



LDB
EMPRESAS

JACAREÍ
MAIO 2023




Sumário

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.....	12
5. Rentabilidades por Artigo	13
6. Análise de Liquidez	20
7. Alocação por Artigo	21
8. Alocação Por Estratégia	21
9. Alocação por Gestor	22
10. Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial	23
11. Performance dos Fundos.....	26
12. Cotização e Taxas.....	34
13. Indexadores.....	36
14. Movimentações.....	42
15. Análise de Risco	45
16. Relatório de Cenário Macroeconômico	52
17. Agenda realizada	53
18. Acompanhamento fundos estressados	55
19. Fundos Estruturados.....	55

1. PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS

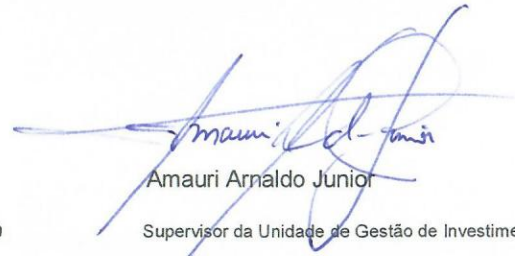
Em 02 de julho de 2019 o IPMJ formalizou sua adesão ao Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios – “Pró Gestão RPPS”. Em atendimento ao Manual do Pró Gestão RPPS, apresenta-se o presente relatório, referente ao mês de maio 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.



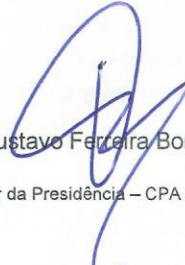
Renata de Souza Santos Esteves

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



Clevio Vitor de Almeida

Membro do CAIF – CGRPPS – CPA 10



Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do CAIF

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**

Victor Adriano Vieira Silva

Membro do CAIF – CGRPPS

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**

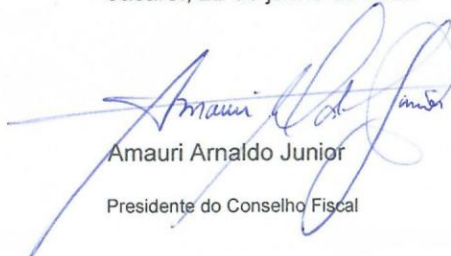
José Ricardo Vinhas

Membro do CAIF

2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 22 dias do mês de junho 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 maio 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 maio 2023.

Jacareí, 22 de junho 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

69,43%

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 (5,930000%)	0,52	0,00	0,59	5,30	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,560000%)	0,53	0,00	0,62	5,53	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,850000%)	0,53	0,00	0,59	5,27	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,580000%)	0,52	0,00	0,58	5,17	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,210000%)	0,52	0,00	0,57	5,04	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,300000%)	0,52	0,00	0,57	5,07	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,420000%)	0,52	0,00	0,58	5,12	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,860000%)	0,53	0,00	0,59	5,28	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,480000%)	0,47	0,04	1,03	5,61	2.159.527,83	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,47	0,04	1,06	5,75	1.054.803,96	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,680000%)	4,03	0,05	0,37	0,37	20.071.150,75	3,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,50	0,04	0,98	5,36	2.191.451,25	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,50	0,04	0,98	5,37	2.187.749,34	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,50	0,04	0,98	5,38	2.186.750,17	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,50	0,04	1,01	5,50	2.174.616,61	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,50	0,04	1,02	5,53	2.175.171,60	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,50	0,04	1,02	5,55	2.174.109,01	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,670000%)	4,01	0,05	0,37	0,37	1.503.051,43	0,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,50	0,04	1,06	5,76	2.028.255,88	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,50	0,04	1,06	5,77	3.174.149,82	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,50	0,04	0,99	5,40	2.203.359,18	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,50	0,04	0,99	5,41	2.200.610,89	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,50	0,04	0,99	5,43	2.196.270,90	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,285000%)	0,50	0,04	1,02	5,53	2.182.355,51	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,50	0,04	1,02	5,56	2.181.159,53	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,51	0,04	1,02	5,57	2.179.452,15	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,50	0,04	1,06	5,76	5.122.048,28	0,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,50	0,04	1,06	5,77	2.115.941,35	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	0,47	0,04	1,07	5,78	2.035.317,49	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,50	0,04	1,07	5,79	6.218.550,35	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,50	0,04	1,07	5,79	2.029.289,14	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	0,47	0,04	1,09	5,88	4.559.171,67	0,69
TESOURO	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,51	0,04	1,10	5,93	3.592.634,31	0,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,280000%)	3,03	0,04	1,10	3,91	3.024.968,46	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	3,07	0,04	1,11	5,99	2.061.339,66	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,000000%)	0,50	0,04	0,99	5,42	2.208.288,26	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,50	0,04	0,99	5,43	2.203.145,45	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,50	0,04	1,00	5,44	2.198.028,42	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,50	0,04	1,02	5,55	2.185.274,93	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,51	0,04	1,02	5,57	2.185.940,63	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,51	0,04	1,03	5,59	2.183.620,57	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,520000%)	0,51	0,04	1,03	5,63	2.174.492,66	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,50	0,04	1,06	5,76	11.277.084,53	1,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,50	0,04	1,06	5,77	2.114.400,82	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	0,47	0,04	1,07	5,78	5.077.864,34	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,50	0,04	1,07	5,80	2.031.895,02	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,50	0,04	1,07	5,80	16.579.148,44	2,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	0,47	0,04	1,09	5,88	9.112.913,84	1,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,51	0,04	1,10	5,93	8.203.902,78	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,268000%)	3,04	0,04	1,10	3,90	7.056.681,13	1,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	3,09	0,04	1,11	5,99	5.157.218,71	0,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,51	0,04	1,02	5,56	2.190.258,46	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,450000%)	0,51	0,04	1,03	5,60	2.221.508,29	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,51	0,04	1,07	5,79	2.176.618,27	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,51	0,04	0,99	5,42	2.221.640,53	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,51	0,04	1,00	5,47	2.222.760,48	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,51	0,04	1,01	5,49	2.223.344,63	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,51	0,04	1,03	5,62	2.226.175,39	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,710000%)	0,51	0,04	1,05	5,71	3.257.632,58	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,50	0,04	0,98	5,35	2.235.817,95	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,51	0,04	1,00	5,47	2.227.022,39	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,51	0,04	1,01	5,51	2.229.179,48	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,51	0,04	1,01	5,53	2.226.328,70	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,51	0,04	1,06	5,75	3.263.737,28	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,50	0,04	0,98	5,36	2.243.420,17	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,50	0,04	0,98	5,38	2.238.373,47	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,51	0,04	1,01	5,49	2.230.047,57	0,34
TESOURO	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,51	0,04	1,01	5,53	2.231.756,14	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 (5,300000%)	0,51	0,04	1,02	5,54	2.232.384,91	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,460000%)	4,04	0,04	0,36	0,36	3.511.469,74	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,51	0,04	1,03	5,62	2.229.201,69	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,835000%)	0,51	0,04	1,06	5,76	3.265.176,08	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,50	0,04	0,99	5,40	2.256.338,88	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,50	0,04	0,99	5,40	2.246.850,42	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,51	0,04	0,99	5,42	2.248.888,25	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,51	0,04	1,01	5,53	2.239.112,73	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,310000%)	0,51	0,04	1,02	5,54	2.239.681,54	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,51	0,04	1,02	5,56	2.236.938,89	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,51	0,04	1,06	5,76	2.090.376,09	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,51	0,04	1,06	5,77	3.264.177,92	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,51	0,04	1,09	5,91	3.079.204,75	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,50	0,04	0,99	5,39	2.267.299,28	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,50	0,04	0,99	5,41	2.264.445,56	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,51	0,04	0,99	5,42	2.259.904,75	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,51	0,04	0,99	5,43	2.253.834,14	0,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,51	0,04	1,02	5,54	2.242.915,10	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,51	0,04	1,02	5,56	2.241.833,94	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,51	0,04	1,03	5,58	2.240.494,28	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,510000%)	0,51	0,04	1,03	5,63	2.233.247,94	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,51	0,04	1,06	5,76	8.435.044,34	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	2,96	0,04	1,07	5,78	3.133.104,46	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,51	0,04	1,07	5,79	2.090.772,82	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,51	0,04	1,07	5,80	11.397.098,22	1,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	3,05	0,04	1,09	5,88	6.776.645,46	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,51	0,04	1,10	5,93	5.644.234,83	0,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,278000%)	4,31	0,04	1,10	3,91	5.189.565,18	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	3,15	0,04	1,11	5,99	3.095.359,07	0,47
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,48	0,04	1,05	5,70	305.704.380,09	46,38

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				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	0,11	0,05	0,44	0,44	5.022.132,50	0,76	224.228.668,39	2,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,07	0,06	1,24	5,28	48.809.033,34	7,41	6.330.456.366,73	0,77
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,06	1,19	5,16	23.041.080,39	3,50	3.184.616.150,75	0,72
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,27	0,06	1,18	4,77	32.758.764,46	4,97	2.441.185.966,26	1,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,40	0,06	1,21	5,11	109.631.010,70	16,63		

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 6,70 % a.a	2,11	0,42	0,42	0,42	5.021.078,63	0,76		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	2,33	0,47	0,47	0,47	5.023.260,51	0,76		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	2,10	0,42	0,42	0,42	5.020.910,50	0,76		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	1,26	0,11	1,22	6,14	5.352.773,27	0,81		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	2,07	0,41	0,41	0,41	5.020.686,11	0,76		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 7,00% a.a	2,11	0,05	1,16	6,23	5.849.299,63	0,89		
Sub-total Artigo 7º IV			2,09	0,30	1,18	6,17	31.288.008,65	4,75		

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	91,53	-52,45	-52,45	-66,60	2.499,51	0,00	86.462,75	2,89
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			91,53	-52,45	-52,45	-66,60	2.499,51	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	0,03	0,05	1,15	5,41	3.272.442,95	0,50	9.143.440.670,66	0,04
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	3,07	-0,00	0,88	2,88	2.112.534,27	0,32	641.259.943,92	0,33
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,46	0,08	1,28	4,24	5.600.822,52	0,85	3.108.738.435,34	0,18
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,53	0,06	1,17	4,32	10.985.799,75	1,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,46

0,06

1,10

5,52

457.611.698,69

69,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

13,77%

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	28,05	0,19	6,33	-1,71	4.025.044,32	0,61	235.699.439,85	1,71
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	25,63	-0,15	4,78	-7,50	2.101.772,66	0,32	201.655.898,28	1,04
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	25,04	0,47	9,56	4,08	7.128.742,60	1,08	255.959.179,38	2,79
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,32	-0,32	7,44	-2,50	4.772.302,67	0,72	1.350.305.370,46	0,35
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,42	-0,09	4,96	-5,00	24.105.035,03	3,66	623.442.178,77	3,87
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,26	-0,80	0,44	-5,07	27.715.435,64	4,21	839.965.227,23	3,30
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22,76	-0,28	11,17	11,07	3.292.248,74	0,50	227.709.629,41	1,45
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	25,38	0,13	10,90	5,58	3.385.445,55	0,51	392.393.734,14	0,86
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	22,28	0,09	13,28	13,36	7.648.150,83	1,16	680.339.527,08	1,12
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	21,48	-0,24	14,35	1,85	6.562.297,82	1,00	205.007.805,52	3,20
Sub-total Artigo 8º I			19,46	-0,26	5,75	-1,42	90.736.475,87	13,77		
Renda Variável			19,46	-0,26	5,75	-1,42	90.736.475,87	13,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,13%

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	27,73	0,29	3,81	16,47	14.015.114,99	2,13	221.795.564,18	6,32
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	48,18	1,17	12,68	16,20	1.800.705,81	0,27	180.506.038,86	1,00
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,64	-0,58	-4,16	-11,95	2.483.604,13	0,38	74.655.753,57	3,33
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,15	0,57	4,72	3,12	2.519.844,28	0,38	61.131.617,06	4,12
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	35,10	-0,36	6,84	21,04	2.597.064,94	0,39	658.978.226,88	0,39
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	24,21	-0,97	2,61	5,57	5.233.323,60	0,79	296.355.367,98	1,77
Sub-total Artigo 9º II			21,11	0,01	3,70	10,40	28.649.657,75	4,35		

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	23,17	0,25	1,71	7,52	18.318.331,33	2,78	754.343.533,17	2,43
Sub-total Artigo 9º III			23,17	0,25	1,71	7,52	18.318.331,33	2,78		

Investimentos no Exterior

20,56 0,10 2,91 9,26 46.967.989,08 7,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,67%

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	17,78	0,49	2,58	9,14	7.363.830,24	1,12	49.408.207,15	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	20,92	-0,47	1,17	12,23	17.000.150,31	2,58	774.472.323,04	2,20
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	20,66	-0,48	1,23	12,43	28.222.333,08	4,28	457.117.581,91	6,17
Sub-total Artigo 10º I			19,75	-0,34	1,40	11,89	52.586.313,62	7,98		

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	50,27	0,81	0,81	-6,36	11.162.217,11	1,69	356.074.677,32	3,13
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	3,18	0,70	0,70	3,65	15.832,23	0,00	2.568.863,85	0,62
Sub-total Artigo 10º II			50,22	0,81	0,81	-6,35	11.178.049,34	1,70		
Investimentos Estruturados			18,37	-0,14	1,29	8,59	63.764.362,96	9,67		
Total			4,42	0,00	1,86	5,07	659.080.526,60	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	305.704.380,09	46,38	0,00	43,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	109.631.010,70	16,63	0,00	12,50	40,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	31.288.008,65	4,75	0,00	2,50	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	2.499,51	0,00	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	10.985.799,75	1,67	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	457.611.698,69	69,43					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	90.736.475,87	13,77	0,00	14,50	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	90.736.475,87	13,77					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	28.649.657,75	4,35	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	18.318.331,33	2,78	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	46.967.989,08	7,13					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	52.586.313,62	7,98	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	11.178.049,34	1,70	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	63.764.362,96	9,67					15,00
Total		659.080.526,60	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	1,05 93,38	5,70 106,07	3,49 107,47	6,59 100,55	9,95 73,85	3.263.927,31	17.188.767,99
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,21 107,53	5,11 95,27	3,26 100,31	6,31 96,25	12,33 91,51	1.380.595,87	5.748.253,35
Artigo 7º IV % do CDI	1,18 104,62	6,17 114,95	3,83 117,95	7,21 110,05		217.758,78	738.727,97
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-52,45 -4.668,93	-66,60 -1.240,43	-60,15 -1.850,50	-64,83 -989,32	-60,86 -451,57	-2.756,73	-4.983,83
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,17 103,74	4,32 80,47	3,09 94,92	5,51 84,11	12,58 93,36	126.548,60	455.001,66
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,75 2,01	-1,42 -0,14	2,30 -0,95	-5,08 -1,39	-2,64 0,07	4.931.328,64	-1.304.774,79
Artigo 9º II % do CDI	3,70 329,32	10,40 193,75	3,48 107,02	7,02 107,17	4,74 35,19	1.022.017,76	2.699.482,57
Artigo 9º III % do CDI	1,71 152,27	7,52 140,05	4,60 141,56	2,50 38,15	8,12 60,28	308.051,43	1.281.092,67
Artigo 10º I % do CDI	1,40 124,50	11,89 221,44	7,27 223,72	7,44 113,59	10,42 77,33	725.310,76	5.587.820,38
Artigo 10º II % do CDI	0,81 71,95	-6,35 -118,22	-0,60 -18,41	-7,54 -115,12	-7,42 -55,06	89.624,42	-556.932,14
JACAREÍ (Total)						12.062.406,84	31.832.455,83

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%)	2.192.547,89	0,00	-2.204.991,59	0,00	0,00	12.443,70	105.825,12
NTN-B 150523 (5,300000%)	2.230.419,90	0,00	-2.243.154,91	0,00	0,00	12.735,01	108.315,84
NTN-B 150523 (5,420000%)	11.071.483,42	0,00	-11.135.207,57	0,00	0,00	63.724,15	542.041,00
NTN-B 150523 (5,580000%)	3.322.087,76	0,00	-3.341.410,34	0,00	0,00	19.322,58	164.393,81
NTN-B 150523 (5,850000%)	2.217.311,25	0,00	-2.230.433,80	0,00	0,00	13.122,55	111.690,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150523 (5,860000%)	11.090.739,30	0,00	-11.156.409,41	0,00	0,00	65.670,11	559.033,12
NTN-B 150523 (5,930000%)	5.492.532,67	0,00	-5.525.200,10	0,00	0,00	32.667,43	278.109,43
NTN-B 150523 (6,560000%)	2.204.081,23	0,00	-2.217.712,70	0,00	0,00	13.631,47	116.133,09
NTN-B 150525 (5,480000%)	2.200.068,45	0,00	0,00	62.949,15	2.159.527,83	22.408,53	117.844,73
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.074.495,26	0,00	0,00	30.926,66	1.054.803,96	11.235,36	58.876,43
NTN-B 150533 (5,680000%)	0,00	19.996.872,43	0,00	0,00	20.071.150,75	74.278,32	74.278,32
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.228.438,37	0,00	0,00	58.565,84	2.191.451,25	21.578,72	114.202,04
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.224.735,44	0,00	0,00	58.565,84	2.187.749,34	21.579,74	114.178,63
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.223.812,52	0,00	0,00	58.687,60	2.186.750,17	21.625,25	114.381,35
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.212.368,77	0,00	0,00	59.783,43	2.174.616,61	22.031,27	116.166,76
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.213.231,74	0,00	0,00	60.270,46	2.175.171,60	22.210,32	116.988,29
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.212.248,05	0,00	0,00	60.392,22	2.174.109,01	22.253,18	117.185,21
NTN-B 150535 (5,670000%)	0,00	1.497.494,98	0,00	0,00	1.503.051,43	5.556,45	5.556,45
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.065.420,21	0,00	0,00	58.809,36	2.028.255,88	21.645,03	113.383,13
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.232.401,60	0,00	0,00	92.171,19	3.174.149,82	33.919,41	177.660,81
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.238.574,18	0,00	0,00	57.104,74	2.203.359,18	21.889,74	115.655,40
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.235.835,47	0,00	0,00	57.104,74	2.200.610,89	21.880,16	115.596,69
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.231.687,59	0,00	0,00	57.348,26	2.196.270,90	21.931,57	115.801,00
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.218.900,49	0,00	0,00	58.809,36	2.182.355,51	22.264,38	117.252,68
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.217.980,03	0,00	0,00	59.174,63	2.181.159,53	22.354,13	117.660,19
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.216.459,85	0,00	0,00	59.418,15	2.179.452,15	22.410,45	117.910,72
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.214.869,20	0,00	0,00	147.449,55	5.122.048,28	54.628,63	286.165,37
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.154.445,21	0,00	0,00	61.122,77	2.115.941,35	22.618,91	118.455,09
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.072.549,64	0,00	0,00	59.052,88	2.035.317,49	21.820,73	114.237,53
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.332.593,65	0,00	0,00	180.811,38	6.218.550,35	66.768,08	349.468,30
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.066.543,03	0,00	0,00	59.052,88	2.029.289,14	21.798,99	114.097,23
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.645.481,34	0,00	0,00	136.126,01	4.559.171,67	49.816,34	260.227,50
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.661.756,14	0,00	0,00	108.730,35	3.592.634,31	39.608,52	206.692,33
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.083.362,90	0,00	0,00	91.805,91	3.024.968,46	33.411,47	116.778,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.101.796,95	0,00	0,00	63.436,18	2.061.339,66	22.978,89	119.755,11
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.242.432,31	0,00	0,00	56.130,67	2.208.288,26	21.986,62	116.113,10
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.237.405,80	0,00	0,00	56.252,43	2.203.145,45	21.992,08	116.103,47
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.232.404,87	0,00	0,00	56.374,19	2.198.028,42	21.997,74	116.094,93
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.221.130,35	0,00	0,00	58.200,57	2.185.274,93	22.345,15	117.623,79
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.222.174,78	0,00	0,00	58.687,60	2.185.940,63	22.453,45	118.133,77
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.220.149,34	0,00	0,00	59.052,88	2.183.620,57	22.524,11	118.442,28
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.211.540,64	0,00	0,00	59.661,67	2.174.492,66	22.613,69	118.804,73
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.480.202,30	0,00	0,00	323.390,59	11.277.084,53	120.272,82	629.987,38
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.152.679,94	0,00	0,00	60.879,25	2.114.400,82	22.600,13	118.359,23
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.170.387,39	0,00	0,00	146.962,52	5.077.864,34	54.439,47	284.991,01
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.069.112,46	0,00	0,00	59.052,88	2.031.895,02	21.835,44	114.278,16
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.884.041,94	0,00	0,00	483.381,27	16.579.148,44	178.487,77	933.956,94
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.286.073,78	0,00	0,00	272.739,06	9.112.913,84	99.579,12	520.183,50
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.363.017,50	0,00	0,00	249.604,94	8.203.902,78	90.490,22	472.211,03
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.193.705,11	0,00	0,00	214.903,76	7.056.681,13	77.879,78	272.236,70
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.259.597,96	0,00	0,00	159.868,92	5.157.218,71	57.489,67	299.667,91
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.168.140,57	0,00	0,00	0,00	2.190.258,46	22.117,89	116.302,05
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.198.881,90	0,00	0,00	0,00	2.221.508,29	22.626,39	118.827,99
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.153.628,55	0,00	0,00	0,00	2.176.618,27	22.989,72	120.146,04
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.199.818,70	0,00	0,00	0,00	2.221.640,53	21.821,83	115.174,86
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.200.707,04	0,00	0,00	0,00	2.222.760,48	22.053,44	116.234,63
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.201.175,77	0,00	0,00	0,00	2.223.344,63	22.168,86	116.765,71
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.203.430,93	0,00	0,00	0,00	2.226.175,39	22.744,46	119.399,00
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.223.761,64	0,00	0,00	0,00	3.257.632,58	33.870,94	177.381,21
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.214.150,40	0,00	0,00	0,00	2.235.817,95	21.667,55	114.562,11
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.204.933,19	0,00	0,00	0,00	2.227.022,39	22.089,20	116.410,73
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.206.861,31	0,00	0,00	0,00	2.229.179,48	22.318,17	117.474,65
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.203.984,27	0,00	0,00	0,00	2.226.328,70	22.344,43	117.573,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.229.536,62	0,00	0,00	0,00	3.263.737,28	34.200,66	178.915,97
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.221.660,38	0,00	0,00	0,00	2.243.420,17	21.759,79	115.019,80
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.216.588,43	0,00	0,00	0,00	2.238.373,47	21.785,04	115.099,03
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.207.833,88	0,00	0,00	0,00	2.230.047,57	22.213,69	116.995,88
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.209.355,91	0,00	0,00	0,00	2.231.756,14	22.400,23	117.851,09
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.209.921,85	0,00	0,00	0,00	2.232.384,91	22.463,06	118.134,70
NTN-B 150830 (5,460000%)	0,00	3.498.762,83	0,00	0,00	3.511.469,74	12.706,91	12.706,91
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.206.406,71	0,00	0,00	0,00	2.229.201,69	22.794,98	119.628,73
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.230.893,30	0,00	0,00	0,00	3.265.176,08	34.282,78	179.294,36
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.234.284,90	0,00	0,00	0,00	2.256.338,88	22.053,98	116.399,40
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.224.853,35	0,00	0,00	0,00	2.246.850,42	21.997,07	116.077,35
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.226.779,15	0,00	0,00	0,00	2.248.888,25	22.109,10	116.606,39
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.216.630,13	0,00	0,00	0,00	2.239.112,73	22.482,60	118.240,71
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.217.128,94	0,00	0,00	0,00	2.239.681,54	22.552,60	118.572,01
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.214.322,32	0,00	0,00	0,00	2.236.938,89	22.616,57	118.847,18
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.068.424,25	0,00	0,00	0,00	2.090.376,09	21.951,84	114.791,64
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.229.851,02	0,00	0,00	0,00	3.264.177,92	34.326,90	179.469,50
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.045.909,87	0,00	0,00	0,00	3.079.204,75	33.294,88	173.484,31
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.245.157,01	0,00	0,00	0,00	2.267.299,28	22.142,27	116.851,59
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.242.257,54	0,00	0,00	0,00	2.264.445,56	22.188,02	117.047,55
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.237.704,42	0,00	0,00	0,00	2.259.904,75	22.200,33	117.067,93
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.231.629,98	0,00	0,00	0,00	2.253.834,14	22.204,16	117.050,57
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.220.357,31	0,00	0,00	0,00	2.242.915,10	22.557,79	118.600,82
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.219.167,52	0,00	0,00	0,00	2.241.833,94	22.666,42	119.089,20
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.217.749,01	0,00	0,00	0,00	2.240.494,28	22.745,27	119.438,46
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.210.392,46	0,00	0,00	0,00	2.233.247,94	22.855,48	119.893,49
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.346.506,78	0,00	0,00	0,00	8.435.044,34	88.537,56	462.998,06
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.100.050,36	0,00	0,00	0,00	3.133.104,46	33.054,10	172.749,33
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.068.675,00	0,00	0,00	0,00	2.090.772,82	22.097,82	115.464,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.276.361,11	0,00	0,00	0,00	11.397.098,22	120.737,11	630.659,79
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.703.813,34	0,00	0,00	0,00	6.776.645,46	72.832,12	379.798,59
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.583.016,38	0,00	0,00	0,00	5.644.234,83	61.218,45	318.876,89
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.133.209,28	0,00	0,00	0,00	5.189.565,18	56.355,90	195.129,00
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.061.436,95	0,00	0,00	0,00	3.095.359,07	33.922,12	176.479,49
					305.704.380,09	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	32.376.960,89	0,00	0,00	0,00	32.758.764,46	381.803,57	1.492.506,01
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	48.210.638,92	0,00	0,00	0,00	48.809.033,34	598.394,42	2.695.116,59
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00	5.022.132,50	22.132,50	22.132,50
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	30.940.315,01	52.589.500,00	-60.867.000,00	0,00	23.041.080,39	378.265,38	1.538.498,25
					109.631.010,70	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 - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00	5.020.910,50	20.910,50	20.910,50
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00	5.023.260,51	23.260,51	23.260,51
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a	5.782.226,20	0,00	0,00	0,00	5.849.299,63	67.073,43	343.076,53
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00	5.020.686,11	20.686,11	20.686,11
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00	5.021.078,63	21.078,63	21.078,63
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.288.023,67	0,00	0,00	0,00	5.352.773,27	64.749,60	309.715,69
					31.288.008,65	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	5.256,24	0,00	0,00	0,00	2.499,51	-2.756,73	-4.983,83
					2.499,51	0,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	3.235.131,65	0,00	0,00	0,00	3.272.442,95	37.311,30	167.822,42
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	2.094.109,19	0,00	0,00	0,00	2.112.534,27	18.425,08	59.121,43
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	5.530.010,30	0,00	0,00	0,00	5.600.822,52	70.812,22	228.057,81
					10.985.799,75	0,00	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	6.506.441,43	0,00	0,00	0,00	7.128.742,60	622.301,17	279.298,39
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.441.954,52	0,00	0,00	0,00	4.772.302,67	330.348,15	-122.151,44
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	2.961.547,49	0,00	0,00	0,00	3.292.248,74	330.701,25	328.149,53
INDIE FIC FIA	3.052.641,43	0,00	0,00	0,00	3.385.445,55	332.804,12	178.978,73
META VALOR FI DE AÇÕES	2.005.959,78	0,00	0,00	0,00	2.101.772,66	95.812,88	-170.359,68
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	22.966.220,65	0,00	0,00	0,00	24.105.035,03	1.138.814,38	-1.267.578,81
OCCAM FIC FIA	27.594.492,38	0,00	0,00	0,00	27.715.435,64	120.943,26	-1.481.141,89
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	3.785.551,20	0,00	0,00	0,00	4.025.044,32	239.493,12	-70.154,71
TARPON GT 30 FIC FIA	6.751.608,87	0,00	0,00	0,00	7.648.150,83	896.541,96	901.119,06
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	5.738.729,47	0,00	0,00	0,00	6.562.297,82	823.568,35	119.066,03
					90.736.475,87	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	13.501.003,59	0,00	0,00	0,00	14.015.114,99	514.111,40	1.981.491,61
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.598.017,23	0,00	0,00	0,00	1.800.705,81	202.688,58	251.064,69
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.591.362,44	0,00	0,00	0,00	2.483.604,13	-107.758,31	-337.073,42
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.406.178,50	0,00	0,00	0,00	2.519.844,28	113.665,78	76.238,91
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.430.865,91	0,00	0,00	0,00	2.597.064,94	166.199,03	451.474,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	5.100.212,32	0,00	0,00	0,00	5.233.323,60	133.111,28	276.286,25
					28.649.657,75	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	18.010.279,90	0,00	0,00	0,00	18.318.331,33	308.051,43	1.281.092,67
					18.318.331,33	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	27.879.868,22	0,00	0,00	0,00	28.222.333,08	342.464,86	3.119.283,48
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	7.178.395,99	0,00	0,00	0,00	7.363.830,24	185.434,25	616.489,23
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	16.802.738,66	0,00	0,00	0,00	17.000.150,31	197.411,65	1.852.047,67
					52.586.313,62	0,00	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	11.072.703,06	0,00	0,00	0,00	11.162.217,11	89.514,05	-557.489,19
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	15.721,86	0,00	0,00	0,00	15.832,23	110,37	557,05
					11.178.049,34	0,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

6. Análise de Liquidez

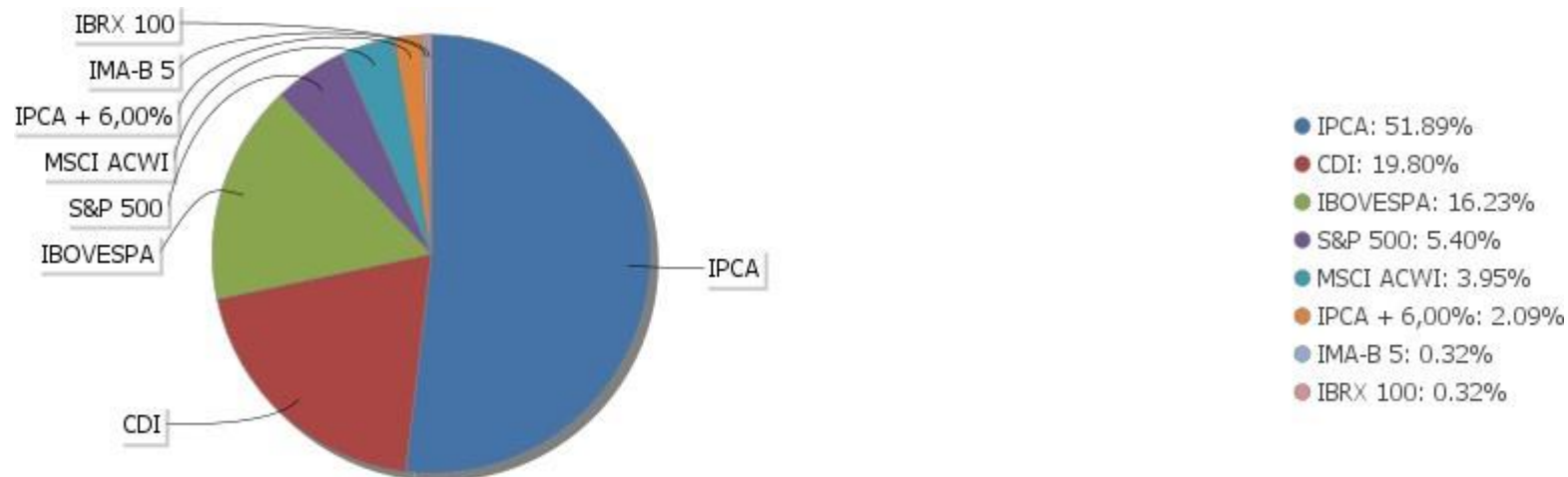
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	257.135.395,78	39,01	257.135.395,78	39,01	
de 31 dias a 365 dias	53.790.524,96	8,16	310.925.920,74	47,18	
acima de 365 dias	348.154.605,85	52,82	659.080.526,60	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

7. Alocação por Artigo

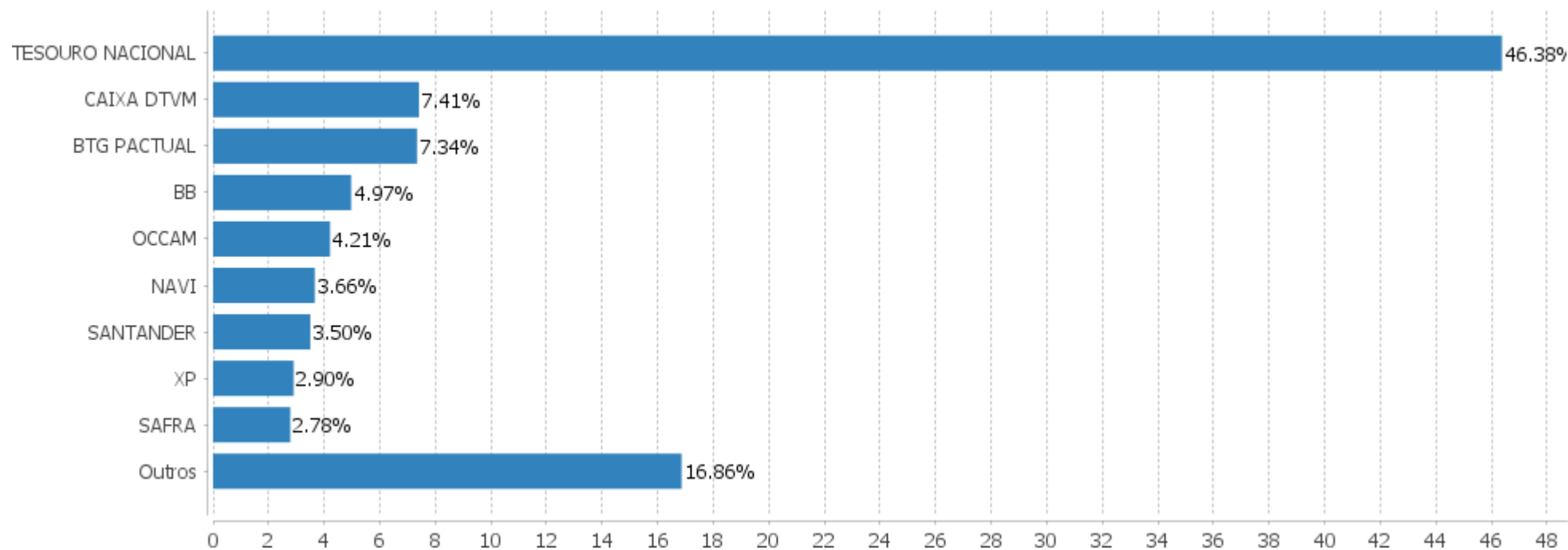


8. Alocação Por Estratégia



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	0,85	1,86								5,07
IPCA + 5,11%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67								5,07
p.p. indexador	0,97	-1,68	-0,35	-0,12	1,19								0,01
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

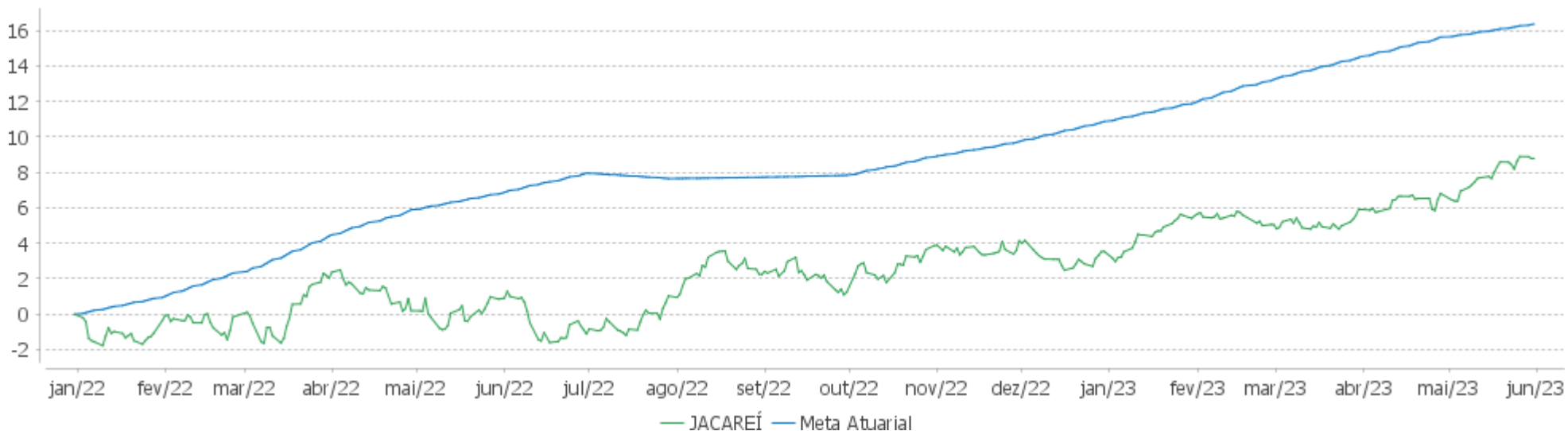
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

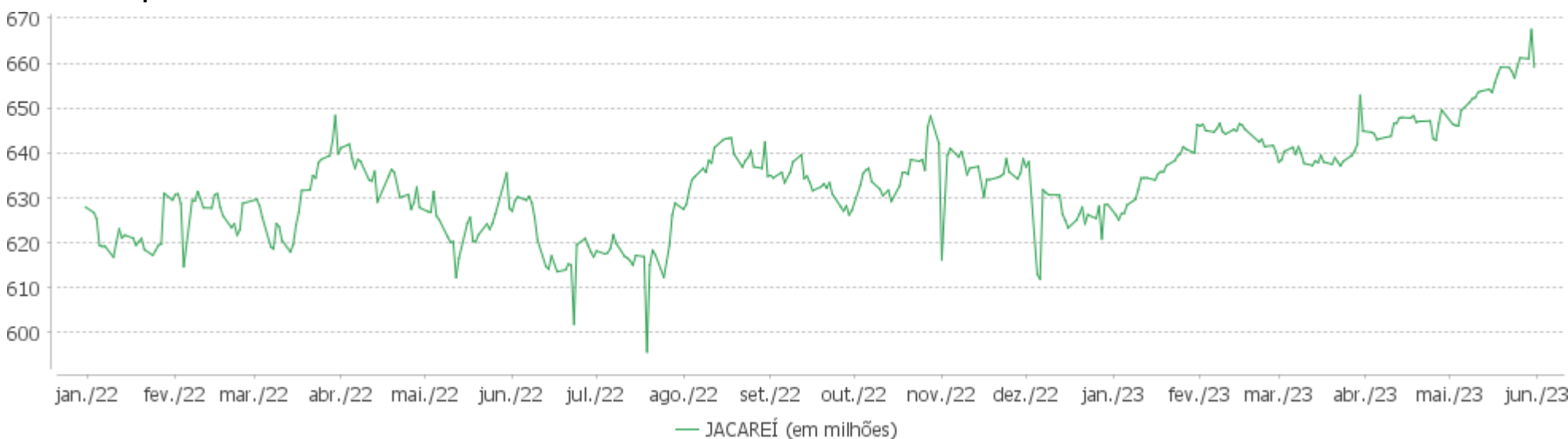
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	6	35,29	03 meses	3,57	2,83	0,74	3,48
Meses abaixo - Meta Atuarial	11	64,71	06 meses	4,47	6,16	-1,69	3,33
			12 meses	7,84	9,05	-1,21	4,42
			24 meses				
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	2,60	2022-10	Desde 31/12/2021	8,79	16,50	-7,70	5,03
Menor rentabilidade da Carteira	-1,97	2022-06					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

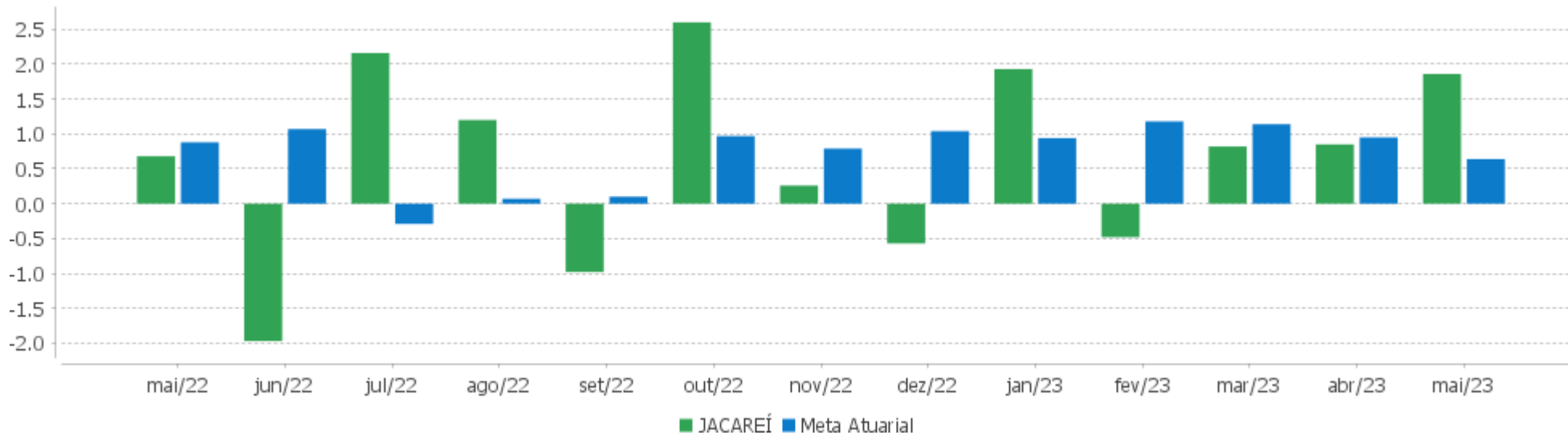


Patrimônio Líquido



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 6,70 % a.a Var. IPCA p.p.	0,42 0,32	0,42 0,32					
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a Var. IPCA p.p.	0,47 0,36	0,47 0,36					
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a Var. IPCA p.p.	0,42 0,31	0,42 0,31					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	1,22 0,99	6,14 3,19	3,95 2,39				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a Var. IPCA p.p.	0,41 0,31	0,41 0,31					
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	1,16 0,93	6,23 3,28	3,76 2,20	7,23 3,64			
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,28 113,99	4,24 79,06	3,21 98,83	5,47 83,47	12,71 94,34	23,22 103,48	30,90 123,12
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	0,88 0,31	2,88 -3,05	2,46 -0,56	3,94 -2,99	7,44 -2,01	17,11 -2,79	29,04 0,28
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	1,15 102,67	5,41 100,68	3,27 100,69	6,63 101,13	13,86 102,87	24,60 109,65	26,44 105,33
NTN-B 150523 (5,930000%) Var. IPCA p.p.	0,59 0,36	5,30 2,35	3,07 1,51	6,22 2,62	9,71 5,78	26,51 10,38	
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,86	5,88 2,93	3,60 2,05	6,82 3,23	7,23 3,29		
NTN-B 150523 (6,560000%) Var. IPCA p.p.	0,62 0,39	5,53 2,57	3,19 1,63	6,50 2,91	10,33 6,40	27,94 11,82	
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,78 2,83	3,54 1,99	6,70 3,11	7,08 3,14		
NTN-B 150533 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	-1,77 -2,00	2,74 -0,21	0,60 -0,96	3,62 0,02	3,91 -0,03		
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,80 2,85	3,56 2,00	6,73 3,13	10,25 6,31	27,18 11,05	
NTN-B 150545 (5,915000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,79 2,84	3,55 1,99	6,71 3,12	10,21 6,28	27,11 10,98	
NTN-B 150545 (4,970000%)	0,99	5,40	3,32	6,24	9,23	25,25	

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.	0,76	2,45	1,76	2,64	5,30	9,12	
NTN-B 150850 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,76	5,41 2,46	3,32 1,76	6,24 2,65	9,24 5,31	25,31 9,19	
NTN-B 150555 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,80 2,84	3,55 1,99	6,71 3,12	10,23 6,29	27,14 11,01	
NTN-B 150850 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,79	5,56 2,61	3,41 1,85	6,43 2,84	9,64 5,70	26,05 9,92	
NTN-B 150545 (5,922000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,79 2,84	3,55 1,99	6,71 3,12	10,22 6,29	27,12 10,99	
NTN-B 150535 (4,910000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,75	5,38 2,43	3,30 1,74	6,21 2,61	9,17 5,24	25,01 8,88	
NTN-B 150555 (5,370000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,79	5,57 2,61	3,41 1,86	6,44 2,84	9,65 5,71	26,08 9,95	
NTN-B 150840 (4,970000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,76	5,40 2,45	3,32 1,76	6,24 2,64	9,23 5,30	25,21 9,08	
NTN-B 150826 (5,490000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,80	5,62 2,66	3,44 1,89	6,50 2,90	9,77 5,84	26,12 9,99	
NTN-B 150545 (6,280000%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,87	5,94 2,99	3,64 2,08	6,89 3,30	7,32 3,38		
NTN-B 150830 (5,460000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,80	2,67 -0,28	3,44 1,88	3,52 -0,07	3,73 -0,21		
NTN-B 150555 (5,000000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,76	5,42 2,46	3,32 1,77	6,25 2,66	9,27 5,33	25,38 9,25	
NTN-B 150535 (5,320000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,79	5,55 2,59	3,40 1,84	6,41 2,82	9,60 5,66	25,86 9,73	
NTN-B 150545 (6,256000%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,87	5,93 2,98	3,63 2,07	6,88 3,29	10,57 6,63	27,77 11,64	
NTN-B 150555 (6,261000%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,87	5,93 2,98	3,63 2,08	6,88 3,29	10,57 6,64	27,76 11,64	
NTN-B 150555 (5,520000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,80	5,63 2,68	3,45 1,89	6,51 2,92	9,80 5,87	26,37 10,24	
NTN-B 150545 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	1,11 0,88	5,99 3,04	3,67 2,11	6,95 3,36	7,40 3,46		
NTN-B 150545 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,76 2,80	3,53 1,97	6,67 3,08	10,13 6,19	26,94 10,81	
NTN-B 150545 (5,340000%)	1,02	5,56	3,41	6,42	9,62	25,98	

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.	0,79	2,60	1,85	2,83	5,68	9,85	
NTN-B 150523 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,59 0,36	5,27 2,32	3,05 1,49	6,18 2,59	9,63 5,70	26,32 10,20	
NTN-B 150535 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,75	5,36 2,41	3,29 1,73	6,18 2,59	9,12 5,18	24,91 8,78	
NTN-B 150828 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,78	5,53 2,57	3,39 1,83	6,39 2,79	9,55 5,61	25,67 9,54	
NTN-B 150555 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,86	5,88 2,93	3,60 2,05	6,82 3,23	10,45 6,51		
NTN-B 150535 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,79	5,53 2,58	3,39 1,84	6,40 2,80	9,57 5,63	25,80 9,67	
NTN-B 150830 (5,300000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,79	5,54 2,59	3,40 1,84	6,40 2,81	9,58 5,64	25,76 9,63	
NTN-B 150830 (5,500000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,80	5,62 2,67	3,45 1,89	6,50 2,91	9,78 5,85	26,19 10,06	
NTN-B 150830 (5,178300%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,78	5,49 2,54	3,37 1,81	6,34 2,75	9,45 5,51	25,50 9,37	
NTN-B 150523 (5,580000%) Var. IPCA p.p.	0,58 0,35	5,17 2,22	3,00 1,44	6,06 2,47	9,37 5,43	25,71 9,58	
NTN-B 150545 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,76	5,43 2,48	3,33 1,77	6,27 2,67	9,30 5,36	25,37 9,24	
NTN-B 150850 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	1,11 0,88	5,99 3,04	3,67 2,11	6,95 3,36	7,38 3,44		
NTN-B 150824 (5,912000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,79 2,84	3,55 1,99	6,71 3,12	10,21 6,27	27,06 10,94	
NTN-B 150555 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,76	5,43 2,48	3,33 1,77	6,27 2,67	9,30 5,36	25,44 9,31	
NTN-B 150850 (5,410000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,80	5,58 2,63	3,42 1,87	6,46 2,86	9,69 5,75	26,14 10,01	
NTN-B 150545 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,76	5,41 2,45	3,32 1,76	6,24 2,65	9,24 5,31	25,27 9,14	
NTN-B 150830 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,75	5,36 2,41	3,29 1,73	6,18 2,59	9,12 5,18	24,82 8,69	
NTN-B 150824 (5,345000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,79	5,56 2,60	3,41 1,85	6,42 2,83	9,62 5,69	25,76 9,63	
NTN-B 150840 (5,310000%)	1,02	5,54	3,40	6,41	9,59	25,89	

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.	0,79	2,59	1,84	2,81	5,65	9,76	
NTN-B 150830 (4,900000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,75	5,38 2,42	3,30 1,74	6,20 2,61	9,16 5,23	24,90 8,77	
NTN-B 150545 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,86	5,88 2,93	3,60 2,05	6,82 3,23	10,45 6,51		
NTN-B 150555 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,78 2,83	3,54 1,99	6,70 3,11	10,20 6,26		
NTN-B 150850 (6,278000%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,87	2,80 -0,16	3,64 2,08	3,72 0,13	4,13 0,19		
NTN-B 150840 (6,220000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,86	5,91 2,96	3,62 2,07	6,86 3,27	10,53 6,59	27,71 11,58	
NTN-B 150555 (5,060000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,77	5,44 2,49	3,34 1,78	6,28 2,69	9,33 5,39	25,49 9,37	
NTN-B 150525 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,75 2,79	3,52 1,96	6,66 3,06	10,11 6,17	26,83 10,70	
NTN-B 150535 (5,196100%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,78	5,50 2,54	3,37 1,81	6,35 2,76	9,47 5,53	25,60 9,47	
NTN-B 150523 (5,210000%) Var. IPCA p.p.	0,57 0,34	5,04 2,09	2,92 1,37	5,89 2,30	9,00 5,07	24,87 8,74	
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,77	5,47 2,51	3,35 1,80	6,31 2,72	9,40 5,46	25,35 9,22	
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,80	5,61 2,66	3,44 1,88	6,49 2,90	9,76 5,83	26,08 9,95	
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,77 2,82	3,53 1,98	6,68 3,09	10,16 6,22	27,00 10,87	
NTN-B 150850 (5,831200%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,76 2,80	3,53 1,97	6,67 3,08	10,13 6,19	26,95 10,82	
NTN-B 150826 (5,190000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,78	5,49 2,54	3,37 1,81	6,35 2,75	9,46 5,53	25,45 9,32	
NTN-B 150840 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,76 2,81	3,53 1,97	6,67 3,08	10,13 6,20	26,95 10,82	
NTN-B 150830 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,78	5,53 2,57	3,39 1,83	6,39 2,79	9,55 5,61	25,70 9,57	
NTN-B 150840 (4,950000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,76	5,40 2,44	3,31 1,75	6,23 2,63	9,21 5,28	25,17 9,04	
NTN-B 150840 (5,020000%)	0,99	5,42	3,33	6,26	9,29	25,31	

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.	0,76	2,47	1,77	2,67	5,35	9,18	
NTN-B 150850 (4,940000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,76	5,39 2,44	3,31 1,75	6,22 2,63	9,20 5,27	25,24 9,11	
NTN-B 150850 (6,261000%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,87	5,93 2,98	3,63 2,08	6,88 3,29	10,57 6,64	27,77 11,64	
NTN-B 150535 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	-1,77 -2,00	2,75 -0,21	0,61 -0,95	3,62 0,03	3,92 -0,02		
NTN-B 150850 (5,010000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,76	5,42 2,47	3,33 1,77	6,26 2,66	9,28 5,34	25,37 9,24	
NTN-B 150523 (5,300000%) Var. IPCA p.p.	0,57 0,34	5,07 2,12	2,94 1,38	5,93 2,34	9,09 5,16	25,07 8,95	
NTN-B 150555 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,77 2,82	3,53 1,98	6,68 3,09	10,16 6,22	27,01 10,88	
NTN-B 150545 (5,380000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,79	5,57 2,62	3,42 1,86	6,44 2,85	9,66 5,72	26,06 9,93	
NTN-B 150826 (5,009000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,76	5,42 2,47	3,33 1,77	6,25 2,66	9,27 5,34	25,05 8,92	
NTN-B 150535 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,77 2,81	3,53 1,98	6,68 3,09	10,15 6,22	26,97 10,84	
NTN-B 150555 (5,831200%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,76 2,80	3,53 1,97	6,67 3,08	10,13 6,19	26,96 10,83	
NTN-B 150828 (4,850000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,75	5,35 2,40	3,29 1,73	6,18 2,58	9,11 5,17	24,75 8,62	
NTN-B 150555 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	1,11 0,88	5,99 3,04	3,67 2,11	6,95 3,36	7,37 3,44		
NTN-B 150828 (5,240000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,78	5,51 2,56	3,38 1,83	6,37 2,78	9,51 5,58	25,60 9,47	
NTN-B 150850 (5,921000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,79 2,84	3,55 1,99	6,71 3,12	10,22 6,28	27,12 10,99	
NTN-B 150523 (5,420000%) Var. IPCA p.p.	0,58 0,35	5,12 2,16	2,97 1,41	5,99 2,39	9,21 5,28	25,35 9,22	
NTN-B 150555 (6,268000%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,87	5,93 2,98	3,63 2,08	6,88 3,29	7,30 3,36		
NTN-B 150826 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,82	5,71 2,75	3,50 1,94	6,61 3,01	10,00 6,07	26,61 10,49	
NTN-B 150830 (5,835000%)	1,06	5,76	3,53	6,67	10,13	26,91	

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.	0,83	2,81	1,97	3,08	6,20	10,79	
NTN-B 150555 (5,315000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,79	5,55 2,59	3,40 1,84	6,41 2,82	9,59 5,66	25,98 9,85	
NTN-B 150535 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,76 2,81	3,53 1,97	6,67 3,08	10,13 6,20	26,93 10,80	
NTN-B 150545 (5,285000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,79	5,53 2,58	3,39 1,84	6,39 2,80	9,56 5,63	25,87 9,74	
NTN-B 150824 (5,450000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,80	5,60 2,65	3,43 1,88	6,48 2,88	9,73 5,80	26,00 9,87	
NTN-B 150545 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,78 2,83	3,54 1,99	6,70 3,11	10,20 6,26		
NTN-B 150850 (5,045000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,76	5,43 2,48	3,33 1,78	6,27 2,68	9,31 5,38	25,44 9,31	
NTN-B 150840 (5,274000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,78	5,53 2,58	3,39 1,83	6,39 2,80	9,55 5,61	25,82 9,69	
NTN-B 150826 (5,130000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,77	5,47 2,52	3,36 1,80	6,32 2,72	9,40 5,46	25,32 9,19	
NTN-B 150840 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,79	5,56 2,61	3,41 1,85	6,43 2,84	9,64 5,70	25,99 9,86	
NTN-B 150840 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,77 2,81	3,53 1,98	6,68 3,09	10,15 6,22	26,98 10,85	
NTN-B 150850 (5,295500%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,79	5,54 2,58	3,40 1,84	6,40 2,81	9,57 5,64	25,92 9,79	
NTN-B 150535 (4,880000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,75	5,37 2,41	3,29 1,74	6,19 2,60	9,14 5,21	24,95 8,82	
NTN-B 150555 (5,420000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,80	5,59 2,64	3,43 1,87	6,46 2,87	9,70 5,77	26,18 10,05	
NTN-B 150850 (5,510000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,80	5,63 2,67	3,45 1,89	6,51 2,91	9,79 5,86	26,34 10,21	
NTN-B 150523 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,59 0,36	5,28 2,32	3,05 1,49	6,18 2,59	9,64 5,71	26,35 10,22	
NTN-B 150555 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,80 2,85	3,56 2,00	6,73 3,13	10,25 6,31	27,18 11,05	
NTN-B 150828 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,75 2,79	3,52 1,96	6,66 3,06	10,11 6,17	26,85 10,72	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	-52,45	-66,60	-60,15	-64,83	-60,86	-71,98	2.942,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-4.668,94	-1.240,43	-1.850,50	-989,32	-451,57	-320,84	11.723,88
BB INSTITUCIONAL FI RF	1,18	4,77	3,20	5,96	13,02	22,47	25,68
% do CDI	104,98	88,91	98,37	90,99	96,59	100,15	102,30
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1,24	5,28	3,32	6,47	13,49	23,07	25,83
% do CDI	110,50	98,43	102,15	98,81	100,09	102,83	102,92
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	0,44	0,44					
Var. IPCA p.p.	0,35	0,35					
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1,19	5,16	3,24	6,36	13,50	23,20	26,17
% do CDI	106,04	96,19	99,65	97,08	100,16	103,43	104,25
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7,44	-2,50	-0,58	-5,48	-4,40	-38,53	-17,72
Var. IBOVESPA p.p.	3,70	-1,22	-3,82	-1,79	-1,69	-24,36	-41,67
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	14,35	1,85	2,64	0,50	-0,03	4,51	
Var. IBOVESPA p.p.	10,61	3,12	-0,60	4,19	2,68	18,68	
TARPON GT 30 FIC FIA	13,28	13,36	13,63	7,95	20,91	24,32	138,12
Var. IBOVESPA p.p.	9,54	14,63	10,38	11,64	23,62	38,49	114,17
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	4,96	-5,00	0,52	-9,62	-1,47	-11,41	25,42
Var. IBOVESPA p.p.	1,22	-3,72	-2,72	-5,93	1,24	2,76	1,47
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	11,17	11,07	16,40	7,42	9,91	13,90	
Var. IBOVESPA p.p.	7,43	12,35	13,16	11,11	12,61	28,07	
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	6,33	-1,71	-0,74	-4,12	-15,50	-33,85	13,26
Var. IBOVESPA p.p.	2,59	-0,44	-3,99	-0,43	-12,79	-19,69	-10,69
INDIE FIC FIA	10,90	5,58	11,15	0,99	-1,95	-37,55	-8,37
Var. IBOVESPA p.p.	7,16	6,86	7,91	4,68	0,75	-23,38	-32,32
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	9,56	4,08	7,50	0,91	-9,69	-29,84	9,81
Var. IBOVESPA p.p.	5,83	5,35	4,26	4,60	-6,98	-15,68	-14,14
META VALOR FI DE AÇÕES	4,78	-7,50	-2,98	-11,16	-12,93	-31,51	-8,01
Var. IBRX 100 p.p.	1,18	-5,41	-5,34	-6,50	-8,46	-15,16	-31,51
OCCAM FIC FIA	0,44	-5,07	-1,26	-7,60	-5,85	-17,65	17,36
Var. IBOVESPA p.p.	-3,30	-3,80	-4,50	-3,91	-3,14	-3,48	-6,59
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	1,71	7,52	4,60	2,50	8,12	-9,49	18,22
Var. IBOVESPA p.p.	-2,03	8,79	1,36	6,19	10,83	4,67	-5,73
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-4,16	-11,95	-13,56	-9,39	-2,64	-38,27	
Var. MSCI ACWI p.p.	-4,72	-16,23	-14,11	-8,01	-9,33	-26,76	
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	2,61	5,57	3,40	5,78	13,30	-7,12	
Var. MSCI ACWI p.p.	2,05	1,29	2,85	7,17	6,60	4,39	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	3,81	16,47	7,26	10,12	2,57	-19,04	11,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. MSCI ACWI p.p.	3,25	12,19	6,71	11,51	-4,12	-7,52	-7,66
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	12,68	16,20	3,59	8,14	8,38	-53,28	
Var. MSCI ACWI p.p.	12,12	11,92	3,04	9,52	1,68	-41,77	
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4,72	3,12	-0,51	1,90	-7,46	-33,06	
Var. MSCI ACWI p.p.	4,16	-1,16	-1,06	3,29	-14,16	-21,54	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	6,84	21,04	7,55	17,16	21,65	-31,28	-3,62
Var. IPCA + 6,00% p.p.	6,10	15,61	4,50	10,53	11,50	-61,73	-53,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	2,58	9,14	6,12	10,93			
Var. S&P 500 p.p.	0,43	2,81	3,10	12,32			
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,17	12,23	7,31	6,80	10,56	15,90	58,10
% do CDI	104,59	227,72	224,86	103,74	78,36	70,87	231,49
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	1,23	12,43	7,55	6,96	15,57	21,88	68,08
Var. S&P 500 p.p.	-0,93	6,10	4,53	8,35	6,56	25,04	39,14
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,81	-6,36	-0,61	-7,56	-8,94	9,59	38,19
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,07	-11,80	-3,65	-14,19	-19,08	-20,86	-11,19
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	0,70	3,65	2,38	3,88	4,14	112,89	-99,26
% do CDI	62,48	67,92	73,36	59,27	30,75	503,22	-395,46
JACAREÍ	1,86	5,07	3,57	4,47	7,84		
Var. IPCA + 4,83% p.p.	1,19	-0,01	0,74	-1,72	-1,38		
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

12. Cotação e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotação	Liquidação	Cotação	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 ESTRATÉGICO IPCA FI RF	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
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	1,14	5,42	3,26	6,67	13,53	20,82	23,37	31,17	40,60
IRF-M 1+	2,85	8,54	6,92	10,30	15,84	14,80	14,48	30,11	50,74
IRF-M TOTAL	2,20	7,34	5,54	8,93	14,73	16,57	17,40	30,67	48,09
IMA-B 5	0,57	5,93	3,02	6,92	9,45	19,90	28,76	40,94	59,58
IMA-B 5+	4,13	11,16	11,29	9,84	11,30	11,03	22,89	28,01	69,69
IMA-B TOTAL	2,53	8,76	7,39	8,55	10,47	15,54	26,13	34,56	66,49
IMA-GERAL TOTAL	1,77	6,78	4,95	7,60	12,55	18,47	23,45	32,82	51,09
IDKA 2	0,29	5,76	2,60	7,07	8,74	18,79	28,85	40,48	57,41
IDKA 20	7,14	15,51	20,12	11,68	12,90	1,60	17,65	14,97	73,96
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95	11,65	41,15
IBRX 100	3,59	-2,09	2,36	-4,66	-4,47	-16,34	23,50	12,48	44,21
IBRX 50	2,92	-3,51	0,95	-5,97	-4,44	-15,81	25,71	11,41	38,93
SMALL CAP	13,54	4,71	13,69	1,56	-7,34	-32,24	6,89	5,09	34,10
Índice Consumo - ICON	12,26		6,51	-6,28	-15,80	-46,84	-32,02	-26,79	-9,87
Índice Dividendos - IDIV	0,84	0,48	2,64	-1,14	-0,85	1,55	39,98	32,28	81,33

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	2,16	6,32	3,02	-1,39	9,00	-3,17	28,94	96,40	109,24

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	5,43	5,10	7,30	5,10	6,84	6,99	13,39	18,05	36,10

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,56	4,28	0,55	-1,39	6,70	-11,51	19,15	69,85	72,84

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	2,95	1,56	3,59	3,94	16,13	25,48	27,84	33,80
INPC	0,36	2,79	1,54	3,50	3,74	16,08	26,41	29,00	35,17
IGPM	-1,84	-2,58	-2,73	-2,14	-4,47	5,78	44,96	54,39	66,19
SELIC	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	4,62	2,56	5,63	8,08	25,59	41,11	49,48	62,68
IPCA + 5,00%	0,66	5,03	2,80	6,13	9,11	28,01	45,21	55,30	70,63
IPCA + 5,50%	0,70	5,23	2,93	6,38	9,63	29,23	47,29	58,27	74,72
IPCA + 5,89%	0,73	5,39	3,02	6,57	10,03	30,18	48,92	60,62	77,96
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38	61,28	78,88
INPC + 4,00%	0,70	4,45	2,54	5,53	7,87	25,54	42,15	50,84	64,35
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49	62,75	80,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150525 (5,480000%)	2.159.527,83	5,480000	2.125.874,02	6,372100	-33.653,81
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.054.803,96	5,810000	1.044.433,27	6,372100	-10.370,69
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.071.150,75	5,680000	20.210.294,24	5,582800	139.143,49
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.191.451,25	4,860000	2.067.902,74	5,552700	-123.548,51
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.187.749,34	4,880000	2.067.902,74	5,552700	-119.846,60
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.186.750,17	4,910000	2.072.201,91	5,552700	-114.548,26
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.174.616,61	5,196100	2.110.894,48	5,552700	-63.722,13
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.175.171,60	5,290000	2.128.091,18	5,552700	-47.080,42
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.174.109,01	5,320000	2.132.390,35	5,552700	-41.718,66
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.503.051,43	5,670000	1.517.608,45	5,552700	14.557,02
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.028.255,88	5,837000	2.076.501,09	5,552700	48.245,21
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.174.149,82	5,855000	3.254.474,79	5,552700	80.324,97
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.203.359,18	4,970000	2.007.719,39	5,730200	-195.639,79
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.200.610,89	4,980000	2.007.719,39	5,730200	-192.891,50
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.196.270,90	5,030000	2.016.281,10	5,730200	-179.989,80
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.182.355,51	5,285000	2.067.651,32	5,730200	-114.704,19
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.181.159,53	5,340000	2.080.493,87	5,730200	-100.665,66
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.179.452,15	5,380000	2.089.055,57	5,730200	-90.396,58
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.122.048,28	5,831000	5.184.111,27	5,730200	62.062,99
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.115.941,35	5,860000	2.148.987,50	5,730200	33.046,15
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.035.317,49	5,897000	2.076.213,02	5,730200	40.895,53
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.218.550,35	5,915000	6.357.064,60	5,730200	138.514,25
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.029.289,14	5,922000	2.076.213,02	5,730200	46.923,88
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.559.171,67	6,140000	4.785.992,07	5,730200	226.820,40
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.592.634,31	6,256000	3.822.800,47	5,730200	230.166,16
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.024.968,46	6,280000	3.227.762,10	5,730200	202.793,64
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.061.339,66	6,400000	2.230.323,68	5,730200	168.984,02
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.208.288,26	5,000000	1.987.630,27	5,722200	-220.657,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.203.145,45	5,030000	1.991.941,84	5,722200	-211.203,61
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.198.028,42	5,060000	1.996.253,40	5,722200	-201.775,02
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.185.274,93	5,315000	2.060.926,84	5,722200	-124.348,09
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.185.940,63	5,370000	2.078.173,09	5,722200	-107.767,54
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.183.620,57	5,420000	2.091.107,77	5,722200	-92.512,80
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.174.492,66	5,520000	2.112.665,58	5,722200	-61.827,08
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.277.084,53	5,831200	11.451.509,78	5,722200	174.425,25
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.114.400,82	5,860000	2.155.781,21	5,722200	41.380,39
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.077.864,34	5,897000	5.204.055,84	5,722200	126.191,50
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.031.895,02	5,927000	2.091.107,77	5,722200	59.212,75
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.579.148,44	5,950000	17.116.902,80	5,722200	537.754,36
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.112.913,84	6,140000	9.657.899,82	5,722200	544.985,98
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.203.902,78	6,261000	8.838.702,96	5,722200	634.800,18
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.056.681,13	6,268000	7.609.907,67	5,722200	553.226,54
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.157.218,71	6,400000	5.661.081,45	5,722200	503.862,74
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.190.258,46	5,345000	2.134.105,16	7,722900	-56.153,30
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.221.508,29	5,450000	2.167.064,32	7,722900	-54.443,97
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.176.618,27	5,912000	2.134.105,16	7,722900	-42.513,11
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.221.640,53	5,009000	2.184.846,15	5,610000	-36.794,38
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.222.760,48	5,130000	2.193.330,99	5,610000	-29.429,49
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.223.344,63	5,190000	2.197.573,41	5,610000	-25.771,22
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.226.175,39	5,490000	2.218.785,51	5,610000	-7.389,88
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.257.632,58	5,710000	3.266.663,18	5,610000	9.030,60
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.235.817,95	4,850000	2.174.772,89	5,498200	-61.045,06
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.227.022,39	5,125600	2.191.930,86	5,498200	-35.091,53
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.229.179,48	5,240000	2.204.799,34	5,498200	-24.380,14
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.226.328,70	5,270000	2.204.799,34	5,498200	-21.529,36
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.263.737,28	5,810000	3.307.199,01	5,498200	43.461,73
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.243.420,17	4,860000	2.170.440,47	5,450000	-72.979,70
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.238.373,47	4,900000	2.170.440,47	5,450000	-67.933,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.230.047,57	5,178300	2.196.433,77	5,450000	-33.613,80
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.231.756,14	5,270000	2.209.430,42	5,450000	-22.325,72
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.232.384,91	5,300000	2.213.762,63	5,450000	-18.622,28
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.511.469,74	5,460000	3.513.427,59	5,450000	1.957,85
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.229.201,69	5,500000	2.235.423,72	5,450000	6.222,03
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.265.176,08	5,835000	3.335.806,71	5,450000	70.630,63
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.256.338,88	4,950000	2.090.908,17	5,674600	-165.430,71
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.246.850,42	4,970000	2.086.561,17	5,674600	-160.289,25
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.248.888,25	5,020000	2.099.602,18	5,674600	-149.286,07
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.239.112,73	5,274000	2.147.419,20	5,674600	-91.693,53
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.239.681,54	5,310000	2.156.113,21	5,674600	-83.568,33
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.236.938,89	5,360000	2.164.807,21	5,674600	-72.131,68
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.090.376,09	5,837000	2.125.684,19	5,674600	35.308,10
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.264.177,92	5,855000	3.325.456,87	5,674600	61.278,95
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.079.204,75	6,220000	3.255.904,83	5,674600	176.700,08
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.267.299,28	4,940000	2.039.748,75	5,726200	-227.550,53
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.264.445,56	4,980000	2.048.465,62	5,726200	-215.979,94
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.259.904,75	5,010000	2.052.824,06	5,726200	-207.080,69
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.253.834,14	5,045000	2.057.182,50	5,726200	-196.651,64
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.242.915,10	5,295500	2.118.200,62	5,726200	-124.714,48
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.241.833,94	5,360000	2.135.634,37	5,726200	-106.199,57
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.240.494,28	5,410000	2.148.709,69	5,726200	-91.784,59
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.233.247,94	5,510000	2.170.501,87	5,726200	-62.746,07
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.435.044,34	5,831200	8.551.254,37	5,726200	116.210,03
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.133.104,46	5,897000	3.203.451,56	5,726200	70.347,10
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.090.772,82	5,921000	2.144.351,25	5,726200	53.578,43
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.397.098,22	5,950000	11.732.913,74	5,726200	335.815,52
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.776.645,46	6,140000	7.147.837,50	5,726200	371.192,04
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.644.234,83	6,261000	6.045.152,81	5,726200	400.917,98
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.189.565,18	6,278000	5.570.083,12	5,726200	380.517,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.095.359,07	6,400000	3.373.430,62	5,726200	278.071,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

14. Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
132	02/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,34183512	230,3173595000
133	02/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,34183512	230,3173595000
103	02/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	247.628,60	1.075,16255200	230,3173595000
104	02/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	738.371,40	3.205,88690400	230,3173595000
105	02/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	22.000,00	0,00	95,52037300	230,3173595000
134	03/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,33971513	230,4298717000
157	03/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	20.000,00	0,00	86,79430300	230,4298717000
135	04/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	15.000,00	65,06264365	230,5470414000
136	05/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,67090449	230,6564446000
137	08/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,33311133	230,7810541000
107	08/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	497.500,00	0,00	2.155,72288609	230,7810541000
138	10/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	30.000,00	129,85975177	231,0184610000
108	10/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	238.870,18	1.033,98740934	231,0184610000
109	10/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	22.066,96	95,52033160	231,0184610000
110	10/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	20.051,08	86,79427572	231,0184610000
111	10/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	498.011,78	2.155,72287100	231,0184610000
139	12/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	29.000,00	125,39730688	231,2649348000
140	12/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,64809013	231,2649348000
141	15/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	10.000,00	43,21507690	231,4007221000
162	15/05/2023	NTN-B 150523 (5,210000%)	0,00	2.204.991,59	520,00000000	4.240,3684420000
163	15/05/2023	NTN-B 150523 (5,300000%)	0,00	2.243.154,91	529,00000000	4.240,3684500000
164	15/05/2023	NTN-B 150523 (5,420000%)	0,00	11.135.207,57	2.626,00000000	4.240,3684580000
165	15/05/2023	NTN-B 150523 (5,580000%)	0,00	3.341.410,34	788,00000000	4.240,3684520000
166	15/05/2023	NTN-B 150523 (5,850000%)	0,00	2.230.433,80	526,00000000	4.240,3684410000
167	15/05/2023	NTN-B 150523 (5,860000%)	0,00	11.156.409,41	2.631,00000980	4.240,3684410646
168	15/05/2023	NTN-B 150523 (5,930000%)	0,00	5.525.200,10	1.303,00000502	4.240,3684410650
169	15/05/2023	NTN-B 150523 (6,560000%)	0,00	2.217.712,70	523,00000000	4.240,3684410000
112	15/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	12,96452307	231,4007221000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
113	15/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	44.288.000,00	0,00	191.390,93256961	231,4007221000
153	17/05/2023	NTN-B 150533 (5,680000%)	19.996.872,43	0,00	4.735,00000000	4.223,2043150000
154	17/05/2023	NTN-B 150830 (5,460000%)	3.498.762,83	0,00	811,00000000	4.314,1341920000
155	17/05/2023	NTN-B 150535 (5,670000%)	1.497.494,98	0,00	353,00000000	4.242,1954110000
158	17/05/2023	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	5.000.000,00	0,00	1,00000000	5.000.000,0000000000
159	17/05/2023	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	5.000.000,00	0,00	1,00000000	5.000.000,0000000000
160	17/05/2023	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	5.000.000,00	0,00	100,00000000	50.000,0000000000
161	17/05/2023	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	5.000.000,00	0,00	100,00000000	50.000,0000000000
114	17/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	657.142,93	2.836,78283239	231,6507709000
115	17/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	44.335.857,07	191.390,93255657	231,6507709000
142	18/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,62899185	231,7767862000
152	18/05/2023	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5.000.000,00	0,00	5.000.000,00000000	1,0000000000
116	18/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	54.858,10	236,68504901	231,7767862000
117	18/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	161.729,21	697,78001780	231,7767862000
118	18/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.622.235,84	15.628,12177780	231,7767862000
119	18/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.161.176,85	5.009,89278969	231,7767862000
143	19/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	14.000,00	60,36986354	231,9037874000
120	19/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,31213311	231,9037874000
144	23/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,30734729	232,1614520000
145	25/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	105.000,00	451,75698883	232,4258453000
121	25/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,30244751	232,4258453000
122	25/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,60489503	232,4258453000
146	26/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	29.000,00	124,69878101	232,5604129000
123	26/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	296.000,00	0,00	1.272,78755790	232,5604129000
147	29/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	11.289,83	48,52118211	232,6783790000
148	29/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	89.710,17	385,55438793	232,6783790000
149	30/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	37.000,00	158,92811839	232,8096524000
124	30/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	7.099.000,00	0,00	30.492,72195898	232,8096524000
129	31/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	440.174,61	1.889,61805184	232,9436944000
130	31/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	296.487,83	1.272,78753247	232,9436944000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
131	31/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	7.103.087,30	30.492,72193564	232,9436944000
151	31/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	367.000,00	0,00	1.575,48802059	232,9436944000
156	31/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	519.637,77	2.230,74409200	232,9436944000
126	31/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	230.477,98	989,41497684	232,9436944000
127	31/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	107.258,50	460,44817945	232,9436944000
128	31/05/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	23.876,01	102,49691481	232,9436944000
Total			102.582.630,24	100.921.520,42		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

15. Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.714.420,85

Value-At-Risk: 1,47%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
JACAREÍ		1,47	1,47			659.080.526,60	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,07%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,930000%)		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
NTN-B 150523 (6,560000%)		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
NTN-B 150523 (5,850000%)		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
NTN-B 150523 (5,580000%)		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
NTN-B 150523 (5,210000%)		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
NTN-B 150523 (5,300000%)		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
NTN-B 150523 (5,420000%)		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
NTN-B 150523 (5,860000%)		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
NTN-B 150525 (5,480000%)		0,07	-0,00	0,10			2.159.527,83	0,33
NTN-B 150525 (5,810000%)		0,07	-0,00	0,10			1.054.803,96	0,16
NTN-B 150533 (5,680000%)		0,20	-0,00	0,20			20.071.150,75	3,05
NTN-B 150535 (4,860000%)		0,07	-0,00	0,10			2.191.451,25	0,33
NTN-B 150535 (4,880000%)		0,07	-0,00	0,10			2.187.749,34	0,33
NTN-B 150535 (4,910000%)		0,07	-0,00	0,10			2.186.750,17	0,33
NTN-B 150535 (5,196100%)		0,07	-0,00	0,10			2.174.616,61	0,33
NTN-B 150535 (5,290000%)		0,07	-0,00	0,10			2.175.171,60	0,33
NTN-B 150535 (5,320000%)		0,07	-0,00	0,10			2.174.109,01	0,33
NTN-B 150535 (5,670000%)		0,19	-0,00	0,20			1.503.051,43	0,23
NTN-B 150535 (5,837000%)		0,07	-0,00	0,10			2.028.255,88	0,31
NTN-B 150535 (5,855000%)		0,07	-0,00	0,10			3.174.149,82	0,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (4,970000%)		0,07	-0,00	0,10			2.203.359,18	0,33
NTN-B 150545 (4,980000%)		0,07	-0,00	0,10			2.200.610,89	0,33
NTN-B 150545 (5,030000%)		0,07	-0,00	0,10			2.196.270,90	0,33
NTN-B 150545 (5,285000%)		0,07	-0,00	0,10			2.182.355,51	0,33
NTN-B 150545 (5,340000%)		0,07	-0,00	0,10			2.181.159,53	0,33
NTN-B 150545 (5,380000%)		0,07	-0,00	0,10			2.179.452,15	0,33
NTN-B 150545 (5,831000%)		0,07	-0,00	0,10			5.122.048,28	0,78
NTN-B 150545 (5,860000%)		0,07	-0,00	0,10			2.115.941,35	0,32
NTN-B 150545 (5,897000%)		0,07	-0,00	0,10			2.035.317,49	0,31
NTN-B 150545 (5,915000%)		0,07	-0,00	0,10			6.218.550,35	0,94
NTN-B 150545 (5,922000%)		0,07	-0,00	0,10			2.029.289,14	0,31
NTN-B 150545 (6,140000%)		0,07	-0,00	0,10			4.559.171,67	0,69
NTN-B 150545 (6,256000%)		0,07	-0,00	0,10			3.592.634,31	0,55
NTN-B 150545 (6,280000%)		0,07	-0,00	0,10			3.024.968,46	0,46
NTN-B 150545 (6,400000%)		0,07	-0,00	0,10			2.061.339,66	0,31
NTN-B 150555 (5,000000%)		0,07	-0,00	0,10			2.208.288,26	0,34
NTN-B 150555 (5,030000%)		0,07	-0,00	0,10			2.203.145,45	0,33
NTN-B 150555 (5,060000%)		0,07	-0,00	0,10			2.198.028,42	0,33
NTN-B 150555 (5,315000%)		0,07	-0,00	0,10			2.185.274,93	0,33
NTN-B 150555 (5,370000%)		0,07	-0,00	0,10			2.185.940,63	0,33
NTN-B 150555 (5,420000%)		0,07	-0,00	0,10			2.183.620,57	0,33
NTN-B 150555 (5,520000%)		0,07	-0,00	0,10			2.174.492,66	0,33
NTN-B 150555 (5,831200%)		0,07	-0,00	0,10			11.277.084,53	1,71
NTN-B 150555 (5,860000%)		0,07	-0,00	0,10			2.114.400,82	0,32
NTN-B 150555 (5,897000%)		0,07	-0,00	0,10			5.077.864,34	0,77
NTN-B 150555 (5,927000%)		0,07	-0,00	0,10			2.031.895,02	0,31
NTN-B 150555 (5,950000%)		0,07	-0,00	0,10			16.579.148,44	2,52
NTN-B 150555 (6,140000%)		0,07	-0,00	0,10			9.112.913,84	1,38
NTN-B 150555 (6,261000%)		0,07	-0,00	0,10			8.203.902,78	1,24
NTN-B 150555 (6,268000%)		0,07	-0,00	0,10			7.056.681,13	1,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150555 (6,400000%)		0,07	-0,00	0,10			5.157.218,71	0,78
NTN-B 150824 (5,345000%)		0,07	-0,00	0,11			2.190.258,46	0,33
NTN-B 150824 (5,450000%)		0,07	-0,00	0,10			2.221.508,29	0,34
NTN-B 150824 (5,912000%)		0,07	-0,00	0,10			2.176.618,27	0,33
NTN-B 150826 (5,009000%)		0,07	-0,00	0,10			2.221.640,53	0,34
NTN-B 150826 (5,130000%)		0,07	-0,00	0,10			2.222.760,48	0,34
NTN-B 150826 (5,190000%)		0,07	-0,00	0,10			2.223.344,63	0,34
NTN-B 150826 (5,490000%)		0,07	-0,00	0,10			2.226.175,39	0,34
NTN-B 150826 (5,710000%)		0,07	-0,00	0,10			3.257.632,58	0,49
NTN-B 150828 (4,850000%)		0,07	-0,00	0,10			2.235.817,95	0,34
NTN-B 150828 (5,125600%)		0,07	-0,00	0,10			2.227.022,39	0,34
NTN-B 150828 (5,240000%)		0,07	-0,00	0,10			2.229.179,48	0,34
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,07	-0,00	0,10			2.226.328,70	0,34
NTN-B 150828 (5,810000%)		0,07	-0,00	0,10			3.263.737,28	0,50
NTN-B 150830 (4,860000%)		0,07	-0,00	0,10			2.243.420,17	0,34
NTN-B 150830 (4,900000%)		0,07	-0,00	0,10			2.238.373,47	0,34
NTN-B 150830 (5,178300%)		0,07	-0,00	0,10			2.230.047,57	0,34
NTN-B 150830 (5,270000%)		0,07	-0,00	0,10			2.231.756,14	0,34
NTN-B 150830 (5,300000%)		0,07	-0,00	0,10			2.232.384,91	0,34
NTN-B 150830 (5,460000%)		0,19	-0,00	0,22			3.511.469,74	0,53
NTN-B 150830 (5,500000%)		0,07	-0,00	0,10			2.229.201,69	0,34
NTN-B 150830 (5,835000%)		0,07	-0,00	0,10			3.265.176,08	0,50
NTN-B 150840 (4,950000%)		0,07	-0,00	0,10			2.256.338,88	0,34
NTN-B 150840 (4,970000%)		0,07	-0,00	0,10			2.246.850,42	0,34
NTN-B 150840 (5,020000%)		0,07	-0,00	0,10			2.248.888,25	0,34
NTN-B 150840 (5,274000%)		0,07	-0,00	0,10			2.239.112,73	0,34
NTN-B 150840 (5,310000%)		0,07	-0,00	0,10			2.239.681,54	0,34
NTN-B 150840 (5,360000%)		0,07	-0,00	0,10			2.236.938,89	0,34
NTN-B 150840 (5,837000%)		0,07	-0,00	0,11			2.090.376,09	0,32
NTN-B 150840 (5,855000%)		0,07	-0,00	0,10			3.264.177,92	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,220000%)		0,07	-0,00	0,10			3.079.204,75	0,47
NTN-B 150850 (4,940000%)		0,07	-0,00	0,10			2.267.299,28	0,34
NTN-B 150850 (4,980000%)		0,07	-0,00	0,10			2.264.445,56	0,34
NTN-B 150850 (5,010000%)		0,07	-0,00	0,10			2.259.904,75	0,34
NTN-B 150850 (5,045000%)		0,07	-0,00	0,10			2.253.834,14	0,34
NTN-B 150850 (5,295500%)		0,07	-0,00	0,10			2.242.915,10	0,34
NTN-B 150850 (5,360000%)		0,07	-0,00	0,10			2.241.833,94	0,34
NTN-B 150850 (5,410000%)		0,07	-0,00	0,10			2.240.494,28	0,34
NTN-B 150850 (5,510000%)		0,07	-0,00	0,10			2.233.247,94	0,34
NTN-B 150850 (5,831200%)		0,07	-0,00	0,10			8.435.044,34	1,28
NTN-B 150850 (5,897000%)		0,07	-0,00	0,10			3.133.104,46	0,48
NTN-B 150850 (5,921000%)		0,07	-0,00	0,10			2.090.772,82	0,32
NTN-B 150850 (5,950000%)		0,07	-0,00	0,10			11.397.098,22	1,73
NTN-B 150850 (6,140000%)		0,07	-0,00	0,10			6.776.645,46	1,03
NTN-B 150850 (6,261000%)		0,07	-0,00	0,10			5.644.234,83	0,86
NTN-B 150850 (6,278000%)		0,20	-0,00	0,23			5.189.565,18	0,79
NTN-B 150850 (6,400000%)		0,07	-0,00	0,10			3.095.359,07	0,47
Sub-total	0,30	0,07	-0,00		-0,25	1,05	305.704.380,09	46,38

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF		0,05	0,00	0,10			5.022.132,50	0,76
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			48.809.033,34	7,41
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,07	0,00	0,07			23.041.080,39	3,50
BB INSTITUCIONAL FI RF		0,06	0,00	0,06			32.758.764,46	4,97
Sub-total	0,05	0,03	0,00		1,85	1,21	109.631.010,70	16,63

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a		0,94	-0,00	0,90			5.021.078,63	0,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a		1,04	-0,00	1,00			5.023.260,51	0,76
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a		0,93	-0,00	0,89			5.020.910,50	0,76
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a		0,23	0,00	0,24			5.352.773,27	0,81
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a		0,92	-0,00	0,88			5.020.686,11	0,76
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a		0,18	-0,00	0,19			5.849.299,63	0,89
Sub-total	0,98	0,49	-0,00		0,05	1,18	31.288.008,65	4,75

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III		5,03	0,00	5,03			2.499,51	0,00
Sub-total	251,57	5,03	0,00		-0,21	-52,45	2.499,51	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		0,02	0,00	0,02			3.272.442,95	0,50
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV		0,97	0,00	0,65			2.112.534,27	0,32
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,26	0,00	0,26			5.600.822,52	0,85
Sub-total	0,27	0,23	0,00		0,15	1,17	10.985.799,75	1,67

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,02%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA		13,79	0,06	8,10			4.025.044,32	0,61
META VALOR FI DE AÇÕES		11,44	0,03	4,95			2.101.772,66	0,32
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		9,70	0,08	4,46			7.128.742,60	1,08
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,82	0,05	4,18			4.772.302,67	0,72
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		8,01	0,21	3,09			24.105.035,03	3,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
OCCAM FIC FIA		7,33	0,24	2,30			27.715.435,64	4,21
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		9,95	0,03	6,19			3.292.248,74	0,50
INDIE FIC FIA		11,37	0,04	5,88			3.385.445,55	0,51
TARPON GT 30 FIC FIA		8,93	0,06	7,12			7.648.150,83	1,16
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA		11,18	0,07	8,86			6.562.297,82	1,00
Sub-total	16,04	8,02	0,87		0,29	5,75	90.736.475,87	13,77

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,30%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO		10,73	0,02	12,81			7.363.830,24	1,12
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		7,22	0,14	7,22			17.000.150,31	2,58
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		7,26	0,23	6,00			28.222.333,08	4,28
Sub-total	11,86	6,42	0,39		0,02	1,40	52.586.313,62	7,98

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		0,30	0,00	0,31			11.162.217,11	1,69
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		0,16	0,00	0,16			15.832,23	0,00
Sub-total	2,72	0,30	0,00		-0,12	0,81	11.178.049,34	1,70

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,99%

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		9,80	0,14	8,31			14.015.114,99	2,13
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		21,45	0,02	19,70			1.800.705,81	0,27
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA		8,50	-0,01	8,87			2.483.604,13	0,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INVESTIMENTO NO EXTERIOR								
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		11,33	-0,01	11,51			2.519.844,28	0,38
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		13,53	0,01	13,53			2.597.064,94	0,39
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		8,84	-0,00	8,90			5.233.323,60	0,79
Sub-total	11,06	7,56	0,15		0,23	3,70	28.649.657,75	4,35

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		7,64	0,07	12,79			18.318.331,33	2,78
Sub-total	15,17	7,64	0,07		0,04	1,71	18.318.331,33	2,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

16. Relatório de Cenário Macroeconômico

Ao longo do mês de maio os ecos da crise bancária americana, iniciada em meados de março, se dissiparam. Além disso, a volatilidade no segmento de renda fixa permaneceu alta, com especial destaque para o mercado americano. Ainda há uma leitura cautelosa, especialmente pela perspectiva mais desfavorável para as economias desenvolvidas, onde a inflação elevada e os juros restritivos sugerem crescimento fraco e alto grau de incerteza. Nos EUA, os dados mais fortes de atividade e emprego e o arrefecimento do stress financeiro abrem a possibilidade para novas elevações da taxa básica de juros. O Fed, por sua vez, elevou a taxa de juros em 0,25%. No atual patamar, os juros continuarão exercendo efeito restritivo sobre a economia, que deve ser intensificado por condições creditícias mais apertadas, dada a situação mais complexa para os bancos regionais. A curva de juros americana voltou a subir, à medida em que a crise bancária precipitada pelo mercado em março foi ficando para trás e as conversas sobre a elevação do teto da dívida foram avançando. Dessa maneira, parte do alívio de março foi revertido. Na Zona do Euro, a inflação continua pressionada, com o avanço do núcleo, e a esperada queda deverá ocorrer de forma gradual. Em reflexo a dinâmica inflacionária, o Banco Central Europeu ainda deve promover um aumento de juros, o que deverá contribuir para a manutenção de um ritmo fraco da atividade na região. Sendo assim, permanece a expectativa de uma dinâmica desafiadora para as economias desenvolvidas nos próximos trimestres. A economia chinesa perdeu o dinamismo observado após o fim da política de covid zero. Onde, o setor de imóveis residenciais segue mostrando fraqueza. Dada a importância do setor para a economia chinesa, isso exerceu pressão baixista sobre commodities no mês. Assim, no mês de maio de 2023, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, renderam -1,32% e +0,25%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos de -0,99% e +1,15%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, valorizaram +0,56% e +2,16%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos positivos de +6,70% e +9% nos últimos 12 meses. Localmente, dado o alívio nas expectativas de inflação para este ano e o avanço na aprovação do novo arcabouço fiscal, observamos queda ao longo da curva de juros locais. Adicionalmente, a atividade econômica continuou a dar sinais mais fortes, o que foi ratificado pelo crescimento de 1,9% do PIB do primeiro trimestre. A inflação continua seguindo um estágio de desaceleração mais lento, com medidas de núcleo pressionadas, isso sugere maior persistência da inflação em um horizonte relevante para a condução da política monetária. Ainda assim, o Banco Central passou a adotar um discurso mais suave, no qual, apesar de reconhecer os desafios à frente, também mostra uma visão mais positiva em relação às perspectivas para a inflação. Adicionalmente, a meta de inflação poderá ser revista pelo Conselho Monetário Nacional. Essa definição e os próximos passos no campo fiscal terão efeito importante sobre as expectativas da inflação. Além disso, vale ressaltar que o andamento do arcabouço fiscal no Congresso e as medidas voltadas para o aumento de arrecadação, elemento fundamental para o sucesso do arcabouço, seguem como tema relevante para os próximos passos do Copom. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo o movimento dos índices internacionais. Apresentando um retorno positivo de 3,47% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento negativo anual de -1,28% e de -2,71% nos últimos 12 meses.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

17. Agenda realizada

02 de maio:

Reunião com Daniel Sandoval representante da gestora RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA, formato online pela plataforma “Teams”. O objetivo da reunião foi apresentar oportunidades de fundos de CAPITAL PROTEGIDO 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.

03 de maio:

Reunião com representantes do BANCO DO BRASIL em parceria com a JP MORGAN realizada na cidade de São Paulo. O objetivo da reunião foi apresentar oportunidades de mercado globais e investimentos no exterior, bem como expor a visão das gestoras 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.

04 de maio:

Reunião com Daniel Varejão representante da PORTO SEGURO INVESTIMENTOS em parceria com a DOLAR BILLS, formato online pela plataforma “Teams”. O objetivo da reunião foi apresentar a conjuntura econômica atual, expectativas para inflação e Selic. Também demonstrou opções em fundos de CAPITAL PROTEGIDO, porém atrelados ao Art. 10º (Multimercados). Participaram da reunião Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e o estagiário João Pedro Gomes Santos.

08 de maio:

Reunião com Marcelo Gengo representante da gestora VINCI PARTNERS, na sede do Instituto. O objetivo da reunião foi apresentar oportunidades variadas em fundos de ações, multimercados, renda fixa, crédito privado e FIP e expor a visão da gestora frente ao cenário nos próximos meses. Participaram da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Rossana Vasques – Presidente do IPMJ e o estagiário João Pedro Gomes Santos.

09 de maio:

Reunião em parceria com a DOLAR BILLS na cidade de São Paulo. O objetivo da reunião foi apresentar oportunidades das gestoras, TARPON, GUEPARDO e PORTO SEGURO, para diversificação da carteira de investimentos, bem como expor a visão dos gestores 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 e Rossana Vasques – Presidente do IPMJ.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

10 de maio:

9h00: Tricentésima octogésima quarta (384ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros (CAIF) do Instituto de Previdência do Município de Jacareí (IPMJ), tendo início às 15h00 em formato híbrido, com as seguintes presenças dos membros do CAIF na sala de reuniões: Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Clévio Vitor de Almeida, Victor Adriano Vieira Silva, José Ricardo Vinhas e, de forma on-line, Rafaela Carvalho dos Santos. Também participaram a Presidente Rossana Vasques, a Assessora da Presidência Fabíola de Melo Silva e os estagiários Julia Victoria Jesus Simões e João Pedro Gomes Santos. Pautas da reunião: 1) Apresentação dos estudos de ALM (Asset Liability Management) 2023; 2) Estudos e propostas para a movimentação da carteira; 3) Credenciamentos. 4) Assuntos Diversos.

17 de maio:

9h00: Tricentésima octogésima quinta (385ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros (CAIF) do Instituto de Previdência do Município de Jacareí (IPMJ), ocorrida em 17 de maio de 2023, tendo início às 9h20 em formato presencial na sala de reuniões do IPMJ, com as seguintes presenças: Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Clévio Vitor de Almeida, Victor Adriano Vieira Silva e 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 do relatório de investimentos de abril de 2023; 2) Análise da carteira fechada de abril de 2023; 3) Apresentação do gestor Rio Bravo Investimentos LTDA.; 4) Credenciamentos; 5) Assuntos diversos.

24 de maio:

10h00: Reunião em parceria com a DOLAR BILLS na cidade de São Paulo. O objetivo da reunião foi a prestação de contas da gestora BRASIL CAPITAL ao longo de seus 15 anos de mercado, bem como as oportunidades de investimentos para os RPPS. Participaram da reunião Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e o estagiário João Pedro Gomes Santos.

31 de maio:

11h00: Reunião em parceria com a XP INVESTIMENTOS na cidade de São Paulo com seu representante Eduardo Reichert. O objetivo da reunião foi a apresentação de opções de fundos em renda fixa. Também ocorreu a visita na sede da gestora INDIE CAPITAL INVESTIMENTOS LTDA. Participaram da reunião Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos e Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Em maio de 2023, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um prejuízo de R\$ 457.660,57 (quatrocentos e cinquenta e sete mil e seiscentos e sessenta reais e cinquenta e sete centavos negativos) e um rendimento negativo acumulado, R\$ 1.406.836,25 (um milhão e quatrocentos e seis mil e oitocentos e trinta e seis reais e vinte e cinco 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 maio de 2023 é de R\$ 2.499,51 (dois mil e quatrocentos e noventa e nove reais e cinquenta e um centavos).

II. PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP

O Fundo PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP em maio 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\$ 2.808.964,36 (dois milhões e oitocentos e oito mil e novecentos e sessenta e quatro reais e trinta e seis centavos negativos). O saldo em 31 de maio de 2023 foi de R\$ 15.832,23 (quinze mil e oitocentos e trinta e dois reais e vinte e três centavos), com um rendimento mensal de R\$ 110,37 (cento e dez reais e trinta e sete centavos).

19. Fundos Estruturados**I. (FIP) KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA**

O Fundo KINEA PRIVATE EQUITY apresenta um valor total aplicado de R\$ 9.095.886,00 (nove milhões e noventa e cinco mil e oitocentos e oitenta e seis reais), e um rendimento acumulado de R\$ 2.546.239,18 (dois milhões e quinhentos e quarenta e seis mil e duzentos e trinta e nove reais e dezoito centavos). O saldo acumulado em 31 de maio de 2023 é de R\$ 11.162.217,11 (onze milhões e cento e sessenta e dois mil e duzentos e dezessete reais e onze centavos) com um rendimento no mês de maio de R\$ R\$ 89.514,05 (oitenta e nove mil e quinhentos e quatorze reais e cinco centavos).