



LDB
EMPRESAS

JACAREÍ
JUNHO 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	11
5. Rentabilidades por Artigo	12
6. Análise de Liquidez	19
7. Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial.....	22
8. Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses.....	24
9. Performance dos Fundos	25
10. Cotização e Taxas	33
11. Indexadores.....	35
12. Curva x Mercado	37
13. Movimentações.....	41
14. Análise de Risco	43
15. Relatório de Cenário Macroeconômico	50
16. Agenda realizada.....	51
17. Acompanhamento fundos estressados	52
18. Fundos Estruturados.....	52

1. PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS

Em 02 de julho de 2019 o IPMJ formalizou sua adesão ao Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios – “Pró Gestão RPPS”. Em atendimento ao Manual do Pró Gestão RPPS, apresenta-se o presente relatório, referente ao mês de junho de 2023, que é elaborado mensalmente pela Unidade de Gestão de Investimentos.

O relatório foi apresentado ao Comitê e contém seus respectivos valores registrados pela Contabilidade. Foram analisadas a legalidade e a conformidade com a Política de Investimentos. O relatório reflete que as movimentações financeiras atenderam requisitos legais e às provisões da Política de Investimentos que atende às necessidades da gestão de investimentos.



Renata de Souza Santos Esteves

Diretora do Dep. Administrativo-Financeiro – CPA 10



Luis Gustavo Ferreira Bonacina

Assessor da Presidência – CPA 20

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**

Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do CAIF

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**

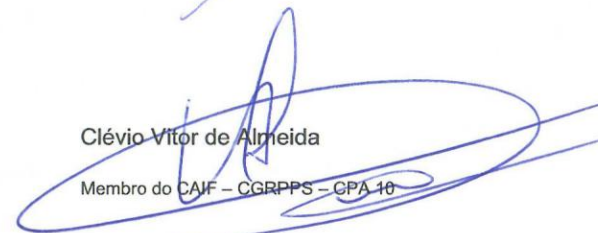
José Ricardo Vinhas

Membro do CAIF



Amauri Arnaldo Junior

Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos – CPA 10



Clévio Vitor de Almeida

Membro do CAIF – CGRPPS – CPA 10



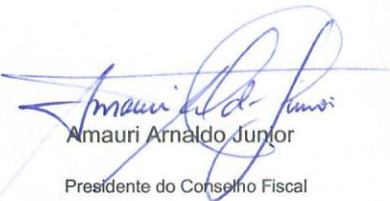
Victor Adriano Vieira Silva

Membro do CAIF – CGRPPS

2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 19 dias do mês de julho 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 junho 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 junho 2023.

Jacareí, 19 de julho 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

RENTA FIXA

68,89%

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 150525 (5,480000%)	0,47	0,02	0,43	6,07	2.168.903,29	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,47	0,02	0,46	6,23	1.059.659,17	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,680000%)	4,02	0,03	0,45	0,82	20.161.438,20	3,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,50	0,01	0,38	5,76	2.199.885,21	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,50	0,01	0,39	5,77	2.196.203,57	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,50	0,01	0,39	5,79	2.195.252,44	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,51	0,02	0,41	5,93	2.183.567,29	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,51	0,02	0,42	5,98	2.184.287,02	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,51	0,02	0,42	5,99	2.183.272,12	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,670000%)	4,01	0,03	0,45	0,82	1.509.803,56	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,51	0,02	0,46	6,25	2.037.635,36	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,51	0,02	0,46	6,26	3.188.875,68	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,50	0,02	0,39	5,82	2.212.031,87	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,50	0,02	0,39	5,82	2.209.289,70	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,50	0,02	0,40	5,85	2.205.019,37	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,285000%)	0,51	0,02	0,42	5,97	2.191.494,31	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,51	0,02	0,42	6,00	2.190.386,80	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,51	0,02	0,43	6,02	2.188.740,76	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,51	0,02	0,46	6,24	5.145.710,67	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,51	0,02	0,46	6,26	2.125.765,54	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	0,47	0,02	0,47	6,28	2.044.826,01	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,51	0,02	0,47	6,29	6.247.690,09	0,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,51	0,02	0,47	6,29	2.038.810,35	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	0,47	0,02	0,49	6,40	4.581.349,85	0,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,51	0,02	0,50	6,45	3.610.439,40	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,280000%)	3,03	0,02	0,50	4,42	3.040.015,50	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	3,07	0,02	0,51	6,53	2.071.787,46	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,000000%)	0,50	0,02	0,40	5,83	2.217.032,64	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,50	0,02	0,40	5,85	2.211.921,36	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,50	0,02	0,40	5,86	2.206.835,92	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,51	0,02	0,42	5,99	2.194.475,93	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,51	0,02	0,43	6,02	2.195.240,51	0,33
TESOURO	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,51	0,02	0,43	6,04	2.192.996,16	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,520000%)	0,51	0,02	0,44	6,09	2.184.002,87	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,51	0,02	0,46	6,24	11.329.184,87	1,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,51	0,02	0,46	6,26	2.124.218,09	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	0,47	0,02	0,47	6,28	5.101.586,14	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,51	0,02	0,47	6,29	2.041.435,95	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,51	0,02	0,47	6,30	16.657.301,54	2,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	0,47	0,02	0,49	6,40	9.157.231,86	1,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,51	0,02	0,50	6,46	8.244.587,11	1,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,268000%)	3,04	0,02	0,50	4,42	7.091.717,39	1,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	3,09	0,02	0,51	6,53	5.183.358,02	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,52	0,02	0,42	6,00	2.199.533,61	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,450000%)	0,51	0,02	0,43	6,06	2.231.100,62	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,51	0,02	0,47	6,28	2.186.811,91	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,51	0,02	0,40	5,84	2.230.453,21	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,51	0,02	0,41	5,90	2.231.793,83	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,51	0,02	0,41	5,93	2.232.485,64	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,52	0,02	0,43	6,08	2.235.857,78	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,710000%)	0,51	0,02	0,45	6,19	3.272.369,74	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,51	0,01	0,38	5,76	2.244.404,52	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,51	0,02	0,41	5,90	2.236.063,45	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,51	0,02	0,42	5,95	2.238.433,93	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,51	0,02	0,42	5,97	2.235.623,77	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,51	0,02	0,46	6,23	3.278.760,60	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,51	0,01	0,38	5,76	2.252.054,22	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,51	0,01	0,39	5,78	2.247.057,71	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,51	0,02	0,41	5,92	2.239.195,45	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,51	0,02	0,42	5,97	2.241.073,10	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,300000%)	0,51	0,02	0,42	5,98	2.241.756,40	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,460000%)	4,04	0,02	0,43	0,80	3.526.657,88	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,52	0,02	0,44	6,08	2.238.914,70	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,835000%)	0,51	0,02	0,46	6,25	3.280.271,42	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,51	0,02	0,39	5,81	2.265.184,24	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,51	0,02	0,39	5,82	2.255.693,78	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,51	0,02	0,40	5,84	2.257.830,09	0,34
TESOURO	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,51	0,02	0,42	5,97	2.248.466,95	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,310000%)	0,51	0,02	0,42	5,99	2.249.103,25	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,51	0,02	0,42	6,01	2.246.438,97	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,52	0,02	0,46	6,25	2.100.041,41	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,51	0,02	0,46	6,26	3.279.318,14	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,52	0,02	0,49	6,44	3.094.378,44	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,51	0,02	0,39	5,80	2.276.169,68	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,51	0,02	0,39	5,82	2.273.376,62	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,51	0,02	0,40	5,84	2.268.871,43	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,51	0,02	0,40	5,86	2.262.840,57	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,51	0,02	0,42	5,98	2.252.325,85	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,51	0,02	0,42	6,01	2.251.352,67	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,51	0,02	0,43	6,04	2.250.097,42	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,510000%)	0,52	0,02	0,44	6,09	2.242.997,09	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,51	0,02	0,46	6,24	8.474.013,05	1,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	2,96	0,02	0,47	6,28	3.147.742,27	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,51	0,02	0,47	6,29	2.100.582,08	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,51	0,02	0,47	6,30	11.450.819,31	1,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	3,05	0,02	0,49	6,40	6.809.608,50	1,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,52	0,02	0,50	6,46	5.672.225,63	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,278000%)	4,31	0,02	0,50	4,42	5.215.373,35	0,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	3,15	0,02	0,51	6,53	3.111.049,08	0,46
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,48	0,02	0,45	6,17	307.081.840,31	45,73

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,35	0,00	0,00	0,00	21.000.000,00	3,13	4.240.209.456,14	0,50
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,27	0,00	0,00	0,00	17.794.164,00	2,65	1.191.739.626,46	1,49
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,40	0,00	0,00	0,00	38.794.164,00	5,78		

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	7,65	0,17	-0,57	-0,13	4.993.526,50	0,74	223.357.903,09	2,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,00	0,00	0,00	20.000.000,00	2,98	14.982.085.274,92	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,06	1,16	6,50	20.373.768,43	3,03	6.131.327.523,66	0,33
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,05	1,15	6,37	28.738.504,31	4,28	3.021.387.375,69	0,95
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,27	0,05	1,12	5,95	0,00	0,00	2.449.962.875,95	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,35	0,06	1,07	6,23	74.105.799,24	11,04		

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				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	1,33	0,08	0,60	1,06	5.053.197,27	0,75		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	1,20	0,06	0,57	0,99	5.049.589,84	0,75		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	1,19	0,05	0,55	0,97	5.048.419,57	0,75		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	1,36	0,56	1,09	7,30	5.411.082,28	0,81		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	1,18	0,06	0,55	0,97	5.048.366,22	0,75		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 7,00% a.a	1,99	0,05	0,58	6,85	5.883.181,95	0,88		
Sub-total Artigo 7º IV			1,98	0,14	0,66	6,87	31.493.837,13	4,69		

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 MULTISETORIAL BVA MASTER III	122,79	125,56	125,56	-24,66	5.637,93	0,00	195.027,12	2,89
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			122,79	125,56	125,56	-24,66	5.637,93	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	1,11	6,57	3.308.689,39	0,49	9.499.167.371,20	0,03
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	2,92	0,19	1,21	4,12	2.138.092,46	0,32	603.853.284,35	0,35
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,46	0,06	1,28	5,58	5.672.531,42	0,84	3.056.181.443,80	0,19
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,54	0,08	1,22	5,59	11.119.313,27	1,66		
Renda Fixa			0,38	0,04	0,63	6,19	462.600.591,88	68,89		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

14,01%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SUL AMERICA	BEM	SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	27,52	0,59	5,56	3,75	4.248.855,13	0,63	190.073.552,72	2,24
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	25,16	0,24	5,76	-2,17	2.222.745,00	0,33	199.096.191,71	1,12
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	24,51	1,18	6,54	10,88	7.594.739,20	1,13	269.871.829,70	2,81
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,05	0,73	9,39	6,66	5.220.200,47	0,78	1.451.994.845,07	0,36
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,67	0,58	10,24	4,73	21.637.540,40	3,22	663.167.224,33	3,26
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,10	-0,42	10,15	4,56	30.527.457,29	4,55	925.420.855,31	3,30
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22,61	0,58	9,55	21,68	3.606.673,77	0,54	261.603.955,82	1,38
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	24,92	1,62	11,40	17,61	3.771.253,52	0,56	421.768.382,80	0,89
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	22,52	1,42	10,12	24,83	8.422.509,63	1,25	776.438.636,95	1,08
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,39	0,83	3,83	5,75	6.813.812,02	1,01	218.523.901,43	3,12
Sub-total Artigo 8º I			19,37	0,44	9,11	7,56	94.065.786,43	14,01		
Renda Variável			19,37	0,44	9,11	7,56	94.065.786,43	14,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,10%

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	25,29	1,26	6,51	24,04	14.926.800,30	2,22	228.145.793,34	6,54
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	45,52	-0,56	4,02	20,87	1.873.053,55	0,28	187.616.356,82	1,00
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,77	-1,11	-2,81	-14,43	2.413.749,26	0,36	68.860.478,67	3,51
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	27,47	-0,89	-3,24	-0,22	2.438.197,25	0,36	59.126.774,47	4,12
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	33,30	-0,60	0,56	21,72	2.611.683,73	0,39	652.308.818,52	0,40
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	23,97	-0,73	-2,57	2,86	5.098.836,32	0,76	288.636.067,89	1,77
Sub-total Artigo 9º II			19,59	0,25	2,49	13,15	29.362.320,41	4,37		

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	22,24	-0,24	-0,06	7,46	18.307.679,04	2,73	726.616.425,21	2,52
Sub-total Artigo 9º III			22,24	-0,24	-0,06	7,46	18.307.679,04	2,73		

Investimentos no Exterior

19,34 0,06 1,49 10,89 47.669.999,45 7,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,00%

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	16,72	0,10	1,52	10,80	7.475.845,02	1,11	50.159.781,16	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	19,40	1,31	6,98	20,06	18.186.353,10	2,71	821.675.560,44	2,21
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	19,08	1,31	7,07	20,38	30.218.740,31	4,50	491.326.352,47	6,15
Sub-total Artigo 10º I			18,06	1,15	6,27	18,90	55.880.938,43	8,32		

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	50,23	0,56	0,56	-5,84	11.224.179,24	1,67	358.051.269,19	3,13
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	2,61	0,61	0,61	4,27	15.928,08	0,00	2.568.863,85	0,62
Sub-total Artigo 10º II			50,15	0,56	0,56	-5,83	11.240.107,32	1,67		
Investimentos Estruturados			17,12	1,05	5,26	14,30	67.121.045,75	10,00		
Total			4,08	0,20	2,32	7,50	671.457.423,51	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	307.081.840,31	45,73	0,00	43,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	38.794.164,00	5,78	0,00	5,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	74.105.799,24	11,04	0,00	12,50	40,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	31.493.837,13	4,69	0,00	2,50	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	5.637,93	0,00	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	11.119.313,27	1,66	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	462.600.591,88	68,89					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	94.065.786,43	14,01	0,00	14,50	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	94.065.786,43	14,01					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	29.362.320,41	4,37	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	18.307.679,04	2,73	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	47.669.999,45	7,10					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	55.880.938,43	8,32	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	11.240.107,32	1,67	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	67.121.045,75	10,00					15,00
Total		671.457.423,51	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	0,45 42,03	6,17 94,96	2,46 78,09	6,17 94,96	9,38 69,26	1.377.460,22	18.566.228,21
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,07 99,38	6,23 95,94	3,18 101,19	6,23 95,94	12,65 93,38	1.162.171,73	6.910.425,08
Artigo 7º IV % do CDI	0,66 61,37	6,87 105,72	3,14 99,86	6,87 105,72		205.828,48	944.556,45
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	125,56 11.713,00	-24,66 -379,47	34,20 1.087,29	-24,66 -379,47	-9,95 -73,47	3.138,42	-1.845,41
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,22 113,37	5,59 86,00	3,24 103,14	5,59 86,00	12,77 94,29	133.513,53	588.515,19
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	9,11 0,11	7,56 -0,05	16,47 0,57	7,56 -0,05	17,61 -2,23	8.329.310,57	7.024.535,78
Artigo 9º II % do CDI	2,49 232,05	13,15 202,33	3,75 119,24	13,15 202,33	10,27 75,86	712.662,66	3.412.145,23
Artigo 9º III % do CDI	-0,06 -5,42	7,46 114,75	2,43 77,12	7,46 114,75	6,61 48,79	-10.652,29	1.270.440,38
Artigo 10º I % do CDI	6,27 584,45	18,90 290,83	9,78 310,76	18,90 290,83	27,23 201,04	3.294.624,80	8.882.445,18
Artigo 10º II % do CDI	0,56 51,79	-5,83 -89,67	0,45 14,18	-5,83 -89,67	-6,34 -46,82	62.057,98	-494.874,16
JACAREÍ (Total)						15.270.116,10	47.102.571,93

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 150525 (5,480000%)	2.159.527,83	0,00	0,00	0,00	2.168.903,29	9.375,46	127.220,19
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.054.803,96	0,00	0,00	0,00	1.059.659,17	4.855,21	63.731,64
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.071.150,75	0,00	0,00	0,00	20.161.438,20	90.287,45	164.565,77
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.191.451,25	0,00	0,00	0,00	2.199.885,21	8.433,96	122.636,00
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.187.749,34	0,00	0,00	0,00	2.196.203,57	8.454,23	122.632,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.186.750,17	0,00	0,00	0,00	2.195.252,44	8.502,27	122.883,62
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.174.616,61	0,00	0,00	0,00	2.183.567,29	8.950,68	125.117,44
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.175.171,60	0,00	0,00	0,00	2.184.287,02	9.115,42	126.103,71
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.174.109,01	0,00	0,00	0,00	2.183.272,12	9.163,11	126.348,32
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.503.051,43	0,00	0,00	0,00	1.509.803,56	6.752,13	12.308,58
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.028.255,88	0,00	0,00	0,00	2.037.635,36	9.379,48	122.762,61
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.174.149,82	0,00	0,00	0,00	3.188.875,68	14.725,86	192.386,67
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.203.359,18	0,00	0,00	0,00	2.212.031,87	8.672,69	124.328,09
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.200.610,89	0,00	0,00	0,00	2.209.289,70	8.678,81	124.275,50
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.196.270,90	0,00	0,00	0,00	2.205.019,37	8.748,47	124.549,47
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.182.355,51	0,00	0,00	0,00	2.191.494,31	9.138,80	126.391,48
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.181.159,53	0,00	0,00	0,00	2.190.386,80	9.227,27	126.887,46
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.179.452,15	0,00	0,00	0,00	2.188.740,76	9.288,61	127.199,33
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.122.048,28	0,00	0,00	0,00	5.145.710,67	23.662,39	309.827,76
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.115.941,35	0,00	0,00	0,00	2.125.765,54	9.824,19	128.279,28
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.035.317,49	0,00	0,00	0,00	2.044.826,01	9.508,52	123.746,05
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.218.550,35	0,00	0,00	0,00	6.247.690,09	29.139,74	378.608,04
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.029.289,14	0,00	0,00	0,00	2.038.810,35	9.521,21	123.618,44
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.559.171,67	0,00	0,00	0,00	4.581.349,85	22.178,18	282.405,68
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.592.634,31	0,00	0,00	0,00	3.610.439,40	17.805,09	224.497,42
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.024.968,46	0,00	0,00	0,00	3.040.015,50	15.047,04	131.825,32
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.061.339,66	0,00	0,00	0,00	2.071.787,46	10.447,80	130.202,91
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.208.288,26	0,00	0,00	0,00	2.217.032,64	8.744,38	124.857,48
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.203.145,45	0,00	0,00	0,00	2.211.921,36	8.775,91	124.879,38
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.198.028,42	0,00	0,00	0,00	2.206.835,92	8.807,50	124.902,43
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.185.274,93	0,00	0,00	0,00	2.194.475,93	9.201,00	126.824,79
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.185.940,63	0,00	0,00	0,00	2.195.240,51	9.299,88	127.433,65
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.183.620,57	0,00	0,00	0,00	2.192.996,16	9.375,59	127.817,87
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.174.492,66	0,00	0,00	0,00	2.184.002,87	9.510,21	128.314,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.277.084,53	0,00	0,00	0,00	11.329.184,87	52.100,34	682.087,72
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.114.400,82	0,00	0,00	0,00	2.124.218,09	9.817,27	128.176,50
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.077.864,34	0,00	0,00	0,00	5.101.586,14	23.721,80	308.712,81
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.031.895,02	0,00	0,00	0,00	2.041.435,95	9.540,93	123.819,09
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.579.148,44	0,00	0,00	0,00	16.657.301,54	78.153,10	1.012.110,04
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.112.913,84	0,00	0,00	0,00	9.157.231,86	44.318,02	564.501,52
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.203.902,78	0,00	0,00	0,00	8.244.587,11	40.684,33	512.895,36
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.056.681,13	0,00	0,00	0,00	7.091.717,39	35.036,26	307.272,96
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.157.218,71	0,00	0,00	0,00	5.183.358,02	26.139,31	325.807,22
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.190.258,46	0,00	0,00	0,00	2.199.533,61	9.275,15	125.577,20
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.221.508,29	0,00	0,00	0,00	2.231.100,62	9.592,33	128.420,32
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.176.618,27	0,00	0,00	0,00	2.186.811,91	10.193,64	130.339,68
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.221.640,53	0,00	0,00	0,00	2.230.453,21	8.812,68	123.987,54
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.222.760,48	0,00	0,00	0,00	2.231.793,83	9.033,35	125.267,98
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.223.344,63	0,00	0,00	0,00	2.232.485,64	9.141,01	125.906,72
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.226.175,39	0,00	0,00	0,00	2.235.857,78	9.682,39	129.081,39
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.257.632,58	0,00	0,00	0,00	3.272.369,74	14.737,16	192.118,37
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.235.817,95	0,00	0,00	0,00	2.244.404,52	8.586,57	123.148,68
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.227.022,39	0,00	0,00	0,00	2.236.063,45	9.041,06	125.451,79
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.229.179,48	0,00	0,00	0,00	2.238.433,93	9.254,45	126.729,10
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.226.328,70	0,00	0,00	0,00	2.235.623,77	9.295,07	126.868,63
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.263.737,28	0,00	0,00	0,00	3.278.760,60	15.023,32	193.939,29
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.243.420,17	0,00	0,00	0,00	2.252.054,22	8.634,05	123.653,85
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.238.373,47	0,00	0,00	0,00	2.247.057,71	8.684,24	123.783,27
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.230.047,57	0,00	0,00	0,00	2.239.195,45	9.147,88	126.143,76
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.231.756,14	0,00	0,00	0,00	2.241.073,10	9.316,96	127.168,05
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.232.384,91	0,00	0,00	0,00	2.241.756,40	9.371,49	127.506,19
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.511.469,74	0,00	0,00	0,00	3.526.657,88	15.188,14	27.895,05
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.229.201,69	0,00	0,00	0,00	2.238.914,70	9.713,01	129.341,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.265.176,08	0,00	0,00	0,00	3.280.271,42	15.095,34	194.389,70
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.256.338,88	0,00	0,00	0,00	2.265.184,24	8.845,36	125.244,76
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.246.850,42	0,00	0,00	0,00	2.255.693,78	8.843,36	124.920,71
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.248.888,25	0,00	0,00	0,00	2.257.830,09	8.941,84	125.548,23
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.239.112,73	0,00	0,00	0,00	2.248.466,95	9.354,22	127.594,93
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.239.681,54	0,00	0,00	0,00	2.249.103,25	9.421,71	127.993,72
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.236.938,89	0,00	0,00	0,00	2.246.438,97	9.500,08	128.347,26
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.090.376,09	0,00	0,00	0,00	2.100.041,41	9.665,32	124.456,96
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.264.177,92	0,00	0,00	0,00	3.279.318,14	15.140,22	194.609,72
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.079.204,75	0,00	0,00	0,00	3.094.378,44	15.173,69	188.658,00
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.267.299,28	0,00	0,00	0,00	2.276.169,68	8.870,40	125.721,99
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.264.445,56	0,00	0,00	0,00	2.273.376,62	8.931,06	125.978,61
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.259.904,75	0,00	0,00	0,00	2.268.871,43	8.966,68	126.034,61
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.253.834,14	0,00	0,00	0,00	2.262.840,57	9.006,43	126.057,00
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.242.915,10	0,00	0,00	0,00	2.252.325,85	9.410,75	128.011,57
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.241.833,94	0,00	0,00	0,00	2.251.352,67	9.518,73	128.607,93
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.240.494,28	0,00	0,00	0,00	2.250.097,42	9.603,14	129.041,60
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.233.247,94	0,00	0,00	0,00	2.242.997,09	9.749,15	129.642,64
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.435.044,34	0,00	0,00	0,00	8.474.013,05	38.968,71	501.966,77
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.133.104,46	0,00	0,00	0,00	3.147.742,27	14.637,81	187.387,14
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.090.772,82	0,00	0,00	0,00	2.100.582,08	9.809,26	125.273,48
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.397.098,22	0,00	0,00	0,00	11.450.819,31	53.721,09	684.380,88
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.776.645,46	0,00	0,00	0,00	6.809.608,50	32.963,04	412.761,63
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.644.234,83	0,00	0,00	0,00	5.672.225,63	27.990,80	346.867,69
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.189.565,18	0,00	0,00	0,00	5.215.373,35	25.808,17	220.937,17
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.095.359,07	0,00	0,00	0,00	3.111.049,08	15.690,01	192.169,50
					307.081.840,31	1.377.460,22	

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	17.794.164,00	0,00	0,00	17.794.164,00	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	21.000.000,00	0,00	0,00	21.000.000,00	0,00	0,00
					38.794.164,00	0,00	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB INSTITUCIONAL FI RF	32.758.764,46	0,00	-33.125.483,18	0,00	0,00	366.718,72	1.859.224,73
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000.000,00	0,00	0,00	20.000.000,00	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	48.809.033,34	0,00	-29.000.000,00	0,00	20.373.768,43	564.735,09	3.259.851,68
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5.022.132,50	0,00	0,00	0,00	4.993.526,50	-28.606,00	-6.473,50
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	23.041.080,39	8.217.100,00	-2.779.000,00	0,00	28.738.504,31	259.323,92	1.797.822,17
					74.105.799,24	1.162.171,73	

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	5.020.910,50	0,00	0,00	0,00	5.048.419,57	27.509,07	48.419,57
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	5.023.260,51	0,00	0,00	0,00	5.053.197,27	29.936,76	53.197,27
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a	5.849.299,63	0,00	0,00	0,00	5.883.181,95	33.882,32	376.958,85
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	5.020.686,11	0,00	0,00	0,00	5.048.366,22	27.680,11	48.366,22
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	5.021.078,63	0,00	0,00	0,00	5.049.589,84	28.511,21	49.589,84
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.352.773,27	0,00	0,00	0,00	5.411.082,28	58.309,01	368.024,70
					31.493.837,13	205.828,48	

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	2.499,51	0,00	0,00	0,00	5.637,93	3.138,42	-1.845,41
					5.637,93	3.138,42	

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	3.272.442,95	0,00	0,00	0,00	3.308.689,39	36.246,44	204.068,86
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	2.112.534,27	0,00	0,00	0,00	2.138.092,46	25.558,19	84.679,62
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	5.600.822,52	0,00	0,00	0,00	5.672.531,42	71.708,90	299.766,71
					11.119.313,27	133.513,53	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	7.128.742,60	0,00	0,00	0,00	7.594.739,20	465.996,60	745.294,99
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.772.302,67	0,00	0,00	0,00	5.220.200,47	447.897,80	325.746,36
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	3.292.248,74	0,00	0,00	0,00	3.606.673,77	314.425,03	642.574,56
INDIE FIC FIA	3.385.445,55	0,00	0,00	0,00	3.771.253,52	385.807,97	564.786,70
META VALOR FI DE AÇÕES	2.101.772,66	0,00	0,00	0,00	2.222.745,00	120.972,34	-49.387,34
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	24.105.035,03	0,00	-5.000.000,00	0,00	21.637.540,40	2.532.505,37	1.264.926,56
OCCAM FIC FIA	27.715.435,64	0,00	0,00	0,00	30.527.457,29	2.812.021,65	1.330.879,76
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	4.025.044,32	0,00	0,00	0,00	4.248.855,13	223.810,81	153.656,10
TARPON GT 30 FIC FIA	7.648.150,83	0,00	0,00	0,00	8.422.509,63	774.358,80	1.675.477,86
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	6.562.297,82	0,00	0,00	0,00	6.813.812,02	251.514,20	370.580,23
					94.065.786,43	8.329.310,57	

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	14.015.114,99	0,00	0,00	0,00	14.926.800,30	911.685,31	2.893.176,92
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.800.705,81	0,00	0,00	0,00	1.873.053,55	72.347,74	323.412,43
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.483.604,13	0,00	0,00	0,00	2.413.749,26	-69.854,87	-406.928,29
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.519.844,28	0,00	0,00	0,00	2.438.197,25	-81.647,03	-5.408,12
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.597.064,94	0,00	0,00	0,00	2.611.683,73	14.618,79	466.093,32

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	5.233.323,60	0,00	0,00	0,00	5.098.836,32	-134.487,28	141.798,97
					29.362.320,41	712.662,66	

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	18.318.331,33	0,00	0,00	0,00	18.307.679,04	-10.652,29	1.270.440,38
					18.307.679,04	-10.652,29	

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	28.222.333,08	0,00	0,00	0,00	30.218.740,31	1.996.407,23	5.115.690,71
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	7.363.830,24	0,00	0,00	0,00	7.475.845,02	112.014,78	728.504,01
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	17.000.150,31	0,00	0,00	0,00	18.186.353,10	1.186.202,79	3.038.250,46
					55.880.938,43	3.294.624,80	

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	11.162.217,11	0,00	0,00	0,00	11.224.179,24	61.962,13	-495.527,06
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	15.832,23	0,00	0,00	0,00	15.928,08	95,85	652,90
					11.240.107,32	62.057,98	

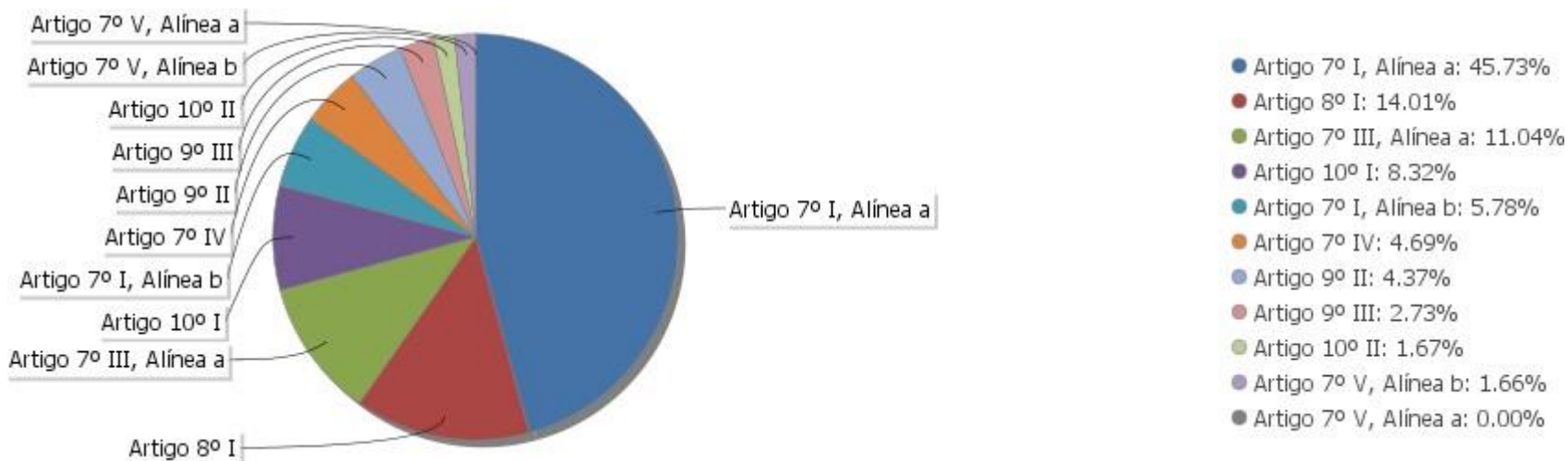
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

6. Análise de Liquidez

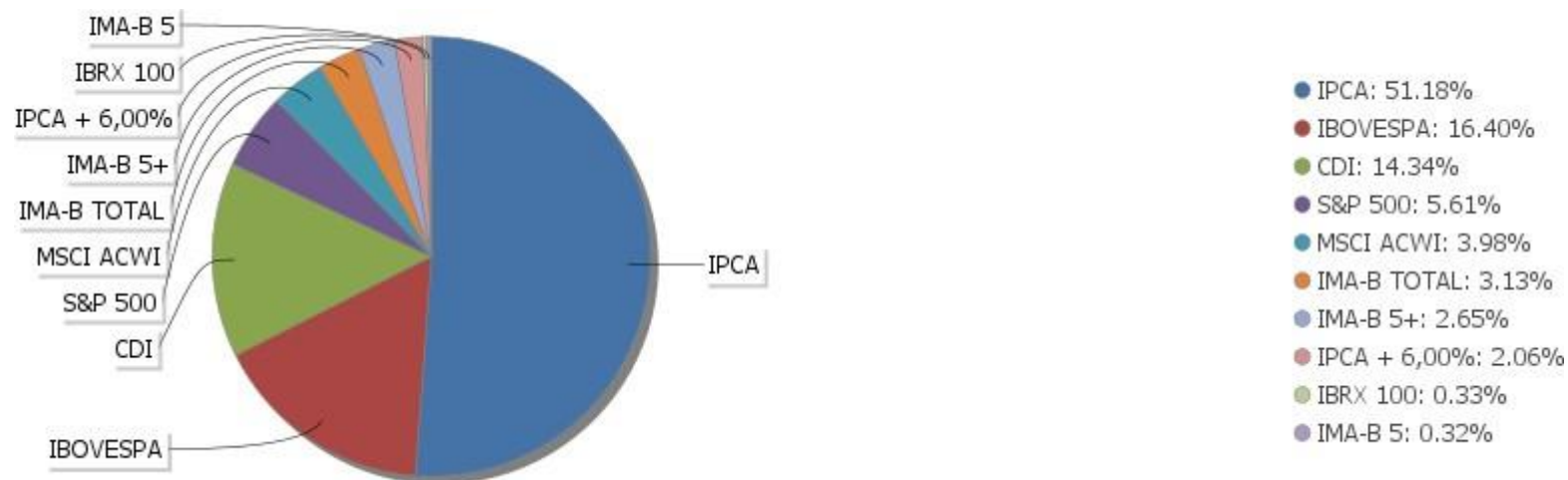
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	262.943.195,39	39,16	262.943.195,39	39,16	
de 31 dias a 365 dias	53.720.844,94	8,00	316.664.040,33	47,16	
acima de 365 dias	354.793.383,18	52,84	671.457.423,51	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

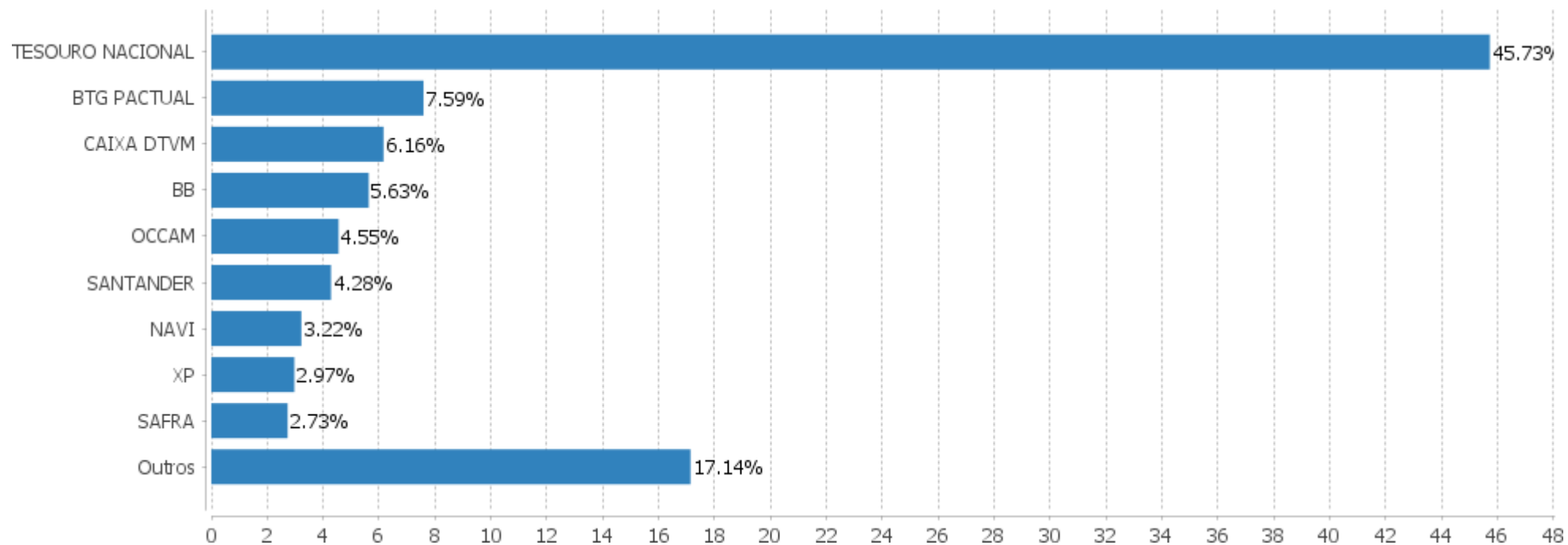


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

7. 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	2,32							7,50
IPCA + 5,11%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34							5,42
p.p. indexador	0,97	-1,68	-0,35	-0,12	1,19	1,99							2,08
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

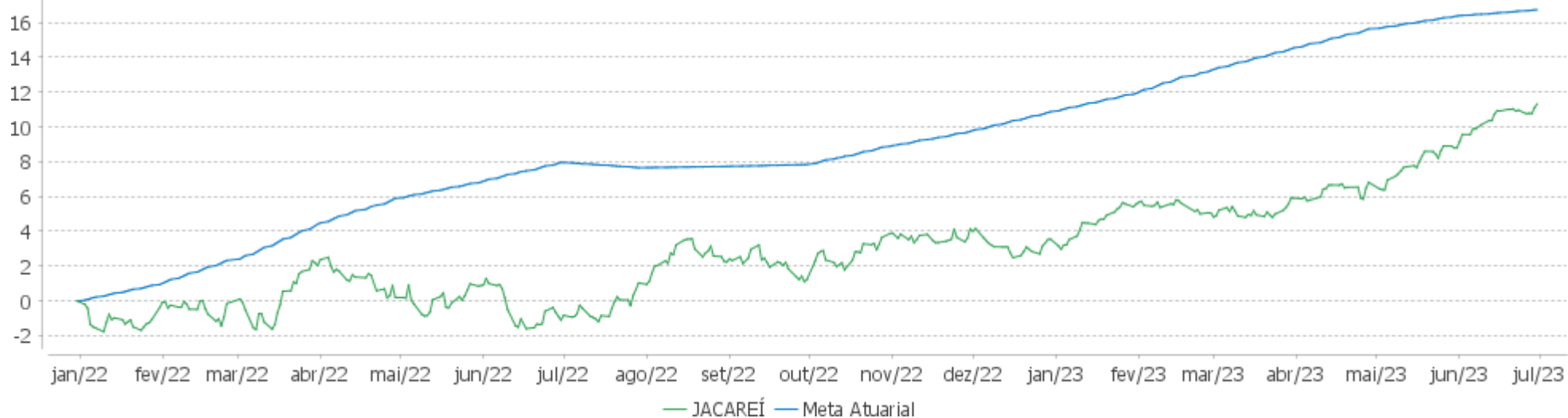
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

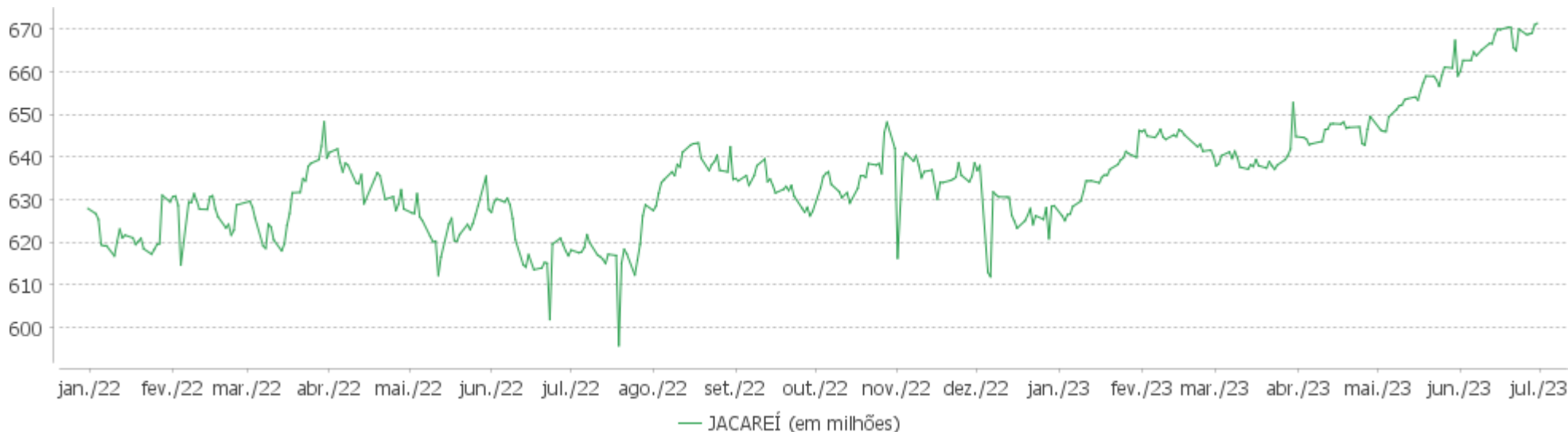
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	38,89	03 meses	5,11	1,98	3,13	3,32
Meses abaixo - Meta Atuarial	11	61,11	06 meses	7,50	5,42	2,08	3,19
			12 meses	12,56	8,27	4,30	4,08
			24 meses				
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	2,60	2022-10	Desde 31/12/2021	11,32	16,89	-5,57	4,94
Menor rentabilidade da Carteira	-1,97	2022-06					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

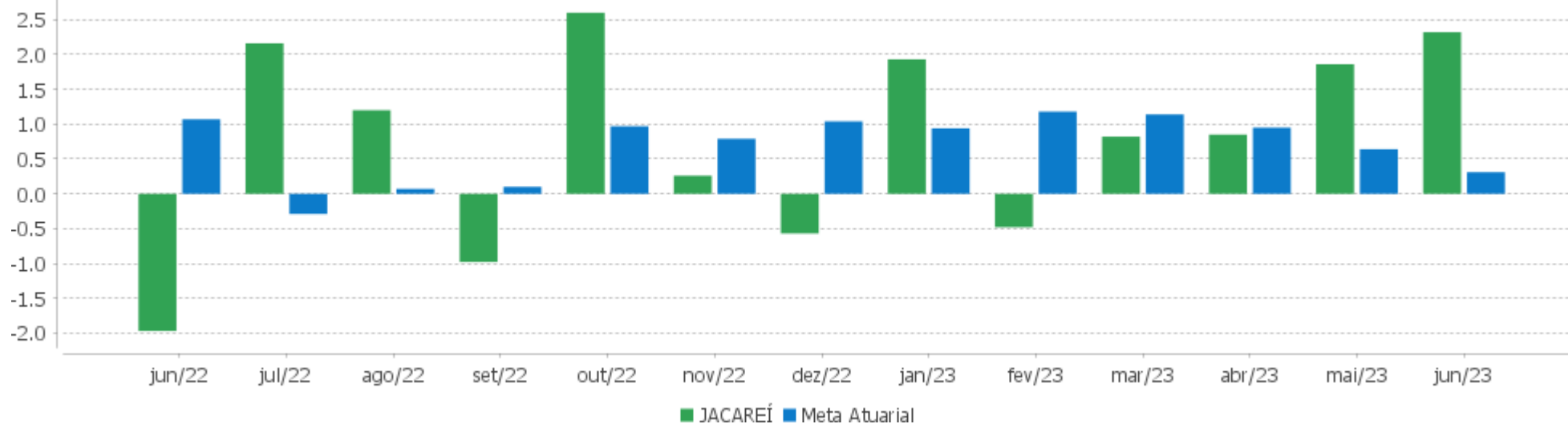


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

8. Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

9. Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a Var. IPCA p.p.	0,60 0,68	1,06 1,04					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a Var. IPCA p.p.	0,57 0,65	0,99 0,97					
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a Var. IPCA p.p.	0,55 0,63	0,97 0,94					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	1,09 1,17	7,30 4,43	3,89 3,13	7,30 4,43			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a Var. IPCA p.p.	0,55 0,63	0,97 0,94					
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,58 0,66	6,85 3,98	2,81 2,05	6,85 3,98			
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,28 119,44	5,58 85,86	3,47 110,33	5,58 85,86	12,97 95,80	24,12 103,21	31,73 121,23
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	1,21 0,16	4,12 -2,92	2,72 0,17	4,12 -2,92	8,53 -1,69	18,26 -3,05	28,72 0,05
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	1,11 103,32	6,57 101,15	3,20 101,73	6,57 101,15	13,90 102,64	25,58 109,47	27,86 106,44
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,57	6,40 3,53	2,56 1,80	6,40 3,53	6,66 3,50	19,28 3,86	
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,28 3,41	2,51 1,74	6,28 3,41	6,51 3,35	19,07 3,65	
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,49	5,90 3,03	2,32 1,56	5,90 3,03	8,81 5,65	24,38 8,96	
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,51	6,07 3,20	2,41 1,65	6,07 3,20	9,18 6,02	25,11 9,68	
NTN-B 150533 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	3,21 0,34	-0,41 -1,17	3,21 0,34	3,35 0,19		
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,26 3,39	2,50 1,74	6,26 3,39	9,57 6,41	26,02 10,60	
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,30 3,43	2,52 1,76	6,30 3,43	9,66 6,50	26,20 10,77	
NTN-B 150545 (5,915000%)	0,47	6,29	2,51	6,29	9,63	26,13	

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.	0,55	3,42	1,75	3,42	6,47	10,70	
NTN-B 150850 (5,831200%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,24 3,37	2,49 1,73	6,24 3,37	9,54 6,38	25,97 10,55	
NTN-B 150826 (5,190000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,49	5,93 3,06	2,34 1,58	5,93 3,06	8,88 5,72	24,48 9,06	
NTN-B 150840 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,25 3,38	2,49 1,73	6,25 3,38	9,55 6,39	25,97 10,54	
NTN-B 150830 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	5,97 3,10	2,36 1,60	5,97 3,10	8,96 5,80	24,73 9,31	
NTN-B 150545 (4,970000%) Var. IPCA p.p.	0,39 0,47	5,82 2,95	2,29 1,53	5,82 2,95	8,65 5,49	24,29 8,86	
NTN-B 150840 (4,950000%) Var. IPCA p.p.	0,39 0,47	5,81 2,94	2,28 1,52	5,81 2,94	8,63 5,47	24,20 8,78	
NTN-B 150850 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,39 0,47	5,82 2,95	2,29 1,53	5,82 2,95	8,66 5,50	24,35 8,93	
NTN-B 150555 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,29 3,42	2,51 1,75	6,29 3,42	9,64 6,48	26,16 10,73	
NTN-B 150850 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	6,01 3,14	2,38 1,62	6,01 3,14	9,06 5,89	25,08 9,65	
NTN-B 150545 (5,922000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,29 3,42	2,51 1,75	6,29 3,42	9,64 6,47	26,14 10,72	
NTN-B 150840 (5,020000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,48	5,84 2,97	2,30 1,54	5,84 2,97	8,71 5,54	24,34 8,92	
NTN-B 150535 (4,910000%) Var. IPCA p.p.	0,39 0,47	5,79 2,92	2,27 1,51	5,79 2,92	8,59 5,43	24,05 8,62	
NTN-B 150555 (5,370000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,51	6,02 3,15	2,38 1,62	6,02 3,15	9,07 5,91	25,11 9,69	
NTN-B 150850 (4,940000%) Var. IPCA p.p.	0,39 0,47	5,80 2,93	2,28 1,52	5,80 2,93	8,62 5,46	24,27 8,85	
NTN-B 150840 (4,970000%) Var. IPCA p.p.	0,39 0,47	5,82 2,95	2,29 1,53	5,82 2,95	8,65 5,49	24,24 8,82	
NTN-B 150826 (5,490000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,51	6,08 3,21	2,41 1,65	6,08 3,21	9,19 6,03	25,15 9,73	
NTN-B 150545 (6,280000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,58	6,47 3,60	2,59 1,83	6,47 3,60	6,75 3,59		
NTN-B 150830 (5,460000%)	0,43	3,11	2,40	3,11	3,18		

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.	0,51	0,24	1,64	0,24	0,02		
NTN-B 150850 (6,261000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,58	6,46 3,59	2,59 1,83	6,46 3,59	9,99 6,82	26,79 11,36	
NTN-B 150535 (5,320000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	5,99 3,12	2,37 1,61	5,99 3,12	9,02 5,85	24,89 9,47	
NTN-B 150555 (5,000000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,48	5,83 2,96	2,29 1,53	5,83 2,96	8,69 5,52	24,41 8,99	
NTN-B 150535 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	3,21 0,34	-0,40 -1,16	3,21 0,34	3,36 0,20		
NTN-B 150850 (5,010000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,48	5,84 2,97	2,30 1,54	5,84 2,97	8,70 5,53	24,41 8,98	
NTN-B 150545 (6,256000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,58	6,45 3,58	2,59 1,83	6,45 3,58	9,98 6,82	26,79 11,36	
NTN-B 150555 (6,261000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,58	6,46 3,59	2,59 1,83	6,46 3,59	9,99 6,82	26,78 11,36	
NTN-B 150555 (5,520000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,52	6,09 3,22	2,42 1,66	6,09 3,22	9,22 6,06	25,39 9,97	
NTN-B 150555 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,26 3,39	2,50 1,74	6,26 3,39	9,57 6,41	26,03 10,61	
NTN-B 150545 (5,380000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,51	6,02 3,15	2,38 1,62	6,02 3,15	9,08 5,92	25,09 9,66	
NTN-B 150826 (5,009000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,48	5,84 2,97	2,30 1,54	5,84 2,97	8,69 5,53	24,08 8,66	
NTN-B 150545 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,59	6,53 3,66	2,62 1,86	6,53 3,66	6,83 3,66		
NTN-B 150535 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,26 3,39	2,50 1,73	6,26 3,39	9,57 6,41	25,99 10,57	
NTN-B 150555 (5,831200%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,24 3,37	2,49 1,73	6,24 3,37	9,54 6,38	25,98 10,55	
NTN-B 150828 (4,850000%) Var. IPCA p.p.	0,38 0,46	5,76 2,89	2,26 1,50	5,76 2,89	8,53 5,37	23,79 8,36	
NTN-B 150555 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,59	6,53 3,66	2,62 1,86	6,53 3,66	6,80 3,64		
NTN-B 150545 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,24 3,37	2,49 1,73	6,24 3,37	9,54 6,38	25,96 10,54	
NTN-B 150828 (5,240000%)	0,42	5,95	2,35	5,95	8,93	24,63	

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.	0,50	3,08	1,59	3,08	5,77	9,21	
NTN-B 150545 (5,340000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	6,00 3,13	2,37 1,61	6,00 3,13	9,04 5,87	25,01 9,59	
NTN-B 150850 (5,921000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,29 3,42	2,51 1,75	6,29 3,42	9,63 6,47	26,14 10,72	
NTN-B 150555 (6,268000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,58	6,46 3,59	2,59 1,83	6,46 3,59	6,73 3,57		
NTN-B 150535 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,38 0,46	5,76 2,89	2,26 1,50	5,76 2,89	8,54 5,38	23,94 8,52	
NTN-B 150826 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	6,19 3,31	2,46 1,70	6,19 3,31	9,42 6,26	25,64 10,22	
NTN-B 150828 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	5,97 3,10	2,36 1,60	5,97 3,10	8,96 5,80	24,70 9,27	
NTN-B 150555 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,57	6,40 3,53	2,56 1,80	6,40 3,53	9,86 6,70	22,86 7,44	
NTN-B 150535 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	5,98 3,11	2,36 1,60	5,98 3,11	8,98 5,82	24,83 9,41	
NTN-B 150830 (5,835000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,25 3,38	2,49 1,73	6,25 3,38	9,55 6,38	25,94 10,51	
NTN-B 150830 (5,300000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	5,98 3,11	2,36 1,60	5,98 3,11	8,99 5,83	24,79 9,37	
NTN-B 150555 (5,315000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	5,99 3,12	2,37 1,61	5,99 3,12	9,01 5,85	25,01 9,58	
NTN-B 150535 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,25 3,38	2,49 1,73	6,25 3,38	9,55 6,39	25,96 10,53	
NTN-B 150545 (5,285000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	5,97 3,10	2,36 1,60	5,97 3,10	8,98 5,82	24,90 9,48	
NTN-B 150830 (5,500000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,52	6,08 3,21	2,41 1,65	6,08 3,21	9,20 6,04	25,22 9,80	
NTN-B 150830 (5,178300%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,49	5,92 3,05	2,34 1,58	5,92 3,05	8,87 5,71	24,53 9,11	
NTN-B 150824 (5,450000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,51	6,06 3,19	2,40 1,64	6,06 3,19	9,15 5,99	25,03 9,61	
NTN-B 150545 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,28 3,41	2,51 1,74	6,28 3,41	9,61 6,45	22,52 7,10	
NTN-B 150545 (5,030000%)	0,40	5,85	2,30	5,85	8,72	24,41	

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.	0,48	2,98	1,54	2,98	5,55	8,98	
NTN-B 150850 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,59	6,53 3,66	2,62 1,86	6,53 3,66	6,81 3,65		
NTN-B 150824 (5,912000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,28 3,41	2,51 1,75	6,28 3,41	9,63 6,46	26,08 10,66	
NTN-B 150850 (5,045000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,48	5,86 2,99	2,30 1,54	5,86 2,99	8,73 5,57	24,47 9,05	
NTN-B 150555 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,48	5,85 2,98	2,30 1,54	5,85 2,98	8,72 5,55	24,47 9,05	
NTN-B 150840 (5,274000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	5,97 3,10	2,36 1,60	5,97 3,10	8,97 5,81	24,85 9,42	
NTN-B 150826 (5,130000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,49	5,90 3,03	2,32 1,56	5,90 3,03	8,82 5,66	24,35 8,93	
NTN-B 150840 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	6,01 3,14	2,38 1,62	6,01 3,14	9,06 5,89	25,02 9,60	
NTN-B 150840 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,26 3,39	2,50 1,73	6,26 3,39	9,57 6,41	26,00 10,58	
NTN-B 150850 (5,410000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,51	6,04 3,17	2,39 1,63	6,04 3,17	9,11 5,95	25,17 9,75	
NTN-B 150545 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,39 0,47	5,82 2,95	2,29 1,53	5,82 2,95	8,66 5,50	24,31 8,88	
NTN-B 150830 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,38 0,46	5,76 2,89	2,26 1,50	5,76 2,89	8,54 5,38	23,86 8,43	
NTN-B 150840 (5,310000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	5,99 3,12	2,37 1,61	5,99 3,12	9,00 5,84	24,92 9,50	
NTN-B 150824 (5,345000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	6,00 3,13	2,38 1,61	6,00 3,13	9,04 5,88	24,79 9,37	
NTN-B 150545 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,57	6,40 3,53	2,56 1,80	6,40 3,53	9,86 6,70	22,88 7,45	
NTN-B 150830 (4,900000%) Var. IPCA p.p.	0,39 0,47	5,78 2,91	2,27 1,51	5,78 2,91	8,58 5,42	23,94 8,52	
NTN-B 150850 (5,295500%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,50	5,98 3,11	2,36 1,60	5,98 3,11	8,99 5,83	24,95 9,53	
NTN-B 150535 (4,880000%) Var. IPCA p.p.	0,39 0,47	5,77 2,90	2,27 1,51	5,77 2,90	8,56 5,40	23,98 8,56	
NTN-B 150555 (5,420000%)	0,43	6,04	2,39	6,04	9,12	25,21	

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.	0,51	3,17	1,63	3,17	5,96	9,78	
NTN-B 150850 (5,510000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,52	6,09 3,22	2,41 1,65	6,09 3,22	9,21 6,05	25,36 9,94	
NTN-B 150850 (6,278000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,58	3,31 0,44	2,59 1,83	3,31 0,44	3,57 0,41		
NTN-B 150555 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,28 3,41	2,51 1,74	6,28 3,41	9,61 6,45	22,54 7,12	
NTN-B 150840 (6,220000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,57	6,44 3,57	2,58 1,82	6,44 3,57	9,94 6,78	26,73 11,30	
NTN-B 150828 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,23 3,36	2,48 1,72	6,23 3,36	9,52 6,36	25,87 10,45	
NTN-B 150555 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,30 3,43	2,52 1,76	6,30 3,43	9,66 6,50	26,20 10,78	
NTN-B 150555 (5,060000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,48	5,86 2,99	2,31 1,55	5,86 2,99	8,75 5,59	24,53 9,10	
NTN-B 150525 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,23 3,36	2,48 1,72	6,23 3,36	9,52 6,36	25,86 10,43	
NTN-B 150535 (5,196100%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,49	5,93 3,06	2,34 1,58	5,93 3,06	8,89 5,73	24,64 9,21	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,35 -0,04	11,24 -0,12	7,06 -0,04	11,24 -0,12	13,32 -0,21	17,31 -0,50	25,74 -0,82
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	3,31 -0,06	14,66 -0,24	10,79 -0,12	14,66 -0,24	15,89 -0,44	13,02 -0,81	22,18 -1,34
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III % do CDI	125,56 11.713,06	-24,66 -379,47	34,20 1.087,29	-24,66 -379,47	-9,95 -73,47	-49,41 -211,43	7.155,98 27.345,47
BB INSTITUCIONAL FI RF % do CDI	1,12 104,43	5,95 91,50	3,19 101,54	5,95 91,50	13,13 96,95	23,41 100,16	26,65 101,85
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,09 101,92	6,44 99,04	3,16 100,55	6,44 99,04	13,54 99,98	23,74 101,59	26,65 101,82
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,16 107,93	6,50 100,07	3,32 105,46	6,50 100,07	13,62 100,59	24,10 103,14	26,93 102,90
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	-0,57 -0,49	-0,13 -0,14					
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,15 107,14	6,37 98,06	3,26 103,54	6,37 98,06	13,60 100,39	24,20 103,57	27,56 105,33
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	9,39	6,66	15,10	6,66	17,15	-33,62	-18,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,38	-0,96	-0,81	-0,96	-2,69	-26,74	-42,61
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,12 1,12	24,83 17,22	30,45 14,54	24,83 17,22	48,58 28,74	32,81 39,69	111,11 86,88
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,83 -5,17	5,75 -1,86	13,75 -2,16	5,75 -1,86	20,97 1,13	2,64 9,51	94,65 70,42
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,24 1,23	4,73 -2,88	16,62 0,72	4,73 -2,88	14,29 -5,55	-4,39 2,48	27,66 3,43
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	9,55 0,55	21,68 14,07	28,86 12,96	21,68 14,07	39,60 19,77	18,74 25,62	
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,56 -3,44	3,75 -3,86	12,87 -3,03	3,75 -3,86	9,39 -10,44	-33,06 -26,19	7,47 -16,76
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	11,40 2,39	17,61 10,00	28,99 13,09	17,61 10,00	26,49 6,66	-30,93 -24,06	-9,44 -33,67
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	6,54 -2,46	10,88 3,27	17,94 2,03	10,88 3,27	14,97 -4,86	-26,19 -19,32	3,40 -20,83
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,15 1,14	4,56 -3,05	11,89 -4,02	4,56 -3,05	13,86 -5,97	-8,85 -1,98	18,63 -5,60
META VALOR FI DE AÇÕES Var. IBRX 100 p.p.	5,76 -3,11	-2,17 -8,77	9,82 -5,14	-2,17 -8,77	7,47 -10,14	-26,36 -16,87	-12,21 -35,59
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-0,06 -9,06	7,46 -0,15	2,43 -13,48	7,46 -0,15	6,61 -13,23	-9,35 -2,48	17,08 -7,15
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-2,81 -2,72	-14,43 -18,61	-12,93 -13,08	-14,43 -18,61	-20,69 -25,96	-37,10 -28,47	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	6,51 6,60	24,04 19,86	8,57 8,42	24,04 19,86	18,53 13,26	-18,54 -9,91	14,00 -0,48
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-2,57 -2,48	2,86 -1,32	-0,13 -0,28	2,86 -1,32	10,03 4,76	-6,01 2,61	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	4,02 4,11	20,87 16,69	9,13 8,98	20,87 16,69	12,78 7,51	-55,16 -46,53	
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-3,24 -3,15	-0,22 -4,40	-1,88 -2,03	-0,22 -4,40	-6,98 -12,25	-35,41 -26,78	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,56 0,16	21,72 15,86	5,61 3,41	21,72 15,86	25,89 16,57	-30,09 -59,75	-9,99 -58,87
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	1,52 0,83	10,80 3,74	5,28 2,55	10,80 3,74			
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6,98	20,06	10,37	20,06	28,23	20,74	67,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	650,91	308,64	329,70	308,64	208,46	88,74	258,76
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	7,07 6,38	20,38 13,32	10,58 7,85	20,38 13,32	34,24 26,07	27,00 27,23	78,76 52,43
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,56 0,15	-5,84 -11,71	0,44 -1,75	-5,84 -11,71	-6,36 -15,69	11,95 -17,71	28,23 -20,65
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	0,61 56,47	4,27 65,77	1,80 57,10	4,27 65,77	6,75 49,85	135,40 579,36	65,27 249,40
JACAREÍ Var. IPCA + 4,83% p.p.	2,32 1,99	7,50 2,08	5,11 3,13	7,50 2,08	12,56 4,15		
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

10. Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BB INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIDC MULTISETORIAL 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	D+1 du	D+1 du	D+1 du	D+6 du		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
INVESTIMENTO NO EXTERIOR						
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		
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

11. 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	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	4,96	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	8,38	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	10,05	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	2,69	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,46	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

12. Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150525 (5,480000%)	2.168.903,29	5,480000	2.148.421,90	6,043200	-20.481,39
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.059.659,17	5,810000	1.055.510,95	6,043200	-4.148,22
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.161.438,20	5,680000	20.804.891,47	5,242000	643.453,27
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.199.885,21	4,860000	2.133.177,04	5,229500	-66.708,17
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.196.203,57	4,880000	2.133.177,04	5,229500	-63.026,53
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.195.252,44	4,910000	2.137.611,92	5,229500	-57.640,52
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.183.567,29	5,196100	2.177.525,83	5,229500	-6.041,46
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.184.287,02	5,290000	2.195.265,35	5,229500	10.978,33
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.183.272,12	5,320000	2.199.700,23	5,229500	16.428,11
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.509.803,56	5,670000	1.565.512,46	5,229500	55.708,90
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.037.635,36	5,837000	2.142.046,80	5,229500	104.411,44
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.188.875,68	5,855000	3.357.203,78	5,229500	168.328,10
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.212.031,87	4,970000	2.083.325,73	5,459700	-128.706,14
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.209.289,70	4,980000	2.083.325,73	5,459700	-125.963,97
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.205.019,37	5,030000	2.092.209,85	5,459700	-112.809,52
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.191.494,31	5,285000	2.145.514,56	5,459700	-45.979,75
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.190.386,80	5,340000	2.158.840,73	5,459700	-31.546,07
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.188.740,76	5,380000	2.167.724,85	5,459700	-21.015,91
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.145.710,67	5,831000	5.379.333,60	5,459700	233.622,93
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.125.765,54	5,860000	2.229.913,68	5,459700	104.148,14
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.044.826,01	5,897000	2.154.398,67	5,459700	109.572,66
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.247.690,09	5,915000	6.596.457,80	5,459700	348.767,71
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.038.810,35	5,922000	2.154.398,67	5,459700	115.588,32
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.581.349,85	6,140000	4.966.222,10	5,459700	384.872,25
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.610.439,40	6,256000	3.966.758,80	5,459700	356.319,40
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.040.015,50	6,280000	3.349.312,58	5,459700	309.297,08
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.071.787,46	6,400000	2.314.312,80	5,459700	242.525,34
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.217.032,64	5,000000	2.074.710,92	5,452600	-142.321,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.211.921,36	5,030000	2.079.211,38	5,452600	-132.709,98
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.206.835,92	5,060000	2.083.711,84	5,452600	-123.124,08
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.194.475,93	5,315000	2.151.218,70	5,452600	-43.257,23
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.195.240,51	5,370000	2.169.220,53	5,452600	-26.019,98
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.192.996,16	5,420000	2.182.721,91	5,452600	-10.274,25
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.184.002,87	5,520000	2.205.224,19	5,452600	21.221,32
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.329.184,87	5,831200	11.953.215,22	5,452600	624.030,35
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.124.218,09	5,860000	2.250.228,77	5,452600	126.010,68
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.101.586,14	5,897000	5.432.052,25	5,452600	330.466,11
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.041.435,95	5,927000	2.182.721,91	5,452600	141.285,96
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.657.301,54	5,950000	17.866.816,42	5,452600	1.209.514,88
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.157.231,86	6,140000	10.081.024,88	5,452600	923.793,02
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.244.587,11	6,261000	9.225.937,95	5,452600	981.350,84
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.091.717,39	6,268000	7.943.307,55	5,452600	851.590,16
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.183.358,02	6,400000	5.909.100,75	5,452600	725.742,73
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.199.533,61	5,345000	2.154.362,17	7,388100	-45.171,44
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.231.100,62	5,450000	2.187.634,17	7,388100	-43.466,45
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.186.811,91	5,912000	2.154.362,17	7,388100	-32.449,74
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.230.453,21	5,009000	2.206.410,92	5,410000	-24.042,29
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.231.793,83	5,130000	2.214.979,50	5,410000	-16.814,33
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.232.485,64	5,190000	2.219.263,79	5,410000	-13.221,85
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.235.857,78	5,490000	2.240.685,26	5,410000	4.827,48
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.272.369,74	5,710000	3.298.905,64	5,410000	26.535,90
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.244.404,52	4,850000	2.210.438,90	5,213100	-33.965,62
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.236.063,45	5,125600	2.227.878,26	5,213100	-8.185,19
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.238.433,93	5,240000	2.240.957,78	5,213100	2.523,85
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.235.623,77	5,270000	2.240.957,78	5,213100	5.334,01
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.278.760,60	5,810000	3.361.436,66	5,213100	82.676,06
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.252.054,22	4,860000	2.218.279,70	5,132700	-33.774,52
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.247.057,71	4,900000	2.218.279,70	5,132700	-28.778,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.239.195,45	5,178300	2.244.845,93	5,132700	5.650,48
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.241.073,10	5,270000	2.258.129,04	5,132700	17.055,94
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.241.756,40	5,300000	2.262.556,74	5,132700	20.800,34
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.526.657,88	5,460000	3.590.867,94	5,132700	64.210,06
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.238.914,70	5,500000	2.284.695,26	5,132700	45.780,56
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.280.271,42	5,835000	3.409.332,08	5,132700	129.060,66
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.265.184,24	4,950000	2.167.067,99	5,371900	-98.116,25
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.255.693,78	4,970000	2.162.562,65	5,371900	-93.131,13
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.257.830,09	5,020000	2.176.078,67	5,371900	-81.751,42
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.248.466,95	5,274000	2.225.637,40	5,371900	-22.829,55
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.249.103,25	5,310000	2.234.648,07	5,371900	-14.455,18
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.246.438,97	5,360000	2.243.658,75	5,371900	-2.780,22
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.100.041,41	5,837000	2.203.110,70	5,371900	103.069,29
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.279.318,14	5,855000	3.446.584,23	5,371900	167.266,09
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.094.378,44	6,220000	3.374.498,80	5,371900	280.120,36
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.276.169,68	4,940000	2.122.145,47	5,459000	-154.024,21
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.273.376,62	4,980000	2.131.214,47	5,459000	-142.162,15
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.268.871,43	5,010000	2.135.748,97	5,459000	-133.122,46
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.262.840,57	5,045000	2.140.283,46	5,459000	-122.557,11
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.252.325,85	5,295500	2.203.766,45	5,459000	-48.559,40
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.251.352,67	5,360000	2.221.904,44	5,459000	-29.448,23
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.250.097,42	5,410000	2.235.507,94	5,459000	-14.589,48
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.242.997,09	5,510000	2.258.180,44	5,459000	15.183,35
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.474.013,05	5,831200	8.896.686,78	5,459000	422.673,73
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.147.742,27	5,897000	3.332.856,67	5,459000	185.114,40
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.100.582,08	5,921000	2.230.973,44	5,459000	130.391,36
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.450.819,31	5,950000	12.206.870,95	5,459000	756.051,64
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.809.608,50	6,140000	7.436.578,14	5,459000	626.969,64
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.672.225,63	6,261000	6.289.349,93	5,459000	617.124,30
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.215.373,35	6,278000	5.795.089,55	5,459000	579.716,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.111.049,08	6,400000	3.509.702,12	5,459000	398.653,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

13. Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
190	01/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	17.000,00	72,93746330	233,0763812000
203	01/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	25.000,00	0,00	107,26097544	233,0763812000
176	01/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	982.000,00	4.213,21111536	233,0763812000
177	01/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	22.000,00	94,38965839	233,0763812000
191	05/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,28583866	233,3265622000
192	07/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	44.000,00	188,37579087	233,5756617000
179	07/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.319.946,45	5.651,04446411	233,5756617000
180	07/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	25.053,55	107,26096126	233,5756617000
181	07/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	534.000,00	0,00	2.286,19709825	233,5756617000
193	12/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,27652875	233,8345088000
194	14/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	34.000,00	145,24378433	234,0891912000
195	15/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	11.000,00	46,96678667	234,2080602000
182	15/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	10.000,00	42,69707879	234,2080602000
183	15/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	4.600,00	0,00	19,64065624	234,2080602000
196	20/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	20.000,00	85,25423221	234,5924593000
184	20/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,26271161	234,5924593000
175	21/06/2023	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	0,00	5.000.000,00	1.249.426,13857455	4,0018372000
197	23/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	109.000,00	463,88359319	234,9727423000
198	23/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	10.000,00	42,55812782	234,9727423000
185	23/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	81.386,61	346,36617509	234,9727423000
186	23/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.613,39	15,37791135	234,9727423000
187	23/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	5.001.000,00	0,00	21.283,31972061	234,9727423000
199	28/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,24863465	235,3697325000
188	28/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	298.000,00	0,00	1.266,09312436	235,3697325000
200	29/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,24638609	235,4943660000
201	29/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	85.000,00	360,94281763	235,4943660000
189	30/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	2.030.000,00	0,00	8.615,59905376	235,6191354000
202	30/06/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	324.500,00	0,00	1.377,22260736	235,6191354000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
170	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.000.000,00	0,00	4.886.909,92308004	4,2971940000
171	30/06/2023	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	17.794.164,00	0,00	4.528.897,04477000	3,9290281550
172	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	29.000.000,00	15.905.095,93789334	1,8233150000
173	30/06/2023	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,00	33.125.483,18	2.897.303,51973700	11,4332112440
174	30/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	20.000.000,00	0,00	6.930.413,09639900	2,8858308620
Total			67.011.264,00	69.904.483,18		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

14. Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 10.659.175,21

Value-At-Risk: 1,59%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
JACAREÍ		1,59	1,59			671.457.423,51	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,24%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,480000%)		0,13	-0,00	0,12			2.168.903,29	0,32
NTN-B 150525 (5,810000%)		0,13	-0,00	0,12			1.059.659,17	0,16
NTN-B 150533 (5,680000%)		0,22	-0,00	0,24			20.161.438,20	3,00
NTN-B 150535 (4,860000%)		0,13	-0,00	0,12			2.199.885,21	0,33
NTN-B 150535 (4,880000%)		0,13	-0,00	0,12			2.196.203,57	0,33
NTN-B 150535 (4,910000%)		0,13	-0,00	0,12			2.195.252,44	0,33
NTN-B 150535 (5,196100%)		0,13	-0,00	0,12			2.183.567,29	0,33
NTN-B 150535 (5,290000%)		0,13	-0,00	0,12			2.184.287,02	0,33
NTN-B 150535 (5,320000%)		0,13	-0,00	0,12			2.183.272,12	0,33
NTN-B 150535 (5,670000%)		0,22	-0,00	0,24			1.509.803,56	0,22
NTN-B 150535 (5,837000%)		0,13	-0,00	0,12			2.037.635,36	0,30
NTN-B 150535 (5,855000%)		0,13	-0,00	0,12			3.188.875,68	0,47
NTN-B 150545 (4,970000%)		0,13	-0,00	0,12			2.212.031,87	0,33
NTN-B 150545 (4,980000%)		0,13	-0,00	0,12			2.209.289,70	0,33
NTN-B 150545 (5,030000%)		0,13	-0,00	0,12			2.205.019,37	0,33
NTN-B 150545 (5,285000%)		0,13	-0,00	0,12			2.191.494,31	0,33
NTN-B 150545 (5,340000%)		0,13	-0,00	0,12			2.190.386,80	0,33
NTN-B 150545 (5,380000%)		0,13	-0,00	0,12			2.188.740,76	0,33
NTN-B 150545 (5,831000%)		0,13	-0,00	0,12			5.145.710,67	0,77
NTN-B 150545 (5,860000%)		0,13	-0,00	0,12			2.125.765,54	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (5,897000%)		0,13	-0,00	0,12			2.044.826,01	0,30
NTN-B 150545 (5,915000%)		0,13	-0,00	0,12			6.247.690,09	0,93
NTN-B 150545 (5,922000%)		0,13	-0,00	0,12			2.038.810,35	0,30
NTN-B 150545 (6,140000%)		0,13	-0,00	0,12			4.581.349,85	0,68
NTN-B 150545 (6,256000%)		0,13	-0,00	0,12			3.610.439,40	0,54
NTN-B 150545 (6,280000%)		0,13	-0,00	0,12			3.040.015,50	0,45
NTN-B 150545 (6,400000%)		0,13	-0,00	0,12			2.071.787,46	0,31
NTN-B 150555 (5,000000%)		0,13	-0,00	0,12			2.217.032,64	0,33
NTN-B 150555 (5,030000%)		0,13	-0,00	0,12			2.211.921,36	0,33
NTN-B 150555 (5,060000%)		0,13	-0,00	0,12			2.206.835,92	0,33
NTN-B 150555 (5,315000%)		0,13	-0,00	0,12			2.194.475,93	0,33
NTN-B 150555 (5,370000%)		0,13	-0,00	0,12			2.195.240,51	0,33
NTN-B 150555 (5,420000%)		0,13	-0,00	0,12			2.192.996,16	0,33
NTN-B 150555 (5,520000%)		0,13	-0,00	0,12			2.184.002,87	0,33
NTN-B 150555 (5,831200%)		0,13	-0,00	0,12			11.329.184,87	1,69
NTN-B 150555 (5,860000%)		0,13	-0,00	0,12			2.124.218,09	0,32
NTN-B 150555 (5,897000%)		0,13	-0,00	0,12			5.101.586,14	0,76
NTN-B 150555 (5,927000%)		0,13	-0,00	0,12			2.041.435,95	0,30
NTN-B 150555 (5,950000%)		0,13	-0,00	0,12			16.657.301,54	2,48
NTN-B 150555 (6,140000%)		0,13	-0,00	0,12			9.157.231,86	1,36
NTN-B 150555 (6,261000%)		0,13	-0,00	0,12			8.244.587,11	1,23
NTN-B 150555 (6,268000%)		0,13	-0,00	0,12			7.091.717,39	1,06
NTN-B 150555 (6,400000%)		0,13	-0,00	0,12			5.183.358,02	0,77
NTN-B 150824 (5,345000%)		0,13	-0,00	0,12			2.199.533,61	0,33
NTN-B 150824 (5,450000%)		0,13	-0,00	0,12			2.231.100,62	0,33
NTN-B 150824 (5,912000%)		0,13	-0,00	0,12			2.186.811,91	0,33
NTN-B 150826 (5,009000%)		0,13	-0,00	0,12			2.230.453,21	0,33
NTN-B 150826 (5,130000%)		0,13	-0,00	0,12			2.231.793,83	0,33
NTN-B 150826 (5,190000%)		0,13	-0,00	0,12			2.232.485,64	0,33
NTN-B 150826 (5,490000%)		0,13	-0,00	0,12			2.235.857,78	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,710000%)		0,13	-0,00	0,12			3.272.369,74	0,49
NTN-B 150828 (4,850000%)		0,13	-0,00	0,12			2.244.404,52	0,33
NTN-B 150828 (5,125600%)		0,13	-0,00	0,12			2.236.063,45	0,33
NTN-B 150828 (5,240000%)		0,13	-0,00	0,12			2.238.433,93	0,33
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,13	-0,00	0,12			2.235.623,77	0,33
NTN-B 150828 (5,810000%)		0,13	-0,00	0,12			3.278.760,60	0,49
NTN-B 150830 (4,860000%)		0,13	-0,00	0,12			2.252.054,22	0,34
NTN-B 150830 (4,900000%)		0,13	-0,00	0,12			2.247.057,71	0,33
NTN-B 150830 (5,178300%)		0,13	-0,00	0,12			2.239.195,45	0,33
NTN-B 150830 (5,270000%)		0,13	-0,00	0,12			2.241.073,10	0,33
NTN-B 150830 (5,300000%)		0,13	-0,00	0,12			2.241.756,40	0,33
NTN-B 150830 (5,460000%)		0,22	-0,00	0,26			3.526.657,88	0,53
NTN-B 150830 (5,500000%)		0,13	-0,00	0,12			2.238.914,70	0,33
NTN-B 150830 (5,835000%)		0,13	-0,00	0,12			3.280.271,42	0,49
NTN-B 150840 (4,950000%)		0,13	-0,00	0,12			2.265.184,24	0,34
NTN-B 150840 (4,970000%)		0,13	-0,00	0,12			2.255.693,78	0,34
NTN-B 150840 (5,020000%)		0,13	-0,00	0,12			2.257.830,09	0,34
NTN-B 150840 (5,274000%)		0,13	-0,00	0,12			2.248.466,95	0,33
NTN-B 150840 (5,310000%)		0,13	-0,00	0,12			2.249.103,25	0,33
NTN-B 150840 (5,360000%)		0,13	-0,00	0,12			2.246.438,97	0,33
NTN-B 150840 (5,837000%)		0,13	-0,00	0,12			2.100.041,41	0,31
NTN-B 150840 (5,855000%)		0,13	-0,00	0,12			3.279.318,14	0,49
NTN-B 150840 (6,220000%)		0,13	-0,00	0,12			3.094.378,44	0,46
NTN-B 150850 (4,940000%)		0,13	-0,00	0,12			2.276.169,68	0,34
NTN-B 150850 (4,980000%)		0,13	-0,00	0,12			2.273.376,62	0,34
NTN-B 150850 (5,010000%)		0,13	-0,00	0,12			2.268.871,43	0,34
NTN-B 150850 (5,045000%)		0,13	-0,00	0,12			2.262.840,57	0,34
NTN-B 150850 (5,295500%)		0,13	-0,00	0,12			2.252.325,85	0,34
NTN-B 150850 (5,360000%)		0,13	-0,00	0,12			2.251.352,67	0,34
NTN-B 150850 (5,410000%)		0,13	-0,00	0,12			2.250.097,42	0,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,510000%)		0,13	-0,00	0,12			2.242.997,09	0,33
NTN-B 150850 (5,831200%)		0,13	-0,00	0,12			8.474.013,05	1,26
NTN-B 150850 (5,897000%)		0,13	-0,00	0,12			3.147.742,27	0,47
NTN-B 150850 (5,921000%)		0,13	-0,00	0,12			2.100.582,08	0,31
NTN-B 150850 (5,950000%)		0,13	-0,00	0,12			11.450.819,31	1,71
NTN-B 150850 (6,140000%)		0,13	-0,00	0,12			6.809.608,50	1,01
NTN-B 150850 (6,261000%)		0,13	-0,00	0,12			5.672.225,63	0,84
NTN-B 150850 (6,278000%)		0,23	-0,00	0,27			5.215.373,35	0,78
NTN-B 150850 (6,400000%)		0,13	-0,00	0,12			3.111.049,08	0,46
Sub-total	0,37	0,12	-0,01		-1,70	0,45	307.081.840,31	45,73

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,86	0,02	0,04			21.000.000,00	3,13
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,37	0,03	0,10			17.794.164,00	2,65
Sub-total	0,00	2,54	0,05		0,00	0,00	38.794.164,00	5,78

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		2,58	-0,00	2,58			4.993.526,50	0,74
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			20.000.000,00	2,98
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,05	0,00	0,05			20.373.768,43	3,03
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,05	0,00	0,05			28.738.504,31	4,28
BB INSTITUCIONAL FI RF		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	0,42	0,18	-0,00		-0,02	1,07	74.105.799,24	11,04

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a		0,21	-0,00	0,23			5.053.197,27	0,75
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a		0,20	-0,00	0,22			5.049.589,84	0,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a		0,19	-0,00	0,21			5.048.419,57	0,75
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a		0,22	0,00	0,24			5.411.082,28	0,81
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a		0,20	-0,00	0,22			5.048.366,22	0,75
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a		0,14	-0,00	0,13			5.883.181,95	0,88
Sub-total	0,55	0,15	-0,00		-0,76	0,66	31.493.837,13	4,69

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1,51	0,00	1,51			5.637,93	0,00
Sub-total	281,78	1,51	0,00		0,44	125,56	5.637,93	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			3.308.689,39	0,49
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV		0,90	0,00	0,29			2.138.092,46	0,32
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,15	0,00	0,15			5.672.531,42	0,84
Sub-total	0,34	0,18	0,00		0,42	1,22	11.119.313,27	1,66

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,31%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA		13,38	0,06	7,68			4.248.855,13	0,63
META VALOR FI DE AÇÕES		10,54	0,03	4,30			2.222.745,00	0,33
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		9,84	0,09	4,73			7.594.739,20	1,13
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,98	0,06	3,84			5.220.200,47	0,78
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		8,61	0,22	3,23			21.637.540,40	3,22
OCCAM FIC FIA		7,89	0,30	2,01			30.527.457,29	4,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		10,04	0,04	6,00			3.606.673,77	0,54
INDIE FIC FIA		11,50	0,05	6,20			3.771.253,52	0,56
TARPON GT 30 FIC FIA		9,36	0,08	7,28			8.422.509,63	1,25
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA		11,32	0,07	9,11			6.813.812,02	1,01
Sub-total	15,93	8,31	0,99		0,50	9,11	94.065.786,43	14,01

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,09%

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		9,73	0,02	11,67			7.475.845,02	1,11
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		6,86	0,13	6,86			18.186.353,10	2,71
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		6,85	0,22	5,44			30.218.740,31	4,50
Sub-total	9,02	6,12	0,37		0,58	6,27	55.880.938,43	8,32

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		0,03	0,00	0,12			11.224.179,24	1,67
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		0,16	0,00	0,16			15.928,08	0,00
Sub-total	1,92	0,03	0,00		-0,27	0,56	11.240.107,32	1,67

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,21%

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		9,04	0,13	7,67			14.926.800,30	2,22
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		16,85	0,01	15,22			1.873.053,55	0,28
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		7,59	-0,01	7,77			2.413.749,26	0,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,41	-0,00	10,22			2.438.197,25	0,36
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		11,84	0,00	11,85			2.611.683,73	0,39
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		8,42	-0,01	8,37			5.098.836,32	0,76
Sub-total	11,29	6,54	0,13		0,13	2,49	29.362.320,41	4,37

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		7,14	0,05	11,89			18.307.679,04	2,73
Sub-total	12,17	7,14	0,05		-0,09	-0,06	18.307.679,04	2,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

15. Relatório de Cenário Macroeconômico

Ao longo do mês de junho, permaneceu a visão de um cenário internacional ainda desafiador. A inflação nas principais economias desenvolvidas continua elevada e acima da meta, com o processo de desinflação ocorrendo em ritmo mais lento. Adicionalmente, o mercado de trabalho apertado apresenta risco para a desinflação prevista. Nos EUA, tivemos dados de atividade econômica mais fortes, demonstrando resiliência apesar do aperto monetário, consequentemente houve a sinalização de que devem ser necessários ajustes adicionais nos Fed Funds. Assim, o efeito sobre a curva de juros foi o aumento das taxas, voltando aos patamares próximos dos observados antes da crise dos bancos regionais, o que pode sugerir que a ameaça de uma crise bancária ficou para trás, pelo menos por enquanto. Na Zona do Euro, os dados de atividade demonstram desaceleração mais acentuada. A deterioração da demanda por bens, após os excessos do período pós-pandemia, em conjunto com o aperto das condições de crédito está exercendo impacto negativo sobre a indústria. Na China, apesar do forte primeiro trimestre por conta da reabertura pós pandemia e dos anúncios de medidas de estímulo para a economia, há poucos sinais de avanço até agora, onde o setor de propriedades encontra-se em estagnação. Assim, a economia chinesa parece passar por desaquecimento mais intenso que o previsto. Além disso, tivemos surpresas altistas nas decisões de política monetária do Reino Unido, Canadá, Austrália e Noruega. Já nos países emergentes, o processo de desinflação se mostra mais avançado. Vale destacar que apesar do ciclo monetário ainda em curso, os principais Bancos Centrais estão mais próximos do estágio final, isso reduz a chance de que as taxas ao final do período do aperto monetário estejam muito além das projeções atuais. Assim, no mês de junho de 2023, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +5,64% e +6,47%, 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 +14,42% e +17,57%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de -0,09% e +0,69%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +5,27% e +8,17% nos últimos 12 meses.

Localmente, houve a queda dos juros que foi sustentada pelo alívio nas expectativas de inflação para este ano, a aprovação do novo arcabouço fiscal e a manutenção da meta de inflação para os próximos anos. A inflação continua evoluindo de forma mais favorável recentemente. A desaceleração do IPCA parece um pouco mais rápida que a esperada, ainda que seu núcleo siga em patamar mais elevado e acima da meta. Além disso, vale destacar a redução das expectativas para inflação observada no Boletim Focus nos períodos mais longos. Com a reunião do CMN as metas de inflação até 2025 foram mantidas e a meta de 2026 foi fixada em 3,0%. Após a reunião, o Ministro da Fazenda anunciou que haverá uma alteração na forma como a consecução da meta seria aferida a partir de 2025, com o estabelecimento de um horizonte móvel, mas ainda sem divulgar os detalhes sobre a nova mecânica. Embora, a taxa Selic tenha sido mantida em 13,75%, o Copom trouxe uma comunicação mais branda. Adicionalmente, houve a retirada na ata da reunião a frase que previa a possibilidade de aumento dos juros caso o processo de desinflação não ocorresse conforme o desejado. Assim, o mercado ainda possui a expectativa de que o fim do ciclo de aperto monetário está próximo. Em consequência as decisões do CMN e Copom, houve redução das taxas da curva de juros. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, devido ao sentimento gerado pela queda dos juros futuros e a aprovação do novo arcabouço fiscal. Apresentando um retorno positivo de 9,00% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de 7,61% e de 19,83% nos últimos 12 meses.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

16. Agenda realizada

15 de junho:

9h00: Tricentésima octogésima sexta (386ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros (CAIF) do Instituto de Previdência do Município de Jacareí (IPMJ), ocorrida em 15 de junho de 2023, tendo início às 9h25 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 e Rafaela Carvalho dos Santos. Ausências justificadas de José Ricardo Vinhas e Victor Adriano Vieira Silva. Participaram da reunião os estagiários Julia Victoria Jesus Simões e João Pedro Gomes Santos. Pautas da reunião: 1) Análise do relatório de investimentos de maio de 2023; 2) Análise da carteira fechada de maio de 2023; 3) Estudos e Propostas para movimentação na carteira; 4) Reunião com a GRID Agente Autônomo de Investimentos e a Gestora OCCAM Brasil Gestão de Recursos LTDA; 5) Assuntos diversos.

22 de junho:

18h00: 1ª Audiência Pública Anual realizada na Câmara Municipal de Jacareí. Foi apresentado pela presidente Rossana Vasques o Relatório de Governança Corporativa, os resultados da Política de Investimentos e da avaliação atuarial do exercício 2022.

28 de junho:

9h00: Tricentésima octogésima sétima (387ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, ocorrida em 28 de junho de 2023, tendo início às 9h20 em formato híbrido, com as seguintes presenças dos membros do CAIF na sala de reuniões do IPMJ: Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Clévio Vitor de Almeida e José Ricardo Vinhas. No formato on-line, Rafaela Carvalho dos Santos e Victor Adriano Vieira Silva. Participou da reunião o estagiário em Ciências Econômicas João Pedro Gomes Santos. Pautas da reunião: 1) Credenciamentos; 2) Apresentação CAIXA Asset sobre Cenário da taxa de juros e possíveis alocações em fundos IMA; 3) Análise parcial da carteira até 26/06/2023; 4) Movimentações; 5) Assuntos Diversos.

30 de junho:

11h00: Reunião em parceria com a MIRAE ASSET INVESTIMENTOS na cidade de São Paulo com seu representante Sung Yop Kim. O objetivo da reunião foi a apresentação da corretora e dos fundos elegíveis para aplicações de RPPS. Participaram da reunião João Pedro Gomes Santos, Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e Rossana Vasques – Presidente do IPMJ.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Em junho de 2023, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um prejuízo de R\$ 454.522,15 (quatrocentos e cinquenta e quatro mil e quinhentos e vinte e dois reais e quinze centavos negativos) e um rendimento negativo acumulado, R\$ 1.403.697,80 (um milhão e quatrocentos e três mil e seiscentos e noventa e sete reais e oitenta 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 30 de junho de 2023 é de R\$ 5.637,93 (cinco mil e seiscentos e trinta e sete reais e noventa e três centavos).

II. PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP

O Fundo PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP em junho 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\$ 2.808.868,50 (dois milhões e oitocentos e oito mil e oitocentos e sessenta e oito reais e cinquenta centavos negativos). O saldo em 30 de junho de 2023 foi de R\$ 15.928,05 (quinze mil e novecentos e vinte e oito reais e cinco centavos), com um rendimento mensal de R\$ 95,86 (noventa e cinco reais e oitenta e seis centavos).

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

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\$ 2.608.201,43 (dois milhões e seiscentos e oito mil e duzentos e um reais e quarenta e três centavos). O saldo acumulado em 30 de junho de 2023 é de R\$ 11.224.179,24 (onze milhões e duzentos e vinte e quatro mil e cento e setenta e nove reais e vinte e quatro centavos) com um rendimento no mês de junho de R\$ 61.962,25 (sessenta e um mil e novecentos e sessenta e dois reais e vinte e cinco centavos).