenta e dois mil e trezentos e dezessete reais e dezenove centavos negativos) e um rendimento negativo acumulado, R\$ - 1.401.492,86 (um milhão e quatrocentos e um mil e quatrocentos e noventa e dois reais e oitenta e seis centavos negativos), o total de amortizações já entregue é de R\$ 6.908.769,93 (seis milhões e novecentos e oito mil e setecentos e sessenta e nove reais e noventa e três centavos negativos). O total aplicado representa um valor de R\$ 7.368.930,01 (sete milhões e trezentos e sessenta e oito mil e novecentos e trinta reais e um centavo). O saldo em 31 de janeiro de 2023 é de R\$ 7.842,89 (sete mil e oitocentos e quarenta e dois reais e oitenta e nove centavos) O acompanhamento é realizado de forma mensal.

ii. PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP

O Fundo PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP em janeiro de 2023, o fundo apresentava aproximadamente um valor total aplicado de R\$ 2.823.363,14 (dois milhões e oitocentos e vinte e três mil e trezentos e sessenta e três reais e quatorze centavos), e um rendimento negativo acumulado de -R\$ 2.809.414,41 (dois milhões e oitocentos e nove mil e quatrocentos e quatorze reais e quarenta e um centavos) O saldo em 31 de janeiro de 2023 foi de R\$ 15.382,18 (quinze mil e trezentos e oitenta e dois reais e dezoito centavos), com um rendimento mensal de R\$ 107,00 (cento e sete reais).

iii. Fundos Estruturados (FIP) KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA

O Fundo KINEA PRIVATE EQUITY apresenta um valor total aplicado de R\$ 8.448.515,00 (oito milhões e quatrocentos e quarenta e oito mil e quinhentos e quinze reais), e um rendimento acumulado de R\$ 2.395.440,52 (dois milhões e trezentos e noventa e cinco mil e quatrocentos e quarenta reais e cinquenta e dois centavos), O saldo acumulado em 31 de janeiro de 2023 é de R\$ 10.843.955,44 (dez milhões e oitocentos e quarenta e três mil e novecentos e cinquenta e cinco reais e quarenta e quatro centavos) com um rendimento no mês de janeiro de -R\$ 708.287,93 (setecentos e oito mil e duzentos e oitenta e sete reais e noventa e três centavos negativo).