



LDB
EMPRESAS

JACAREÍ
MARÇO 2023



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

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**
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 – CGRPPS – 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 19 dias do mês de abril 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 março 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 março 2023.

Jacareí, 19 de abril de 2023



Amauri Arnaldo Junior

Presidente do Conselho Fiscal



Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do Conselho Fiscal

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

3. Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

70,15%

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%)	0,63	0,05	1,42	3,51	2.172.879,14	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,300000%)	0,63	0,05	1,43	3,53	2.210.277,22	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,420000%)	0,63	0,06	1,44	3,56	10.970.606,55	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,580000%)	0,63	0,06	1,46	3,60	3.291.464,30	0,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,850000%)	0,63	0,06	1,48	3,67	2.196.469,43	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,860000%)	0,63	0,06	1,48	3,67	10.986.415,58	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,930000%)	0,63	0,06	1,49	3,69	5.440.606,64	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,560000%)	0,63	0,06	1,54	3,84	2.182.321,82	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,480000%)	0,60	0,06	1,45	3,58	2.179.934,26	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,60	0,06	1,48	3,66	1.064.424,15	0,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,62	0,05	1,39	3,43	2.208.972,87	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,62	0,05	1,40	3,43	2.205.274,11	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,62	0,05	1,40	3,44	2.204.312,98	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,63	0,05	1,42	3,51	2.192.542,99	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,63	0,05	1,43	3,53	2.193.259,81	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%)	0,63	0,05	1,43	3,54	2.192.238,74	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,63	0,06	1,48	3,67	2.046.023,96	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,63	0,06	1,48	3,67	3.202.005,73	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,62	0,05	1,40	3,45	2.218.856,64	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,62	0,05	1,40	3,45	2.216.124,98	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,62	0,05	1,41	3,47	2.211.939,59	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,285000%)	0,63	0,05	1,43	3,53	2.198.885,27	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,63	0,06	1,44	3,54	2.197.889,67	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,63	0,06	1,44	3,55	2.196.324,06	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,63	0,06	1,48	3,66	5.165.919,28	0,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,63	0,06	1,48	3,67	2.134.180,69	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	2,90	0,06	1,49	3,68	2.053.003,51	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,63	0,06	1,49	3,68	6.272.799,19	0,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,63	0,06	1,49	3,69	2.047.019,25	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	2,98	0,06	1,51	3,74	4.600.919,04	0,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,63	0,06	1,52	3,77	3.626.347,62	0,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,280000%)	4,25	0,06	1,52	1,78	3.053.495,73	0,47
TESOURO	NTN-B 150545 (6,400000%)	4,31	0,06	1,53	3,80	2.081.271,11	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%)	0,62	0,05	1,41	3,46	2.222.633,47	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,62	0,05	1,41	3,47	2.217.605,79	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,62	0,05	1,41	3,47	2.212.603,52	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,63	0,05	1,43	3,54	2.201.050,46	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,63	0,06	1,44	3,55	2.202.001,36	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,63	0,06	1,44	3,56	2.199.919,65	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,520000%)	0,63	0,06	1,45	3,59	2.191.241,50	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,63	0,06	1,48	3,66	11.372.440,69	1,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,63	0,06	1,48	3,67	2.132.430,98	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	2,89	0,06	1,48	3,68	5.121.622,33	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,63	0,06	1,49	3,69	2.049.557,07	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,63	0,06	1,49	3,69	16.724.204,91	2,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	2,99	0,06	1,51	3,74	9.196.987,51	1,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,63	0,06	1,52	3,77	8.282.114,17	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,268000%)	4,26	0,06	1,52	1,78	7.124.085,01	1,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	4,34	0,06	1,53	3,80	5.208.230,46	0,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,63	0,06	1,44	3,54	2.148.493,64	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%)	0,63	0,06	1,45	3,57	2.178.802,42	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,63	0,06	1,49	3,68	2.133.296,28	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,63	0,05	1,41	3,46	2.180.382,29	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,63	0,05	1,42	3,49	2.181.084,31	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,63	0,05	1,42	3,51	2.181.459,30	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,63	0,06	1,45	3,58	2.183.250,41	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,710000%)	0,63	0,06	1,47	3,63	3.193.760,18	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,63	0,05	1,39	3,42	2.194.825,86	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,63	0,05	1,42	3,49	2.185.280,35	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,63	0,05	1,43	3,52	2.187.020,07	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,63	0,05	1,43	3,53	2.184.122,81	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,63	0,06	1,48	3,66	3.199.264,24	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,63	0,05	1,39	3,43	2.202.254,72	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,63	0,05	1,40	3,44	2.197.167,05	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,63	0,05	1,42	3,50	2.188.075,57	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,63	0,05	1,43	3,53	2.189.448,99	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,300000%)	0,63	0,05	1,43	3,53	2.189.964,83	0,34
TESOURO	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,63	0,06	1,45	3,58	2.186.185,09	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%)	0,63	0,06	1,48	3,66	3.200.554,98	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,63	0,05	1,40	3,45	2.214.634,88	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,63	0,05	1,40	3,45	2.205.256,16	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,63	0,05	1,41	3,46	2.207.088,31	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,63	0,05	1,43	3,53	2.196.650,25	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,310000%)	0,63	0,05	1,43	3,54	2.197.091,40	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,63	0,06	1,44	3,55	2.194.234,52	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,63	0,06	1,48	3,67	2.049.000,48	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,63	0,06	1,48	3,67	3.199.480,89	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,63	0,06	1,51	3,76	3.016.527,71	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,63	0,05	1,40	3,45	2.225.426,28	0,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,63	0,05	1,40	3,45	2.222.490,38	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,63	0,05	1,41	3,46	2.217.933,74	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,63	0,05	1,41	3,47	2.211.858,10	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,63	0,05	1,43	3,53	2.200.311,71	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,63	0,06	1,44	3,55	2.199.035,44	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,63	0,06	1,44	3,56	2.197.558,13	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%)	0,63	0,06	1,45	3,59	2.190.118,44	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,63	0,06	1,48	3,66	8.268.158,57	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	2,98	0,06	1,49	3,68	3.070.813,08	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,63	0,06	1,49	3,69	2.049.132,58	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,63	0,06	1,49	3,69	11.169.618,04	1,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	3,07	0,06	1,51	3,74	6.639.500,69	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,63	0,06	1,52	3,77	5.529.010,87	0,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,278000%)	4,33	0,06	1,52	1,78	5.083.491,60	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	3,17	0,06	1,53	3,80	3.031.539,70	0,47
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,61	0,06	1,47	3,63	318.744.390,09	49,43

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	1,16	3,08	47.788.448,33	7,41	5.527.183.481,99	0,86
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,05	1,13	3,02	32.045.500,25	4,97	2.908.858.412,17	1,10
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,27	0,05	1,12	2,67	32.100.142,82	4,98	2.464.448.423,52	1,30
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,92	0,05	1,14	2,96	111.934.091,40	17,36		

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	1,24	-0,36	1,15	3,28	5.208.490,30	0,81		

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	2,41	-0,02	1,50	3,92	5.722.182,59	0,89		
		Sub-total Artigo 7º IV	2,33	-0,18	1,33	3,62	10.930.672,89	1,70		
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	150,74	-33,02	-33,02	-43,86	4.201,03	0,00	145.321,92	2,89
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	150,74	-33,02	-33,02	-43,86	4.201,03	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	0,05	0,05	1,18	3,27	3.206.087,16	0,50	7.586.250.542,97	0,04
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	3,24	-0,17	0,96	1,37	2.081.542,55	0,32	587.006.703,86	0,35
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,45	0,06	1,03	2,04	5.482.253,37	0,85	3.553.528.277,99	0,15
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	0,51	0,01	1,06	2,27	10.769.883,08	1,67		
		Renda Fixa	0,64	0,05	1,37	3,42	452.383.238,49	70,15		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

13,18%

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	-1,79	-7,17	-8,08	3.764.285,53	0,58	273.553.453,68	1,38
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	25,34	-2,07	-6,57	-10,92	2.023.982,46	0,31	199.044.953,48	1,02
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	25,35	-2,14	-2,89	-5,98	6.439.632,10	1,00	236.109.157,61	2,73
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,70	-1,52	-5,51	-7,33	4.535.489,44	0,70	1.304.244.679,71	0,35
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,18	-1,73	-4,98	-10,20	22.784.772,46	3,53	620.608.798,04	3,67
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,48	-1,24	-2,80	-6,55	27.283.644,99	4,23	819.838.527,03	3,33
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22,78	-0,30	-1,04	-5,57	2.798.851,44	0,43	186.298.792,15	1,50
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	25,91	-1,72	-4,01	-8,82	2.923.659,93	0,45	389.327.611,18	0,75
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	22,18	-1,67	-4,07	-4,30	6.456.673,35	1,00	566.322.430,10	1,14
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	21,11	-0,73	-6,31	-7,03	5.990.172,62	0,93	191.040.302,42	3,14
Sub-total Artigo 8º I			19,40	-1,48	-4,17	-7,65	85.001.164,32	13,18		
Renda Variável			19,37	-1,48	-4,17	-7,65	85.001.164,32	13,18		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,16%

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	31,06	1,81	5,22	14,25	13.748.947,58	2,13	227.388.440,52	6,05
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	54,10	-0,85	-1,26	10,76	1.716.422,14	0,27	181.981.982,30	0,94
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,17	-0,17	-3,51	-1,72	2.772.120,69	0,43	87.773.846,38	3,16
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,10	0,02	-1,89	1,69	2.484.938,25	0,39	60.340.152,16	4,12
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	37,80	0,15	2,41	15,26	2.473.032,30	0,38	574.972.448,79	0,43
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	25,40	-0,09	0,87	2,99	5.105.323,01	0,79	290.551.141,69	1,76
Sub-total Artigo 9º II			22,79	0,80	2,22	9,06	28.300.783,97	4,39		

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	25,10	0,94	2,06	4,91	17.874.052,66	2,77	812.929.058,18	2,20
Sub-total Artigo 9º III			25,10	0,94	2,06	4,91	17.874.052,66	2,77		
Investimentos no Exterior			21,91	0,85	2,16	7,41	46.174.836,63	7,16		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,51%

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	17,77	0,57	2,34	5,24	7.100.926,26	1,10	47.644.233,06	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	23,42	1,45	4,01	8,78	16.477.410,65	2,56	806.667.695,08	2,04
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	23,21	1,47	4,14	8,86	27.326.290,18	4,24	496.229.337,01	5,51
Sub-total Artigo 10º I			22,46	1,34	3,84	8,31	50.904.627,09	7,89		

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	40,81	-0,49	-0,49	-6,26	10.379.495,80	1,61	331.105.870,01	3,13
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	95,96	1,19	1,19	2,43	15.647,03	0,00	2.507.814,62	0,62
Sub-total Artigo 10º II			40,79	-0,49	-0,49	-6,25	10.395.142,83	1,61		

Investimentos Estruturados			19,39	1,02	3,08	5,53	61.299.769,92	9,51		
Total			4,88	-0,01	0,82	2,28	644.859.009,36	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

4. 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	318.744.390,09	49,43	0,00	43,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	111.934.091,40	17,36	0,00	12,50	40,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	10.930.672,89	1,70	0,00	2,50	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	4.201,03	0,00	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	10.769.883,08	1,67	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	452.383.238,53	70,15					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	85.001.164,32	13,18	0,00	14,50	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	85.001.164,32	13,18					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	28.300.783,97	4,39	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	17.874.052,66	2,77	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	46.174.836,63	7,16					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	50.904.627,09	7,89	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	10.395.142,83	1,61	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	61.299.769,92	9,51					15,00
Total		644.859.009,36	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

5. 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	1,47 124,90	3,63 111,54	3,63 111,54	6,16 94,05	11,26 84,82	4.608.718,74	10.934.575,11
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,14 97,15	2,96 90,98	2,96 90,98	6,28 95,82	12,22 92,01	1.259.402,34	3.397.834,06
Artigo 7º IV % do CDI	1,33 113,56	3,62 111,22	3,62 111,22	6,61 100,87		143.886,84	381.392,21
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-33,02 -2.811,38	-43,86 -1.349,36	-43,86 -1.349,36	-40,20 -613,43	-86,39 -650,55	-2.071,46	-3.282,31
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,06 90,20	2,27 69,84	2,27 69,84	5,54 84,58	12,57 94,64	112.911,12	239.085,00
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,17 -1,26	-7,65 -0,49	-7,65 -0,49	-10,16 -2,74	-13,75 1,35	-3.699.503,73	-7.040.086,32
Artigo 9º II % do CDI	2,22 188,87	9,06 278,67	9,06 278,67	11,99 182,98	-13,25 -99,77	614.240,13	2.350.608,79
Artigo 9º III % do CDI	2,06 175,75	4,91 151,10	4,91 151,10	9,03 137,78	-6,55 -49,32	361.539,32	836.814,00
Artigo 10º I % do CDI	3,84 327,03	8,31 255,69	8,31 255,69	18,38 280,55	-1,60 -12,07	1.883.189,81	3.906.133,84
Artigo 10º II % do CDI	-0,49 -41,74	-6,25 -192,13	-6,25 -192,13	-7,89 -120,49	-8,15 -61,40	-51.217,31	-692.467,65
JACAREÍ (Total)						5.231.095,77	14.310.606,69

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%)	2.142.354,90	0,00	0,00	0,00	2.172.879,14	30.524,24	73.712,67
NTN-B 150523 (5,300000%)	2.179.057,70	0,00	0,00	0,00	2.210.277,22	31.219,52	75.438,15
NTN-B 150523 (5,420000%)	10.814.528,71	0,00	0,00	0,00	10.970.606,55	156.077,84	377.439,98
NTN-B 150523 (5,580000%)	3.244.188,28	0,00	0,00	0,00	3.291.464,30	47.276,02	114.447,77
NTN-B 150523 (5,850000%)	2.164.416,13	0,00	0,00	0,00	2.196.469,43	32.053,30	77.726,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150523 (5,860000%)	10.825.993,40	0,00	0,00	0,00	10.986.415,58	160.422,18	389.039,29
NTN-B 150523 (5,930000%)	5.360.845,47	0,00	0,00	0,00	5.440.606,64	79.761,17	193.515,97
NTN-B 150523 (6,560000%)	2.149.162,04	0,00	0,00	0,00	2.182.321,82	33.159,78	80.742,21
NTN-B 150525 (5,480000%)	2.148.807,05	0,00	0,00	0,00	2.179.934,26	31.127,21	75.302,01
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.048.927,69	0,00	0,00	0,00	1.064.424,15	15.496,46	37.569,96
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.178.606,58	0,00	0,00	0,00	2.208.972,87	30.366,29	73.157,82
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.174.919,49	0,00	0,00	0,00	2.205.274,11	30.354,62	73.137,56
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.173.914,63	0,00	0,00	0,00	2.204.312,98	30.398,35	73.256,56
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.161.768,42	0,00	0,00	0,00	2.192.542,99	30.774,57	74.309,71
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.162.298,77	0,00	0,00	0,00	2.193.259,81	30.961,04	74.806,04
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.161.236,68	0,00	0,00	0,00	2.192.238,74	31.002,06	74.922,72
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.016.188,44	0,00	0,00	0,00	2.046.023,96	29.835,52	72.341,85
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.155.264,92	0,00	0,00	0,00	3.202.005,73	46.740,81	113.345,53
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.188.141,56	0,00	0,00	0,00	2.218.856,64	30.715,08	74.048,12
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.185.430,07	0,00	0,00	0,00	2.216.124,98	30.694,91	74.006,04
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.181.208,59	0,00	0,00	0,00	2.211.939,59	30.731,00	74.121,43
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.167.854,59	0,00	0,00	0,00	2.198.885,27	31.030,68	74.973,08
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.166.769,60	0,00	0,00	0,00	2.197.889,67	31.120,07	75.215,70
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.165.150,72	0,00	0,00	0,00	2.196.324,06	31.173,34	75.364,48
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.090.616,51	0,00	0,00	0,00	5.165.919,28	75.302,77	182.586,82
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.103.017,71	0,00	0,00	0,00	2.134.180,69	31.162,98	75.571,66
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.022.960,54	0,00	0,00	0,00	2.053.003,51	30.042,97	72.870,67
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.180.912,91	0,00	0,00	0,00	6.272.799,19	91.886,28	222.905,76
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.017.021,17	0,00	0,00	0,00	2.047.019,25	29.998,08	72.774,46
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.532.644,20	0,00	0,00	0,00	4.600.919,04	68.274,84	165.848,86
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.572.179,69	0,00	0,00	0,00	3.626.347,62	54.167,93	131.675,29
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.007.820,47	0,00	0,00	0,00	3.053.495,73	45.675,26	53.499,64
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.049.928,79	0,00	0,00	0,00	2.081.271,11	31.342,32	76.250,38
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.191.811,56	0,00	0,00	0,00	2.222.633,47	30.821,91	74.327,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.186.795,32	0,00	0,00	0,00	2.217.605,79	30.810,47	74.311,38
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.181.806,05	0,00	0,00	0,00	2.212.603,52	30.797,47	74.295,84
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.169.933,03	0,00	0,00	0,00	2.201.050,46	31.117,43	75.198,75
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.170.767,46	0,00	0,00	0,00	2.202.001,36	31.233,90	75.506,90
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.168.621,19	0,00	0,00	0,00	2.199.919,65	31.298,46	75.688,48
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.159.879,59	0,00	0,00	0,00	2.191.241,50	31.361,91	75.891,90
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.206.657,63	0,00	0,00	0,00	11.372.440,69	165.783,06	401.952,95
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.101.293,87	0,00	0,00	0,00	2.132.430,98	31.137,11	75.510,14
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.046.679,70	0,00	0,00	0,00	5.121.622,33	74.942,63	181.786,48
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.019.513,39	0,00	0,00	0,00	2.049.557,07	30.043,68	72.887,33
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.478.729,99	0,00	0,00	0,00	16.724.204,91	245.474,92	595.632,14
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.060.513,02	0,00	0,00	0,00	9.196.987,51	136.474,49	331.518,11
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.158.367,15	0,00	0,00	0,00	8.282.114,17	123.747,02	300.817,48
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.017.597,31	0,00	0,00	0,00	7.124.085,01	106.487,70	124.736,82
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.129.799,29	0,00	0,00	0,00	5.208.230,46	78.431,17	190.810,74
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.118.064,71	0,00	0,00	0,00	2.148.493,64	30.428,93	74.537,23
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.147.749,99	0,00	0,00	0,00	2.178.802,42	31.052,43	76.122,12
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.102.052,05	0,00	0,00	0,00	2.133.296,28	31.244,23	76.824,05
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.150.128,43	0,00	0,00	0,00	2.180.382,29	30.253,86	73.916,62
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.150.594,18	0,00	0,00	0,00	2.181.084,31	30.490,13	74.558,46
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.150.852,34	0,00	0,00	0,00	2.181.459,30	30.606,96	74.880,38
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.152.058,86	0,00	0,00	0,00	2.183.250,41	31.191,55	76.474,02
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.147.534,42	0,00	0,00	0,00	3.193.760,18	46.225,76	113.508,81
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.164.670,70	0,00	0,00	0,00	2.194.825,86	30.155,16	73.570,02
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.154.740,77	0,00	0,00	0,00	2.185.280,35	30.539,58	74.668,69
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.156.242,01	0,00	0,00	0,00	2.187.020,07	30.778,06	75.315,24
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.153.330,62	0,00	0,00	0,00	2.184.122,81	30.792,19	75.367,67
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.152.688,19	0,00	0,00	0,00	3.199.264,24	46.576,05	114.442,93
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.171.980,19	0,00	0,00	0,00	2.202.254,72	30.274,53	73.854,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.166.886,00	0,00	0,00	0,00	2.197.167,05	30.281,05	73.892,61
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.157.398,08	0,00	0,00	0,00	2.188.075,57	30.677,49	75.023,88
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.158.579,94	0,00	0,00	0,00	2.189.448,99	30.869,05	75.543,94
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.159.033,82	0,00	0,00	0,00	2.189.964,83	30.931,01	75.714,62
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.154.933,46	0,00	0,00	0,00	2.186.185,09	31.251,63	76.612,13
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.153.891,33	0,00	0,00	0,00	3.200.554,98	46.663,65	114.673,26
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.184.016,63	0,00	0,00	0,00	2.214.634,88	30.618,25	74.695,40
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.174.729,30	0,00	0,00	0,00	2.205.256,16	30.526,86	74.483,09
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.176.442,78	0,00	0,00	0,00	2.207.088,31	30.645,53	74.806,45
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.165.673,72	0,00	0,00	0,00	2.196.650,25	30.976,53	75.778,23
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.166.039,39	0,00	0,00	0,00	2.197.091,40	31.052,01	75.981,87
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.163.129,97	0,00	0,00	0,00	2.194.234,52	31.104,55	76.142,81
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.019.121,44	0,00	0,00	0,00	2.049.000,48	29.879,04	73.416,03
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.152.775,94	0,00	0,00	0,00	3.199.480,89	46.704,95	114.772,47
NTN-B 150840 (6,220000%)	2.971.561,92	0,00	0,00	0,00	3.016.527,71	44.965,79	110.807,27
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.194.679,17	0,00	0,00	0,00	2.225.426,28	30.747,11	74.978,59
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.191.708,80	0,00	0,00	0,00	2.222.490,38	30.781,58	75.092,37
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.187.157,42	0,00	0,00	0,00	2.217.933,74	30.776,32	75.096,92
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.181.101,36	0,00	0,00	0,00	2.211.858,10	30.756,74	75.074,53
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.169.241,42	0,00	0,00	0,00	2.200.311,71	31.070,29	75.997,43
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.167.863,22	0,00	0,00	0,00	2.199.035,44	31.172,22	76.290,70
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.166.312,58	0,00	0,00	0,00	2.197.558,13	31.245,55	76.502,31
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.158.793,12	0,00	0,00	0,00	2.190.118,44	31.325,32	76.763,99
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.147.632,39	0,00	0,00	0,00	8.268.158,57	120.526,18	296.112,29
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.025.877,85	0,00	0,00	0,00	3.070.813,08	44.935,23	110.457,95
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.019.106,42	0,00	0,00	0,00	2.049.132,58	30.026,16	73.823,98
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.005.674,60	0,00	0,00	0,00	11.169.618,04	163.943,44	403.179,61
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.540.975,72	0,00	0,00	0,00	6.639.500,69	98.524,97	242.653,82
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.446.394,89	0,00	0,00	0,00	5.529.010,87	82.615,98	203.652,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.007.462,05	0,00	0,00	0,00	5.083.491,60	76.029,55	89.055,42
NTN-B 150850 (6,400000%)	2.985.887,21	0,00	0,00	0,00	3.031.539,70	45.652,49	112.660,12
					318.744.390,09	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	31.743.692,70	0,00	0,00	0,00	32.100.142,82	356.450,12	833.884,37
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	47.240.475,23	0,00	0,00	0,00	47.788.448,33	547.973,10	1.674.531,58
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	32.327.021,13	9.860.500,00	-10.497.000,00	0,00	32.045.500,25	354.979,12	889.418,11
					111.934.091,40	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	5.637.462,84	0,00	0,00	0,00	5.722.182,59	84.719,75	215.959,49
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.149.323,21	0,00	0,00	0,00	5.208.490,30	59.167,09	165.432,72
					10.930.672,89	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	6.272,49	0,00	0,00	0,00	4.201,03	-2.071,46	-3.282,31
					4.201,03	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	3.168.732,35	0,00	0,00	0,00	3.206.087,16	37.354,81	101.466,63
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	2.061.750,72	0,00	0,00	0,00	2.081.542,55	19.791,83	28.129,71
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	5.426.488,89	0,00	0,00	0,00	5.482.253,37	55.764,48	109.488,66
					10.769.883,08	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	6.631.290,48	0,00	0,00	0,00	6.439.632,10	-191.658,38	-409.812,11
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.800.159,47	0,00	0,00	0,00	4.535.489,44	-264.670,03	-358.964,67
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	2.828.328,87	0,00	0,00	0,00	2.798.851,44	-29.477,43	-165.247,77
INDIE FIC FIA	3.045.797,89	0,00	0,00	0,00	2.923.659,93	-122.137,96	-282.806,89
META VALOR FI DE AÇÕES	2.166.381,55	0,00	0,00	0,00	2.023.982,46	-142.399,09	-248.149,88
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	23.980.026,57	0,00	0,00	0,00	22.784.772,46	-1.195.254,11	-2.587.841,38
OCCAM FIC FIA	28.069.014,93	0,00	0,00	0,00	27.283.644,99	-785.369,94	-1.912.932,54
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	4.055.170,81	0,00	0,00	0,00	3.764.285,53	-290.885,28	-330.913,50
TARPON GT 30 FIC FIA	6.730.923,99	0,00	0,00	0,00	6.456.673,35	-274.250,64	-290.358,42
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	6.393.573,50	0,00	0,00	0,00	5.990.172,62	-403.400,88	-453.059,17
					85.001.164,32	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	13.066.429,63	0,00	0,00	0,00	13.748.947,58	682.517,95	1.715.324,20
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.738.332,57	0,00	0,00	0,00	1.716.422,14	-21.910,43	166.781,02
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.873.091,98	0,00	0,00	0,00	2.772.120,69	-100.971,29	-48.556,86
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.532.777,56	0,00	0,00	0,00	2.484.938,25	-47.839,31	41.332,88
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.414.845,78	0,00	0,00	0,00	2.473.032,30	58.186,52	327.441,89
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	5.061.066,32	0,00	0,00	0,00	5.105.323,01	44.256,69	148.285,66
					28.300.783,97	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	17.512.513,34	0,00	0,00	0,00	17.874.052,66	361.539,32	836.814,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					17.874.052,66	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	26.240.353,02	0,00	0,00	0,00	27.326.290,18	1.085.937,16	2.223.240,58
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	6.938.888,14	0,00	0,00	0,00	7.100.926,26	162.038,12	353.585,25
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	15.842.196,12	0,00	0,00	0,00	16.477.410,65	635.214,53	1.329.308,01
					50.904.627,09	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	10.430.896,65	0,00	0,00	0,00	10.379.495,80	-51.400,85	-692.839,50
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	15.463,49	0,00	0,00	0,00	15.647,03	183,55	371,85
					10.395.142,83	0,00	0,00

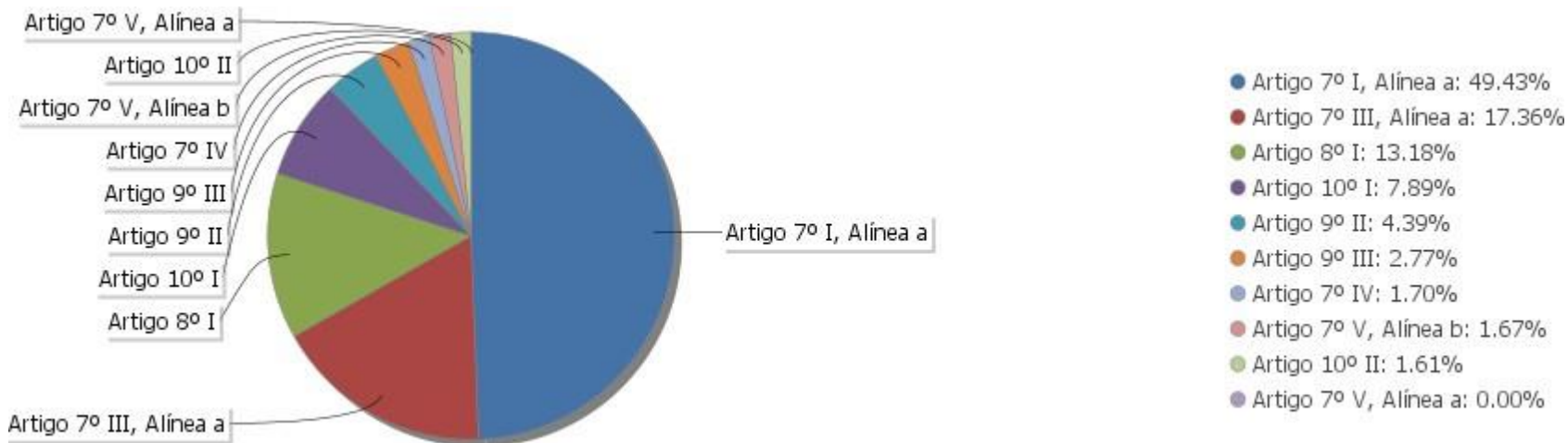
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

6. Análise de Liquidez

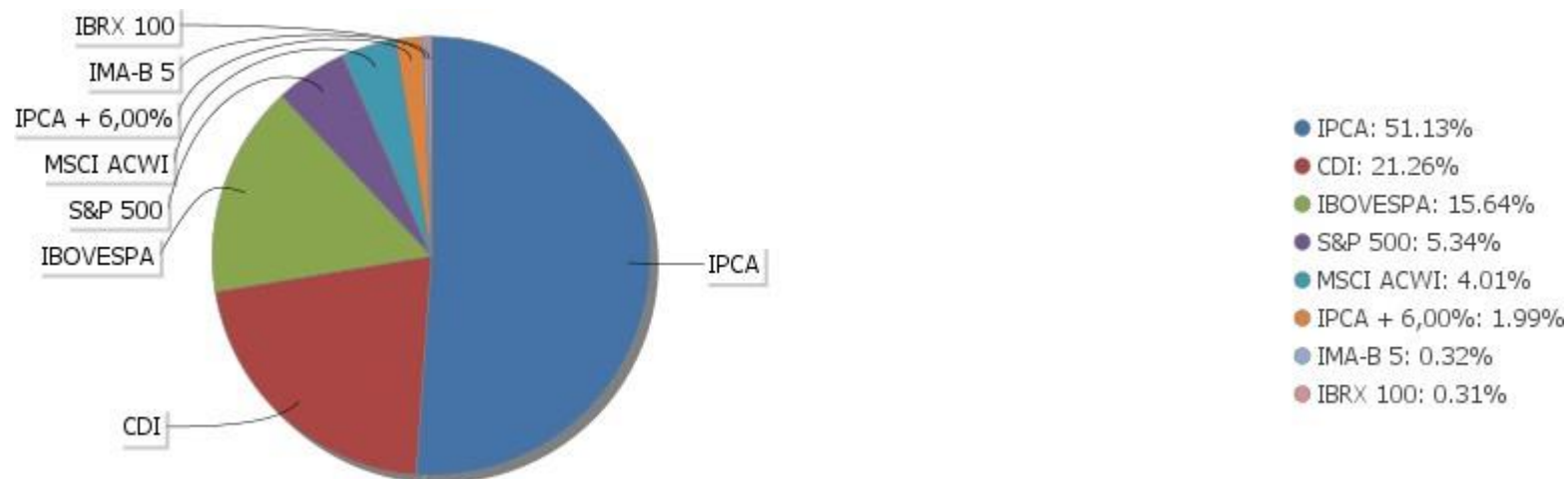
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	255.550.545,81	39,63	255.550.545,81	39,63	
de 31 dias a 365 dias	88.704.945,45	13,76	344.255.491,26	53,38	
acima de 365 dias	300.603.518,14	46,62	644.859.009,36	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

7. Alocação por Artigo

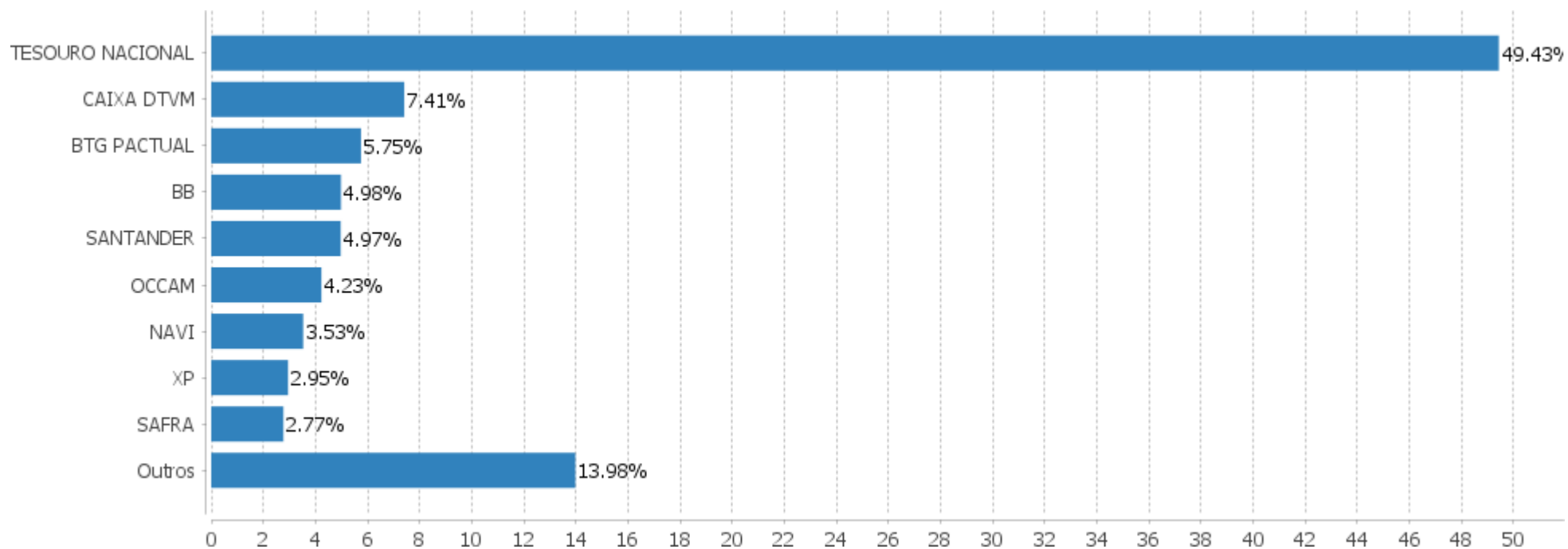


8. Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

9. Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

10. 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	0,82										2,28
IPCA + 5,11%	0,97	1,20	1,17										3,37
p.p. indexador	0,97	-1,68	-0,35										-1,10
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

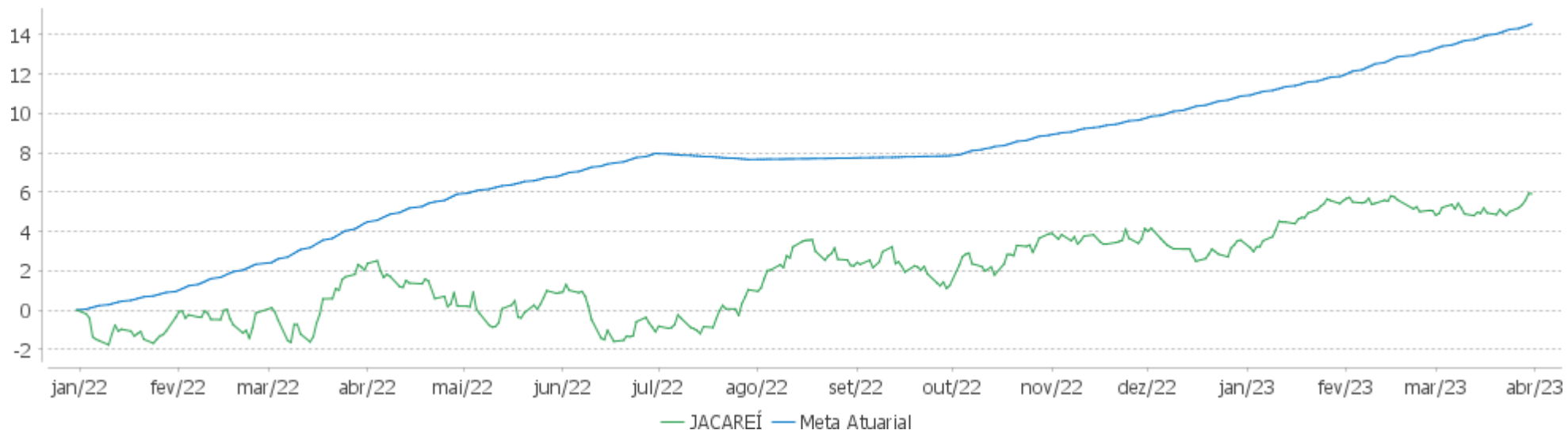
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	5	33,33	03 meses	2,28	3,37	-1,10	3,05
Meses abaixo - Meta Atuarial	10	66,67	06 meses	4,61	6,28	-1,68	3,93
			12 meses	3,80	9,78	-5,97	4,88
			24 meses				
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	2,60	2022-10	Desde 31/12/2021	5,91	14,61	-8,71	5,18
Menor rentabilidade da Carteira	-1,97	2022-06					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

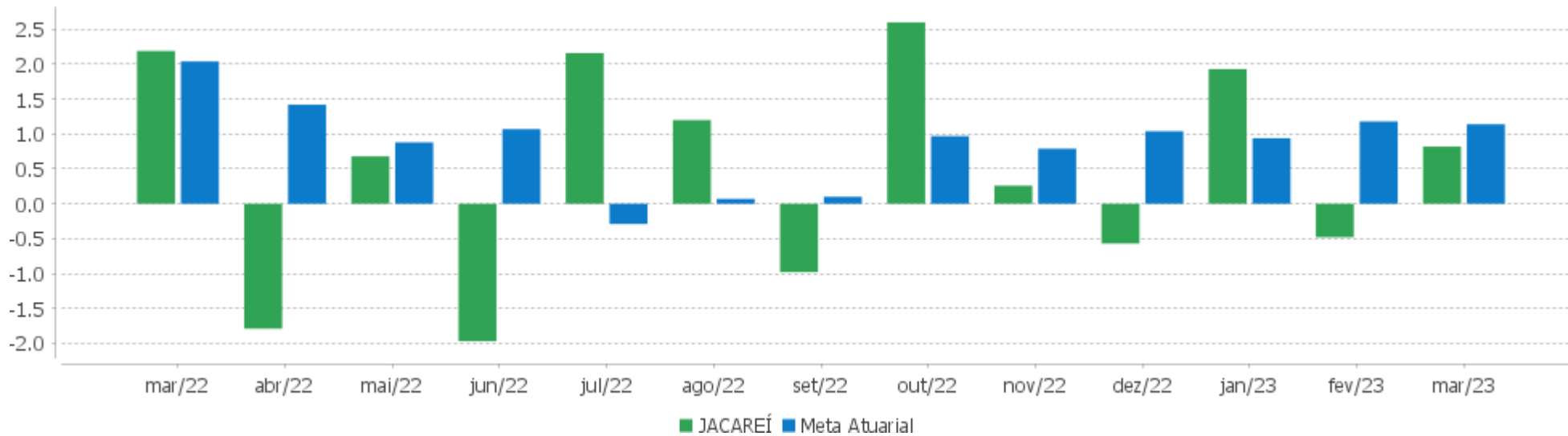


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

11. 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.	1,15 0,44	3,28 1,19	3,28 1,19				
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	1,50 0,79	3,92 1,83	3,92 1,83	6,89 3,13			
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,03 87,48	2,04 62,69	2,04 62,69	5,50 83,95	12,53 94,32	21,76 105,95	27,35 117,75
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	0,96 -0,56	1,37 -3,01	1,37 -3,01	3,91 -3,11	8,30 -2,09	17,76 -2,25	30,74 0,54
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	1,18 100,36	3,27 100,54	3,27 100,54	6,70 102,27	13,83 104,17	22,54 109,70	23,89 102,87
NTN-B 150523 (5,930000%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,69 1,59	3,69 1,59	6,32 2,56	11,58 6,93		
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	1,51 0,80	3,74 1,65	3,74 1,65	6,42 2,67	8,54 3,89		
NTN-B 150523 (6,560000%) Var. IPCA p.p.	1,54 0,83	3,84 1,75	3,84 1,75	6,63 2,88	12,24 7,59		
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,68 1,59	3,68 1,59	6,30 2,55	8,39 3,74		
NTN-B 150523 (5,210000%) Var. IPCA p.p.	1,42 0,71	3,51 1,42	3,51 1,42	5,96 2,20	10,82 6,17		
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	1,45 0,74	3,58 1,48	3,58 1,48	6,10 2,34	11,10 6,45		
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	1,42 0,71	3,49 1,40	3,49 1,40	5,92 2,16	10,73 6,08		
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,69 1,60	3,69 1,60	6,33 2,57	11,60 6,95		
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,48 0,77	3,67 1,58	3,67 1,58	6,29 2,53	11,50 6,85		
NTN-B 150545 (5,915000%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,68 1,59	3,68 1,59	6,31 2,56	11,56 6,91		
NTN-B 150850 (5,831200%) Var. IPCA p.p.	1,48 0,77	3,66 1,57	3,66 1,57	6,27 2,51	11,47 6,82		
NTN-B 150826 (5,190000%)	1,42	3,51	3,51	5,95	10,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	1º Mês	2º Mês	3º Mês	6º Mês	12º Mês	24º Mês	36º Mês
Var. IPCA p.p.	0,71	1,41	1,41	2,19	6,15		
NTN-B 150830 (5,270000%)	1,43	3,53	3,53	5,99	10,88		
Var. IPCA p.p.	0,72	1,43	1,43	2,23	6,23		
NTN-B 150840 (5,837000%)	1,48	3,67	3,67	6,27	11,48		
Var. IPCA p.p.	0,77	1,57	1,57	2,52	6,83		
NTN-B 150545 (4,970000%)	1,40	3,45	3,45	5,84	10,57		
Var. IPCA p.p.	0,69	1,36	1,36	2,08	5,92		
NTN-B 150840 (4,950000%)	1,40	3,45	3,45	5,83	10,55		
Var. IPCA p.p.	0,69	1,35	1,35	2,07	5,90		
NTN-B 150850 (4,980000%)	1,40	3,45	3,45	5,85	10,58		
Var. IPCA p.p.	0,69	1,36	1,36	2,09	5,93		
NTN-B 150850 (5,360000%)	1,44	3,55	3,55	6,04	10,98		
Var. IPCA p.p.	0,73	1,45	1,45	2,28	6,33		
NTN-B 150555 (5,927000%)	1,49	3,69	3,69	6,32	11,58		
Var. IPCA p.p.	0,78	1,59	1,59	2,56	6,92		
NTN-B 150545 (5,922000%)	1,49	3,69	3,69	6,32	11,57		
Var. IPCA p.p.	0,78	1,59	1,59	2,56	6,92		
NTN-B 150535 (4,910000%)	1,40	3,44	3,44	5,81	10,50		
Var. IPCA p.p.	0,69	1,34	1,34	2,05	5,85		
NTN-B 150840 (5,020000%)	1,41	3,46	3,46	5,87	10,62		
Var. IPCA p.p.	0,70	1,37	1,37	2,11	5,97		
NTN-B 150555 (5,370000%)	1,44	3,55	3,55	6,04	10,99		
Var. IPCA p.p.	0,73	1,46	1,46	2,28	6,34		
NTN-B 150850 (4,940000%)	1,40	3,45	3,45	5,83	10,54		
Var. IPCA p.p.	0,69	1,35	1,35	2,07	5,88		
NTN-B 150826 (5,490000%)	1,45	3,58	3,58	6,10	11,11		
Var. IPCA p.p.	0,74	1,49	1,49	2,34	6,46		
NTN-B 150840 (4,970000%)	1,40	3,45	3,45	5,84	10,57		
Var. IPCA p.p.	0,69	1,36	1,36	2,08	5,92		
NTN-B 150545 (6,280000%)	1,52	3,77	3,77	3,34	5,42		
Var. IPCA p.p.	0,81	1,68	1,68	-0,41	0,77		
NTN-B 150850 (6,261000%)	1,52	3,77	3,77	6,48	11,93		
Var. IPCA p.p.	0,81	1,68	1,68	2,73	7,28		
NTN-B 150555 (5,000000%)	1,41	3,46	3,46	5,86	10,60		
Var. IPCA p.p.	0,70	1,37	1,37	2,10	5,95		
NTN-B 150535 (5,320000%)	1,43	3,54	3,54	6,02	10,94		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	1º Mês	2º Mês	3º Mês	6º Mês	12º Mês	24º Mês	36º Mês
Var. IPCA p.p.	0,72	1,44	1,44	2,26	6,29		
NTN-B 150850 (5,010000%)	1,41	3,46	3,46	5,86	10,61		
Var. IPCA p.p.	0,70	1,37	1,37	2,10	5,96		
NTN-B 150545 (6,256000%)	1,52	3,77	3,77	6,48	11,92		
Var. IPCA p.p.	0,81	1,67	1,67	2,73	7,27		
NTN-B 150555 (6,261000%)	1,52	3,77	3,77	6,48	11,93		
Var. IPCA p.p.	0,81	1,68	1,68	2,73	7,28		
NTN-B 150523 (5,300000%)	1,43	3,53	3,53	6,01	10,91		
Var. IPCA p.p.	0,72	1,44	1,44	2,25	6,26		
NTN-B 150555 (5,520000%)	1,45	3,59	3,59	6,12	11,15		
Var. IPCA p.p.	0,74	1,49	1,49	2,36	6,50		
NTN-B 150555 (5,860000%)	1,48	3,67	3,67	6,29	11,50		
Var. IPCA p.p.	0,77	1,58	1,58	2,53	6,85		
NTN-B 150545 (5,380000%)	1,44	3,55	3,55	6,05	11,00		
Var. IPCA p.p.	0,73	1,46	1,46	2,29	6,35		
NTN-B 150826 (5,009000%)	1,41	3,46	3,46	5,86	10,61		
Var. IPCA p.p.	0,70	1,37	1,37	2,10	5,96		
NTN-B 150545 (6,400000%)	1,53	3,80	3,80	3,36	5,45		
Var. IPCA p.p.	0,82	1,71	1,71	-0,40	0,80		
NTN-B 150555 (5,831200%)	1,48	3,66	3,66	6,27	11,47		
Var. IPCA p.p.	0,77	1,57	1,57	2,51	6,82		
NTN-B 150535 (5,855000%)	1,48	3,67	3,67	6,28	11,50		
Var. IPCA p.p.	0,77	1,58	1,58	2,53	6,85		
NTN-B 150828 (4,850000%)	1,39	3,42	3,42	5,78	10,44		
Var. IPCA p.p.	0,68	1,33	1,33	2,02	5,79		
NTN-B 150545 (5,831000%)	1,48	3,66	3,66	6,27	11,47		
Var. IPCA p.p.	0,77	1,57	1,57	2,51	6,82		
NTN-B 150555 (6,400000%)	1,53	3,80	3,80	3,34	5,40		
Var. IPCA p.p.	0,82	1,71	1,71	-0,42	0,75		
NTN-B 150828 (5,240000%)	1,43	3,52	3,52	5,98	10,85		
Var. IPCA p.p.	0,72	1,43	1,43	2,22	6,20		
NTN-B 150545 (5,340000%)	1,44	3,54	3,54	6,03	10,96		
Var. IPCA p.p.	0,73	1,45	1,45	2,27	6,31		
NTN-B 150523 (5,850000%)	1,48	3,67	3,67	6,28	11,49		
Var. IPCA p.p.	0,77	1,57	1,57	2,52	6,84		
NTN-B 150850 (5,921000%)	1,49	3,69	3,69	6,32	11,57		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	1º Mês	2º Mês	3º Mês	6º Mês	12º Mês	24º Mês	36º Mês
Var. IPCA p.p.	0,78	1,59	1,59	2,56	6,92		
NTN-B 150523 (5,420000%)	1,44	3,56	3,56	6,07	11,04		
Var. IPCA p.p.	0,73	1,47	1,47	2,31	6,39		
NTN-B 150555 (6,268000%)	1,52	3,77	3,77	3,33	5,39		
Var. IPCA p.p.	0,81	1,68	1,68	-0,43	0,74		
NTN-B 150826 (5,710000%)	1,47	3,63	3,63	6,21	11,35		
Var. IPCA p.p.	0,76	1,54	1,54	2,45	6,70		
NTN-B 150535 (4,860000%)	1,39	3,43	3,43	5,79	10,45		
Var. IPCA p.p.	0,68	1,33	1,33	2,03	5,80		
NTN-B 150555 (6,140000%)	1,51	3,74	3,74	6,42	8,54		
Var. IPCA p.p.	0,80	1,65	1,65	2,67	3,89		
NTN-B 150828 (5,270000%)	1,43	3,53	3,53	5,99	10,88		
Var. IPCA p.p.	0,72	1,43	1,43	2,23	6,23		
NTN-B 150535 (5,290000%)	1,43	3,53	3,53	6,00	10,90		
Var. IPCA p.p.	0,72	1,44	1,44	2,24	6,25		
NTN-B 150830 (5,835000%)	1,48	3,66	3,66	6,27	11,48		
Var. IPCA p.p.	0,77	1,57	1,57	2,52	6,83		
NTN-B 150555 (5,315000%)	1,43	3,54	3,54	6,01	10,93		
Var. IPCA p.p.	0,72	1,44	1,44	2,26	6,28		
NTN-B 150535 (5,837000%)	1,48	3,67	3,67	6,27	11,48		
Var. IPCA p.p.	0,77	1,57	1,57	2,52	6,83		
NTN-B 150830 (5,300000%)	1,43	3,53	3,53	6,01	10,91		
Var. IPCA p.p.	0,72	1,44	1,44	2,25	6,26		
NTN-B 150830 (5,500000%)	1,45	3,58	3,58	6,11	11,13		
Var. IPCA p.p.	0,74	1,49	1,49	2,35	6,47		
NTN-B 150545 (5,285000%)	1,43	3,53	3,53	6,00	10,90		
Var. IPCA p.p.	0,72	1,44	1,44	2,24	6,25		
NTN-B 150830 (5,178300%)	1,42	3,50	3,50	5,95	10,79		
Var. IPCA p.p.	0,71	1,41	1,41	2,19	6,14		
NTN-B 150824 (5,450000%)	1,45	3,57	3,57	6,08	11,07		
Var. IPCA p.p.	0,74	1,48	1,48	2,32	6,42		
NTN-B 150523 (5,580000%)	1,46	3,60	3,60	6,15	11,21		
Var. IPCA p.p.	0,75	1,51	1,51	2,39	6,56		
NTN-B 150545 (5,897000%)	1,49	3,68	3,68	6,30	8,39		
Var. IPCA p.p.	0,78	1,59	1,59	2,55	3,74		
NTN-B 150545 (5,030000%)	1,41	3,47	3,47	5,87	10,63		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	1º Mês	2º Mês	3º Mês	6º Mês	12º Mês	24º Mês	36º Mês
Var. IPCA p.p.	0,70	1,37	1,37	2,11	5,98		
NTN-B 150850 (6,400000%)	1,53	3,80	3,80	6,55	8,70		
Var. IPCA p.p.	0,82	1,71	1,71	2,80	4,05		
NTN-B 150824 (5,912000%)	1,49	3,68	3,68	6,31	11,56		
Var. IPCA p.p.	0,78	1,59	1,59	2,55	6,91		
NTN-B 150850 (5,045000%)	1,41	3,47	3,47	5,88	10,65		
Var. IPCA p.p.	0,70	1,38	1,38	2,12	6,00		
NTN-B 150555 (5,030000%)	1,41	3,47	3,47	5,87	10,63		
Var. IPCA p.p.	0,70	1,37	1,37	2,11	5,98		
NTN-B 150840 (5,274000%)	1,43	3,53	3,53	5,99	10,89		
Var. IPCA p.p.	0,72	1,43	1,43	2,24	6,24		
NTN-B 150826 (5,130000%)	1,42	3,49	3,49	5,92	10,74		
Var. IPCA p.p.	0,71	1,40	1,40	2,16	6,08		
NTN-B 150840 (5,360000%)	1,44	3,55	3,55	6,04	10,98		
Var. IPCA p.p.	0,73	1,45	1,45	2,28	6,33		
NTN-B 150850 (5,410000%)	1,44	3,56	3,56	6,06	11,03		
Var. IPCA p.p.	0,73	1,47	1,47	2,30	6,38		
NTN-B 150840 (5,855000%)	1,48	3,67	3,67	6,28	11,50		
Var. IPCA p.p.	0,77	1,58	1,58	2,53	6,85		
NTN-B 150545 (4,980000%)	1,40	3,45	3,45	5,85	10,58		
Var. IPCA p.p.	0,69	1,36	1,36	2,09	5,93		
NTN-B 150830 (4,860000%)	1,39	3,43	3,43	5,79	10,45		
Var. IPCA p.p.	0,68	1,33	1,33	2,03	5,80		
NTN-B 150840 (5,310000%)	1,43	3,54	3,54	6,01	10,93		
Var. IPCA p.p.	0,72	1,44	1,44	2,25	6,27		
NTN-B 150824 (5,345000%)	1,44	3,54	3,54	6,03	10,96		
Var. IPCA p.p.	0,73	1,45	1,45	2,27	6,31		
NTN-B 150545 (6,140000%)	1,51	3,74	3,74	6,42	8,54		
Var. IPCA p.p.	0,80	1,65	1,65	2,67	3,89		
NTN-B 150830 (4,900000%)	1,40	3,44	3,44	5,81	10,49		
Var. IPCA p.p.	0,69	1,34	1,34	2,05	5,84		
NTN-B 150850 (5,295500%)	1,43	3,53	3,53	6,00	10,91		
Var. IPCA p.p.	0,72	1,44	1,44	2,25	6,26		
NTN-B 150535 (4,880000%)	1,40	3,43	3,43	5,80	10,47		
Var. IPCA p.p.	0,69	1,34	1,34	2,04	5,82		
NTN-B 150555 (5,420000%)	1,44	3,56	3,56	6,07	11,04		

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.	0,73	1,47	1,47	2,31	6,39		
NTN-B 150850 (5,510000%) Var. IPCA p.p.	1,45 0,74	3,59 1,49	3,59 1,49	6,11 2,35	11,14 6,49		
NTN-B 150850 (6,278000%) Var. IPCA p.p.	1,52 0,81	0,70 -1,40	0,70 -1,40	3,34 -0,42	5,40 0,75		
NTN-B 150555 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,48 0,77	3,68 1,59	3,68 1,59	6,30 2,55	8,39 3,74		
NTN-B 150840 (6,220000%) Var. IPCA p.p.	1,51 0,80	3,76 1,67	3,76 1,67	6,46 2,71	11,88 7,23		
NTN-B 150523 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,48 0,77	3,67 1,58	3,67 1,58	6,29 2,53	11,50 6,85		
NTN-B 150555 (5,060000%) Var. IPCA p.p.	1,41 0,70	3,47 1,38	3,47 1,38	5,89 2,13	10,66 6,01		
NTN-B 150555 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,69 1,60	3,69 1,60	6,33 2,57	11,60 6,95		
NTN-B 150828 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	1,48 0,77	3,66 1,56	3,66 1,56	6,26 2,50	11,45 6,80		
NTN-B 150525 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	1,48 0,77	3,66 1,56	3,66 1,56	6,26 2,50	11,45 6,80		
NTN-B 150535 (5,196100%) Var. IPCA p.p.	1,42 0,71	3,51 1,41	3,51 1,41	5,95 2,20	10,81 6,15		
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III % do CDI	-33,02 -2.811,38	-43,86 -1.349,36	-43,86 -1.349,36	-40,20 -613,43	-86,39 -650,55	59,24 288,38	4.700,35 20.236,65
BB INSTITUCIONAL FI RF % do CDI	1,12 95,59	2,67 82,05	2,67 82,05	5,99 91,47	12,84 96,70	20,67 100,60	23,81 102,52
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,16 98,75	3,08 94,86	3,08 94,86	6,38 97,40	13,21 99,49	21,04 102,44	23,63 101,72
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,13 96,28	3,02 92,82	3,02 92,82	6,38 97,44	13,33 100,39	21,44 104,38	23,93 103,04
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,51 -2,61	-7,33 -0,18	-7,33 -0,18	-11,01 -3,60	-19,61 -4,51	-38,85 -26,21	0,46 -39,07
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,31 -3,40	-7,03 0,12	-7,03 0,12	-4,59 2,82	-1,88 13,21	17,82 30,47	
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,07 -1,17	-4,30 2,85	-4,30 2,85	-9,08 -1,67	-4,37 10,73	22,71 35,36	137,12 97,59
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	-4,98	-10,20	-10,20	-12,16	-11,61	-6,84	42,57

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.	-2,08	-3,04	-3,04	-4,75	3,49	5,81	3,04
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,04 1,86	-5,57 1,58	-5,57 1,58	-10,49 -3,07	-7,99 7,11	9,54 22,19	
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,17 -4,27	-8,08 -0,92	-8,08 -0,92	-14,06 -6,65	-25,70 -10,60	-29,79 -17,14	36,04 -3,48
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,01 -1,10	-8,82 -1,66	-8,82 -1,66	-13,34 -5,93	-24,46 -9,36	-41,06 -28,41	-1,40 -40,93
META VALOR FI DE AÇÕES Var. IBRX 100 p.p.	-6,57 -3,51	-10,92 -3,65	-10,92 -3,65	-14,86 -7,22	-24,19 -8,15	-30,09 -16,39	18,52 -21,43
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,80 0,11	-6,55 0,60	-6,55 0,60	-8,00 -0,59	-12,63 2,47	-12,41 0,24	37,89 -1,64
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-2,89 0,02	-5,98 1,17	-5,98 1,17	-12,42 -5,01	-24,66 -9,56	-29,46 -16,81	20,35 -19,18
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	2,06 4,97	4,91 12,07	4,91 12,07	9,03 16,44	-6,55 8,55	-12,42 0,23	39,36 -0,17
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-3,51 -3,82	-1,72 -5,75	-1,72 -5,75	2,52 -7,31	6,33 8,87	-30,52 -16,18	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	5,22 4,92	14,25 10,23	14,25 10,23	17,10 7,28	-15,97 -13,43	-15,71 -1,37	37,98 -4,91
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	0,87 0,57	2,99 -1,03	2,99 -1,03	13,58 3,75	0,45 2,98	-9,85 4,49	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-1,26 -1,57	10,76 6,74	10,76 6,74	-4,78 -14,61	-33,93 -31,40	-58,22 -43,88	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,41 1,16	15,26 11,67	15,26 11,67	17,34 10,54	-7,32 -18,25	-36,51 -67,38	14,12 -32,99
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-1,89 -2,19	1,69 -2,33	1,69 -2,33	2,66 -7,16	-24,83 -22,30	-36,50 -22,16	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	2,34 1,36	5,24 1,03	5,24 1,03				
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	4,01 341,34	8,78 269,97	8,78 269,97	19,29 294,43	-1,37 -10,33	18,91 92,03	80,48 346,51
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	4,14 3,17	8,86 4,65	8,86 4,65	19,71 12,02	3,14 5,87	25,17 32,94	
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,49 -1,74	-6,26 -9,85	-6,26 -9,85	-7,91 -14,71	-9,67 -20,60	9,79 -21,08	38,21 -8,91
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	1,19	2,43	2,43	3,22	14,14	102,64	-99,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	101,04	74,89	74,89	49,07	106,48	499,64	-427,39
JACAREÍ	0,82	2,28	2,28	4,61	3,80		
Var. IPCA + 4,83% p.p.	-0,35	-1,10	-1,10	-1,75	-6,19		
CDI	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23
IBOVESPA	-2,91	-7,16	-7,16	-7,41	-15,10	-12,65	39,53
INPC + 6,00%	1,18	3,38	3,38	6,49	10,62	31,02	48,44
IPCA + 6,00%	1,25	3,59	3,59	6,80	10,93	30,87	47,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

12. 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

13. 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	1,23	3,35	3,35	6,61	13,19	19,00	21,98	30,11	38,81
IRF-M 1+	2,67	4,23	4,23	5,37	11,08	11,70	13,73	28,47	41,59
IRF-M TOTAL	2,15	3,89	3,89	5,70	11,55	13,99	16,56	29,49	41,33
IMA-B 5	1,52	4,38	4,38	7,03	10,38	20,01	30,21	42,37	55,45
IMA-B 5+	3,73	3,61	3,61	1,83	5,03	5,39	18,05	27,77	49,85
IMA-B TOTAL	2,66	3,98	3,98	4,22	7,51	12,36	24,02	35,36	53,92
IMA-GERAL TOTAL	1,86	3,63	3,63	5,42	10,83	16,27	22,06	32,40	45,00
IDKA 2	1,58	4,71	4,71	7,06	10,21	20,24	30,55	42,44	55,53
IDKA 20	6,29	2,22	2,22	-3,57	-0,11	-7,62	6,42	12,74	41,71
CDI	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23	29,94	38,18

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,91	-7,16	-7,16	-7,41	-15,10	-12,65	39,53	6,78	19,35
IBRX 100	-3,07	-7,27	-7,27	-7,64	-16,05	-13,70	39,95	8,87	22,66
IBRX 50	-3,50	-7,76	-7,76	-7,41	-15,56	-12,07	44,85	7,72	19,11
SMALL CAP	-1,74	-9,51	-9,51	-16,40	-27,95	-35,01	6,96	-5,85	5,23
Índice Consumo - ICON	-5,95			-24,62	-38,13	-49,63	-23,97	-29,27	-29,77
Índice Dividendos - IDIV	-2,02	-4,08	-4,08	-1,06	-6,43	4,48	45,59	34,27	52,68

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	0,97	4,21	4,21	7,69	-2,74	-7,77	55,37	89,02	137,84

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,69	-3,70	-3,70	-7,68	-0,68	-3,01	10,70	11,20	17,11

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,30	4,02	4,02	9,83	-2,53	-14,34	42,88	65,81	95,59

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,71	2,09	2,09	3,76	4,65	16,48	23,58	27,66	33,50
INPC	0,64	1,88	1,88	3,46	4,36	16,60	24,69	28,82	34,84
IGPM	0,05	0,20	0,20	-0,89	0,17	14,96	50,71	60,97	74,28
SELIC	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23	29,94	38,19

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,07	3,10	3,10	5,80	8,84	25,98	38,97	49,35	62,38
IPCA + 5,00%	1,16	3,35	3,35	6,30	9,88	28,41	43,00	55,17	70,32
IPCA + 5,50%	1,20	3,47	3,47	6,55	10,41	29,64	45,05	58,15	74,41
IPCA + 5,89%	1,24	3,56	3,56	6,74	10,81	30,60	46,66	60,50	77,65
IPCA + 6,00%	1,25	3,59	3,59	6,80	10,93	30,87	47,12	61,17	78,57
INPC + 4,00%	1,00	2,89	2,89	5,49	8,54	26,12	40,22	50,70	64,00
INPC + 6,00%	1,18	3,38	3,38	6,49	10,62	31,02	48,44	62,64	80,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

14. Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
50	01/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	42.000,00	0,00	186,04888000	225,7471270000
55	01/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	959.000,00	4.248,11608000	225,7471270000
65	01/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,85947100	225,7471270000
56	03/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	13,27500900	225,9885545000
66	03/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,85000600	225,9885545000
57	07/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	138.918,86	614,14647200	226,1982549000
58	07/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	39.081,14	172,77387100	226,1982549000
67	07/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	13,26270200	226,1982549000
59	10/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	409.000,00	1.805,55758500	226,5228224000
68	10/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	31.000,00	136,85155300	226,5228224000
69	13/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,41247000	226,6304792000
70	14/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	28.000,00	123,48742800	226,7437299000
60	15/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	5.000,00	22,03998700	226,8603943000
71	15/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	12.000,00	52,89596800	226,8603943000
61	20/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	10.500,00	46,21440400	227,2018951000
72	20/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	14.000,00	61,61920500	227,2018951000
62	24/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	47.000,00	206,48003500	227,6249136000
73	24/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	94.000,00	412,96006900	227,6249136000
74	27/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	13,17441300	227,7141391000
75	28/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,77858800	227,8270969000
51	29/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	292.000,00	0,00	1.281,02260800	227,9428936000
76	29/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	78.000,00	342,19097100	227,9428936000
52	30/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	8.839.000,00	0,00	38.756,35940400	228,0657971000
77	30/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	28.000,00	122,77158800	228,0657971000
53	31/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	4.000,00	0,00	17,52947800	228,1870581000
54	31/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	683.500,00	0,00	2.995,34954300	228,1870581000
63	31/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	8.583.000,00	37.613,87727900	228,1870581000
64	31/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.500,00	15,33829400	228,1870581000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
78	31/03/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,38237000	228,1870581000
Total			9.860.500,00	10.497.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

15. Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.160.634,03

Value-At-Risk: 1,42%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
JACAREÍ		1,42	1,42			644.859.009,36	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,06%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,210000%)		0,10	-0,00	0,13			2.172.879,14	0,34
NTN-B 150523 (5,300000%)		0,10	-0,00	0,13			2.210.277,22	0,34
NTN-B 150523 (5,420000%)		0,11	-0,00	0,13			10.970.606,55	1,70
NTN-B 150523 (5,580000%)		0,11	-0,00	0,14			3.291.464,30	0,51
NTN-B 150523 (5,850000%)		0,11	-0,00	0,14			2.196.469,43	0,34
NTN-B 150523 (5,860000%)		0,11	-0,00	0,14			10.986.415,58	1,70
NTN-B 150523 (5,930000%)		0,11	-0,00	0,14			5.440.606,64	0,84
NTN-B 150523 (6,560000%)		0,13	-0,00	0,15			2.182.321,82	0,34
NTN-B 150525 (5,480000%)		0,07	0,00	0,10			2.179.934,26	0,34
NTN-B 150525 (5,810000%)		0,07	0,00	0,10			1.064.424,15	0,17
NTN-B 150535 (4,860000%)		0,10	-0,00	0,12			2.208.972,87	0,34
NTN-B 150535 (4,880000%)		0,10	-0,00	0,12			2.205.274,11	0,34
NTN-B 150535 (4,910000%)		0,10	-0,00	0,13			2.204.312,98	0,34
NTN-B 150535 (5,196100%)		0,10	-0,00	0,13			2.192.542,99	0,34
NTN-B 150535 (5,290000%)		0,10	-0,00	0,13			2.193.259,81	0,34
NTN-B 150535 (5,320000%)		0,10	-0,00	0,13			2.192.238,74	0,34
NTN-B 150535 (5,837000%)		0,11	-0,00	0,14			2.046.023,96	0,32
NTN-B 150535 (5,855000%)		0,11	-0,00	0,14			3.202.005,73	0,50
NTN-B 150545 (4,970000%)		0,10	-0,00	0,13			2.218.856,64	0,34
NTN-B 150545 (4,980000%)		0,10	-0,00	0,13			2.216.124,98	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%)		0,10	-0,00	0,13			2.211.939,59	0,34
NTN-B 150545 (5,285000%)		0,10	-0,00	0,13			2.198.885,27	0,34
NTN-B 150545 (5,340000%)		0,10	-0,00	0,13			2.197.889,67	0,34
NTN-B 150545 (5,380000%)		0,11	-0,00	0,13			2.196.324,06	0,34
NTN-B 150545 (5,831000%)		0,11	-0,00	0,14			5.165.919,28	0,80
NTN-B 150545 (5,860000%)		0,11	-0,00	0,14			2.134.180,69	0,33
NTN-B 150545 (5,897000%)		0,07	0,00	0,10			2.053.003,51	0,32
NTN-B 150545 (5,915000%)		0,11	-0,00	0,14			6.272.799,19	0,97
NTN-B 150545 (5,922000%)		0,11	-0,00	0,14			2.047.019,25	0,32
NTN-B 150545 (6,140000%)		0,07	0,00	0,10			4.600.919,04	0,71
NTN-B 150545 (6,256000%)		0,12	-0,00	0,14			3.626.347,62	0,56
NTN-B 150545 (6,280000%)		0,21	0,00	0,22			3.053.495,73	0,47
NTN-B 150545 (6,400000%)		0,21	0,00	0,22			2.081.271,11	0,32
NTN-B 150555 (5,000000%)		0,10	-0,00	0,13			2.222.633,47	0,34
NTN-B 150555 (5,030000%)		0,10	-0,00	0,13			2.217.605,79	0,34
NTN-B 150555 (5,060000%)		0,10	-0,00	0,13			2.212.603,52	0,34
NTN-B 150555 (5,315000%)		0,10	-0,00	0,13			2.201.050,46	0,34
NTN-B 150555 (5,370000%)		0,11	-0,00	0,13			2.202.001,36	0,34
NTN-B 150555 (5,420000%)		0,11	-0,00	0,13			2.199.919,65	0,34
NTN-B 150555 (5,520000%)		0,11	-0,00	0,13			2.191.241,50	0,34
NTN-B 150555 (5,831200%)		0,11	-0,00	0,14			11.372.440,69	1,76
NTN-B 150555 (5,860000%)		0,11	-0,00	0,14			2.132.430,98	0,33
NTN-B 150555 (5,897000%)		0,07	0,00	0,10			5.121.622,33	0,79
NTN-B 150555 (5,927000%)		0,11	-0,00	0,14			2.049.557,07	0,32
NTN-B 150555 (5,950000%)		0,11	-0,00	0,14			16.724.204,91	2,59
NTN-B 150555 (6,140000%)		0,07	0,00	0,10			9.196.987,51	1,43
NTN-B 150555 (6,261000%)		0,12	-0,00	0,14			8.282.114,17	1,28
NTN-B 150555 (6,268000%)		0,21	0,00	0,22			7.124.085,01	1,10
NTN-B 150555 (6,400000%)		0,21	0,00	0,22			5.208.230,46	0,81
NTN-B 150824 (5,345000%)		0,11	0,00	0,13			2.148.493,64	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%)		0,11	0,00	0,13			2.178.802,42	0,34
NTN-B 150824 (5,912000%)		0,11	0,00	0,14			2.133.296,28	0,33
NTN-B 150826 (5,009000%)		0,10	0,00	0,13			2.180.382,29	0,34
NTN-B 150826 (5,130000%)		0,10	0,00	0,13			2.181.084,31	0,34
NTN-B 150826 (5,190000%)		0,10	0,00	0,13			2.181.459,30	0,34
NTN-B 150826 (5,490000%)		0,11	0,00	0,13			2.183.250,41	0,34
NTN-B 150826 (5,710000%)		0,11	0,00	0,14			3.193.760,18	0,50
NTN-B 150828 (4,850000%)		0,10	0,00	0,12			2.194.825,86	0,34
NTN-B 150828 (5,125600%)		0,10	0,00	0,13			2.185.280,35	0,34
NTN-B 150828 (5,240000%)		0,10	0,00	0,13			2.187.020,07	0,34
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,10	0,00	0,13			2.184.122,81	0,34
NTN-B 150828 (5,810000%)		0,11	0,00	0,14			3.199.264,24	0,50
NTN-B 150830 (4,860000%)		0,10	0,00	0,12			2.202.254,72	0,34
NTN-B 150830 (4,900000%)		0,10	0,00	0,12			2.197.167,05	0,34
NTN-B 150830 (5,178300%)		0,10	0,00	0,13			2.188.075,57	0,34
NTN-B 150830 (5,270000%)		0,10	0,00	0,13			2.189.448,99	0,34
NTN-B 150830 (5,300000%)		0,10	0,00	0,13			2.189.964,83	0,34
NTN-B 150830 (5,500000%)		0,11	0,00	0,13			2.186.185,09	0,34
NTN-B 150830 (5,835000%)		0,11	0,00	0,14			3.200.554,98	0,50
NTN-B 150840 (4,950000%)		0,10	0,00	0,13			2.214.634,88	0,34
NTN-B 150840 (4,970000%)		0,10	0,00	0,13			2.205.256,16	0,34
NTN-B 150840 (5,020000%)		0,10	0,00	0,13			2.207.088,31	0,34
NTN-B 150840 (5,274000%)		0,10	0,00	0,13			2.196.650,25	0,34
NTN-B 150840 (5,310000%)		0,10	0,00	0,13			2.197.091,40	0,34
NTN-B 150840 (5,360000%)		0,11	0,00	0,13			2.194.234,52	0,34
NTN-B 150840 (5,837000%)		0,11	0,00	0,14			2.049.000,48	0,32
NTN-B 150840 (5,855000%)		0,11	0,00	0,14			3.199.480,89	0,50
NTN-B 150840 (6,220000%)		0,12	0,00	0,14			3.016.527,71	0,47
NTN-B 150850 (4,940000%)		0,10	0,00	0,13			2.225.426,28	0,35
NTN-B 150850 (4,980000%)		0,10	0,00	0,13			2.222.490,38	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%)		0,10	0,00	0,13			2.217.933,74	0,34
NTN-B 150850 (5,045000%)		0,10	0,00	0,13			2.211.858,10	0,34
NTN-B 150850 (5,295500%)		0,10	0,00	0,13			2.200.311,71	0,34
NTN-B 150850 (5,360000%)		0,11	0,00	0,13			2.199.035,44	0,34
NTN-B 150850 (5,410000%)		0,11	0,00	0,13			2.197.558,13	0,34
NTN-B 150850 (5,510000%)		0,11	0,00	0,13			2.190.118,44	0,34
NTN-B 150850 (5,831200%)		0,11	0,00	0,14			8.268.158,57	1,28
NTN-B 150850 (5,897000%)		0,07	0,00	0,10			3.070.813,08	0,48
NTN-B 150850 (5,921000%)		0,11	0,00	0,14			2.049.132,58	0,32
NTN-B 150850 (5,950000%)		0,11	0,00	0,14			11.169.618,04	1,73
NTN-B 150850 (6,140000%)		0,07	0,00	0,10			6.639.500,69	1,03
NTN-B 150850 (6,261000%)		0,12	0,00	0,14			5.529.010,87	0,86
NTN-B 150850 (6,278000%)		0,21	-0,00	0,24			5.083.491,60	0,79
NTN-B 150850 (6,400000%)		0,07	0,00	0,10			3.031.539,70	0,47
Sub-total	0,22	0,08	0,00		1,33	1,47	318.744.390,09	49,43

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			47.788.448,33	7,41
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,07	-0,00	0,07			32.045.500,25	4,97
BB INSTITUCIONAL FI RF		0,05	0,00	0,05			32.100.142,82	4,98
Sub-total	0,05	0,03	0,00		-0,62	1,14	111.934.091,40	17,36

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		0,13	0,00	0,14			5.208.490,30	0,81
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a		0,29	0,00	0,31			5.722.182,59	0,89
Sub-total	0,86	0,17	0,00		0,19	1,33	10.930.672,89	1,70

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		2,72	0,00	2,72			4.201,03	0,00
Sub-total	132,68	2,72	0,00		-0,26	-33,02	4.201,03	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			3.206.087,16	0,50
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV		1,73	0,00	0,82			2.081.542,55	0,32
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,26	-0,00	0,26			5.482.253,37	0,85
Sub-total	0,39	0,36	0,00		-0,30	1,06	10.769.883,08	1,67

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,50%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA		15,82	0,06	8,89			3.764.285,53	0,58
META VALOR FI DE AÇÕES		12,38	0,03	4,64			2.023.982,46	0,31
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		13,38	0,08	6,34			6.439.632,10	1,00
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		9,94	0,05	4,80			4.535.489,44	0,70
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		9,41	0,22	3,69			22.784.772,46	3,53
OCCAM FIC FIA		7,87	0,23	2,73			27.283.644,99	4,23
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		13,80	0,04	7,61			2.798.851,44	0,43
INDIE FIC FIA		13,95	0,04	6,95			2.923.659,93	0,45
TARPON GT 30 FIC FIA		11,72	0,07	7,65			6.456.673,35	1,00
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA		12,26	0,05	9,99			5.990.172,62	0,93
Sub-total	18,18	9,50	0,87		-0,29	-4,17	85.001.164,32	13,18

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,52%

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		10,92	0,02	15,60			7.100.926,26	1,10
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		7,75	0,13	7,75			16.477.410,65	2,56
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		7,80	0,22	6,52			27.326.290,18	4,24
Sub-total	15,71	6,66	0,37		0,17	3,84	50.904.627,09	7,89

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		0,39	-0,00	0,39			10.379.495,80	1,61
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		0,13	0,00	0,13			15.647,03	0,00
Sub-total	1,63	0,39	-0,00		-1,02	-0,49	10.395.142,83	1,61

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,70%

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		10,00	0,12	7,80			13.748.947,58	2,13
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		22,36	0,01	19,36			1.716.422,14	0,27
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,01	-0,01	10,32			2.772.120,69	0,43
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		13,20	-0,01	13,09			2.484.938,25	0,39
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		14,74	0,00	14,74			2.473.032,30	0,38
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		10,50	-0,01	9,30			5.105.323,01	0,79
Sub-total	15,19	8,87	0,11		0,07	2,22	28.300.783,97	4,39

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		9,60	0,07	16,19			17.874.052,66	2,77
Sub-total	17,01	9,60	0,07		0,05	2,06	17.874.052,66	2,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

16. Relatório de Cenário Macroeconômico

No mês de março, houve queda acentuada na curva de juros dos EUA, em somatória a uma visão mais cautelosa para a economia global. Esses movimentos foram originados pelos eventos negativos relacionados aos bancos nos EUA (bancos regionais) e na Europa (bancos suíços), reforçando um contexto de incerteza em torno do cenário econômico. O colapso do Silicon Valley Bank (SVB) e do Signature Bank nos EUA, e do Credit Suisse, na Suíça, chamaram a atenção do mercado para os efeitos do aperto monetário que os bancos centrais vêm praticando. O receio do surgimento de mais casos de bancos com insuficiência de capital resultou em uma queda relevante da curva de juros, antecipando um Fed bem mais cauteloso na condução da política monetária.

Além disso, os diretores do Fed, por meio de suas previsões trimestrais, reforçaram a sua intenção de encerrar o ciclo de alta, com os Fed Funds estabilizando-se no intervalo de 5,00% a 5,25%. Assim, o S&P 500 após o evento do SVB apresentou recuperação, fechando o mês em território positivo. Esta recuperação veio em decorrência da firme atuação do Fed no caso SVB, o que tranquilizou os investidores.

Adicionalmente, a indicação de fim próximo do ciclo de aperto monetário foi positiva para ativos de risco de maneira geral, e para a bolsa em particular. Vale mencionar que a economia Chinesa ainda continua demonstrando sinais positivos, uma vez que há destaque para a confirmação da recuperação da atividade, com sinais de estabilização do mercado imobiliário. Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos.

Assim, no mês de março de 2023, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, renderam +2,82% e +3,51%, 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 -9,11% e -9,29%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, subiram +0,30% e 0,97%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Entretanto, acumulam retornos negativos de -2,53% e -2,74% nos últimos 12 meses.

No Brasil, apesar do discurso conservador do Copom, a curva de juros apresentou queda seguindo a tendência do cenário global, devido aos problemas enfrentados pelos bancos no exterior, combinado com o aperto das condições de crédito internas que começaram a se intensificar após os problemas apresentados pelas Lojas Americanas.

O Copom, em sua última reunião, manteve a taxa Selic estável em 13,75%, reafirmando o tom mais conservador em perseguir a meta de inflação. Tendo como destaque a preocupação com as expectativas de inflação, que se encontram em níveis superiores à meta de 3,0%, inclusive para horizontes mais longos, e a espera pelas definições no campo fiscal, principalmente pelo projeto do novo arcabouço fiscal.

Com relação ao arcabouço fiscal, proposto pelo Ministro da Fazenda, estabelece que os gastos do governo terão crescimento real, dentro de uma banda, em função do crescimento da receita. Além disso, será estabelecida uma banda para a trajetória de resultado primário alinhado com a sustentabilidade da dívida pública ao longo do tempo. Vale destacar que, o projeto ainda avançará no Congresso, tendo chances de sofrer eventuais alterações.

Além disso, há a necessidade de acompanhar a reação dos agentes econômicos e os efeitos do projeto sobre as expectativas de inflação. O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, divergindo do movimento dos índices internacionais e ainda sofrendo com as incertezas locais, em somatória com a queda no preço das commodities. Apresentando um retorno negativo de -2,91% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento negativo anual de -7,16% e de -15,10% nos últimos 12 meses.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

17. Agenda realizada

13 de março:

10h00: Reunião com Frederico Mesnik representante da gestora TRÍGONO CAPITAL LTDA, formato online pela plataforma “Teams”. O objetivo da reunião foi apresentar oportunidades de mercado e expor a visão da gestora frente ao cenário nos próximos meses. Participaram da reunião Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos e Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos.

15 de março:

9h00: Tricentésima octogésima (380ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, ocorrida em 15 de março 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 e Clévio Vitor de Almeida. Ausências justificadas de Rafaela Carvalho dos Santos e José Ricardo Vinhas. Participaram da reunião os estagiários Julia Victoria Jesus Simões e João Pedro Gomes Santos. Pautas da reunião: 1) Análise do relatório de investimentos de fevereiro de 2023; 2) Análise da carteira fechada de fevereiro de 2023; 3) Apresentação da Resolução de Credenciamentos; 4) Apresentação da distribuidora Dolar Bills Agente Autônomos de Investimentos; 5) Assuntos diversos.

29 de março:

9h00: Tricentésima octogésima primeira (381ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, ocorrida em 29 de março de 2023, tendo início às 9h20 em formato presencial com as seguintes presenças na sala de reuniões do IPMJ: Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Clévio Vitor de Almeida, Victor Adriano Vieira Silva, Rafaela Carvalho dos Santos. Ausência justificada de José Ricardo Vinhas. Participaram da reunião os estagiários Julia Victoria Jesus Simões e João Pedro Gomes Santos. Pautas da reunião: 1) Análise parcial carteira até 24/03/2023; 2) Apresentação Santander Asset Management; 3) Credenciamentos; 4) Assuntos Diversos;

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

Em março de 2023, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um prejuízo de R\$ 455.959,05 (quatrocentos e cinquenta e cinco mil e novecentos e cinquenta e nove reais e cinco centavos negativos) e um rendimento negativo acumulado, R\$ 1.405.134,73 (um milhão e quatrocentos e cinco mil e cento e trinta e quatro reais e setenta e três 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). 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 março de 2023 é de R\$ R\$ 4.201,03 (quatro mil e duzentos e um reais e três centavos).

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

II. PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP

O Fundo PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP em março de 2023, 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\$ 2.809.149,56 (dois milhões e oitocentos e nove mil e cento e quarenta e nove reais e cinquenta e seis centavos negativos). O saldo em 31 de março de 2023 foi de R\$ 15.647,03 (quinze mil e seiscentos e quarenta e sete reais e três centavos), com um rendimento mensal de R\$ 183,55 (cento e oitenta e três reais e cinquenta e cinco centavos).

19. 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\$ 2.410.888,94 (dois milhões e quatrocentos e dez mil e oitocentos e oitenta e oito reais e noventa e quatro centavos), O saldo acumulado em 31 de março de 2023 é de R\$ 10.379.495,80 (dez milhões e trezentos e setenta e nove mil e quatrocentos e noventa e cinco reais e oitenta centavos) com um rendimento no mês de março de -R\$ 51.400,82 (cinquenta e um mil e quatrocentos reais e oitenta e dois centavos negativos).