



LDB
EMPRESAS

JACAREÍ
FEVEREIRO 2023

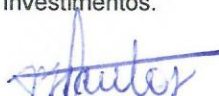


1.	PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS	3
2.	RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS.....	4
3.	Posição de Ativos e Enquadramento.....	5
3.1	Enquadramento da Carteira.....	11
4.	Rentabilidades por Artigo.....	12
5.	Análise de Liquidez	19
6.	Alocação por Artigo.....	20
7.	Alocação Por Estratégia.....	20
8.	Alocação por Gestor	21
9.	Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial.....	22
10.	Performance dos Fundos	25
11.	Cotização e Taxas.....	33
12.	Indexadores.....	35
13.	Movimentações	37
14.	Análise de Risco.....	39
15.	Relatório de Cenário Macroeconômico	46
16.	Agenda realizada.....	47
17.	Acompanhamento fundos estressados	48
18.	Fundos Estruturados	48

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 fevereiro 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



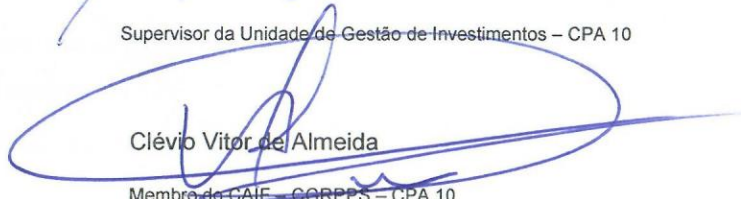
Amauri Arnaldo Junior

Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos – CPA 10



Luis Gustavo Ferreira Bonacina

Assessor da Presidência – CPA 20



Clévio Vitor de Almeida

Membro do CAIF – CORPPS – CPA 10

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**

Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do CAIF



Victor Adriano Vieira Silva

Membro do CAIF – CGRPPS

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**

José Ricardo Vinhas

Membro do CAIF

2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 22 dias do mês de março 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 fevereiro 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 fevereiro 2023.

Jacareí, 22 de março de 2023



Amauri Arnaldo Junior

Presidente do Conselho Fiscal



Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do Conselho Fiscal

3. Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

69,80%

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%)	0,65	0,06	0,91	2,06	2.142.354,90	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,300000%)	0,65	0,06	0,92	2,07	2.179.057,70	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,420000%)	0,66	0,06	0,93	2,09	10.814.528,71	1,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,580000%)	0,66	0,06	0,94	2,11	3.244.188,28	0,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,850000%)	0,66	0,07	0,96	2,16	2.164.416,13	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,860000%)	0,66	0,07	0,96	2,16	10.825.993,40	1,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,930000%)	0,65	0,07	0,96	2,17	5.360.845,47	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,560000%)	0,66	0,07	1,01	2,26	2.149.162,04	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,480000%)	0,63	0,06	0,93	2,10	2.148.807,05	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,63	0,07	0,96	2,15	1.048.927,69	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,65	0,06	0,89	2,00	2.178.606,58	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,65	0,06	0,89	2,01	2.174.919,49	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,65	0,06	0,89	2,01	2.173.914,63	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,65	0,06	0,91	2,06	2.161.768,42	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,65	0,06	0,92	2,07	2.162.298,77	0,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,65	0,06	0,92	2,07	2.161.236,68	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,65	0,07	0,96	2,15	2.016.188,44	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,65	0,07	0,96	2,16	3.155.264,92	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,65	0,06	0,90	2,02	2.188.141,56	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,65	0,06	0,90	2,02	2.185.430,07	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,65	0,06	0,90	2,03	2.181.208,59	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,285000%)	0,65	0,06	0,92	2,07	2.167.854,59	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,65	0,06	0,92	2,08	2.166.769,60	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,65	0,06	0,93	2,08	2.165.150,72	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,65	0,07	0,96	2,15	5.090.616,51	0,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,65	0,07	0,96	2,16	2.103.017,71	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	2,91	0,07	0,96	2,16	2.022.960,54	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,65	0,07	0,96	2,17	6.180.912,91	0,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,65	0,07	0,96	2,17	2.017.021,17	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	2,99	0,07	0,98	2,20	4.532.644,20	0,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,66	0,07	0,99	2,22	3.572.179,69	0,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,280000%)	4,27	0,07	0,26	0,26	3.007.820,47	0,47
TESOURO	NTN-B 150545 (6,400000%)	4,32	0,07	1,00	2,24	2.049.928,79	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,000000%)	0,65	0,06	0,90	2,03	2.191.811,56	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,65	0,06	0,90	2,03	2.186.795,32	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,65	0,06	0,90	2,03	2.181.806,05	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,65	0,06	0,92	2,07	2.169.933,03	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,65	0,06	0,93	2,08	2.170.767,46	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,66	0,06	0,93	2,09	2.168.621,19	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,520000%)	0,66	0,06	0,94	2,11	2.159.879,59	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,65	0,07	0,96	2,15	11.206.657,63	1,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,65	0,07	0,96	2,16	2.101.293,87	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	2,91	0,07	0,96	2,16	5.046.679,70	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,65	0,07	0,96	2,17	2.019.513,39	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,65	0,07	0,97	2,17	16.478.729,99	2,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	3,00	0,07	0,98	2,20	9.060.513,02	1,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,66	0,07	0,99	2,22	8.158.367,15	1,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,268000%)	4,28	0,07	0,26	0,26	7.017.597,31	1,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	4,35	0,07	1,00	2,24	5.129.799,29	0,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,66	0,06	0,92	2,08	2.118.064,71	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,450000%)	0,66	0,06	0,93	2,09	2.147.749,99	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,66	0,07	0,96	2,17	2.102.052,05	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,65	0,06	0,90	2,03	2.150.128,43	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,66	0,06	0,91	2,04	2.150.594,18	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,66	0,06	0,91	2,05	2.150.852,34	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,66	0,06	0,93	2,10	2.152.058,86	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,710000%)	0,66	0,06	0,95	2,13	3.147.534,42	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,65	0,06	0,89	2,00	2.164.670,70	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,66	0,06	0,91	2,04	2.154.740,77	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,66	0,06	0,92	2,06	2.156.242,01	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,66	0,06	0,92	2,07	2.153.330,62	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,66	0,07	0,96	2,15	3.152.688,19	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,65	0,06	0,89	2,00	2.171.980,19	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,65	0,06	0,89	2,01	2.166.886,00	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,66	0,06	0,91	2,05	2.157.398,08	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,66	0,06	0,92	2,07	2.158.579,94	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,300000%)	0,66	0,06	0,92	2,07	2.159.033,82	0,34
TESOURO	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,66	0,06	0,93	2,10	2.154.933,46	0,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,835000%)	0,66	0,07	0,96	2,15	3.153.891,33	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,65	0,06	0,90	2,02	2.184.016,63	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,65	0,06	0,90	2,02	2.174.729,30	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,65	0,06	0,90	2,03	2.176.442,78	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,66	0,06	0,92	2,07	2.165.673,72	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,310000%)	0,66	0,06	0,92	2,07	2.166.039,39	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,66	0,06	0,92	2,08	2.163.129,97	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,66	0,07	0,96	2,15	2.019.121,44	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,66	0,07	0,96	2,16	3.152.775,94	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,66	0,07	0,98	2,21	2.971.561,92	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,65	0,06	0,90	2,02	2.194.679,17	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,65	0,06	0,90	2,02	2.191.708,80	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,65	0,06	0,90	2,03	2.187.157,42	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,66	0,06	0,90	2,03	2.181.101,36	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,66	0,06	0,92	2,07	2.169.241,42	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,66	0,06	0,92	2,08	2.167.863,22	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,66	0,06	0,93	2,09	2.166.312,58	0,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,510000%)	0,66	0,06	0,94	2,10	2.158.793,12	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,66	0,07	0,96	2,15	8.147.632,39	1,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	2,99	0,07	0,96	2,16	3.025.877,85	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,66	0,07	0,96	2,17	2.019.106,42	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,66	0,07	0,97	2,17	11.005.674,60	1,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	3,08	0,07	0,98	2,20	6.540.975,72	1,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,66	0,07	0,99	2,22	5.446.394,89	0,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,278000%)	4,34	0,07	0,26	0,26	5.007.462,05	0,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	3,18	0,07	1,00	2,24	2.985.887,21	0,47
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,63	0,06	0,95	2,13	314.135.671,37	49,06

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	0,79	1,90	47.240.475,23	7,38	5.618.748.319,92	0,84
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,05	0,81	1,87	32.327.021,13	5,05	2.976.038.258,45	1,09
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,27	0,05	0,70	1,53	31.743.692,70	4,96	2.495.126.406,97	1,27
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,32	0,05	0,77	1,80	111.311.189,06	17,39		

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	1,16	0,25	1,22	2,11	5.149.323,21	0,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		7,00% a.a								
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 7,00% a.a	2,66	0,11	1,08	2,38	5.637.462,84	0,88		
Sub-total Artigo 7º IV			2,55	0,18	1,15	2,25	10.786.786,05	1,68		

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	145,80	-20,02	-20,02	-16,18	6.272,49	0,00	216.978,07	2,89
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			145,80	-20,02	-20,02	-16,18	6.272,49	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	0,06	0,05	0,90	2,07	3.168.732,35	0,49	6.280.757.425,13	0,05
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	3,47	-0,03	0,47	0,41	2.061.750,72	0,32	663.958.790,96	0,31
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,44	0,03	0,61	1,00	5.426.488,89	0,85	4.142.994.770,70	0,13
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,50	0,03	0,67	1,20	10.656.971,96	1,66		
Renda Fixa			0,76	0,06	0,90	2,02	446.896.890,93	69,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

13,85%

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	28,18	-1,85	-8,59	-0,98	4.055.170,81	0,63	307.865.688,82	1,32
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	25,70	-0,75	-9,11	-4,65	2.166.381,55	0,34	214.710.169,24	1,01
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	26,12	-0,80	-8,10	-3,18	6.631.290,48	1,04	248.914.366,60	2,66
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	22,48	-0,92	-6,29	-1,93	4.800.159,47	0,75	1.337.859.374,92	0,36
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,74	-1,02	-7,29	-5,49	23.980.026,57	3,75	669.790.007,70	3,58
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,75	-0,63	-6,44	-3,86	28.069.014,93	4,38	901.055.650,43	3,12
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	23,42	1,06	-3,69	-4,58	2.828.328,87	0,44	188.530.137,50	1,50
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	26,69	-0,61	-8,23	-5,01	3.045.797,89	0,48	418.530.878,05	0,73
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	21,82	0,67	-2,53	-0,24	6.730.923,99	1,05	590.438.062,23	1,14
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,82	0,23	-4,00	-0,77	6.393.573,50	1,00	204.471.931,28	3,13
Sub-total Artigo 8º I			19,78	-0,61	-6,48	-3,63	88.700.668,06	13,85		
Renda Variável			19,54	-0,61	-6,48	-3,63	88.700.668,06	13,85		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,06%

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	32,31	-0,17	-3,03	8,58	13.066.429,63	2,04	220.200.259,80	5,93
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	56,04	1,17	0,71	12,18	1.738.332,57	0,27	186.017.956,94	0,93
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	26,72	1,23	-0,57	1,86	2.873.091,98	0,45	95.474.224,88	3,01
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	32,02	1,10	1,17	3,65	2.532.777,56	0,40	61.502.322,21	4,12
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	39,18	1,41	1,39	12,55	2.414.845,78	0,38	590.852.345,79	0,41
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	25,68	0,53	0,35	2,10	5.061.066,32	0,79	286.454.880,94	1,77
Sub-total Artigo 9º II			24,00	0,44	-1,19	6,69	27.686.543,84	4,32		

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	25,79	0,33	0,23	2,79	17.512.513,34	2,74	847.652.363,95	2,07
Sub-total Artigo 9º III			25,79	0,33	0,23	2,79	17.512.513,34	2,74		
Investimentos no Exterior			22,88	0,40	-0,64	5,14	45.199.057,18	7,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,29%

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	14,79	-0,08	0,90	2,84	6.938.888,14	1,08	46.557.027,07	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	23,72	-0,10	-1,79	4,58	15.842.196,12	2,47	843.260.220,97	1,88
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	23,54	-0,11	-1,74	4,53	26.240.353,02	4,10	485.533.147,91	5,40
Sub-total Artigo 10º I			22,94	-0,10	-1,39	4,30	49.021.437,28	7,66		

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	40,90	0,65	0,65	-5,79	10.430.896,65	1,63	332.745.556,72	3,13
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	117,52	0,53	0,53	1,23	15.463,49	0,00	2.507.814,62	0,62
Sub-total Artigo 10º II			40,87	0,64	0,64	-5,78	10.446.360,14	1,63		
Investimentos Estruturados			19,78	0,03	-1,04	2,38	59.467.797,42	9,29		
Total			5,28	-0,01	-0,48	1,45	640.264.413,59	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

3.1 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	314.135.671,37	49,06	0,00	43,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	111.311.189,06	17,39	0,00	12,50	40,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	10.786.786,05	1,68	0,00	2,50	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	6.272,49	0,00	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	10.656.971,96	1,66	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	446.896.890,93	69,80					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	88.700.668,06	13,85	0,00	14,50	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	88.700.668,06	13,85					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	27.686.543,84	4,32	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	17.512.513,34	2,74	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	45.199.057,18	7,06					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	49.021.437,28	7,66	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	10.446.360,14	1,63	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	59.467.797,42	9,29					15,00
Total		640.264.413,59	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,95 103,03	2,13 103,68	2,99 93,52	4,74 73,50	11,56 88,90	2.857.811,59	6.325.856,35
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,77 84,20	1,80 87,52	2,95 92,24	6,25 97,03	13,63 104,87	939.534,71	2.138.431,72
Artigo 7º IV % do CDI	1,15 124,85	2,25 109,73	3,25 101,70			122.246,84	237.505,37
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-20,02 -2.180,84	-16,18 -788,62	-11,73 -366,85	-8,74 -135,64	-80,38 -618,39	-1.570,40	-1.210,85
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,67 72,95	1,20 58,40	2,35 73,59	5,63 87,34	12,52 96,34	70.901,91	126.173,88
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-6,48 1,01	-3,63 0,75	-7,21 -0,49	-6,75 -2,56	-6,15 1,10	-6.144.774,13	-3.340.582,59
Artigo 9º II % do CDI	-1,19 -129,36	6,69 326,12	3,42 107,08	-1,03 -15,92	-17,90 -137,70	-332.778,03	1.736.368,66
Artigo 9º III % do CDI	0,23 25,19	2,79 135,96	-2,01 -62,83	-0,51 -7,93	-12,58 -96,81	40.416,17	475.274,68
Artigo 10º I % do CDI	-1,39 -151,55	4,30 209,78	0,16 4,99	4,71 73,05	-0,89 -6,88	-691.740,51	2.022.944,03
Artigo 10º II % do CDI	0,64 70,23	-5,78 -281,88	-6,99 -218,47	-7,70 -119,41	-7,30 -56,14	66.930,55	-641.250,34
JACAREÍ (Total)						-3.073.021,30	9.079.510,91

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%)	2.122.939,35	0,00	0,00	0,00	2.142.354,90	19.415,55	43.188,43
NTN-B 150523 (5,300000%)	2.159.178,43	0,00	0,00	0,00	2.179.057,70	19.879,27	44.218,63
NTN-B 150523 (5,420000%)	10.714.994,13	0,00	0,00	0,00	10.814.528,71	99.534,58	221.362,14
NTN-B 150523 (5,580000%)	3.213.980,39	0,00	0,00	0,00	3.244.188,28	30.207,89	67.171,75
NTN-B 150523 (5,850000%)	2.143.873,18	0,00	0,00	0,00	2.164.416,13	20.542,95	45.672,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150523 (5,860000%)	10.723.156,05	0,00	0,00	0,00	10.825.993,40	102.837,35	228.617,11
NTN-B 150523 (5,930000%)	5.309.673,05	0,00	0,00	0,00	5.360.845,47	51.172,42	113.754,80
NTN-B 150523 (6,560000%)	2.127.746,95	0,00	0,00	0,00	2.149.162,04	21.415,09	47.582,43
NTN-B 150525 (5,480000%)	2.128.943,44	0,00	0,00	0,00	2.148.807,05	19.863,61	44.174,80
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.038.999,47	0,00	0,00	0,00	1.048.927,69	9.928,22	22.073,50
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.159.374,42	0,00	0,00	0,00	2.178.606,58	19.232,16	42.791,53
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.155.692,00	0,00	0,00	0,00	2.174.919,49	19.227,49	42.782,94
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.154.652,15	0,00	0,00	0,00	2.173.914,63	19.262,48	42.858,21
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.142.197,39	0,00	0,00	0,00	2.161.768,42	19.571,03	43.535,14
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.142.585,95	0,00	0,00	0,00	2.162.298,77	19.712,82	43.845,00
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.141.489,76	0,00	0,00	0,00	2.161.236,68	19.746,92	43.920,66
NTN-B 150535 (5,837000%)	1.997.069,01	0,00	0,00	0,00	2.016.188,44	19.119,43	42.506,33
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.125.306,57	0,00	0,00	0,00	3.155.264,92	29.958,35	66.604,72
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.168.665,02	0,00	0,00	0,00	2.188.141,56	19.476,54	43.333,04
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.165.962,68	0,00	0,00	0,00	2.185.430,07	19.467,39	43.311,13
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.161.703,74	0,00	0,00	0,00	2.181.208,59	19.504,85	43.390,43
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.148.099,11	0,00	0,00	0,00	2.167.854,59	19.755,48	43.942,40
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.146.943,52	0,00	0,00	0,00	2.166.769,60	19.826,08	44.095,63
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.145.280,97	0,00	0,00	0,00	2.165.150,72	19.869,75	44.191,14
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.042.358,70	0,00	0,00	0,00	5.090.616,51	48.257,81	107.284,05
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.083.042,54	0,00	0,00	0,00	2.103.017,71	19.975,17	44.408,68
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.003.696,44	0,00	0,00	0,00	2.022.960,54	19.264,10	42.827,70
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.121.976,68	0,00	0,00	0,00	6.180.912,91	58.936,23	131.019,48
NTN-B 150545 (5,922000%)	1.997.777,80	0,00	0,00	0,00	2.017.021,17	19.243,37	42.776,38
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.488.743,90	0,00	0,00	0,00	4.532.644,20	43.900,30	97.574,02
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.537.302,59	0,00	0,00	0,00	3.572.179,69	34.877,10	77.507,36
NTN-B 150545 (6,280000%)	0,00	2.999.996,09	0,00	0,00	3.007.820,47	7.824,38	7.824,38
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.029.719,03	0,00	0,00	0,00	2.049.928,79	20.209,76	44.908,06
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.172.256,14	0,00	0,00	0,00	2.191.811,56	19.555,42	43.505,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.167.243,42	0,00	0,00	0,00	2.186.795,32	19.551,90	43.500,91
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.162.253,75	0,00	0,00	0,00	2.181.806,05	19.552,30	43.498,37
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.150.113,60	0,00	0,00	0,00	2.169.933,03	19.819,43	44.081,32
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.150.861,29	0,00	0,00	0,00	2.170.767,46	19.906,17	44.273,00
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.148.662,99	0,00	0,00	0,00	2.168.621,19	19.958,20	44.390,02
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.139.855,91	0,00	0,00	0,00	2.159.879,59	20.023,68	44.529,99
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.100.428,89	0,00	0,00	0,00	11.206.657,63	106.228,74	236.169,89
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.081.333,79	0,00	0,00	0,00	2.101.293,87	19.960,08	44.373,03
NTN-B 150555 (5,897000%)	4.998.617,79	0,00	0,00	0,00	5.046.679,70	48.061,91	106.843,85
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.000.240,81	0,00	0,00	0,00	2.019.513,39	19.272,58	42.843,65
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.321.209,85	0,00	0,00	0,00	16.478.729,99	157.520,14	350.157,22
NTN-B 150555 (6,140000%)	8.972.760,08	0,00	0,00	0,00	9.060.513,02	87.752,94	195.043,62
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.078.696,62	0,00	0,00	0,00	8.158.367,15	79.670,53	177.070,46
NTN-B 150555 (6,268000%)	0,00	6.999.348,19	0,00	0,00	7.017.597,31	18.249,12	18.249,12
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.079.224,41	0,00	0,00	0,00	5.129.799,29	50.574,88	112.379,57
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.160.112,93	0,00	0,00	61.728,02	2.118.064,71	19.679,80	44.108,30
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.190.318,19	0,00	0,00	62.681,34	2.147.749,99	20.113,14	45.069,69
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.143.431,66	0,00	0,00	61.728,02	2.102.052,05	20.348,41	45.579,82
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.192.022,34	0,00	0,00	61.370,52	2.150.128,43	19.476,61	43.662,76
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.192.542,08	0,00	0,00	61.608,85	2.150.594,18	19.660,95	44.068,33
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.192.827,71	0,00	0,00	61.728,02	2.150.852,34	19.752,65	44.273,42
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.194.173,98	0,00	0,00	62.323,85	2.152.058,86	20.208,73	45.282,47
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.209.260,35	0,00	0,00	91.757,86	3.147.534,42	30.031,93	67.283,05
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.205.721,30	0,00	0,00	60.417,19	2.164.670,70	19.366,59	43.414,86
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.195.944,28	0,00	0,00	60.893,85	2.154.740,77	19.690,34	44.129,11
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.197.620,16	0,00	0,00	61.251,35	2.156.242,01	19.873,20	44.537,18
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.194.689,54	0,00	0,00	61.251,35	2.153.330,62	19.892,43	44.575,48
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.214.268,35	0,00	0,00	91.877,03	3.152.688,19	30.296,87	67.866,88
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.212.238,25	0,00	0,00	59.702,19	2.171.980,19	19.444,13	43.579,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.207.129,58	0,00	0,00	59.702,19	2.166.886,00	19.458,61	43.611,56
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.198.025,64	0,00	0,00	60.417,19	2.157.398,08	19.789,63	44.346,39
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.199.416,84	0,00	0,00	60.774,69	2.158.579,94	19.937,79	44.674,89
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.199.940,61	0,00	0,00	60.893,85	2.159.033,82	19.987,06	44.783,61
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.196.177,03	0,00	0,00	61.489,68	2.154.933,46	20.246,11	45.360,50
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.215.288,42	0,00	0,00	91.757,86	3.153.891,33	30.360,77	68.009,61
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.221.662,21	0,00	0,00	57.318,87	2.184.016,63	19.673,29	44.077,15
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.212.309,02	0,00	0,00	57.199,71	2.174.729,30	19.619,99	43.956,23
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.214.289,24	0,00	0,00	57.557,20	2.176.442,78	19.710,74	44.160,92
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.204.542,79	0,00	0,00	58.868,03	2.165.673,72	19.998,96	44.801,70
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.205.089,78	0,00	0,00	59.106,36	2.166.039,39	20.055,97	44.929,86
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.202.371,36	0,00	0,00	59.344,69	2.163.129,97	20.103,30	45.038,26
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.057.957,27	0,00	0,00	58.272,20	2.019.121,44	19.436,37	43.536,99
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.213.548,62	0,00	0,00	91.162,03	3.152.775,94	30.389,35	68.067,52
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.031.419,04	0,00	0,00	89.255,37	2.971.561,92	29.398,25	65.841,48
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.230.702,76	0,00	0,00	55.769,71	2.194.679,17	19.746,12	44.231,48
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.227.934,88	0,00	0,00	56.008,05	2.191.708,80	19.781,97	44.310,79
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.223.497,65	0,00	0,00	56.127,21	2.187.157,42	19.786,98	44.320,60
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.217.562,00	0,00	0,00	56.246,38	2.181.101,36	19.785,74	44.317,79
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.207.098,04	0,00	0,00	57.914,70	2.169.241,42	20.058,08	44.927,14
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.206.110,84	0,00	0,00	58.391,37	2.167.863,22	20.143,75	45.118,48
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.204.855,50	0,00	0,00	58.748,86	2.166.312,58	20.205,94	45.256,76
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.197.851,95	0,00	0,00	59.344,69	2.158.793,12	20.285,86	45.438,67
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.303.041,20	0,00	0,00	233.803,80	8.147.632,39	78.394,99	175.586,11
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.084.211,21	0,00	0,00	87.587,05	3.025.877,85	29.253,69	65.522,72
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.058.180,98	0,00	0,00	58.629,70	2.019.106,42	19.555,14	43.797,82
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.219.658,67	0,00	0,00	320.795,02	11.005.674,60	106.810,95	239.236,17
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.672.060,71	0,00	0,00	195.432,33	6.540.975,72	64.347,34	144.128,85
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.557.641,01	0,00	0,00	165.283,32	5.446.394,89	54.037,20	121.036,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (6,278000%)	0,00	4.994.436,18	0,00	0,00	5.007.462,05	13.025,87	13.025,87
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.048.205,68	0,00	0,00	92.234,53	2.985.887,21	29.916,06	67.007,63
					314.135.671,37	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	31.522.545,63	0,00	0,00	0,00	31.743.692,70	221.147,07	477.434,25
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	61.786.105,11	0,00	-15.000.000,00	0,00	47.240.475,23	454.370,12	1.126.558,48
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	31.480.447,61	19.180.930,81	-18.598.374,81	0,00	32.327.021,13	264.017,52	534.438,99
					111.311.189,06	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	5.577.443,56	0,00	0,00	0,00	5.637.462,84	60.019,28	131.239,74
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.087.095,65	0,00	0,00	0,00	5.149.323,21	62.227,56	106.265,63
					10.786.786,05	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 MULTISETORIAL BVA MASTER III	7.842,89	0,00	0,00	0,00	6.272,49	-1.570,40	-1.210,85
					6.272,49	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	3.140.346,10	0,00	0,00	0,00	3.168.732,35	28.386,25	64.111,82
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	2.052.109,21	0,00	0,00	0,00	2.061.750,72	9.641,51	8.337,88
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	5.393.614,74	0,00	0,00	0,00	5.426.488,89	32.874,15	53.724,18
					10.656.971,96	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	7.215.818,37	0,00	0,00	0,00	6.631.290,48	-584.527,89	-218.153,73
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.122.436,15	0,00	0,00	0,00	4.800.159,47	-322.276,68	-94.294,64
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	2.936.754,00	0,00	0,00	0,00	2.828.328,87	-108.425,13	-135.770,34
INDIE FIC FIA	3.318.850,75	0,00	0,00	0,00	3.045.797,89	-273.052,86	-160.668,93
META VALOR FI DE AÇÕES	2.383.465,70	0,00	0,00	0,00	2.166.381,55	-217.084,15	-105.750,79
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	25.865.396,11	0,00	0,00	0,00	23.980.026,57	-1.885.369,54	-1.392.587,27
OCCAM FIC FIA	30.000.670,68	0,00	0,00	0,00	28.069.014,93	-1.931.655,75	-1.127.562,60
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	4.436.240,47	0,00	0,00	0,00	4.055.170,81	-381.069,66	-40.028,22
TARPON GT 30 FIC FIA	6.905.555,69	0,00	0,00	0,00	6.730.923,99	-174.631,70	-16.107,78
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	6.660.254,27	0,00	0,00	0,00	6.393.573,50	-266.680,77	-49.658,29
					88.700.668,06	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	13.474.897,80	0,00	0,00	0,00	13.066.429,63	-408.468,17	1.032.806,25
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.726.049,02	0,00	0,00	0,00	1.738.332,57	12.283,55	188.691,45
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.889.695,11	0,00	0,00	0,00	2.873.091,98	-16.603,13	52.414,43
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.503.543,84	0,00	0,00	0,00	2.532.777,56	29.233,72	89.172,19
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.381.629,55	0,00	0,00	0,00	2.414.845,78	33.216,23	269.255,37
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	5.043.506,55	0,00	0,00	0,00	5.061.066,32	17.559,77	104.028,97
					27.686.543,84	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	17.472.097,17	0,00	0,00	0,00	17.512.513,34	40.416,17	475.274,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					17.512.513,34	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	26.704.772,14	0,00	0,00	0,00	26.240.353,02	-464.419,12	1.137.303,42
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	6.876.730,05	0,00	0,00	0,00	6.938.888,14	62.158,09	191.547,13
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	16.131.675,60	0,00	0,00	0,00	15.842.196,12	-289.479,48	694.093,48
					49.021.437,28	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	10.364.047,41	0,00	0,00	0,00	10.430.896,65	66.849,24	-641.438,65
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	15.382,18	0,00	0,00	0,00	15.463,49	81,31	188,31
					10.446.360,14	0,00	0,00

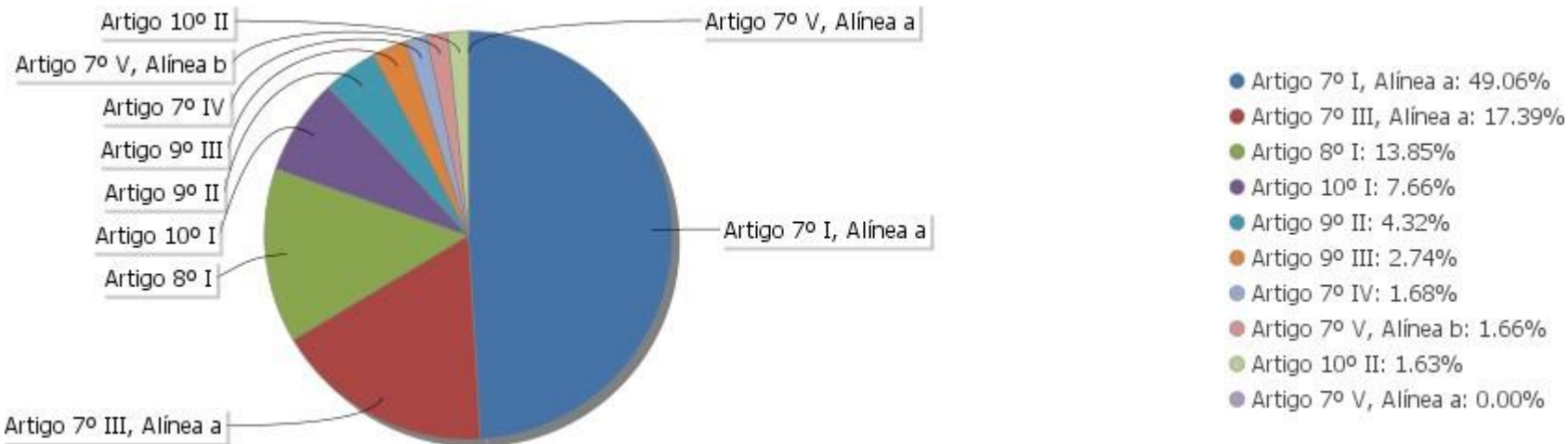
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

5. Análise de Liquidez

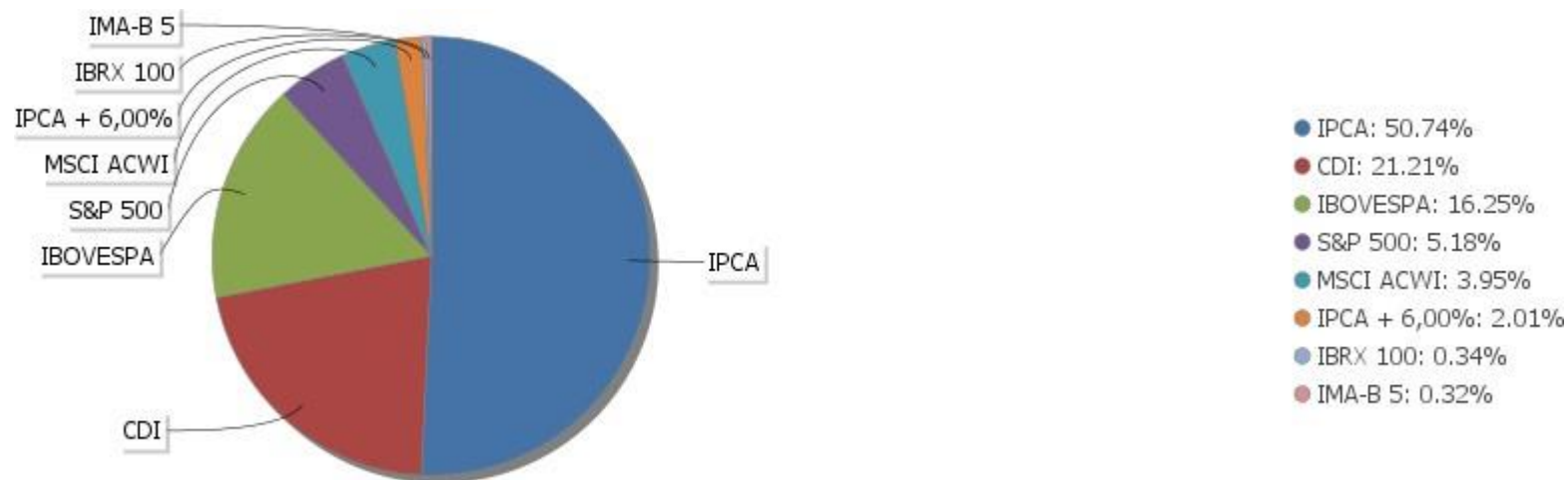
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	253.077.078,42	39,53	253.077.078,42	39,53
de 31 a 365 dias	90.714.527,73	14,17	343.791.606,15	53,70
acima de 365 dias	296.472.807,44	46,30	640.264.413,59	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

6. Alocação por Artigo

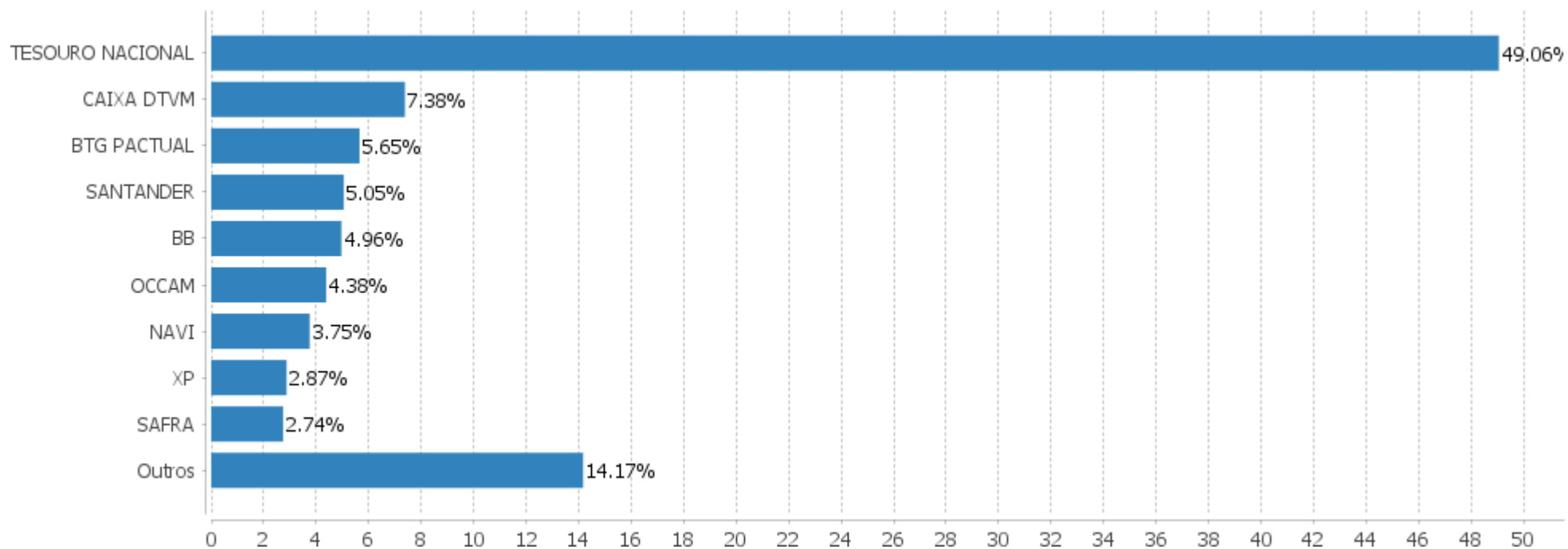


7. Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

8. Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	-0,48											1,45
IPCA + 5,11%	0,97	1,20											2,18
p.p. indexador	0,97	-1,68											-0,73
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

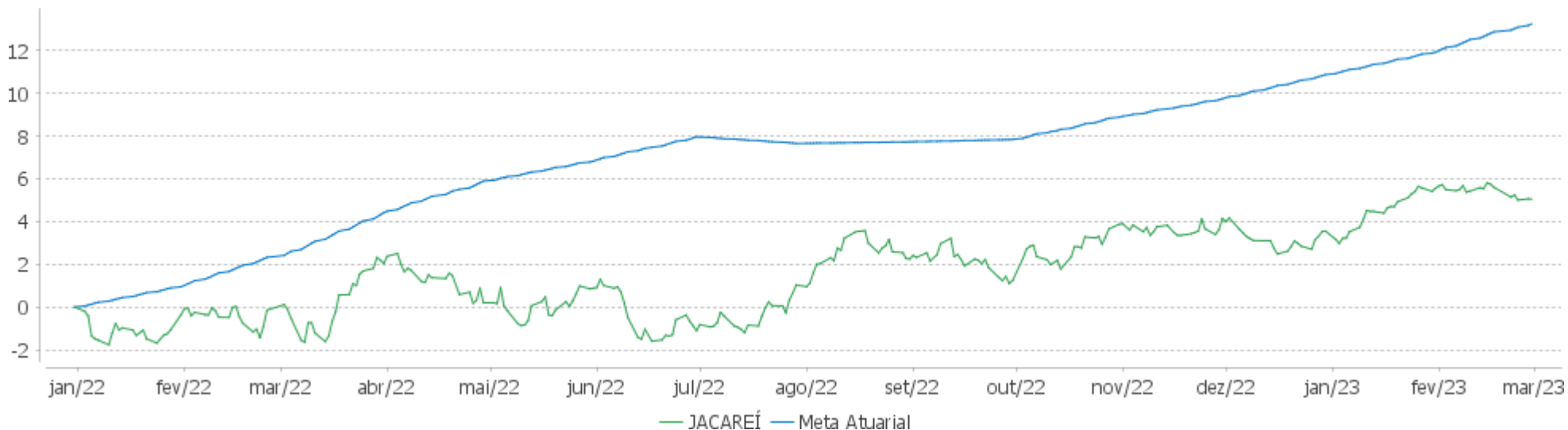
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

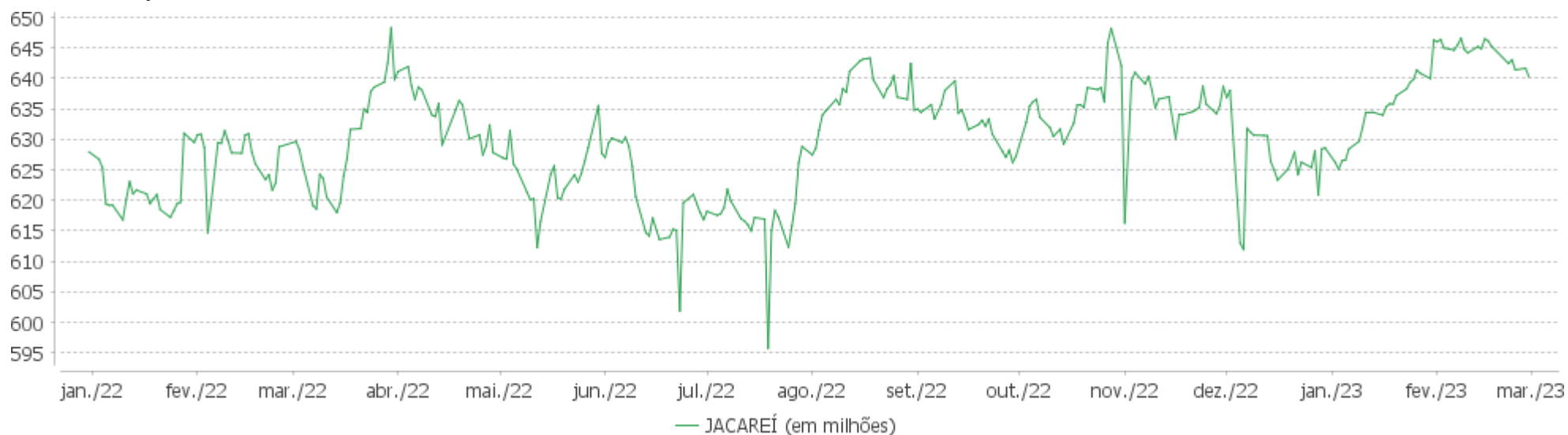
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	5	35,71	03 meses	0,87	3,24	-2,37	3,16
Meses abaixo - Meta Atuarial	9	64,29	06 meses	2,74	5,16	-2,42	4,29
			12 meses	5,21	10,72	-5,51	5,28
			24 meses				
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	2,60	2022-10	Desde 31/12/2021	5,05	13,29	-8,24	5,31
Menor rentabilidade da Carteira	-1,97	2022-06					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

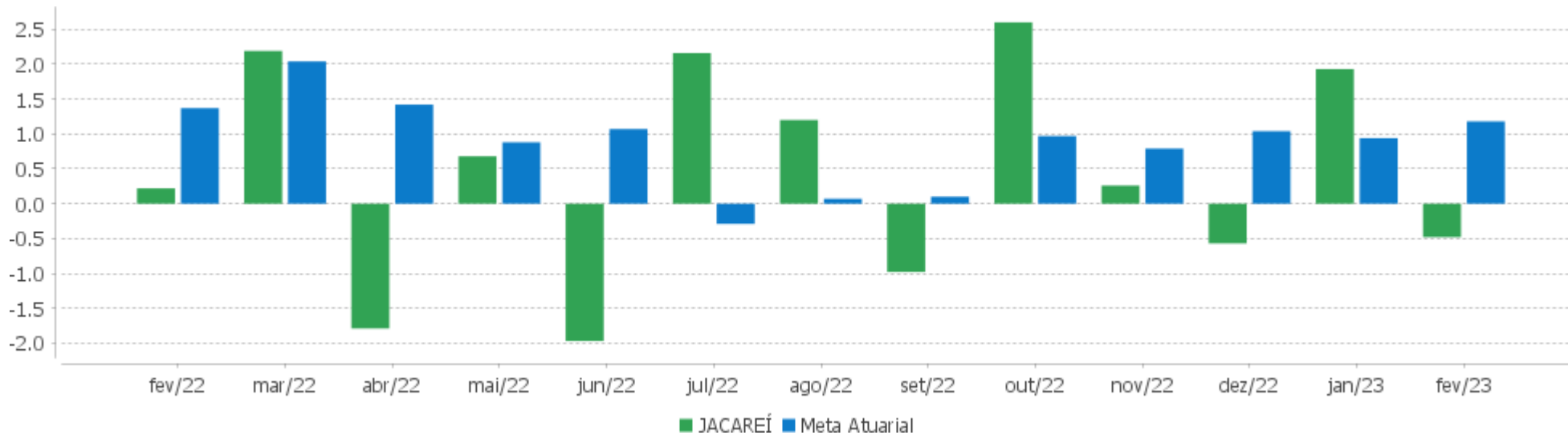


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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.	1,22 0,38	2,11 0,73					
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	1,08 0,24	2,38 1,01	3,35 1,34				
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	0,61 66,38	1,00 48,74	2,19 68,36	5,62 87,24	12,52 96,29	21,05 108,63	23,60 106,25
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	0,47 -0,94	0,41 -2,42	1,44 -2,35	3,63 -2,24	10,34 -1,23	17,03 -1,59	23,79 -2,22
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,90 98,45	2,07 100,65	3,25 101,54	6,63 102,85	13,64 104,94	21,30 109,92	22,73 102,35
NTN-B 150523 (5,930000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,17 0,79	3,06 1,05	4,90 2,17	11,89 6,29		
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,14	2,20 0,83	3,11 1,10	5,00 2,27	8,84 3,24		
NTN-B 150523 (6,560000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,17	2,26 0,89	3,21 1,20	5,20 2,48	12,55 6,96		
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,16 0,79	3,05 1,05	4,88 2,16	8,69 3,10		
NTN-B 150523 (5,210000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,07	2,06 0,68	2,88 0,88	4,55 1,82	11,13 5,54		
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,07	2,04 0,67	2,86 0,86	4,51 1,78	11,04 5,45		
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,09	2,10 0,72	2,95 0,95	4,68 1,96	11,42 5,82		
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,13	2,17 0,80	3,06 1,06	4,91 2,18	11,91 6,31		
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,16 0,78	3,04 1,04	4,87 2,14	11,82 6,22		
NTN-B 150545 (5,915000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,17 0,79	3,05 1,05	4,89 2,17	11,87 6,28		
NTN-B 150850 (5,831200%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,15 0,78	3,03 1,03	4,85 2,13	11,79 6,19		
NTN-B 150826 (5,190000%)	0,91	2,05	2,88	4,54	11,11		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	12 Meses	12 Meses	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,07	0,68	0,88	1,81	5,51		
NTN-B 150840 (5,837000%)	0,96	2,15	3,03	4,85	11,79		
Var. IPCA p.p.	0,12	0,78	1,03	2,13	6,20		
NTN-B 150830 (5,270000%)	0,92	2,07	2,90	4,58	11,20		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,69	0,89	1,85	5,60		
NTN-B 150545 (4,970000%)	0,90	2,02	2,83	4,43	10,88		
Var. IPCA p.p.	0,06	0,65	0,82	1,71	5,28		
NTN-B 150840 (4,950000%)	0,90	2,02	2,82	4,42	10,86		
Var. IPCA p.p.	0,06	0,64	0,82	1,70	5,26		
NTN-B 150850 (4,980000%)	0,90	2,02	2,83	4,44	10,89		
Var. IPCA p.p.	0,06	0,65	0,82	1,71	5,29		
NTN-B 150850 (5,360000%)	0,92	2,08	2,92	4,62	11,29		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,71	0,92	1,90	5,69		
NTN-B 150555 (5,927000%)	0,96	2,17	3,06	4,90	11,89		
Var. IPCA p.p.	0,12	0,79	1,05	2,17	6,29		
NTN-B 150545 (5,922000%)	0,96	2,17	3,05	4,90	11,88		
Var. IPCA p.p.	0,12	0,79	1,05	2,17	6,28		
NTN-B 150555 (5,370000%)	0,93	2,08	2,92	4,63	11,30		
Var. IPCA p.p.	0,09	0,71	0,92	1,90	5,70		
NTN-B 150840 (5,020000%)	0,90	2,03	2,84	4,46	10,93		
Var. IPCA p.p.	0,06	0,65	0,83	1,73	5,34		
NTN-B 150535 (4,910000%)	0,89	2,01	2,81	4,41	10,82		
Var. IPCA p.p.	0,05	0,64	0,81	1,68	5,22		
NTN-B 150850 (4,940000%)	0,90	2,02	2,82	4,42	10,85		
Var. IPCA p.p.	0,06	0,64	0,82	1,69	5,25		
NTN-B 150840 (4,970000%)	0,90	2,02	2,83	4,43	10,88		
Var. IPCA p.p.	0,06	0,65	0,82	1,71	5,28		
NTN-B 150545 (6,280000%)	0,99	2,22	3,14	1,96	5,71		
Var. IPCA p.p.	0,15	0,85	1,14	-0,77	0,12		
NTN-B 150826 (5,490000%)	0,93	2,10	2,95	4,69	11,43		
Var. IPCA p.p.	0,09	0,73	0,95	1,96	5,83		
NTN-B 150850 (6,261000%)	0,99	2,22	3,14	5,06	12,24		
Var. IPCA p.p.	0,15	0,84	1,13	2,33	6,64		
NTN-B 150555 (5,000000%)	0,90	2,03	2,83	4,45	10,91		
Var. IPCA p.p.	0,06	0,65	0,83	1,72	5,31		
NTN-B 150535 (5,320000%)	0,92	2,07	2,91	4,60	11,25		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	12 Meses	12 Meses	3 Meses	6 Meses	12 Meses	24 Meses	36 Meses
Var. IPCA p.p.	0,08	0,70	0,91	1,88	5,65		
NTN-B 150850 (5,010000%)	0,90	2,03	2,84	4,45	10,92		
Var. IPCA p.p.	0,06	0,65	0,83	1,73	5,33		
NTN-B 150555 (6,261000%)	0,99	2,22	3,13	5,06	12,24		
Var. IPCA p.p.	0,15	0,84	1,13	2,33	6,64		
NTN-B 150523 (5,300000%)	0,92	2,07	2,90	4,59	11,23		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,70	0,90	1,87	5,63		
NTN-B 150545 (6,256000%)	0,99	2,22	3,13	5,06	12,23		
Var. IPCA p.p.	0,15	0,84	1,13	2,33	6,64		
NTN-B 150555 (5,520000%)	0,94	2,11	2,96	4,70	11,46		
Var. IPCA p.p.	0,10	0,73	0,95	1,97	5,86		
NTN-B 150555 (5,860000%)	0,96	2,16	3,04	4,87	11,82		
Var. IPCA p.p.	0,12	0,78	1,04	2,14	6,22		
NTN-B 150545 (5,380000%)	0,93	2,08	2,92	4,63	11,31		
Var. IPCA p.p.	0,09	0,71	0,92	1,91	5,71		
NTN-B 150826 (5,009000%)	0,90	2,03	2,83	4,45	10,92		
Var. IPCA p.p.	0,06	0,65	0,83	1,73	5,32		
NTN-B 150545 (6,400000%)	1,00	2,24	3,17	1,97	5,74		
Var. IPCA p.p.	0,16	0,87	1,17	-0,75	0,14		
NTN-B 150555 (5,831200%)	0,96	2,15	3,03	4,85	11,79		
Var. IPCA p.p.	0,12	0,78	1,03	2,13	6,19		
NTN-B 150535 (5,855000%)	0,96	2,16	3,04	4,86	11,81		
Var. IPCA p.p.	0,12	0,78	1,03	2,14	6,21		
NTN-B 150828 (4,850000%)	0,89	2,00	2,80	4,38	10,75		
Var. IPCA p.p.	0,05	0,63	0,79	1,65	5,16		
NTN-B 150545 (5,831000%)	0,96	2,15	3,03	4,85	11,79		
Var. IPCA p.p.	0,12	0,78	1,03	2,13	6,19		
NTN-B 150555 (6,400000%)	1,00	2,24	3,17	1,95	5,70		
Var. IPCA p.p.	0,16	0,87	1,17	-0,77	0,10		
NTN-B 150828 (5,240000%)	0,92	2,06	2,89	4,57	11,16		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,69	0,89	1,84	5,57		
NTN-B 150545 (5,340000%)	0,92	2,08	2,91	4,61	11,27		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,70	0,91	1,89	5,67		
NTN-B 150523 (5,850000%)	0,96	2,16	3,04	4,86	11,81		
Var. IPCA p.p.	0,12	0,78	1,03	2,13	6,21		
NTN-B 150850 (5,921000%)	0,96	2,17	3,05	4,90	11,88		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	12 Meses	12 Meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses	72 meses
Var. IPCA p.p.	0,12	0,79	1,05	2,17	6,28		
NTN-B 150523 (5,420000%)	0,93	2,09	2,93	4,65	11,35		
Var. IPCA p.p.	0,09	0,72	0,93	1,93	5,76		
NTN-B 150535 (4,860000%)	0,89	2,00	2,80	4,38	10,76		
Var. IPCA p.p.	0,05	0,63	0,80	1,65	5,17		
NTN-B 150555 (6,268000%)	0,99	2,22	3,14	1,94	5,68		
Var. IPCA p.p.	0,15	0,85	1,13	-0,78	0,08		
NTN-B 150826 (5,710000%)	0,95	2,13	3,00	4,79	11,66		
Var. IPCA p.p.	0,11	0,76	1,00	2,07	6,06		
NTN-B 150555 (6,140000%)	0,98	2,20	3,11	5,00	8,84		
Var. IPCA p.p.	0,14	0,83	1,10	2,27	3,24		
NTN-B 150828 (5,270000%)	0,92	2,07	2,90	4,58	11,20		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,69	0,89	1,85	5,60		
NTN-B 150535 (5,290000%)	0,92	2,07	2,90	4,59	11,22		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,70	0,90	1,86	5,62		
NTN-B 150830 (5,835000%)	0,96	2,15	3,03	4,85	11,79		
Var. IPCA p.p.	0,12	0,78	1,03	2,13	6,19		
NTN-B 150555 (5,315000%)	0,92	2,07	2,91	4,60	11,24		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,70	0,91	1,88	5,65		
NTN-B 150535 (5,837000%)	0,96	2,15	3,03	4,85	11,79		
Var. IPCA p.p.	0,12	0,78	1,03	2,13	6,20		
NTN-B 150830 (5,300000%)	0,92	2,07	2,90	4,59	11,23		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,70	0,90	1,87	5,63		
NTN-B 150830 (5,500000%)	0,93	2,10	2,95	4,69	11,44		
Var. IPCA p.p.	0,09	0,73	0,95	1,96	5,84		
NTN-B 150545 (5,285000%)	0,92	2,07	2,90	4,59	11,21		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,69	0,90	1,86	5,61		
NTN-B 150523 (5,580000%)	0,94	2,11	2,97	4,73	11,52		
Var. IPCA p.p.	0,10	0,74	0,97	2,00	5,93		
NTN-B 150824 (5,450000%)	0,93	2,09	2,94	4,67	11,38		
Var. IPCA p.p.	0,09	0,72	0,94	1,94	5,79		
NTN-B 150830 (5,178300%)	0,91	2,05	2,88	4,54	11,10		
Var. IPCA p.p.	0,07	0,68	0,87	1,81	5,50		
NTN-B 150545 (5,897000%)	0,96	2,16	3,05	4,88	8,69		
Var. IPCA p.p.	0,12	0,79	1,05	2,16	3,09		
NTN-B 150545 (5,030000%)	0,90	2,03	2,84	4,46	10,94		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	12 Mês	12 Mes	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,06	0,66	0,84	1,74	5,35		
NTN-B 150850 (6,400000%)	1,00	2,24	3,17	5,13	9,00		
Var. IPCA p.p.	0,16	0,87	1,17	2,40	3,40		
NTN-B 150824 (5,912000%)	0,96	2,17	3,05	4,89	11,87		
Var. IPCA p.p.	0,12	0,79	1,05	2,16	6,27		
NTN-B 150850 (5,045000%)	0,90	2,03	2,84	4,47	10,96		
Var. IPCA p.p.	0,06	0,66	0,84	1,74	5,36		
NTN-B 150555 (5,030000%)	0,90	2,03	2,84	4,46	10,94		
Var. IPCA p.p.	0,06	0,66	0,84	1,74	5,35		
NTN-B 150840 (5,274000%)	0,92	2,07	2,90	4,58	11,20		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,69	0,90	1,86	5,60		
NTN-B 150826 (5,130000%)	0,91	2,04	2,86	4,51	11,05		
Var. IPCA p.p.	0,07	0,67	0,86	1,79	5,45		
NTN-B 150840 (5,360000%)	0,92	2,08	2,92	4,62	11,29		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,71	0,92	1,90	5,69		
NTN-B 150850 (5,410000%)	0,93	2,09	2,93	4,65	11,34		
Var. IPCA p.p.	0,09	0,71	0,93	1,92	5,75		
NTN-B 150840 (5,855000%)	0,96	2,16	3,04	4,86	11,81		
Var. IPCA p.p.	0,12	0,78	1,03	2,14	6,21		
NTN-B 150545 (4,980000%)	0,90	2,02	2,83	4,44	10,89		
Var. IPCA p.p.	0,06	0,65	0,82	1,71	5,29		
NTN-B 150830 (4,860000%)	0,89	2,00	2,80	4,38	10,76		
Var. IPCA p.p.	0,05	0,63	0,80	1,65	5,17		
NTN-B 150824 (5,345000%)	0,92	2,08	2,92	4,62	11,27		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,70	0,91	1,89	5,68		
NTN-B 150840 (5,310000%)	0,92	2,07	2,91	4,60	11,24		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,70	0,90	1,87	5,64		
NTN-B 150545 (6,140000%)	0,98	2,20	3,11	5,00	8,85		
Var. IPCA p.p.	0,14	0,83	1,10	2,27	3,25		
NTN-B 150830 (4,900000%)	0,89	2,01	2,81	4,40	10,81		
Var. IPCA p.p.	0,05	0,64	0,81	1,67	5,21		
NTN-B 150850 (5,295500%)	0,92	2,07	2,90	4,59	11,22		
Var. IPCA p.p.	0,08	0,70	0,90	1,87	5,63		
NTN-B 150535 (4,880000%)	0,89	2,01	2,80	4,39	10,78		
Var. IPCA p.p.	0,05	0,63	0,80	1,66	5,19		
NTN-B 150555 (5,420000%)	0,93	2,09	2,93	4,65	11,35		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,09	0,72	0,93	1,93	5,76		
NTN-B 150850 (5,510000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,10	2,10 0,73	2,96 0,95	4,70 1,97	11,45 5,85		
NTN-B 150850 (6,278000%) Var. IPCA p.p.	-2,01 -2,85	-0,81 -2,18	0,08 -1,92	1,95 -0,77	5,70 0,10		
NTN-B 150555 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,16 0,79	3,05 1,05	4,88 2,16	8,70 3,10		
NTN-B 150840 (6,220000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,14	2,21 0,84	3,13 1,12	5,04 2,31	12,19 6,60		
NTN-B 150523 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,16 0,78	3,04 1,04	4,87 2,14	11,82 6,22		
NTN-B 150828 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,15 0,78	3,03 1,02	4,84 2,11	11,76 6,17		
NTN-B 150555 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,13	2,17 0,80	3,06 1,06	4,91 2,18	11,91 6,31		
NTN-B 150555 (5,060000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,06	2,03 0,66	2,85 0,84	4,48 1,75	10,97 5,38		
NTN-B 150525 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,15 0,78	3,03 1,02	4,84 2,11	11,76 6,17		
NTN-B 150535 (5,196100%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,07	2,06 0,68	2,88 0,88	4,54 1,82	11,12 5,52		
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III % do CDI	-20,02 -2.180,84	-16,18 -788,61	-11,73 -366,84	-8,74 -135,64	-80,38 -618,39	278,53 1.437,23	9.320,62 41.964,65
BB INSTITUCIONAL FI RF % do CDI	0,70 76,41	1,53 74,42	2,68 83,76	5,99 92,87	12,67 97,45	19,63 101,28	22,13 99,65
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,79 86,35	1,90 92,67	3,05 95,45	6,33 98,29	12,95 99,63	19,81 102,21	22,41 100,88
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,81 87,91	1,87 90,90	3,02 94,56	6,37 98,90	13,14 101,09	20,38 105,16	22,46 101,12
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,29 1,20	-1,93 2,45	-4,93 1,78	-6,11 -1,92	-9,07 -1,81	-34,17 -29,53	-27,40 -28,13
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,53 4,96	-0,24 4,14	-4,99 1,72	-1,71 2,48	7,65 14,91	31,82 36,46	75,43 74,70
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,00 3,49	-0,77 3,61	-2,08 4,63	-1,48 2,71	10,98 18,23	40,21 44,85	
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	-7,29	-5,49	-10,09	-8,33	-5,18	3,47	8,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,20	-1,11	-3,38	-4,14	2,08	8,11	7,51
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,59 -1,10	-0,98 3,40	-3,41 3,31	-9,48 -5,29	-13,90 -6,64	-23,09 -18,45	-15,98 -16,71
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,69 3,80	-4,58 -0,20	-7,72 -1,00	-8,27 -4,08	-1,24 6,02	19,59 24,23	
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,23 -0,73	-5,01 -0,63	-9,14 -2,42	-11,23 -7,04	-20,68 -13,42	-37,22 -32,58	-32,63 -33,36
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,44 1,05	-3,86 0,51	-6,42 0,29	-5,48 -1,28	-6,65 0,61	-6,34 -1,71	3,54 2,81
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-8,10 -0,61	-3,18 1,19	-6,14 0,58	-10,65 -6,46	-16,71 -9,45	-25,02 -20,39	-24,90 -25,63
META VALOR FI DE AÇÕES Var. IBRX 100 p.p.	-9,11 -1,52	-4,65 -0,31	-8,43 -1,58	-7,21 -2,45	-12,82 -4,59	-20,39 -14,79	-21,20 -22,14
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	0,23 7,72	2,79 7,17	-2,01 4,71	-0,51 3,68	-12,58 -5,33	-11,59 -6,96	36,54 35,81
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-0,57 0,34	1,86 -1,85	4,82 6,74	2,98 -0,18	-8,42 0,33	-31,41 -21,55	
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	0,35 1,27	2,10 -1,61	2,30 4,23	5,19 2,03	-5,46 3,29	-8,90 0,96	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-3,03 -2,11	8,58 4,87	2,67 4,59	-2,35 -5,51	-19,15 -10,40	-21,72 -11,86	17,82 -24,19
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	0,71 1,63	12,18 8,47	4,39 6,32	-11,13 -14,29	-36,72 -27,97	-59,34 -49,48	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,39 0,13	12,55 10,23	8,94 5,46	3,74 -1,95	-16,89 -28,80	-39,33 -70,49	19,72 -26,43
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	1,17 2,09	3,65 -0,06	2,43 4,35	-6,48 -9,64	-25,88 -17,13	-40,34 -30,48	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	0,90 1,44	2,84 -0,37	4,53 8,81				
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-1,79 -195,45	4,58 223,32	-0,48 -14,91	4,82 74,75	-0,83 -6,41	18,93 97,66	47,29 212,94
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-1,74 -1,20	4,53 1,32	-0,56 3,73	9,19 8,25	3,66 11,90	25,26 27,16	
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,65 -0,62	-5,79 -8,11	-7,00 -10,48	-7,71 -13,40	-8,70 -20,61	10,58 -20,58	31,22 -14,93
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	0,53	1,23	1,46	2,56	-42,51	97,07	-99,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	57,57	60,08	45,79	39,65	-327,04	500,88	-446,98
JACAREÍ	-0,48	1,45	0,87	2,74	5,21		
Var. IPCA + 4,83% p.p.	-1,68	-0,73	-2,39	-2,51	-5,76		
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

11. Cotização 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		0,20
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		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,98	2,09	3,30	6,49	12,81	17,61	21,23	29,14	38,03
IRF-M 1+	0,79	1,51	3,16	4,25	9,06	7,22	10,24	25,91	40,07
IRF-M TOTAL	0,86	1,71	3,21	4,93	10,13	10,66	13,99	27,51	40,19
IMA-B 5	1,41	2,82	3,79	5,87	11,57	18,62	26,01	41,34	55,61
IMA-B 5+	1,17	-0,11	-1,30	0,52	4,86	0,42	1,37	23,71	45,02
IMA-B TOTAL	1,28	1,28	1,08	3,02	7,94	8,94	12,38	32,61	51,33
IMA-GERAL TOTAL	1,03	1,74	2,52	4,81	10,51	13,70	17,46	30,71	43,72
IDKA 2	1,62	3,08	4,36	6,05	11,25	18,71	26,96	41,17	55,55
IDKA 20	0,79	-3,83	-7,02	-4,75	-2,27	-14,73	-16,36	6,39	31,39
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,30

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73	9,78	22,94
IBRX 100	-7,59	-4,34	-6,85	-4,76	-8,23	-5,60	0,93	12,19	26,64
IBRX 50	-7,54	-4,41	-6,85	-3,59	-7,74	-3,34	4,52	11,43	23,50
SMALL CAP	-10,52	-7,90	-10,68	-16,48	-20,21	-30,84	-29,32	-4,09	7,17
Índice Consumo - ICON	-9,78		-12,01	-20,80	-30,44	-45,20	-44,63	-25,38	-25,80
Índice Dividendos - IDIV	-7,55	-2,11	-3,69	-0,84	5,04	14,70	10,65	34,58	57,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-0,54	3,21	-4,28	0,94	-8,25	-1,90	55,57	98,62	134,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,45	-2,05	-2,05	-5,64	2,45	-2,71	-5,24	15,36	21,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,92	3,71	-1,93	3,17	-8,75	-9,86	42,01	74,04	94,86

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,84	1,37	2,00	2,73	5,60	16,73	22,79	27,71	32,68
INPC	0,77	1,23	1,93	2,47	5,47	16,86	24,12	28,99	34,07
IGPM	-0,06	0,15	0,60	-1,88	1,86	18,28	52,51	62,91	75,30
SELIC	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,31

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,12	2,01	2,99	4,71	9,80	26,26	38,06	49,31	61,33
IPCA + 5,00%	1,19	2,16	3,23	5,20	10,85	28,69	42,07	55,11	69,21
IPCA + 5,50%	1,23	2,24	3,36	5,45	11,38	29,92	44,10	58,08	73,26
IPCA + 5,89%	1,25	2,30	3,45	5,64	11,79	30,89	45,70	60,42	76,48
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15	61,08	77,39
INPC + 4,00%	1,05	1,87	2,92	4,45	9,67	26,39	39,56	50,81	63,02
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73	62,70	79,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

13. Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
17	01/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	938.000,00	4.188,55812889	223,9434123000
18	01/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,93082757	223,9434123000
19	02/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	12.000,00	53,55705061	224,0601352000
20	07/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	23.000,00	0,00	102,49692364	224,3969788000
21	07/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	481.000,00	0,00	2.143,52262037	224,3969788000
22	10/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	953.000,00	4.240,97167409	224,7126539000
23	10/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	156.800,00	0,00	697,78001941	224,7126539000
24	10/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	29.000,00	129,05370257	224,7126539000
25	13/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,44808845	224,8156736000
26	14/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	35.000,00	155,63704047	224,8821996000
27	14/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	8.000,00	35,57418068	224,8821996000
28	15/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	26.000,00	115,57433649	224,9634373000
29	15/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	3.515.756,00	0,00	15.628,12180591	224,9634373000
30	17/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	11.000,00	48,85592258	225,1518223000
31	17/02/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	15.000.000,00	8.618.614,25323442	1,7404190000
32	17/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,44144751	225,1518223000
33	17/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	15.001.000,00	0,00	66.626,15406244	225,1518223000
34	22/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,87839430	225,2659584000
35	22/02/2023	NTN-B 150555 (6,268000%)	6.999.348,19	0,00	1.765,00000000	3.965,6363690000
36	22/02/2023	NTN-B 150850 (6,278000%)	4.994.436,18	0,00	1.278,00000000	3.908,0095290000
37	22/02/2023	NTN-B 150545 (6,280000%)	2.999.996,09	0,00	754,00000000	3.978,7746590000
38	22/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	6.660.777,46	29.568,50430180	225,2659584000
39	22/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	8.335.597,35	37.003,35998038	225,2659584000
40	22/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	3.374,81	0,00	14,98144693	225,2659584000
41	23/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	10.000,00	44,36917978	225,3816737000
42	24/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	149.000,00	660,77264797	225,4935952000
43	24/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,43471576	225,4935952000
44	24/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	13,30414727	225,4935952000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
45	27/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	6.639,71	29,44128148	225,5238110000
46	27/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	90.000,00	399,07094333	225,5238110000
47	27/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	360,29	1,59756967	225,5238110000
48	28/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.323.621,55	5.866,20352329	225,6351224000
49	28/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	378,45	1,67726547	225,6351224000
Total			34.174.711,27	33.598.374,81		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

14. Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 10.378.762,80

Value-At-Risk: 1,62%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
JACAREÍ		1,62	1,62			640.264.413,59	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,10%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,210000%)		0,17	0,00	0,19			2.142.354,90	0,33
NTN-B 150523 (5,300000%)		0,17	0,00	0,19			2.179.057,70	0,34
NTN-B 150523 (5,420000%)		0,17	0,00	0,19			10.814.528,71	1,69
NTN-B 150523 (5,580000%)		0,17	0,00	0,19			3.244.188,28	0,51
NTN-B 150523 (5,850000%)		0,17	0,00	0,19			2.164.416,13	0,34
NTN-B 150523 (5,860000%)		0,17	0,00	0,19			10.825.993,40	1,69
NTN-B 150523 (5,930000%)		0,17	0,00	0,19			5.360.845,47	0,84
NTN-B 150523 (6,560000%)		0,17	0,00	0,19			2.149.162,04	0,34
NTN-B 150525 (5,480000%)		0,17	0,00	0,19			2.148.807,05	0,34
NTN-B 150525 (5,810000%)		0,17	0,00	0,19			1.048.927,69	0,16
NTN-B 150535 (4,860000%)		0,17	0,00	0,19			2.178.606,58	0,34
NTN-B 150535 (4,880000%)		0,17	0,00	0,19			2.174.919,49	0,34
NTN-B 150535 (4,910000%)		0,17	0,00	0,19			2.173.914,63	0,34
NTN-B 150535 (5,196100%)		0,17	0,00	0,19			2.161.768,42	0,34
NTN-B 150535 (5,290000%)		0,17	0,00	0,19			2.162.298,77	0,34
NTN-B 150535 (5,320000%)		0,17	0,00	0,19			2.161.236,68	0,34
NTN-B 150535 (5,837000%)		0,17	0,00	0,19			2.016.188,44	0,31
NTN-B 150535 (5,855000%)		0,17	0,00	0,19			3.155.264,92	0,49
NTN-B 150545 (4,970000%)		0,17	0,00	0,19			2.188.141,56	0,34
NTN-B 150545 (4,980000%)		0,17	0,00	0,19			2.185.430,07	0,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (5,030000%)		0,17	0,00	0,19			2.181.208,59	0,34
NTN-B 150545 (5,285000%)		0,17	0,00	0,19			2.167.854,59	0,34
NTN-B 150545 (5,340000%)		0,17	0,00	0,19			2.166.769,60	0,34
NTN-B 150545 (5,380000%)		0,17	0,00	0,19			2.165.150,72	0,34
NTN-B 150545 (5,831000%)		0,17	0,00	0,19			5.090.616,51	0,80
NTN-B 150545 (5,860000%)		0,17	0,00	0,19			2.103.017,71	0,33
NTN-B 150545 (5,897000%)		0,17	0,00	0,19			2.022.960,54	0,32
NTN-B 150545 (5,915000%)		0,17	0,00	0,19			6.180.912,91	0,97
NTN-B 150545 (5,922000%)		0,17	0,00	0,19			2.017.021,17	0,32
NTN-B 150545 (6,140000%)		0,17	0,00	0,19			4.532.644,20	0,71
NTN-B 150545 (6,256000%)		0,17	0,00	0,19			3.572.179,69	0,56
NTN-B 150545 (6,280000%)		0,24	0,00	0,24			3.007.820,47	0,47
NTN-B 150545 (6,400000%)		0,24	0,00	0,24			2.049.928,79	0,32
NTN-B 150555 (5,000000%)		0,17	0,00	0,19			2.191.811,56	0,34
NTN-B 150555 (5,030000%)		0,17	0,00	0,19			2.186.795,32	0,34
NTN-B 150555 (5,060000%)		0,17	0,00	0,19			2.181.806,05	0,34
NTN-B 150555 (5,315000%)		0,17	0,00	0,19			2.169.933,03	0,34
NTN-B 150555 (5,370000%)		0,17	0,00	0,19			2.170.767,46	0,34
NTN-B 150555 (5,420000%)		0,17	0,00	0,19			2.168.621,19	0,34
NTN-B 150555 (5,520000%)		0,17	0,00	0,19			2.159.879,59	0,34
NTN-B 150555 (5,831200%)		0,17	0,00	0,19			11.206.657,63	1,75
NTN-B 150555 (5,860000%)		0,17	0,00	0,19			2.101.293,87	0,33
NTN-B 150555 (5,897000%)		0,17	0,00	0,19			5.046.679,70	0,79
NTN-B 150555 (5,927000%)		0,17	0,00	0,19			2.019.513,39	0,32
NTN-B 150555 (5,950000%)		0,17	0,00	0,19			16.478.729,99	2,57
NTN-B 150555 (6,140000%)		0,17	0,00	0,19			9.060.513,02	1,42
NTN-B 150555 (6,261000%)		0,17	0,00	0,19			8.158.367,15	1,27
NTN-B 150555 (6,268000%)		0,24	0,00	0,24			7.017.597,31	1,10
NTN-B 150555 (6,400000%)		0,24	0,00	0,24			5.129.799,29	0,80
NTN-B 150824 (5,345000%)		0,18	0,00	0,19			2.118.064,71	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,450000%)		0,17	0,00	0,19			2.147.749,99	0,34
NTN-B 150824 (5,912000%)		0,17	0,00	0,19			2.102.052,05	0,33
NTN-B 150826 (5,009000%)		0,17	0,00	0,19			2.150.128,43	0,34
NTN-B 150826 (5,130000%)		0,17	0,00	0,19			2.150.594,18	0,34
NTN-B 150826 (5,190000%)		0,17	0,00	0,19			2.150.852,34	0,34
NTN-B 150826 (5,490000%)		0,17	0,00	0,19			2.152.058,86	0,34
NTN-B 150826 (5,710000%)		0,17	0,00	0,19			3.147.534,42	0,49
NTN-B 150828 (4,850000%)		0,17	0,00	0,19			2.164.670,70	0,34
NTN-B 150828 (5,125600%)		0,17	0,00	0,19			2.154.740,77	0,34
NTN-B 150828 (5,240000%)		0,17	0,00	0,19			2.156.242,01	0,34
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,17	0,00	0,19			2.153.330,62	0,34
NTN-B 150828 (5,810000%)		0,17	0,00	0,19			3.152.688,19	0,49
NTN-B 150830 (4,860000%)		0,17	0,00	0,19			2.171.980,19	0,34
NTN-B 150830 (4,900000%)		0,17	0,00	0,19			2.166.886,00	0,34
NTN-B 150830 (5,178300%)		0,17	0,00	0,19			2.157.398,08	0,34
NTN-B 150830 (5,270000%)		0,17	0,00	0,19			2.158.579,94	0,34
NTN-B 150830 (5,300000%)		0,17	0,00	0,19			2.159.033,82	0,34
NTN-B 150830 (5,500000%)		0,17	0,00	0,19			2.154.933,46	0,34
NTN-B 150830 (5,835000%)		0,17	0,00	0,19			3.153.891,33	0,49
NTN-B 150840 (4,950000%)		0,17	0,00	0,19			2.184.016,63	0,34
NTN-B 150840 (4,970000%)		0,17	0,00	0,19			2.174.729,30	0,34
NTN-B 150840 (5,020000%)		0,17	0,00	0,19			2.176.442,78	0,34
NTN-B 150840 (5,274000%)		0,17	0,00	0,19			2.165.673,72	0,34
NTN-B 150840 (5,310000%)		0,17	0,00	0,19			2.166.039,39	0,34
NTN-B 150840 (5,360000%)		0,17	0,00	0,19			2.163.129,97	0,34
NTN-B 150840 (5,837000%)		0,18	0,00	0,19			2.019.121,44	0,32
NTN-B 150840 (5,855000%)		0,17	0,00	0,19			3.152.775,94	0,49
NTN-B 150840 (6,220000%)		0,17	0,00	0,19			2.971.561,92	0,46
NTN-B 150850 (4,940000%)		0,17	0,00	0,19			2.194.679,17	0,34
NTN-B 150850 (4,980000%)		0,17	0,00	0,19			2.191.708,80	0,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,010000%)		0,17	0,00	0,19			2.187.157,42	0,34
NTN-B 150850 (5,045000%)		0,17	0,00	0,19			2.181.101,36	0,34
NTN-B 150850 (5,295500%)		0,17	0,00	0,19			2.169.241,42	0,34
NTN-B 150850 (5,360000%)		0,17	0,00	0,19			2.167.863,22	0,34
NTN-B 150850 (5,410000%)		0,17	0,00	0,19			2.166.312,58	0,34
NTN-B 150850 (5,510000%)		0,17	0,00	0,19			2.158.793,12	0,34
NTN-B 150850 (5,831200%)		0,17	0,00	0,19			8.147.632,39	1,27
NTN-B 150850 (5,897000%)		0,17	0,00	0,19			3.025.877,85	0,47
NTN-B 150850 (5,921000%)		0,17	0,00	0,19			2.019.106,42	0,32
NTN-B 150850 (5,950000%)		0,17	0,00	0,19			11.005.674,60	1,72
NTN-B 150850 (6,140000%)		0,17	0,00	0,19			6.540.975,72	1,02
NTN-B 150850 (6,261000%)		0,17	0,00	0,19			5.446.394,89	0,85
NTN-B 150850 (6,278000%)		0,24	-0,00	0,26			5.007.462,05	0,78
NTN-B 150850 (6,400000%)		0,17	0,00	0,19			2.985.887,21	0,47
Sub-total	0,19	0,14	0,01		0,15	0,95	314.135.671,37	49,06

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		0,04	-0,00	0,04			47.240.475,23	7,38
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,07	-0,00	0,07			32.327.021,13	5,05
BB INSTITUCIONAL FI RF		0,05	0,00	0,05			31.743.692,70	4,96
Sub-total	0,16	0,04	-0,00		-0,89	0,77	111.311.189,06	17,39

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		0,26	0,00	0,26			5.149.323,21	0,80
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a		0,60	0,00	0,61			5.637.462,84	0,88
Sub-total	0,49	0,35	0,00		0,47	1,15	10.786.786,05	1,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III		0,52	0,00	0,52			6.272,49	0,00
Sub-total	83,60	0,52	0,00		-0,25	-20,02	6.272,49	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			3.168.732,35	0,49
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV		1,76	0,00	0,83			2.061.750,72	0,32
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,27	-0,00	0,27			5.426.488,89	0,85
Sub-total	0,59	0,37	0,00		-0,42	0,67	10.656.971,96	1,66

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,71%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA		14,07	0,06	7,46			4.055.170,81	0,63
META VALOR FI DE AÇÕES		13,80	0,03	5,40			2.166.381,55	0,34
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		14,49	0,09	7,31			6.631.290,48	1,04
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		9,74	0,04	5,30			4.800.159,47	0,75
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		10,11	0,23	4,31			23.980.026,57	3,75
OCCAM FIC FIA		8,70	0,24	2,91			28.069.014,93	4,38
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		12,33	0,03	6,34			2.828.328,87	0,44
INDIE FIC FIA		13,58	0,04	6,26			3.045.797,89	0,48
TARPON GT 30 FIC FIA		11,25	0,07	7,52			6.730.923,99	1,05
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA		7,22	0,03	7,20			6.393.573,50	1,00
Sub-total	15,73	9,71	0,86		-0,47	-6,48	88.700.668,06	13,85

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,21%

Artigo 10º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO		7,91	0,01	15,87			6.938.888,14	1,08
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		10,36	0,19	10,36			15.842.196,12	2,47
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		10,32	0,31	7,79			26.240.353,02	4,10
Sub-total	14,10	8,75	0,51		-0,16	-1,39	49.021.437,28	7,66

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		0,36	-0,00	0,36			10.430.896,65	1,63
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		0,09	0,00	0,09			15.463,49	0,00
Sub-total	2,41	0,35	-0,00		-0,11	0,64	10.446.360,14	1,63

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,93%

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		12,46	0,15	9,46			13.066.429,63	2,04
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		23,93	0,01	20,91			1.738.332,57	0,27
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,90	-0,02	12,50			2.873.091,98	0,45
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		14,60	-0,01	14,34			2.532.777,56	0,40
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		14,70	0,00	14,70			2.414.845,78	0,38
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		11,20	-0,01	11,20			5.061.066,32	0,79
Sub-total	17,92	9,96	0,14		-0,12	-1,19	27.686.543,84	4,32

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		11,49	0,11	18,38			17.512.513,34	2,74
Sub-total	14,07	11,49	0,11		-0,05	0,23	17.512.513,34	2,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

15. Relatório de Cenário Macroeconômico

No mês de fevereiro, o sentimento de aversão a risco aumentou nos mercados globais devido à resiliência da inflação, contratações do mercado de trabalho e à expectativa de altas adicionais nos juros americanos.

Assim, o discurso de diversos bancos centrais evoluiu em uma direção ainda mais conservadora, o que influenciou as Bolsas globais recuarem e o dólar ganhou força contra as moedas internacionais. Nos EUA, a leitura de dados demonstra o mercado de trabalho ainda aquecido. Além disso, os indicadores também mostram uma inflação ainda resiliente, com o componente de serviços seguindo pressionado.

Esta combinação sugere que poderá ocorrer o prolongamento do ciclo de aperto monetário. Na Zona do Euro, a inflação mostra dinâmica desfavorável para o Banco Central Europeu (ECB), principalmente nos componentes do núcleo. Neste ambiente, é previsto que o ECB continue subindo os juros nas próximas reuniões. O firme aperto monetário reforça a perspectiva de uma atividade fraca ao longo do ano.

Na China, os sinais para a atividade seguem positivos, com a retomada ficando mais evidente, a atividade segue em recuperação. As informações desde então sugerem que o pior momento da dinâmica de casos de Covid-19 foi superado e que a atividade vem reagindo até melhor do que a expectativa inicial. Isso reforça a percepção mais favorável para a economia da China.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos negativos. Assim, no mês de fevereiro de 2023, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, caíram -2,98% e -2,61%, 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 -9,95% e -9,45%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, caíram -0,92% e -0,54%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Acumulando retornos negativos de -8,75% e -8,25% nos últimos 12 meses.

No Brasil, a desaceleração da atividade e inflação segue em curso, entretanto a incerteza em relação à sustentabilidade fiscal e a discussão sobre uma possível mudança nas metas de inflação seguem dominando o cenário. Para a inflação, houve uma melhora na trajetória, tanto pelo comportamento dos preços de bens e serviços como pelas diferentes medidas de núcleo. Isso reforça a perspectiva de queda do IPCA à frente. As discussões a respeito da tributação sobre combustíveis foram encerradas, ficando decidido a recomposição parcial dos tributos. Entretanto, as incertezas relacionadas às decisões de política econômica permanecem.

Onde por um lado, é aguardada a proposta de arcabouço para as regras fiscais. Já por outro, as notícias neste início de ano colocaram em destaque a condução da política monetária, principalmente pela possibilidade de alteração nas metas de inflação. Com as incertezas da política econômica, as expectativas de inflação compiladas pelo Banco Central (Relatório Focus) vêm apresentando alta.

Nesse contexto, espera-se a manutenção dos juros básicos em patamares restritivos por mais tempo. 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 07.03.2023, 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 6,36% 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 negativa, seguindo o movimento dos índices internacionais e ainda sofrendo com as incertezas no quadro fiscal. Apresentando um retorno negativo de -7,49% no mês.

Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento negativo anual de -4,38% e de -7,26% nos últimos 12 meses. Mediante a todo esse cenário exposto acima e em linha com o último relatório disponibilizado, tentando elucidar muitos questionamentos recebidos acerca dos prêmios trazidos pelas NTN-Bs atualmente, a estratégia de compra direta de NTN-Bs, respaldada por um estudo de ALM, pode auxiliar na “ancoragem de rentabilidade” ainda acima da meta atuarial dos RPPS. Tal estratégia, em especial para carregamento até o vencimento, pode contribuir proporcionalmente para a redução da volatilidade global da carteira de investimentos do RPPS, devido ao benefício da “marcação na curva” do preço desse ativo.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Os índices de renda fixa encerraram o mês de fevereiro: IRF-M 0,86%, IMA-B 1,28%, IMA-B 5 1,41% e IMA-B 5+ 1,17%, e na renda variável: IBOV -7,49%, o Índice Small Cap. -10,53%, IBRX 50 -10,53%.

16. Agenda realizada

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 do curso 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.

09 de fevereiro:

10h00: Reunião com Daniel Sandoval e Luiz Henrique de Oliveira representantes da gestora RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA, para a apresentação do fundo RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B, formato online pela plataforma "Teams". O objetivo do fundo é a proteção da carteira preservando o patrimônio líquido do IPMJ em momentos de volatilidade alta e cenário incerto. Participaram da reunião Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e os estagiários João Pedro Gomes Santos e Julia Victória Jesus Simões.

15 de fevereiro:

9h00: Ata da tricentésima septuagésima nona (379ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, ocorrida em 15 de fevereiro de 2023, tendo início às 9h15 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, Clévio Vitor de Almeida e José Ricardo Vinhas. Ausência justificada de Rafaela Carvalho dos Santos. Participaram da reunião os estagiários Julia Victória Jesus Simões e João Pedro Gomes Santos. Pautas da reunião: 1) Relatório Anual de Investimentos 2022; 2) Análise do relatório de investimentos e carteira fechada de janeiro de 2023; 3) Apresentação do Banco do Brasil; 4) Assuntos diversos.

16 de fevereiro:

10h00: Reunião com Flávia Figer e Lucas Assis representantes da Dólar Bills Investimentos. A pauta da reunião foi a apresentação do cenário econômico. Participaram da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e Rossana Vasques – Presidente do IPMJ.

17 de fevereiro:

14h00: Reunião com os representantes Paloma Ribeiro dos Santos, Luiz Renato Silva Bueno e Marcelo Silva Ribeiro da Sicredi Vanguarda. Na reunião, foi apresentado para o IPMJ os vários fundos sob gestão da Sicredi, tendo como destaque o fundo SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL REF DI FI RF, CNPJ: 24.634.187/0001-43. Observou-se consistência desde o início do fundo frente ao seu benchmark (CDI), resiliência em 2023 comparado com os demais fundos e evolução significativa do Patrimônio Líquido.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

17. Acompanhamento fundos estressados**I. FIDC MULTISSETORIAL MASTER III**

Em fevereiro de 2023, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um prejuízo de R\$ 453.887,59 (quatrocentos e cinquenta e três mil e oitocentos e oitenta e sete reais e cinquenta e nove centavos negativos) e um rendimento negativo acumulado, R\$ 1.403.063,26 (um milhão e quatrocentos e três mil e sessenta e três reais e vinte 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 28 de fevereiro de 2023 é de R\$ 7.312,92 (sete mil e trezentos e doze reais e noventa e dois centavos) O acompanhamento é realizado de forma mensal.

II. PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP

O Fundo PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP em fevereiro 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\$ 2.809.333,11 (dois milhões e oitocentos e nove mil e trezentos e trinta e três reais e onze centavos negativos) O saldo em 28 de fevereiro de 2023 foi de R\$ 15.463,49 (quinze mil e quatrocentos e sessenta e três reais e quarenta e nove centavos), com um rendimento mensal de R\$ 81,30 (oitenta e um reais e trinta centavos).

18. Fundos Estruturados**III. (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\$ 2.462.289,76 (dois milhões e quatrocentos e sessenta e dois mil e duzentos e oitenta e nove reais e setenta e seis centavos), O saldo acumulado em 28 de fevereiro de 2023 é de R\$ 10.910.804,68 (dez milhões e novecentos e dez mil e oitocentos e quatro reais e sessenta e oito centavos) com um rendimento no mês de fevereiro de R\$ 66.849,24 (sessenta e seis mil e oitocentos e quarenta e nove reais e vinte e quatro centavos).