



**LDB**  
EMPRESAS

**JACAREÍ**  
JULHO 2023



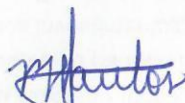
**Sumário**

PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS .....	3
RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS .....	4
Posição de Ativos e Enquadramento .....	5
Enquadramento da Carteira .....	11
Rentabilidades por Artigo.....	12
RESULTADO POR ATIVO.....	12
Análise de Liquidez.....	19
Alocação por Artigo.....	20
Alocação Por Estratégia.....	20
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial.....	22
Performance dos Fundos.....	25
Cotização e Taxas.....	33
Indexadores.....	35
Movimentações.....	41
Análise de Risco.....	43
Relatório de Cenário Macroeconômico.....	50
Agenda realizada.....	51
Acompanhamento fundos estressados.....	53
Fundos Estruturados.....	54

## PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS

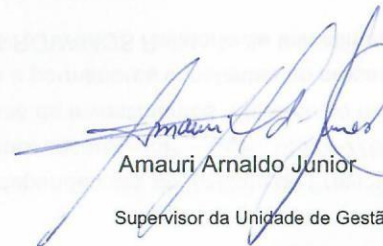
Em 02 de julho de 2019 o IPMJ formalizou sua adesão ao Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios – “Pró Gestão RPPS”. Em atendimento ao Manual do Pró Gestão RPPS, apresenta-se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



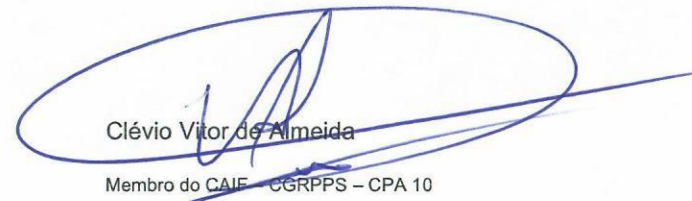
Amauri Arnaldo Júnior

Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos – CPA 10



Luis Gustavo Ferreira Bonacina

Assessor da Presidência – CPA 20



Clévio Vitor de Almeida

Membro do CAIF – CGRPPS – CPA 10

**AUSÊNCIA  
JUSTIFICADA**

Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do CAIF

**AUSÊNCIA  
JUSTIFICADA**

José Ricardo Vinhas

Membro do CAIF



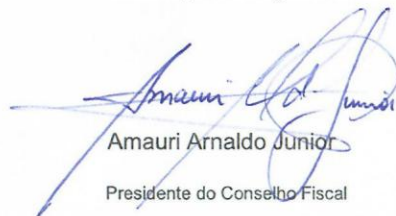
Victor Adriano Vieira Silva

Membro do CAIF – CGRPPS

## RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 21 dias do mês de agosto 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 julho 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 julho 2023.

Jacareí, 21 de agosto de 2023



Amauri Arnaldo Junior  
Presidente do Conselho Fiscal



Rafaela Carvalho dos Santos  
Membro do Conselho Fiscal

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

68,13%

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%)	0,45	0,02	0,45	6,55	2.178.634,52	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,45	0,03	0,47	6,74	1.064.691,44	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,680000%)	4,02	0,04	0,46	1,29	20.255.065,69	2,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,48	0,02	0,40	6,19	2.208.670,58	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,48	0,02	0,40	6,20	2.205.010,65	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,48	0,02	0,40	6,22	2.204.107,50	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,48	0,02	0,43	6,38	2.192.871,72	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,49	0,02	0,43	6,44	2.193.758,64	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,49	0,02	0,44	6,45	2.192.791,36	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,670000%)	4,00	0,03	0,46	1,29	1.516.804,20	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,48	0,03	0,48	6,75	2.047.354,78	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,48	0,03	0,48	6,76	3.204.130,53	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,48	0,02	0,41	6,25	2.221.058,79	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,48	0,02	0,41	6,26	2.218.324,27	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,48	0,02	0,41	6,29	2.214.125,09	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,285000%)	0,49	0,02	0,43	6,43	2.200.987,25	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,49	0,02	0,44	6,47	2.199.970,39	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,49	0,02	0,44	6,49	2.198.387,62	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,48	0,03	0,48	6,75	5.170.230,69	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,48	0,03	0,48	6,77	2.135.944,18	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	0,45	0,03	0,48	6,79	2.054.675,70	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,48	0,03	0,48	6,80	6.277.878,62	0,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,48	0,03	0,48	6,80	2.048.671,86	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	0,45	0,03	0,50	6,93	4.604.299,90	0,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,49	0,03	0,51	7,00	3.628.853,94	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,280000%)	3,03	0,03	0,51	4,96	3.055.579,02	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	3,07	0,03	0,52	7,08	2.082.590,12	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,000000%)	0,48	0,02	0,41	6,27	2.226.133,28	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,48	0,02	0,41	6,29	2.221.054,78	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,48	0,02	0,42	6,30	2.216.002,17	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,49	0,02	0,44	6,45	2.204.035,16	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,49	0,02	0,44	6,48	2.204.899,08	0,32
TESOURO	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,49	0,02	0,44	6,51	2.202.732,36	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,520000%)	0,49	0,03	0,45	6,57	2.193.870,82	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,48	0,03	0,48	6,75	11.383.161,52	1,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,48	0,03	0,48	6,77	2.134.389,40	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	0,45	0,03	0,48	6,79	5.126.163,79	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,48	0,03	0,48	6,81	2.051.319,55	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,49	0,03	0,49	6,82	16.738.235,51	2,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	0,45	0,03	0,50	6,93	9.203.102,49	1,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,49	0,03	0,51	7,00	8.286.672,67	1,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,268000%)	3,04	0,03	0,51	4,95	7.127.951,82	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	3,09	0,03	0,52	7,08	5.210.386,15	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,50	0,02	0,44	6,47	2.209.166,92	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,450000%)	0,49	0,02	0,45	6,53	2.241.056,27	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,49	0,03	0,48	6,80	2.197.372,48	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,49	0,02	0,41	6,27	2.239.626,19	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,49	0,02	0,42	6,34	2.241.187,81	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,49	0,02	0,43	6,38	2.241.987,45	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,49	0,02	0,45	6,55	2.245.908,26	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%)	0,49	0,03	0,47	6,68	3.287.649,15	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,48	0,02	0,40	6,18	2.253.350,74	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,49	0,02	0,42	6,34	2.245.467,42	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,49	0,02	0,43	6,41	2.248.049,73	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,49	0,02	0,43	6,43	2.245.281,90	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,49	0,03	0,47	6,74	3.294.330,34	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,48	0,02	0,40	6,19	2.261.048,61	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,48	0,02	0,40	6,21	2.256.103,63	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,49	0,02	0,42	6,37	2.248.706,37	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,49	0,02	0,43	6,43	2.250.755,68	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,300000%)	0,49	0,02	0,43	6,44	2.251.495,81	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,460000%)	4,04	0,02	0,45	1,25	3.542.425,38	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,49	0,03	0,45	6,56	2.248.997,76	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,835000%)	0,49	0,03	0,48	6,75	3.295.910,11	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,49	0,02	0,41	6,24	2.274.392,40	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,49	0,02	0,41	6,25	2.264.900,48	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,49	0,02	0,41	6,28	2.267.135,81	0,33
TESOURO	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,49	0,02	0,43	6,43	2.258.188,60	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%)	0,49	0,02	0,44	6,45	2.258.890,60	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,49	0,02	0,44	6,48	2.256.304,47	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,49	0,03	0,48	6,75	2.110.058,26	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,49	0,03	0,48	6,76	3.295.007,43	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,50	0,03	0,51	6,98	3.110.072,86	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,49	0,02	0,41	6,23	2.285.403,50	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,49	0,02	0,41	6,26	2.282.672,79	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,49	0,02	0,41	6,27	2.278.204,58	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,49	0,02	0,41	6,29	2.272.210,72	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,49	0,02	0,43	6,44	2.262.101,87	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,49	0,02	0,44	6,48	2.261.240,90	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,49	0,02	0,44	6,51	2.260.068,10	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,510000%)	0,49	0,02	0,45	6,56	2.253.113,17	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,49	0,03	0,48	6,75	8.514.399,16	1,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	2,95	0,03	0,48	6,79	3.162.904,16	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,49	0,03	0,48	6,80	2.110.741,21	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,49	0,03	0,49	6,82	11.506.459,67	1,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	3,04	0,03	0,50	6,93	6.843.716,69	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,50	0,03	0,51	7,00	5.701.183,78	0,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,278000%)	4,31	0,03	0,51	4,96	5.242.065,97	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	3,14	0,03	0,52	7,08	3.127.271,04	0,46
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,46</b>	<b>0,03</b>	<b>0,47</b>	<b>6,67</b>	<b>308.510.165,83</b>	<b>45,14</b>

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	5,21	0,26	0,80	0,80	21.168.314,95	3,10	4.916.698.620,80	0,43
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,02	0,38	0,69	0,69	21.265.691,55	3,11	1.449.653.568,31	1,47
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,71</b>	<b>0,32</b>	<b>0,75</b>	<b>0,75</b>	<b>42.434.006,50</b>	<b>6,21</b>		

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	6,04	0,06	1,50	1,37	5.068.544,00	0,74	226.713.407,39	2,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,06	1,06	20.212.906,48	2,96	14.673.774.494,53	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	1,15	7,72	20.607.428,47	3,01	5.833.199.134,59	0,35
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,06	1,13	7,58	28.098.781,63	4,11	2.886.944.335,56	0,97
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,16</b>	<b>0,06</b>	<b>1,14</b>	<b>7,45</b>	<b>73.987.660,58</b>	<b>10,82</b>		

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				
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	1,02	0,01	0,53	1,60	5.080.038,14	0,74		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,94	-0,05	0,47	1,46	5.073.184,15	0,74		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	0,92	0,03	0,53	1,51	5.075.380,16	0,74		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	1,28	-0,01	0,52	7,86	5.439.463,20	0,80		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	0,93	-0,05	0,45	1,42	5.071.122,20	0,74		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 7,00% a.a	1,89	0,03	0,57	7,45	5.916.488,59	0,87		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>1,88</b>	<b>-0,01</b>	<b>0,51</b>	<b>7,42</b>	<b>31.655.676,44</b>	<b>4,63</b>		

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	137,93	87,29	87,29	41,11	10.559,48	0,00	365.272,94	2,89
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>137,93</b>	<b>87,29</b>	<b>87,29</b>	<b>41,11</b>	<b>10.559,48</b>	<b>0,00</b>		

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	1,13	7,78	3.346.221,53	0,49	10.206.677.671,68	0,03
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	2,73	0,00	0,33	4,47	0,00	0,00	546.205.448,85	0,00
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,47	0,07	1,35	7,01	5.749.356,19	0,84	3.164.495.740,81	0,18
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>0,54</b>	<b>0,06</b>	<b>1,28</b>	<b>6,94</b>	<b>9.095.577,72</b>	<b>1,33</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,33</b>	<b>0,06</b>	<b>0,62</b>	<b>6,85</b>	<b>465.693.646,55</b>	<b>68,13</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

14,59%

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	27,28	1,49	8,29	12,35	4.600.945,00	0,67	195.273.567,58	2,36
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	25,14	0,95	4,50	2,23	2.322.824,28	0,34	207.962.232,43	1,12
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	24,30	0,84	1,83	12,91	7.733.581,15	1,13	272.639.015,95	2,84
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,87	0,47	3,06	9,92	5.380.162,24	0,79	1.488.977.770,22	0,36
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,83	1,25	3,43	8,33	22.380.423,09	3,27	667.615.884,13	3,35
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,37	1,44	2,85	7,54	31.398.975,95	4,59	928.043.963,15	3,38
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22,56	1,47	5,29	28,12	6.099.493,01	0,89	325.539.800,95	1,87
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	24,85	0,99	3,75	22,02	3.912.625,92	0,57	435.215.102,93	0,90
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	21,92	1,81	5,91	32,21	8.920.020,57	1,31	827.979.329,08	1,08
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,01	1,34	2,51	8,41	6.984.910,16	1,02	220.784.428,22	3,16
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>19,41</b>	<b>1,30</b>	<b>3,62</b>	<b>11,45</b>	<b>99.733.961,37</b>	<b>14,59</b>		
Renda Variável			19,41	1,30	3,62	11,45	99.733.961,37	14,59		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**INVESTIMENTOS NO EXTERIOR** **7,21%**

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	24,55	0,87	6,12	31,63	15.840.318,98	2,32	239.265.030,75	6,62
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	43,20	2,74	5,48	27,50	1.975.788,07	0,29	192.909.055,46	1,02
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,58	0,71	2,47	-12,31	2.473.468,76	0,36	69.641.936,40	3,55
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	26,71	0,54	1,62	1,39	2.477.594,57	0,36	60.083.159,72	4,12
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,45	1,75	3,57	26,07	2.704.932,38	0,40	662.986.244,95	0,41
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	23,20	0,51	1,81	4,72	5.191.218,46	0,76	293.744.521,03	1,77
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>18,94</b>	<b>0,97</b>	<b>4,43</b>	<b>18,16</b>	<b>30.663.321,22</b>	<b>4,49</b>		

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	21,60	0,13	1,55	9,12	18.590.753,69	2,72	722.537.692,85	2,57
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>21,60</b>	<b>0,13</b>	<b>1,55</b>	<b>9,12</b>	<b>18.590.753,69</b>	<b>2,72</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>18,68</b>	<b>0,65</b>	<b>3,32</b>	<b>14,58</b>	<b>49.254.074,91</b>	<b>7,21</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,07%

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	16,01	-0,64	-0,38	10,38	7.447.584,17	1,09	49.970.161,87	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	18,72	0,11	3,61	24,39	18.842.709,47	2,76	863.022.855,86	2,18
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	18,38	0,11	3,68	24,80	31.329.441,56	4,58	531.369.874,48	5,90
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>17,28</b>	<b>0,01</b>	<b>3,11</b>	<b>22,60</b>	<b>57.619.735,20</b>	<b>8,43</b>		

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	50,22	0,00	0,18	-5,68	11.224.787,34	1,64	358.070.667,45	3,13
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	439,19	-98,75	-98,75	-98,70	198,95	0,00	2.615.006,70	0,01
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>50,14</b>	<b>-0,14</b>	<b>0,04</b>	<b>-5,79</b>	<b>11.224.986,29</b>	<b>1,64</b>		

Investimentos Estruturados

16,58 -0,01 2,60 17,27 68.844.721,49 10,07

Total

3,93 0,27 1,43 9,04 683.526.404,33 100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	308.510.165,83	45,14	0,00	43,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	42.434.006,50	6,21	0,00	5,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	73.987.660,58	10,82	0,00	12,50	40,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	31.655.676,44	4,63	0,00	2,50	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	10.559,48	0,00	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	9.095.577,72	1,33	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>465.693.646,55</b>	<b>68,13</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	99.733.961,37	14,59	0,00	14,50	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>99.733.961,37</b>	<b>14,59</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	30.663.321,22	4,49	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	18.590.753,69	2,72	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>49.254.074,91</b>	<b>7,21</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	57.619.735,20	8,43	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	11.224.986,29	1,64	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>68.844.721,49</b>	<b>10,07</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>683.526.404,33</b>	<b>100,00</b>					

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## 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	0,47 43,39	6,67 87,24	1,98 59,84	5,43 84,28	9,35 68,84	1.428.325,52	19.994.553,73
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,75 69,56	0,75 9,76	0,75 22,58	0,75 11,57	1,90 13,98	308.542,50	308.542,50
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,14 106,71	7,45 97,51	3,46 104,64	6,37 98,85	13,51 99,45	832.556,03	7.742.981,11
Artigo 7º IV % do CDI	0,51 47,94	7,42 97,11	2,36 71,58	6,26 97,11		161.839,31	1.106.395,76
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	87,29 8.143,19	41,11 538,03	100,89 3.054,64	34,64 537,48	63,03 464,02	4.921,55	3.076,14
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,28 119,66	6,94 90,87	3,71 112,27	6,38 99,07	13,00 95,66	121.381,18	709.896,37
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,62 0,35	11,45 0,33	19,55 2,79	8,16 0,65	16,69 -1,51	3.468.174,94	10.492.710,72
Artigo 9º II % do CDI	4,43 413,33	18,16 237,72	10,99 332,66	9,44 146,43	6,68 49,19	1.301.000,81	4.713.146,04
Artigo 9º III % do CDI	1,55 144,24	9,12 119,35	3,22 97,58	6,40 99,35	0,96 7,03	283.074,65	1.553.515,03
Artigo 10º I % do CDI	3,11 290,27	22,60 295,79	11,10 336,19	15,90 246,79	19,13 140,81	1.738.796,77	10.621.241,95
Artigo 10º II % do CDI	0,04 3,45	-5,79 -75,82	1,41 42,55	0,64 9,86	-6,90 -50,80	4.189,71	-490.684,45
<b>JACAREÍ (Total)</b>						<b>9.652.802,97</b>	<b>56.755.374,90</b>

## 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%)	2.168.903,29	0,00	0,00	0,00	2.178.634,52	9.731,23	136.951,42
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.059.659,17	0,00	0,00	0,00	1.064.691,44	5.032,27	68.763,91
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.161.438,20	0,00	0,00	0,00	20.255.065,69	93.627,49	258.193,26
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.199.885,21	0,00	0,00	0,00	2.208.670,58	8.785,37	131.421,37



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.196.203,57	0,00	0,00	0,00	2.205.010,65	8.807,08	131.439,94
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.195.252,44	0,00	0,00	0,00	2.204.107,50	8.855,06	131.738,68
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.183.567,29	0,00	0,00	0,00	2.192.871,72	9.304,43	134.421,87
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.184.287,02	0,00	0,00	0,00	2.193.758,64	9.471,62	135.575,33
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.183.272,12	0,00	0,00	0,00	2.192.791,36	9.519,24	135.867,56
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.509.803,56	0,00	0,00	0,00	1.516.804,20	7.000,64	19.309,22
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.037.635,36	0,00	0,00	0,00	2.047.354,78	9.719,42	132.482,03
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.188.875,68	0,00	0,00	0,00	3.204.130,53	15.254,85	207.641,52
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.212.031,87	0,00	0,00	0,00	2.221.058,79	9.026,92	133.355,01
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.209.289,70	0,00	0,00	0,00	2.218.324,27	9.034,57	133.310,07
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.205.019,37	0,00	0,00	0,00	2.214.125,09	9.105,72	133.655,19
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.191.494,31	0,00	0,00	0,00	2.200.987,25	9.492,94	135.884,42
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.190.386,80	0,00	0,00	0,00	2.199.970,39	9.583,59	136.471,05
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.188.740,76	0,00	0,00	0,00	2.198.387,62	9.646,86	136.846,19
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.145.710,67	0,00	0,00	0,00	5.170.230,69	24.520,02	334.347,78
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.125.765,54	0,00	0,00	0,00	2.135.944,18	10.178,64	138.457,92
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.044.826,01	0,00	0,00	0,00	2.054.675,70	9.849,69	133.595,74
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.247.690,09	0,00	0,00	0,00	6.277.878,62	30.188,53	408.796,57
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.038.810,35	0,00	0,00	0,00	2.048.671,86	9.861,51	133.479,95
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.581.349,85	0,00	0,00	0,00	4.604.299,90	22.950,05	305.355,73
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.610.439,40	0,00	0,00	0,00	3.628.853,94	18.414,54	242.911,96
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.040.015,50	0,00	0,00	0,00	3.055.579,02	15.563,52	147.388,84
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.071.787,46	0,00	0,00	0,00	2.082.590,12	10.802,66	141.005,57
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.217.032,64	0,00	0,00	0,00	2.226.133,28	9.100,64	133.958,12
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.211.921,36	0,00	0,00	0,00	2.221.054,78	9.133,42	134.012,80
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.206.835,92	0,00	0,00	0,00	2.216.002,17	9.166,25	134.068,68
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.194.475,93	0,00	0,00	0,00	2.204.035,16	9.559,23	136.384,02
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.195.240,51	0,00	0,00	0,00	2.204.899,08	9.658,57	137.092,22
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.192.996,16	0,00	0,00	0,00	2.202.732,36	9.736,20	137.554,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.184.002,87	0,00	0,00	0,00	2.193.870,82	9.867,95	138.182,89
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.329.184,87	0,00	0,00	0,00	11.383.161,52	53.976,65	736.064,37
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.124.218,09	0,00	0,00	0,00	2.134.389,40	10.171,31	138.347,81
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.101.586,14	0,00	0,00	0,00	5.126.163,79	24.577,65	333.290,46
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.041.435,95	0,00	0,00	0,00	2.051.319,55	9.883,60	133.702,69
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.657.301,54	0,00	0,00	0,00	16.738.235,51	80.933,97	1.093.044,01
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.157.231,86	0,00	0,00	0,00	9.203.102,49	45.870,63	610.372,15
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.244.587,11	0,00	0,00	0,00	8.286.672,67	42.085,56	554.980,92
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.091.717,39	0,00	0,00	0,00	7.127.951,82	36.234,43	343.507,39
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.183.358,02	0,00	0,00	0,00	5.210.386,15	27.028,13	352.835,35
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.199.533,61	0,00	0,00	0,00	2.209.166,92	9.633,31	135.210,51
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.231.100,62	0,00	0,00	0,00	2.241.056,27	9.955,65	138.375,97
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.186.811,91	0,00	0,00	0,00	2.197.372,48	10.560,57	140.900,25
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.230.453,21	0,00	0,00	0,00	2.239.626,19	9.172,98	133.160,52
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.231.793,83	0,00	0,00	0,00	2.241.187,81	9.393,98	134.661,96
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.232.485,64	0,00	0,00	0,00	2.241.987,45	9.501,81	135.408,53
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.235.857,78	0,00	0,00	0,00	2.245.908,26	10.050,48	139.131,87
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.272.369,74	0,00	0,00	0,00	3.287.649,15	15.279,41	207.397,78
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.244.404,52	0,00	0,00	0,00	2.253.350,74	8.946,22	132.094,90
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.236.063,45	0,00	0,00	0,00	2.245.467,42	9.403,97	134.855,76
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.238.433,93	0,00	0,00	0,00	2.248.049,73	9.615,80	136.344,90
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.235.623,77	0,00	0,00	0,00	2.245.281,90	9.658,13	136.526,76
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.278.760,60	0,00	0,00	0,00	3.294.330,34	15.569,74	209.509,03
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.252.054,22	0,00	0,00	0,00	2.261.048,61	8.994,39	132.648,24
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.247.057,71	0,00	0,00	0,00	2.256.103,63	9.045,92	132.829,19
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.239.195,45	0,00	0,00	0,00	2.248.706,37	9.510,92	135.654,68
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.241.073,10	0,00	0,00	0,00	2.250.755,68	9.682,58	136.850,63
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.241.756,40	0,00	0,00	0,00	2.251.495,81	9.739,41	137.245,60
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.526.657,88	0,00	0,00	0,00	3.542.425,38	15.767,50	43.662,55

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.238.914,70	0,00	0,00	0,00	2.248.997,76	10.083,06	139.424,80
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.280.271,42	0,00	0,00	0,00	3.295.910,11	15.638,69	210.028,39
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.265.184,24	0,00	0,00	0,00	2.274.392,40	9.208,16	134.452,92
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.255.693,78	0,00	0,00	0,00	2.264.900,48	9.206,70	134.127,41
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.257.830,09	0,00	0,00	0,00	2.267.135,81	9.305,72	134.853,95
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.248.466,95	0,00	0,00	0,00	2.258.188,60	9.721,65	137.316,58
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.249.103,25	0,00	0,00	0,00	2.258.890,60	9.787,35	137.781,07
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.246.438,97	0,00	0,00	0,00	2.256.304,47	9.865,50	138.212,76
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.100.041,41	0,00	0,00	0,00	2.110.058,26	10.016,85	134.473,81
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.279.318,14	0,00	0,00	0,00	3.295.007,43	15.689,29	210.299,01
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.094.378,44	0,00	0,00	0,00	3.110.072,86	15.694,42	204.352,42
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.276.169,68	0,00	0,00	0,00	2.285.403,50	9.233,82	134.955,81
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.273.376,62	0,00	0,00	0,00	2.282.672,79	9.296,17	135.274,78
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.268.871,43	0,00	0,00	0,00	2.278.204,58	9.333,15	135.367,76
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.262.840,57	0,00	0,00	0,00	2.272.210,72	9.370,15	135.427,15
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.252.325,85	0,00	0,00	0,00	2.262.101,87	9.776,02	137.787,59
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.251.352,67	0,00	0,00	0,00	2.261.240,90	9.888,23	138.496,16
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.250.097,42	0,00	0,00	0,00	2.260.068,10	9.970,68	139.012,28
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.242.997,09	0,00	0,00	0,00	2.253.113,17	10.116,08	139.758,72
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.474.013,05	0,00	0,00	0,00	8.514.399,16	40.386,11	542.352,88
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.147.742,27	0,00	0,00	0,00	3.162.904,16	15.161,89	202.549,03
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.100.582,08	0,00	0,00	0,00	2.110.741,21	10.159,13	135.432,61
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.450.819,31	0,00	0,00	0,00	11.506.459,67	55.640,36	740.021,24
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.809.608,50	0,00	0,00	0,00	6.843.716,69	34.108,19	446.869,82
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.672.225,63	0,00	0,00	0,00	5.701.183,78	28.958,15	375.825,84
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.215.373,35	0,00	0,00	0,00	5.242.065,97	26.692,62	247.629,79
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.111.049,08	0,00	0,00	0,00	3.127.271,04	16.221,96	208.391,46
					308.510.165,83	1.428.325,52	

**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	17.794.164,00	3.331.300,00	0,00	0,00	21.265.691,55	140.227,55	140.227,55
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.000.000,00	0,00	0,00	0,00	21.168.314,95	168.314,95	168.314,95
					42.434.006,50	308.542,50	

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	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.859.224,73
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	20.000.000,00	0,00	0,00	0,00	20.212.906,48	212.906,48	212.906,48
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	20.373.768,43	0,00	0,00	0,00	20.607.428,47	233.660,04	3.493.511,72
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	4.993.526,50	0,00	0,00	0,00	5.068.544,00	75.017,50	68.544,00
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	28.738.504,31	11.176.305,31	-12.127.000,00	0,00	28.098.781,63	310.972,01	2.108.794,18
					73.987.660,58	832.556,03	

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	5.048.419,57	0,00	0,00	0,00	5.075.380,16	26.960,59	75.380,16
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	5.053.197,27	0,00	0,00	0,00	5.080.038,14	26.840,87	80.038,14
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a	5.883.181,95	0,00	0,00	0,00	5.916.488,59	33.306,64	410.265,49
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	5.048.366,22	0,00	0,00	0,00	5.071.122,20	22.755,98	71.122,20
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	5.049.589,84	0,00	0,00	0,00	5.073.184,15	23.594,31	73.184,15
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.411.082,28	0,00	0,00	0,00	5.439.463,20	28.380,92	396.405,62
					31.655.676,44	161.839,31	

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	5.637,93	0,00	0,00	0,00	10.559,48	4.921,55	3.076,14
					10.559,48	4.921,55	

**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	3.308.689,39	0,00	0,00	0,00	3.346.221,53	37.532,14	241.601,00
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	2.138.092,46	0,00	-2.145.116,73	0,00	0,00	7.024,27	91.703,89
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	5.672.531,42	0,00	0,00	0,00	5.749.356,19	76.824,77	376.591,48
					9.095.577,72	121.381,18	

## 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	7.594.739,20	0,00	0,00	0,00	7.733.581,15	138.841,95	884.136,94
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.220.200,47	0,00	0,00	0,00	5.380.162,24	159.961,77	485.708,13
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	3.606.673,77	2.200.000,00	0,00	0,00	6.099.493,01	292.819,24	935.393,80
INDIE FIC FIA	3.771.253,52	0,00	0,00	0,00	3.912.625,92	141.372,40	706.159,10
META VALOR FI DE AÇÕES	2.222.745,00	0,00	0,00	0,00	2.322.824,28	100.079,28	50.691,94
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	21.637.540,40	0,00	0,00	0,00	22.380.423,09	742.882,69	2.007.809,25
OCCAM FIC FIA	30.527.457,29	0,00	0,00	0,00	31.398.975,95	871.518,66	2.202.398,42
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	4.248.855,13	0,00	0,00	0,00	4.600.945,00	352.089,87	505.745,97
TARPON GT 30 FIC FIA	8.422.509,63	0,00	0,00	0,00	8.920.020,57	497.510,94	2.172.988,80
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	6.813.812,02	0,00	0,00	0,00	6.984.910,16	171.098,14	541.678,37
					99.733.961,37	3.468.174,94	

## 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	14.926.800,30	0,00	0,00	0,00	15.840.318,98	913.518,68	3.806.695,60
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.873.053,55	0,00	0,00	0,00	1.975.788,07	102.734,52	426.146,95
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.413.749,26	0,00	0,00	0,00	2.473.468,76	59.719,50	-347.208,79
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.438.197,25	0,00	0,00	0,00	2.477.594,57	39.397,32	33.989,20
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.611.683,73	0,00	0,00	0,00	2.704.932,38	93.248,65	559.341,97

**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	5.098.836,32	0,00	0,00	0,00	5.191.218,46	92.382,14	234.181,11
					30.663.321,22	1.301.000,81	

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	18.307.679,04	0,00	0,00	0,00	18.590.753,69	283.074,65	1.553.515,03
					18.590.753,69	283.074,65	

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	30.218.740,31	0,00	0,00	0,00	31.329.441,56	1.110.701,25	6.226.391,96
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	7.475.845,02	0,00	0,00	0,00	7.447.584,17	-28.260,85	700.243,16
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	18.186.353,10	0,00	0,00	0,00	18.842.709,47	656.356,37	3.694.606,83
					57.619.735,20	1.738.796,77	

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	11.224.179,24	0,00	0,00	19.310,74	11.224.787,34	19.918,84	-475.608,22
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	15.928,08	0,00	0,00	0,00	198,95	-15.729,13	-15.076,23
					11.224.986,29	4.189,71	

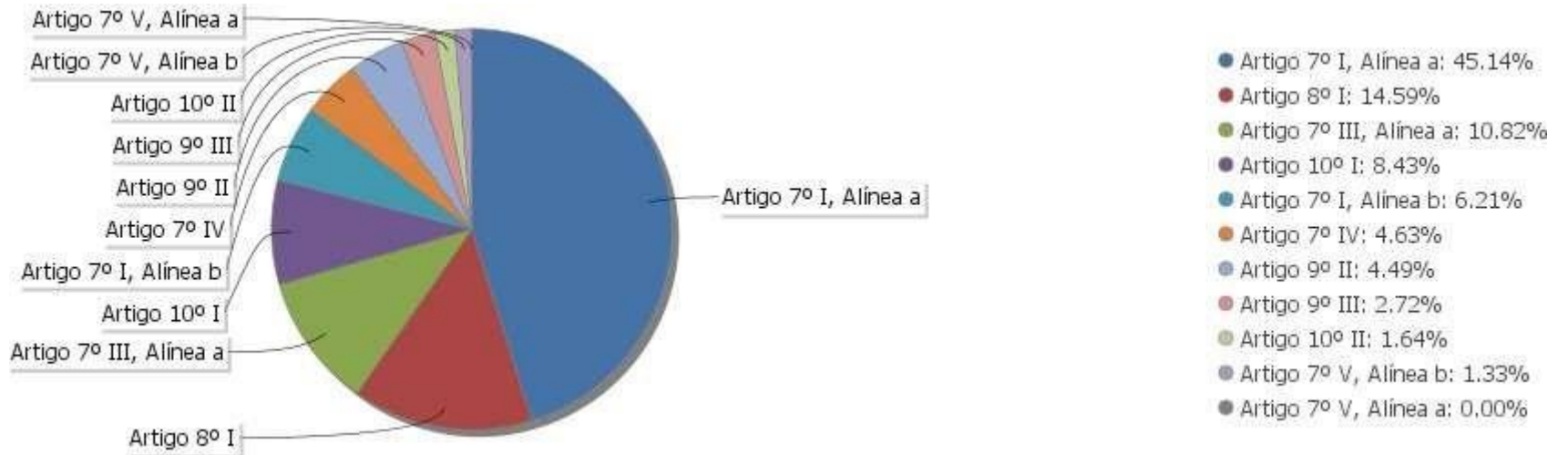
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

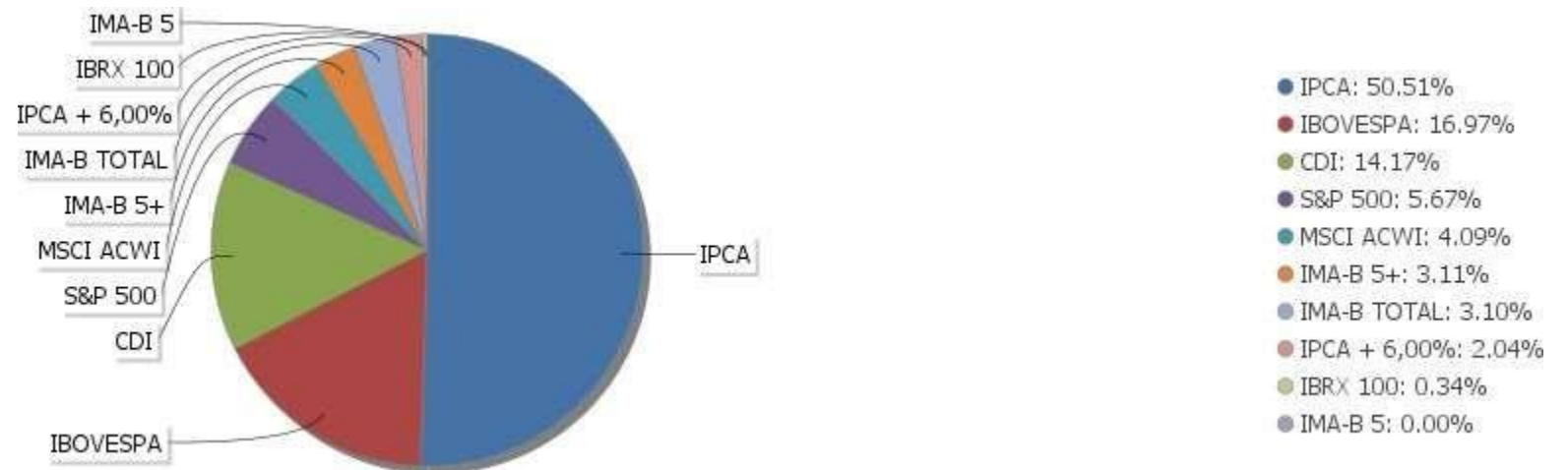
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	268.788.650,72	39,32	268.788.650,72	39,32	
de 31 dias a 365 dias	58.278.579,99	8,53	327.067.230,71	47,85	
acima de 365 dias	356.459.173,61	52,15	683.526.404,33	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



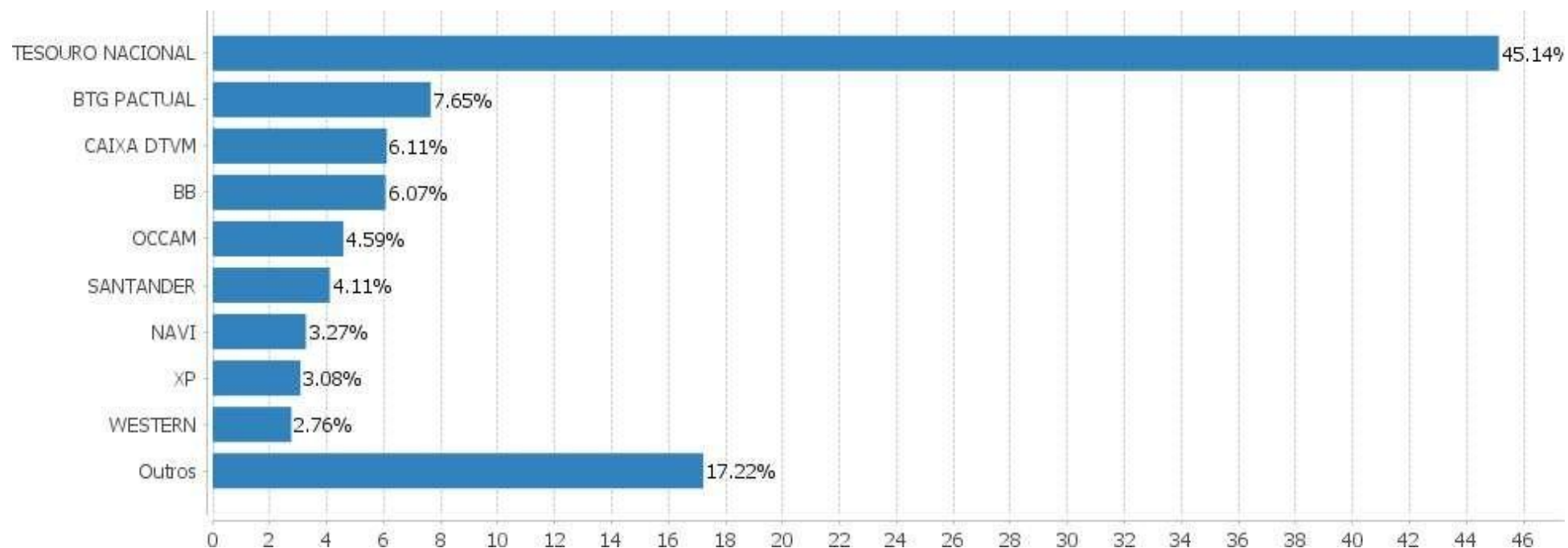
Alocação Por Estratégia





## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	1,43						9,04
IPCA + 5,11%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34	0,54						5,99
p.p. indexador	0,97	-1,68	-0,35	-0,12	1,19	1,99	0,89						3,05
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

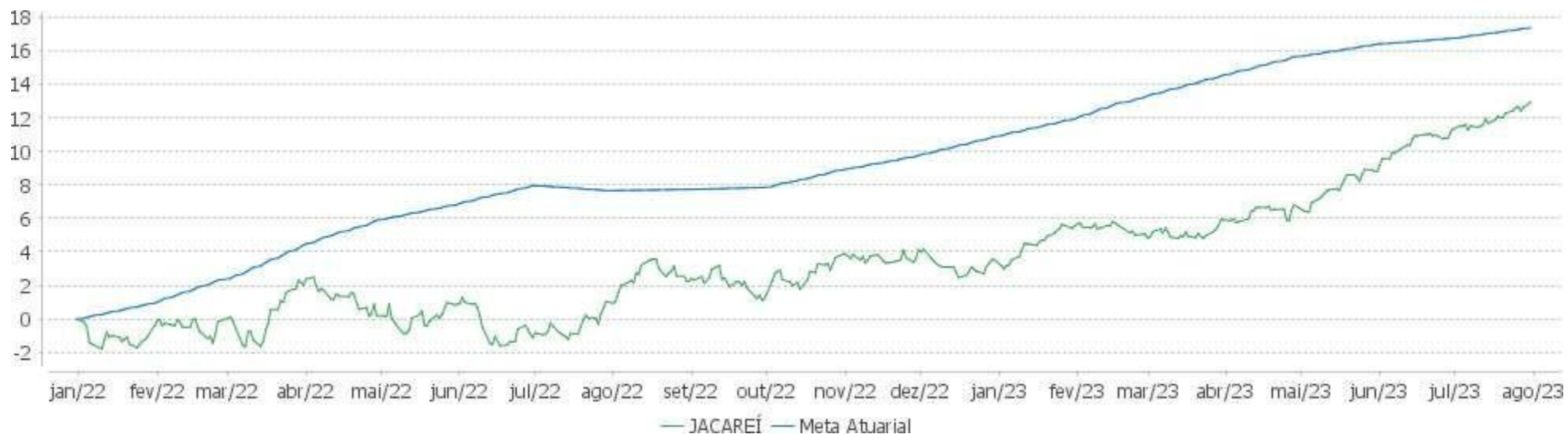
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

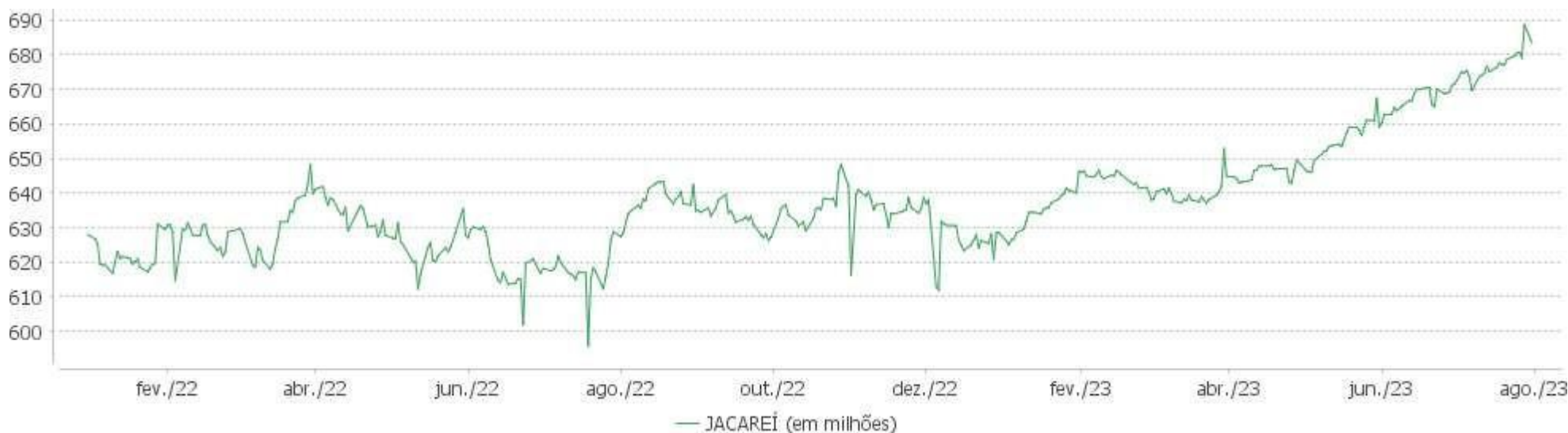
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	8	42,11	03 meses	5,72	1,55	4,17	2,88
Meses abaixo - Meta Atuarial	11	57,89	06 meses	6,98	4,97	2,00	3,15
			12 meses	11,77	9,16	2,60	3,93
			24 meses				
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	2,60	2022-10	Desde 31/12/2021	12,91	17,52	-4,60	4,85
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

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.	0,53 0,41	1,60 1,46					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	1,46 1,32					
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a Var. IPCA p.p.	0,53 0,41	1,51 1,36					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,52 0,40	7,86 4,87	2,86 2,59	6,93 4,48			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a Var. IPCA p.p.	0,45 0,33	1,42 1,28					
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,57 0,45	7,45 4,46	2,32 2,05	6,08 3,63			
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,35 126,34	7,01 91,74	3,97 120,09	6,60 102,34	13,28 97,76	25,15 103,69	32,18 117,99
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	1,25 0,28	5,43 -2,65	3,38 0,76	5,50 -1,10	9,72 -1,56	19,67 -2,80	27,87 -0,79
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	1,13 105,82	7,78 101,86	3,43 103,96	6,56 101,73	13,97 102,81	26,47 109,17	29,12 106,76
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,38	6,93 3,94	2,09 1,82	5,65 3,20	6,65 2,66	18,43 3,96	
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,79 3,80	2,03 1,76	5,53 3,08	6,51 2,52	18,21 3,75	
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,33	6,55 3,55	1,93 1,66	5,33 2,88	9,18 5,18	24,21 9,75	
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,30	6,34 3,35	1,84 1,57	5,16 2,71	8,81 4,82	23,49 9,03	
NTN-B 150533 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,34	3,69 0,69	-0,87 -1,14	2,49 0,03	3,35 -0,64		
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,77 3,77	2,02 1,75	5,52 3,06	9,57 5,58	25,11 10,65	
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,37	6,82 3,83	2,04 1,77	5,56 3,11	9,66 5,67	25,29 10,83	
NTN-B 150545 (5,915000%)	0,48	6,80	2,03	5,54	9,63	25,22	

**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.	0,36	3,81	1,76	3,09	5,63	10,76	
NTN-B 150850 (5,831200%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,75 3,76	2,01 1,74	5,50 3,05	9,54 5,55	25,07 10,60	
NTN-B 150826 (5,190000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,31	6,38 3,38	1,85 1,58	5,19 2,74	8,88 4,89	23,59 9,13	
NTN-B 150830 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,31	6,43 3,43	1,87 1,60	5,23 2,78	8,96 4,97	23,84 9,37	
NTN-B 150840 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,75 3,76	2,01 1,74	5,50 3,05	9,54 5,55	25,06 10,60	
NTN-B 150545 (4,970000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,29	6,25 3,26	1,80 1,53	5,08 2,63	8,65 4,66	23,40 8,93	
NTN-B 150840 (4,950000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,29	6,24 3,24	1,80 1,53	5,07 2,62	8,63 4,64	23,31 8,85	
NTN-B 150850 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,29	6,26 3,26	1,80 1,53	5,09 2,64	8,66 4,67	23,46 9,00	
NTN-B 150555 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,81 3,81	2,03 1,76	5,55 3,10	9,64 5,65	25,25 10,79	
NTN-B 150850 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,32	6,48 3,48	1,90 1,63	5,27 2,82	9,05 5,06	24,18 9,72	
NTN-B 150545 (5,922000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,80 3,81	2,03 1,76	5,55 3,09	9,63 5,64	25,23 10,77	
NTN-B 150840 (5,020000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,29	6,28 3,29	1,81 1,54	5,11 2,65	8,70 4,71	23,45 8,99	
NTN-B 150535 (4,910000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,28	6,22 3,22	1,79 1,52	5,05 2,60	8,59 4,60	23,16 8,69	
NTN-B 150555 (5,370000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,32	6,48 3,49	1,90 1,63	5,28 2,83	9,06 5,07	24,21 9,75	
NTN-B 150850 (4,940000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,29	6,23 3,24	1,79 1,52	5,07 2,62	8,62 4,63	23,38 8,92	
NTN-B 150840 (4,970000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,29	6,25 3,26	1,80 1,53	5,08 2,63	8,65 4,66	23,35 8,89	
NTN-B 150545 (6,280000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,39	7,01 4,02	2,12 1,85	5,72 3,27	6,75 2,75		
NTN-B 150826 (5,490000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,33	6,55 3,56	1,93 1,66	5,34 2,88	9,19 5,19	24,25 9,79	
NTN-B 150830 (5,460000%)	0,45	3,57	1,92	2,39	3,17		

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.	0,33	0,58	1,65	-0,06	-0,82		
NTN-B 150850 (6,261000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,39	7,00 4,01	2,12 1,85	5,71 3,26	9,98 5,99	25,87 11,41	
NTN-B 150555 (5,000000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,29	6,27 3,27	1,81 1,54	5,10 2,64	8,68 4,69	23,52 9,06	
NTN-B 150535 (5,320000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,32	6,45 3,46	1,89 1,62	5,25 2,80	9,01 5,02	24,00 9,53	
NTN-B 150535 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,34	3,69 0,69	-0,87 -1,14	2,49 0,04	3,36 -0,63		
NTN-B 150850 (5,010000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,29	6,27 3,28	1,81 1,54	5,10 2,65	8,69 4,70	23,52 9,05	
NTN-B 150545 (6,256000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,39	7,00 4,00	2,12 1,85	5,71 3,26	9,98 5,98	25,87 11,41	
NTN-B 150555 (6,261000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,39	7,00 4,01	2,12 1,85	5,71 3,26	9,98 5,99	25,87 11,40	
NTN-B 150555 (5,520000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,33	6,57 3,58	1,94 1,67	5,35 2,90	9,22 5,23	24,49 10,03	
NTN-B 150555 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,77 3,77	2,02 1,75	5,52 3,06	9,57 5,58	25,12 10,66	
NTN-B 150545 (5,380000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,32	6,49 3,50	1,90 1,63	5,28 2,83	9,07 5,08	24,19 9,73	
NTN-B 150826 (5,009000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,29	6,27 3,28	1,81 1,54	5,10 2,65	8,69 4,70	23,20 8,73	
NTN-B 150545 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	0,52 0,40	7,08 4,09	2,15 1,88	5,78 3,33	6,82 2,83	18,69 4,23	
NTN-B 150535 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,76 3,77	2,02 1,75	5,51 3,06	9,56 5,57	25,09 10,62	
NTN-B 150555 (5,831200%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,75 3,76	2,01 1,74	5,50 3,05	9,54 5,55	25,07 10,61	
NTN-B 150828 (4,850000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,28	6,18 3,19	1,77 1,50	5,02 2,57	8,53 4,53	22,90 8,44	
NTN-B 150555 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	0,52 0,40	7,08 4,09	2,15 1,88	5,78 3,33	6,80 2,81	18,62 4,15	
NTN-B 150545 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,75 3,76	2,01 1,74	5,50 3,05	9,54 5,55	25,06 10,59	
NTN-B 150828 (5,240000%)	0,43	6,41	1,87	5,21	8,93	23,74	

**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.	0,31	3,41	1,60	2,76	4,94	9,28	
NTN-B 150545 (5,340000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,32	6,47 3,47	1,89 1,62	5,26 2,81	9,03 5,04	24,11 9,65	
NTN-B 150850 (5,921000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,80 3,81	2,03 1,76	5,55 3,09	9,63 5,64	25,24 10,77	
NTN-B 150826 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,68 3,69	1,98 1,71	5,44 2,99	9,41 5,42	24,74 10,27	
NTN-B 150555 (6,268000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,39	7,00 4,01	2,12 1,85	5,71 3,26	6,72 2,73		
NTN-B 150535 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,28	6,19 3,19	1,77 1,50	5,03 2,58	8,54 4,55	23,06 8,59	
NTN-B 150828 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,31	6,43 3,43	1,87 1,60	5,23 2,78	8,96 4,97	23,80 9,34	
NTN-B 150555 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,38	6,93 3,94	2,09 1,82	5,65 3,20	9,86 5,86	21,98 7,51	
NTN-B 150535 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,31	6,44 3,44	1,88 1,61	5,24 2,79	8,98 4,99	23,93 9,47	
NTN-B 150830 (5,835000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,75 3,76	2,01 1,74	5,50 3,05	9,54 5,55	25,03 10,57	
NTN-B 150535 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,75 3,76	2,01 1,74	5,50 3,05	9,54 5,55	25,05 10,59	
NTN-B 150830 (5,300000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,31	6,44 3,45	1,88 1,61	5,24 2,79	8,99 5,00	23,90 9,44	
NTN-B 150555 (5,315000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,32	6,45 3,46	1,88 1,61	5,25 2,80	9,01 5,01	24,11 9,65	
NTN-B 150830 (5,500000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,33	6,56 3,56	1,93 1,66	5,34 2,89	9,20 5,21	24,32 9,86	
NTN-B 150545 (5,285000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,31	6,43 3,44	1,88 1,61	5,24 2,78	8,98 4,98	24,01 9,54	
NTN-B 150830 (5,178300%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,30	6,37 3,38	1,85 1,58	5,18 2,73	8,87 4,87	23,64 9,18	
NTN-B 150824 (5,450000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,33	6,53 3,54	1,92 1,65	5,32 2,86	9,15 5,15	24,14 9,67	
NTN-B 150545 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,29	6,29 3,29	1,81 1,54	5,11 2,66	8,71 4,72	23,51 9,05	
NTN-B 150545 (5,897000%)	0,48	6,79	2,03	5,53	9,61	21,64	



**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.	0,36	3,80	1,76	3,08	5,61	7,18	
NTN-B 150850 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	0,52 0,40	7,08 4,09	2,15 1,88	5,78 3,33	6,81 2,81	18,65 4,18	
NTN-B 150824 (5,912000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,80 3,80	2,03 1,76	5,54 3,09	9,62 5,63	25,18 10,71	
NTN-B 150850 (5,045000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,29	6,29 3,30	1,82 1,55	5,12 2,67	8,73 4,74	23,58 9,12	
NTN-B 150555 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,29	6,29 3,29	1,81 1,54	5,11 2,66	8,71 4,72	23,58 9,12	
NTN-B 150840 (5,274000%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,31	6,43 3,43	1,87 1,60	5,23 2,78	8,96 4,97	23,95 9,49	
NTN-B 150826 (5,130000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,30	6,34 3,35	1,84 1,57	5,16 2,71	8,82 4,82	23,46 9,00	
NTN-B 150840 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,32	6,48 3,48	1,90 1,63	5,27 2,82	9,05 5,06	24,12 9,66	
NTN-B 150840 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,76 3,77	2,02 1,75	5,51 3,06	9,56 5,57	25,10 10,63	
NTN-B 150850 (5,410000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,32	6,51 3,51	1,91 1,64	5,30 2,85	9,10 5,11	24,27 9,81	
NTN-B 150545 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,41 0,29	6,26 3,26	1,80 1,53	5,09 2,64	8,66 4,67	23,42 8,95	
NTN-B 150830 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,28	6,19 3,19	1,77 1,50	5,03 2,58	8,54 4,55	22,97 8,51	
NTN-B 150824 (5,345000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,32	6,47 3,47	1,89 1,62	5,26 2,81	9,04 5,05	23,90 9,44	
NTN-B 150840 (5,310000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,32	6,45 3,45	1,88 1,61	5,25 2,80	9,00 5,01	24,02 9,56	
NTN-B 150545 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,38	6,93 3,94	2,09 1,82	5,65 3,20	9,86 5,86	21,99 7,53	
NTN-B 150830 (4,900000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,28	6,21 3,22	1,78 1,51	5,05 2,60	8,58 4,59	23,05 8,59	
NTN-B 150850 (5,295500%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,31	6,44 3,45	1,88 1,61	5,24 2,79	8,99 4,99	24,06 9,59	
NTN-B 150535 (4,880000%) Var. IPCA p.p.	0,40 0,28	6,20 3,20	1,78 1,51	5,04 2,59	8,56 4,57	23,10 8,63	
NTN-B 150555 (5,420000%)	0,44	6,51	1,91	5,30	9,11	24,31	

## 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.	0,32	3,52	1,64	2,85	5,12	9,84	
NTN-B 150850 (5,510000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,33	6,56 3,57	1,93 1,66	5,35 2,89	9,21 5,22	24,46 10,00	
NTN-B 150555 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,79 3,80	2,03 1,76	5,53 3,08	9,61 5,61	21,66 7,19	
NTN-B 150850 (6,278000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,39	3,84 0,84	2,12 1,85	2,58 0,13	3,57 -0,42		
NTN-B 150840 (6,220000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,39	6,98 3,98	2,11 1,84	5,69 3,24	9,94 5,95	25,81 11,35	
NTN-B 150828 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,74 3,75	2,01 1,74	5,49 3,04	9,52 5,52	24,97 10,50	
NTN-B 150555 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,37	6,82 3,83	2,04 1,77	5,56 3,11	9,66 5,67	25,29 10,83	
NTN-B 150555 (5,060000%) Var. IPCA p.p.	0,42 0,30	6,30 3,31	1,82 1,55	5,13 2,67	8,74 4,75	23,63 9,17	
NTN-B 150525 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,74 3,75	2,01 1,74	5,49 3,04	9,52 5,52	24,95 10,49	
NTN-B 150535 (5,196100%) Var. IPCA p.p.	0,43 0,31	6,38 3,39	1,86 1,59	5,19 2,74	8,88 4,89	23,74 9,28	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,80 -0,01	12,14 -0,13	5,79 -0,04	12,17 -0,09	15,29 -0,16	18,72 -0,49	21,43 -0,79
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,69 -0,04	15,45 -0,29	8,30 -0,12	16,93 -0,29	18,90 -0,48	14,69 -0,85	14,67 -1,25
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III % do CDI	87,29 8.143,17	41,11 538,03	100,89 3.054,62	34,64 537,47	63,03 464,02	-42,86 -176,75	15.633,88 57.321,63
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,06 99,30	7,57 99,07	3,34 101,26	6,37 98,91	13,57 99,91	24,57 101,31	27,69 101,54
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,15 106,99	7,72 101,10	3,59 108,60	6,55 101,68	13,76 101,29	24,97 102,95	27,99 102,61
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	1,50 1,38	1,37 1,24					
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,13 105,87	7,58 99,21	3,51 106,42	6,46 100,28	13,70 100,83	25,13 103,65	28,67 105,12
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,06 -0,20	9,92 -1,20	21,12 4,35	5,03 -2,47	11,27 -6,93	-28,30 -28,42	-22,39 -40,88
TARPON GT 30 FIC FIA	5,91	32,21	32,12	29,17	43,47	42,26	104,40

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	2,64	21,08	15,35	21,67	25,27	42,14	85,91
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,51 -0,75	8,41 -2,72	21,72 4,95	4,87 -2,63	17,68 -0,52	2,54 2,42	92,26 73,77
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,43 0,17	8,33 -2,80	19,68 2,91	6,26 -1,24	14,78 -3,43	3,63 3,52	21,39 2,90
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,29 2,03	28,12 16,99	28,23 11,46	29,31 21,81	36,99 18,79	32,25 32,13	
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,29 5,02	12,35 1,22	21,54 4,77	3,71 -3,79	13,26 -4,94	-25,46 -25,57	4,22 -14,27
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,75 0,48	22,02 10,90	28,17 11,40	17,89 10,39	25,97 7,76	-26,78 -26,90	-13,11 -31,60
META VALOR FI DE AÇÕES Var. IBRX 100 p.p.	4,50 1,18	2,23 -7,90	15,80 -0,73	-2,54 -8,94	8,90 -7,49	-18,49 -15,89	-16,34 -33,93
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,85 -0,41	7,54 -3,58	13,79 -2,98	4,66 -2,84	13,25 -4,95	-2,23 -2,34	11,02 -7,47
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	1,83 -1,44	12,91 1,78	18,86 2,09	7,18 -0,33	11,34 -6,86	-20,35 -20,46	-3,46 -21,95
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	1,55 -1,72	9,12 -2,01	3,22 -13,55	6,40 -1,10	0,96 -17,25	-13,34 -13,45	16,53 -1,96
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	2,47 0,59	-12,31 -18,45	-4,55 -6,91	-14,40 -15,81	-13,89 -15,22	-32,60 -22,99	
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,81 -0,07	4,72 -1,42	1,78 -0,58	2,93 1,52	4,05 2,72	-10,02 -0,41	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	6,12 4,24	31,63 25,49	17,33 14,97	17,55 16,15	14,28 12,95	-14,93 -5,32	13,85 -2,91
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	5,48 3,60	27,50 21,36	23,64 21,28	14,47 13,06	5,88 4,55	-53,54 -43,93	
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	1,62 -0,27	1,39 -4,75	2,97 0,61	-1,04 -2,44	-12,64 -13,97	-38,16 -28,55	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	3,57 2,96	26,07 19,56	11,27 9,51	13,57 8,17	16,70 6,50	-28,42 -56,98	-9,76 -58,21
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-0,38 -1,83	10,38 1,77	3,75 -0,61	8,30 3,63			
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	3,61 336,67	24,39 319,23	12,14 367,57	16,81 260,78	20,66 152,10	21,96 90,54	64,50 236,49
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	3,68	24,80	12,37	17,32	26,28	28,16	75,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 p.p.	2,22	16,19	8,02	12,65	24,75	31,50	47,41
<b>KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME</b>	<b>0,18</b>	<b>-5,68</b>	<b>1,55</b>	<b>0,77</b>	<b>-6,79</b>	<b>13,33</b>	<b>31,89</b>
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,43	-12,18	-0,22	-4,64	-17,00	-15,22	-16,56
<b>PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP</b>	<b>-98,75</b>	<b>-98,70</b>	<b>-98,73</b>	<b>-98,71</b>	<b>-98,66</b>	<b>-97,06</b>	<b>-97,92</b>
% do CDI	-9.211,99	-1.291,82	-2.989,25	-1.531,64	-726,26	-400,23	-359,01
<b>JACAREÍ</b>	<b>1,43</b>	<b>9,04</b>	<b>5,72</b>	<b>6,98</b>	<b>11,77</b>		
Var. IPCA + 4,83% p.p.	0,89	3,05	4,17	2,00	2,48		
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## 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 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 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		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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**

**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	1,07	7,81	3,44	6,64	13,84	23,07	25,52	32,43	42,08
IRF-M 1+	0,82	12,33	6,44	11,52	18,36	19,55	15,56	29,44	53,47
IRF-M TOTAL	0,89	10,59	5,29	9,67	16,44	20,41	18,73	30,37	50,29
IMA-B 5	0,97	8,08	2,62	6,60	11,29	22,46	28,66	40,02	59,74
IMA-B 5+	0,73	15,74	8,42	17,22	19,37	15,53	15,93	24,98	73,16
IMA-B TOTAL	0,81	12,27	5,83	12,27	15,46	19,21	22,22	32,19	68,50
IMA-GERAL TOTAL	0,98	9,70	4,55	8,94	14,59	21,41	23,44	32,48	52,87
IDKA 2	0,98	7,84	2,26	6,31	10,55	21,73	28,89	40,07	57,72
IDKA 20	0,76	23,26	14,33	29,18	28,75	8,83	7,52	12,84	82,11
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49	19,77	53,93
IBRX 100	3,32	10,13	16,52	6,40	16,39	-2,60	17,59	20,13	57,20
IBRX 50	3,70	8,84	16,09	5,28	16,73	-1,88	19,92	20,20	51,93
SMALL CAP	3,12	16,80	26,65	13,48	17,47	-20,79	-4,84	2,63	47,75
Índice Consumo - ICON	2,22	10,79	25,68	7,60	0,74	-37,60	-35,76	-27,95	-0,79
Índice Dividendos - IDIV	2,84	12,41	12,81	6,16	18,72	18,15	34,93	39,66	97,67

### 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	1,45	8,61	4,36	4,67	1,54	-3,34	27,84	93,91	105,76

#### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,33	11,51	11,86	13,33	13,61	13,21	16,98	20,22	48,40

#### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,88	6,14	2,36	1,41	1,33	-9,61	16,75	69,84	71,77

#### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,12	2,99	0,27	2,45	3,99	14,46	24,76	27,64	31,75
INPC	-0,09	2,59	0,17	2,13	3,53	14,01	25,24	28,62	32,68
IGPM	-0,72	-5,15	-4,43	-5,35	-7,72	1,58	35,94	48,54	58,04
SELIC	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

#### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,45	5,34	1,27	4,43	8,14	23,77	40,25	49,25	60,17
IPCA + 5,00%	0,53	5,93	1,52	4,92	9,17	26,15	44,31	55,05	67,99
IPCA + 5,50%	0,57	6,22	1,64	5,16	9,69	27,35	46,37	58,02	72,01
IPCA + 5,89%	0,60	6,44	1,74	5,35	10,09	28,29	47,99	60,36	75,20
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45	61,03	76,11
INPC + 4,00%	0,24	4,94	1,17	4,10	7,65	23,27	40,79	50,39	61,30
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03	62,26	77,35



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%)	2.178.634,52	5,480000	2.168.373,24	5,773600	-10.261,28
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.064.691,44	5,810000	1.065.312,96	5,773600	621,52
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.255.065,69	5,680000	20.884.295,53	5,248700	629.229,84
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.208.670,58	4,860000	2.140.898,48	5,237600	-67.772,10
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.205.010,65	4,880000	2.140.898,48	5,237600	-64.112,17
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.204.107,50	4,910000	2.145.349,41	5,237600	-58.758,09
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.192.871,72	5,196100	2.185.407,80	5,237600	-7.463,92
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.193.758,64	5,290000	2.203.211,53	5,237600	9.452,89
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.192.791,36	5,320000	2.207.662,46	5,237600	14.871,10
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.516.804,20	5,670000	1.571.179,13	5,237600	54.374,93
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.047.354,78	5,837000	2.149.800,34	5,237600	102.445,56
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.204.130,53	5,855000	3.369.355,82	5,237600	165.225,29
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.221.058,79	4,970000	2.106.087,05	5,406400	-114.971,74
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.218.324,27	4,980000	2.106.087,05	5,406400	-112.237,22
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.214.125,09	5,030000	2.115.068,23	5,406400	-99.056,86
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.200.987,25	5,285000	2.168.955,32	5,406400	-32.031,93
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.199.970,39	5,340000	2.182.427,10	5,406400	-17.543,29
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.198.387,62	5,380000	2.191.408,28	5,406400	-6.979,34
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.170.230,69	5,831000	5.438.105,38	5,406400	267.874,69
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.135.944,18	5,860000	2.254.276,55	5,406400	118.332,37
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.054.675,70	5,897000	2.177.936,50	5,406400	123.260,80
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.277.878,62	5,915000	6.668.527,24	5,406400	390.648,62
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.048.671,86	5,922000	2.177.936,50	5,406400	129.264,64
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.604.299,90	6,140000	5.020.480,44	5,406400	416.180,54
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.628.853,94	6,256000	4.010.097,52	5,406400	381.243,58
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.055.579,02	6,280000	3.385.905,41	5,406400	330.326,39
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.082.590,12	6,400000	2.339.597,77	5,406400	257.007,65
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.226.133,28	5,000000	2.091.690,06	5,426800	-134.443,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.221.054,78	5,030000	2.096.227,35	5,426800	-124.827,43
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.216.002,17	5,060000	2.100.764,64	5,426800	-115.237,53
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.204.035,16	5,315000	2.168.823,97	5,426800	-35.211,19
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.204.899,08	5,370000	2.186.973,12	5,426800	-17.925,96
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.202.732,36	5,420000	2.200.584,99	5,426800	-2.147,37
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.193.870,82	5,520000	2.223.271,43	5,426800	29.400,61
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.383.161,52	5,831200	12.051.038,60	5,426800	667.877,08
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.134.389,40	5,860000	2.268.644,31	5,426800	134.254,92
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.126.163,79	5,897000	5.476.507,38	5,426800	350.343,59
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.051.319,55	5,927000	2.200.584,99	5,426800	149.265,44
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.738.235,51	5,950000	18.013.035,86	5,426800	1.274.800,35
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.203.102,49	6,140000	10.163.526,53	5,426800	960.424,04
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.286.672,67	6,261000	9.301.441,69	5,426800	1.014.769,02
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.127.951,82	6,268000	8.008.314,43	5,426800	880.362,61
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.210.386,15	6,400000	5.957.459,97	5,426800	747.073,82
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.209.166,92	5,345000	2.177.532,68	6,880000	-31.634,24
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.241.056,27	5,450000	2.211.162,52	6,880000	-29.893,75
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.197.372,48	5,912000	2.177.532,68	6,880000	-19.839,80
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.239.626,19	5,009000	2.227.086,16	5,222800	-12.540,03
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.241.187,81	5,130000	2.235.735,03	5,222800	-5.452,78
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.241.987,45	5,190000	2.240.059,47	5,222800	-1.927,98
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.245.908,26	5,490000	2.261.681,67	5,222800	15.773,41
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.287.649,15	5,710000	3.329.818,14	5,222800	42.168,99
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.253.350,74	4,850000	2.228.660,26	5,117200	-24.690,48
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.245.467,42	5,125600	2.246.243,37	5,117200	775,95
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.248.049,73	5,240000	2.259.430,71	5,117200	11.380,98
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.245.281,90	5,270000	2.259.430,71	5,117200	14.148,81
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.294.330,34	5,810000	3.389.146,07	5,117200	94.815,73
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.261.048,61	4,860000	2.234.516,87	5,076000	-26.531,74
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.256.103,63	4,900000	2.234.516,87	5,076000	-21.586,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.248.706,37	5,178300	2.261.277,55	5,076000	12.571,18
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.250.755,68	5,270000	2.274.657,89	5,076000	23.902,21
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.251.495,81	5,300000	2.279.118,01	5,076000	27.622,20
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.542.425,38	5,460000	3.617.152,06	5,076000	74.726,68
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.248.997,76	5,500000	2.301.418,57	5,076000	52.420,81
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.295.910,11	5,835000	3.434.287,41	5,076000	138.377,30
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.274.392,40	4,950000	2.183.247,60	5,342400	-91.144,80
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.264.900,48	4,970000	2.178.708,63	5,342400	-86.191,85
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.267.135,81	5,020000	2.192.325,56	5,342400	-74.810,25
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.258.188,60	5,274000	2.242.254,30	5,342400	-15.934,30
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.258.890,60	5,310000	2.251.332,25	5,342400	-7.558,35
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.256.304,47	5,360000	2.260.410,20	5,342400	4.105,73
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.110.058,26	5,837000	2.219.559,41	5,342400	109.501,15
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.295.007,43	5,855000	3.472.316,87	5,342400	177.309,44
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.110.072,86	6,220000	3.399.693,25	5,342400	289.620,39
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.285.403,50	4,940000	2.136.385,80	5,442100	-149.017,70
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.282.672,79	4,980000	2.145.515,65	5,442100	-137.157,14
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.278.204,58	5,010000	2.150.080,58	5,442100	-128.124,00
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.272.210,72	5,045000	2.154.645,51	5,442100	-117.565,21
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.262.101,87	5,295500	2.218.554,48	5,442100	-43.547,39
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.261.240,90	5,360000	2.236.814,19	5,442100	-24.426,71
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.260.068,10	5,410000	2.250.508,97	5,442100	-9.559,13
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.253.113,17	5,510000	2.273.333,61	5,442100	20.220,44
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.514.399,16	5,831200	8.956.386,62	5,442100	441.987,46
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.162.904,16	5,897000	3.355.221,29	5,442100	192.317,13
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.110.741,21	5,921000	2.245.944,04	5,442100	135.202,83
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.506.459,67	5,950000	12.288.783,27	5,442100	782.323,60
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.843.716,69	6,140000	7.486.480,15	5,442100	642.763,46
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.701.183,78	6,261000	6.331.553,64	5,442100	630.369,86
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.242.065,97	6,278000	5.833.976,60	5,442100	591.910,63

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.127.271,04	6,400000	3.533.253,44	5,442100	405.982,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
204	03/07/2023	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	3.331.300,00	0,00	846.527,07258600	3,9352551240
205	03/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	983.000,00	4.169,75639394	235,7451868000
219	03/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,48373631	235,7451868000
220	06/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	16.000,00	67,76166987	236,1216899000
206	07/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.912.594,14	8.095,87028421	236,2431799000
207	07/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	299.105,86	1.266,09310003	236,2431799000
208	07/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	157.300,00	665,83932737	236,2431799000
209	07/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	893.000,00	3.780,00330159	236,2431799000
210	07/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	169.000,00	0,00	715,36456659	236,2431799000
221	07/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	41.000,00	173,54998361	236,2431799000
222	07/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,23292643	236,2431799000
239	07/07/2023	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	0,00	2.145.116,73	787.023,40208731	2,7256073000
211	10/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	199.477,84	0,00	843,94325971	236,3640419000
212	10/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	2.145.116,73	0,00	9.075,47828661	236,3640419000
240	10/07/2023	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	2.200.000,00	0,00	375.010,44723707	5,8665032300
213	12/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	19.310,74	0,00	81,61131620	236,6184115000
223	12/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,22621382	236,6184115000
224	13/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	33.000,00	139,39312739	236,7405095000
225	13/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	13.000,00	54,91244412	236,7405095000
226	13/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,22403416	236,7405095000
214	14/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	9.000,00	37,99610331	236,8663946000
227	14/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	19.000,00	80,21399588	236,8663946000
228	19/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,43014248	237,2439144000
229	19/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,43014248	237,2439144000
230	20/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	17.000,00	71,61773387	237,3713755000
231	24/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	12,62407830	237,6411116000
215	25/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	77.629,85	326,49862195	237,7647095000
216	25/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	10.370,15	43,61517747	237,7647095000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
232	25/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	129.000,00	542,55318323	237,7647095000
233	26/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,40728572	237,8889058000
234	27/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	11.971,01	50,29421385	238,0196266000
235	27/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	36.242,77	152,26798948	238,0196266000
236	27/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	44.786,22	188,16187824	238,0196266000
217	28/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	8.275.000,00	0,00	34.746,05077867	238,1565621000
237	28/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	35.000,00	146,96214831	238,1565621000
218	31/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	7.375.000,00	30.949,28362002	238,2930762000
238	31/07/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	368.400,00	0,00	1.545,99540144	238,2930762000
<b>Total</b>			<b>16.707.605,31</b>	<b>14.272.116,73</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 10.662.343,81

Value-At-Risk: 1,56%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
JACAREÍ		1,56	1,56			683.526.404,33	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,21%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,480000%)		0,11	-0,00	0,09			2.178.634,52	0,32
NTN-B 150525 (5,810000%)		0,11	-0,00	0,09			1.064.691,44	0,16
NTN-B 150533 (5,680000%)		0,24	-0,00	0,25			20.255.065,69	2,96
NTN-B 150535 (4,860000%)		0,11	-0,00	0,09			2.208.670,58	0,32
NTN-B 150535 (4,880000%)		0,11	-0,00	0,09			2.205.010,65	0,32
NTN-B 150535 (4,910000%)		0,11	-0,00	0,09			2.204.107,50	0,32
NTN-B 150535 (5,196100%)		0,11	-0,00	0,09			2.192.871,72	0,32
NTN-B 150535 (5,290000%)		0,11	-0,00	0,09			2.193.758,64	0,32
NTN-B 150535 (5,320000%)		0,11	-0,00	0,09			2.192.791,36	0,32
NTN-B 150535 (5,670000%)		0,24	-0,00	0,25			1.516.804,20	0,22
NTN-B 150535 (5,837000%)		0,11	-0,00	0,09			2.047.354,78	0,30
NTN-B 150535 (5,855000%)		0,11	-0,00	0,09			3.204.130,53	0,47
NTN-B 150545 (4,970000%)		0,11	-0,00	0,09			2.221.058,79	0,32
NTN-B 150545 (4,980000%)		0,11	-0,00	0,09			2.218.324,27	0,32
NTN-B 150545 (5,030000%)		0,11	-0,00	0,09			2.214.125,09	0,32
NTN-B 150545 (5,285000%)		0,11	-0,00	0,09			2.200.987,25	0,32
NTN-B 150545 (5,340000%)		0,11	-0,00	0,09			2.199.970,39	0,32
NTN-B 150545 (5,380000%)		0,11	-0,00	0,09			2.198.387,62	0,32
NTN-B 150545 (5,831000%)		0,11	-0,00	0,09			5.170.230,69	0,76
NTN-B 150545 (5,860000%)		0,11	-0,00	0,09			2.135.944,18	0,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (5,897000%)		0,11	-0,00	0,09			2.054.675,70	0,30
NTN-B 150545 (5,915000%)		0,11	-0,00	0,09			6.277.878,62	0,92
NTN-B 150545 (5,922000%)		0,11	-0,00	0,09			2.048.671,86	0,30
NTN-B 150545 (6,140000%)		0,11	-0,00	0,09			4.604.299,90	0,67
NTN-B 150545 (6,256000%)		0,11	-0,00	0,09			3.628.853,94	0,53
NTN-B 150545 (6,280000%)		0,11	-0,00	0,09			3.055.579,02	0,45
NTN-B 150545 (6,400000%)		0,11	-0,00	0,09			2.082.590,12	0,30
NTN-B 150555 (5,000000%)		0,11	-0,00	0,09			2.226.133,28	0,33
NTN-B 150555 (5,030000%)		0,11	-0,00	0,09			2.221.054,78	0,32
NTN-B 150555 (5,060000%)		0,11	-0,00	0,09			2.216.002,17	0,32
NTN-B 150555 (5,315000%)		0,11	-0,00	0,09			2.204.035,16	0,32
NTN-B 150555 (5,370000%)		0,11	-0,00	0,09			2.204.899,08	0,32
NTN-B 150555 (5,420000%)		0,11	-0,00	0,09			2.202.732,36	0,32
NTN-B 150555 (5,520000%)		0,11	-0,00	0,09			2.193.870,82	0,32
NTN-B 150555 (5,831200%)		0,11	-0,00	0,09			11.383.161,52	1,67
NTN-B 150555 (5,860000%)		0,11	-0,00	0,09			2.134.389,40	0,31
NTN-B 150555 (5,897000%)		0,11	-0,00	0,09			5.126.163,79	0,75
NTN-B 150555 (5,927000%)		0,11	-0,00	0,09			2.051.319,55	0,30
NTN-B 150555 (5,950000%)		0,11	-0,00	0,09			16.738.235,51	2,45
NTN-B 150555 (6,140000%)		0,11	-0,00	0,09			9.203.102,49	1,35
NTN-B 150555 (6,261000%)		0,11	-0,00	0,09			8.286.672,67	1,21
NTN-B 150555 (6,268000%)		0,11	-0,00	0,09			7.127.951,82	1,04
NTN-B 150555 (6,400000%)		0,11	-0,00	0,09			5.210.386,15	0,76
NTN-B 150824 (5,345000%)		0,11	-0,00	0,09			2.209.166,92	0,32
NTN-B 150824 (5,450000%)		0,11	-0,00	0,09			2.241.056,27	0,33
NTN-B 150824 (5,912000%)		0,11	-0,00	0,09			2.197.372,48	0,32
NTN-B 150826 (5,009000%)		0,11	-0,00	0,09			2.239.626,19	0,33
NTN-B 150826 (5,130000%)		0,11	-0,00	0,09			2.241.187,81	0,33
NTN-B 150826 (5,190000%)		0,11	-0,00	0,09			2.241.987,45	0,33
NTN-B 150826 (5,490000%)		0,11	-0,00	0,09			2.245.908,26	0,33



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,710000%)		0,11	-0,00	0,09			3.287.649,15	0,48
NTN-B 150828 (4,850000%)		0,11	-0,00	0,09			2.253.350,74	0,33
NTN-B 150828 (5,125600%)		0,11	-0,00	0,09			2.245.467,42	0,33
NTN-B 150828 (5,240000%)		0,11	-0,00	0,09			2.248.049,73	0,33
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,11	-0,00	0,09			2.245.281,90	0,33
NTN-B 150828 (5,810000%)		0,11	-0,00	0,09			3.294.330,34	0,48
NTN-B 150830 (4,860000%)		0,11	-0,00	0,09			2.261.048,61	0,33
NTN-B 150830 (4,900000%)		0,11	-0,00	0,09			2.256.103,63	0,33
NTN-B 150830 (5,178300%)		0,11	-0,00	0,09			2.248.706,37	0,33
NTN-B 150830 (5,270000%)		0,11	-0,00	0,09			2.250.755,68	0,33
NTN-B 150830 (5,300000%)		0,11	-0,00	0,09			2.251.495,81	0,33
NTN-B 150830 (5,460000%)		0,11	-0,00	0,09			3.542.425,38	0,52
NTN-B 150830 (5,500000%)		0,11	-0,00	0,09			2.248.997,76	0,33
NTN-B 150830 (5,835000%)		0,11	-0,00	0,09			3.295.910,11	0,48
NTN-B 150840 (4,950000%)		0,11	-0,00	0,09			2.274.392,40	0,33
NTN-B 150840 (4,970000%)		0,11	-0,00	0,09			2.264.900,48	0,33
NTN-B 150840 (5,020000%)		0,11	-0,00	0,09			2.267.135,81	0,33
NTN-B 150840 (5,274000%)		0,11	-0,00	0,09			2.258.188,60	0,33
NTN-B 150840 (5,310000%)		0,11	-0,00	0,09			2.258.890,60	0,33
NTN-B 150840 (5,360000%)		0,11	-0,00	0,09			2.256.304,47	0,33
NTN-B 150840 (5,837000%)		0,11	-0,00	0,09			2.110.058,26	0,31
NTN-B 150840 (5,855000%)		0,11	-0,00	0,09			3.295.007,43	0,48
NTN-B 150840 (6,220000%)		0,11	-0,00	0,09			3.110.072,86	0,46
NTN-B 150850 (4,940000%)		0,11	-0,00	0,09			2.285.403,50	0,33
NTN-B 150850 (4,980000%)		0,11	-0,00	0,09			2.282.672,79	0,33
NTN-B 150850 (5,010000%)		0,11	-0,00	0,09			2.278.204,58	0,33
NTN-B 150850 (5,045000%)		0,11	-0,00	0,09			2.272.210,72	0,33
NTN-B 150850 (5,295500%)		0,11	-0,00	0,09			2.262.101,87	0,33
NTN-B 150850 (5,360000%)		0,11	-0,00	0,09			2.261.240,90	0,33
NTN-B 150850 (5,410000%)		0,11	-0,00	0,09			2.260.068,10	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,510000%)		0,11	-0,00	0,09			2.253.113,17	0,33
NTN-B 150850 (5,831200%)		0,11	-0,00	0,09			8.514.399,16	1,25
NTN-B 150850 (5,897000%)		0,11	-0,00	0,09			3.162.904,16	0,46
NTN-B 150850 (5,921000%)		0,11	-0,00	0,09			2.110.741,21	0,31
NTN-B 150850 (5,950000%)		0,11	-0,00	0,09			11.506.459,67	1,68
NTN-B 150850 (6,140000%)		0,11	-0,00	0,09			6.843.716,69	1,00
NTN-B 150850 (6,261000%)		0,11	-0,00	0,09			5.701.183,78	0,83
NTN-B 150850 (6,278000%)		0,11	-0,00	0,09			5.242.065,97	0,77
NTN-B 150850 (6,400000%)		0,11	-0,00	0,09			3.127.271,04	0,46
<b>Sub-total</b>	0,07	0,11	-0,01		-8,90	0,47	308.510.165,83	45,14

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,53	0,01	0,14			21.168.314,95	3,10
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,48	0,02	0,06			21.265.691,55	3,11
<b>Sub-total</b>	4,03	2,00	0,04		-0,08	0,75	42.434.006,50	6,21

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF		1,84	-0,00	1,83			5.068.544,00	0,74
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			20.212.906,48	2,96
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			20.607.428,47	3,01
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,03	0,00	0,03			28.098.781,63	4,11
<b>Sub-total</b>	0,17	0,13	-0,00		0,42	1,14	73.987.660,58	10,82

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a		0,14	-0,00	0,16			5.080.038,14	0,74
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a		0,17	-0,00	0,19			5.073.184,15	0,74
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a		0,13	-0,00	0,16			5.075.380,16	0,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a		0,15	0,00	0,16			5.439.463,20	0,80
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a		0,17	-0,00	0,19			5.071.122,20	0,74
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a		0,13	-0,00	0,11			5.916.488,59	0,87
<b>Sub-total</b>	0,13	0,12	-0,00		-4,29	0,51	31.655.676,44	4,63

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III		2,39	0,00	2,39			10.559,48	0,00
<b>Sub-total</b>	217,37	2,39	0,00		0,40	87,29	10.559,48	0,00

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV		0,02	0,00	0,02			3.346.221,53	0,49
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,10	0,00	0,10			5.749.356,19	0,84
<b>Sub-total</b>	0,16	0,07	0,00		1,33	1,28	9.095.577,72	1,33

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,27%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA		13,26	0,07	7,65			4.600.945,00	0,67
META VALOR FI DE AÇÕES		10,05	0,03	3,77			2.322.824,28	0,34
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		9,46	0,09	4,66			7.733.581,15	1,13
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		9,17	0,06	4,05			5.380.162,24	0,79
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		8,62	0,22	3,27			22.380.423,09	3,27
OCCAM FIC FIA		8,28	0,32	2,05			31.398.975,95	4,59
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		9,23	0,06	5,68			6.099.493,01	0,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INDIE FIC FIA		9,36	0,04	4,76			3.912.625,92	0,57
TARPON GT 30 FIC FIA		8,79	0,07	7,24			8.920.020,57	1,31
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA		10,99	0,07	8,69			6.984.910,16	1,02
<b>Sub-total</b>	16,25	8,27	1,04		0,16	3,62	99.733.961,37	14,59

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,57%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO		8,44	0,02	10,91			7.447.584,17	1,09
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		6,18	0,12	6,18			18.842.709,47	2,76
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		6,17	0,20	5,22			31.329.441,56	4,58
<b>Sub-total</b>	6,79	5,46	0,33		0,30	3,11	57.619.735,20	8,43

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME		0,01	0,00	0,09			11.224.787,34	1,64
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		19,95	-0,00	19,95			198,95	0,00
<b>Sub-total</b>	0,80	0,01	0,00		-1,29	0,04	11.224.986,29	1,64

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,10%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		9,39	0,14	7,46			15.840.318,98	2,32
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		12,93	0,01	11,88			1.975.788,07	0,29
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		7,51	-0,00	7,28			2.473.468,76	0,36
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,90	-0,01	8,99			2.477.594,57	0,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,41	-0,00	9,42			2.704.932,38	0,40
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		7,99	-0,01	7,96			5.191.218,46	0,76
<b>Sub-total</b>	11,53	6,36	0,13		0,29	4,43	30.663.321,22	4,49

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		7,27	0,03	12,54			18.590.753,69	2,72
<b>Sub-total</b>	10,37	7,27	0,03		0,05	1,55	18.590.753,69	2,72

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Relatório de Cenário Macroeconômico

No mercado internacional, julho foi um mês relativamente calmo, com oscilações moderadas dos juros globais, acrescido do aumento da expectativa sobre a probabilidade de um “pouso suave” das economias, em virtude de uma melhora no cenário inflacionário. Ainda assim, os principais bancos centrais voltaram a elevar os juros, em linha com o esperado. Nos EUA, o Fed elevou os juros em 0,25%, mas apesar do aperto monetário, os dados de atividade econômica demonstram resiliência, com expansão do PIB no segundo trimestre e um mercado de trabalho ainda aquecido. Já o núcleo da inflação ao consumidor (CPI) encontra-se em níveis ainda pressionados, entretanto a inflação divulgada foi mais baixa do que o consenso do mercado, com bom desempenho das medidas de núcleo. Na Zona do Euro, banco central europeu subiu os juros em 0,25%, em resposta a uma inflação ainda pressionada. Assim como nos EUA, ainda há o movimento de elevação do PIB, entretanto a atividade já mostra certa acomodação, com um fraco desempenho na Alemanha. Na economia chinesa, os dados de atividade continuaram a mostrar nível de atividade abaixo das expectativas, enquanto a economia avança de forma moderada e as pressões deflacionárias se intensificaram. Desta forma, o governo vem adotando medidas de estímulo e maior apoio ao setor privado. Vale destacar que apesar de uma certa recuperação dos preços das commodities neste mês, a leitura é de que a atividade econômica global vem desacelerando, o que dessa forma dá suporte a expectativa do fim do ciclo de alta dos juros nas economias desenvolvidas e o início do ciclo de redução dos juros nas economias emergentes. Assim, no mês de julho de 2023, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +3,55% e +3,11%, 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 +10,88% e +11,11%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +1,88% e +1,45%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +1,33% e +1,54% nos últimos 12 meses.

No Brasil, os juros oscilaram com dados de inflação mais benignos, que levaram ao mercado a ajustar apostas sobre o ritmo esperado de queda dos juros. Além disso, houve a aprovação da Reforma Tributária, na Câmara, e a alteração da nota de risco do Brasil pela Fitch Ratings. O projeto de Reforma Tributária, um assunto politicamente complicado e que já vinha sendo discutido há anos, foi aprovado pela Câmara em julho. Sendo este um importante passo para a melhora fiscal do país. Entretanto, é um tema a ser observado nos próximos meses, uma vez que ainda há a necessidade de ser aprovado no Senado, onde pode sofrer modificações. Alinhado à perspectiva de uma melhora no cenário fiscal, a Fitch Ratings decidiu elevar a nota de risco soberano do Brasil de BB- para BB. Vale destacar que o mercado brasileiro de juros, como geralmente acontece, já havia precificado essa melhora da nota do Brasil, com o forte rally dos últimos 3 meses, ainda que este tenha sido um movimento comum a todos os emergentes. A inflação continua evoluindo de forma favorável, com destaque para a continuidade da desaceleração das medidas de núcleo. No entanto, ainda é necessário observar o núcleo do grupo de serviços que apresentam níveis elevados quando observados nos últimos doze meses. Já no começo de agosto, em acordo com as expectativas do mercado, o Copom iniciou o ciclo de redução dos juros com um corte de 0,50% da taxa Selic para 13,25%. A expectativa no mercado estava dividida entre um corte de 0,25% e 0,50%. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo a direção dos índices globais. Apresentando um retorno positivo de +3,27% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +11,13% e de +18,20% nos últimos 12 meses.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Agenda realizada

04 de julho:

11h00: Reunião com a gestora 4UM INVESTIMENTOS através de seu representante Dario Pedro via plataforma online “Teams”. O objetivo da reunião foi a apresentação institucional da gestora, visão geral, apresentação de rating e dos fundos de renda fixa e ações elegíveis para aplicações de RPPS. Participou da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos do IPMJ.

06 de julho:

14h30: Reunião com os representantes da ITAÚ ASSET MANAGEMENT, Chrystie Lombardi e Cleber Gobbi na sala de reuniões do IPMJ. O objetivo da reunião foi a apresentação do cenário macroeconômico, mercados e produtos em destaque da gestora. Participaram da reunião, Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos e Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos do IPMJ.

12 de julho:

10h00: Reunião em parceria com a HMC CAPITAL na cidade de São Paulo com seu representante Vinicius Lima. O objetivo da reunião foi a apresentação da estrutura da gestora e dos produtos disponíveis aos RPPS como os fundos Internacionais: Gestores de Crédito, Multimercado e Ações e Fundos Locais: Gestor de Renda Variável I Vinland e Fundos de Private Equity I Gestora Invest Tech. Participaram da reunião Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e representantes do Comitê de Investimentos da cidade de São José dos Campos - IPSM

13 de julho:

14h30: Tricentésima octogésima oitava (388ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros (CAIF) do Instituto de Previdência do Município de Jacareí (IPMJ), ocorrida em 13 de julho de 2023, 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 Victor Adriano Vieira Silva. Ausências justificadas de José Ricardo Vinhas e Rafaela Carvalho dos Santos. Participou da reunião a estagiária Julia Victoria Jesus Simões. Pautas da reunião: 1) Análise do relatório de investimentos de junho de 2023; 2) Análise da carteira fechada de junho de 2023; 3) Reunião com a XP Investimentos e a Gestora de fundos quantitativos Kadima Asset Management; 4) Assuntos diversos.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

26 de julho:

9h00: Tricentésima octogésima nona (389ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, ocorrida em 26 de julho de 2023, tendo início às 9h30, 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 Victor Adriano Vieira Silva. Ausências justificadas de José Ricardo Vinhas e Rafaela Carvalho dos Santos. Pautas da reunião: 1) Análise parcial da carteira até 24/07/2023; 2) Apresentação do Relatório Semestral de Diligência de Verificação de Lastros; 3) Credenciamentos; 4) Assuntos Diversos.

26 de julho:

15h00: Reunião com os representantes da BRAM ASSET MANAGEMENT, Carol, Paulo, Danilo e Lúcio na sala de reuniões do IPMJ. O objetivo da reunião foi a apresentação do cenário econômico, fundos de renda fixa e ações. 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

## Acompanhamento fundos estressados

**I. FIDC MULSTISETORIAL MASTER III**

Em julho de 2023, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um prejuízo de R\$ 449.600,60 (quatrocentos e quarenta e nove mil e seiscentos reais e sessenta centavos negativos) e um rendimento negativo acumulado, R\$ 1.398.776,25 (um milhão e trezentos e noventa e oito mil e setecentos e setenta 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 julho de 2023 é de R\$ 10.559,48 (dez mil e quinhentos e cinquenta e nove reais e quarenta e oito centavos).

**II. PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP**

O Fundo PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP em julho 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\$ 2.823.164,19 (dois milhões e oitocentos e vinte e três mil e cento e sessenta e quatro reais e dezenove centavos negativos). O saldo em 31 de julho de 2023 foi de R\$ 198,95 (cento e noventa e oito reais e noventa e cinco centavos), com um rendimento negativo mensal de R\$ -15.729,13 (quinze mil e setecentos e vinte e nove reais e treze centavos negativos).

No dia 21/07/2023 foi divulgado pela gestora Pátria Investimentos LTDA um comunicado de Conclusão de Desinvestimento do fundo Pátria Special Opportunities I. O documento objetivou comunicar aos cotistas a conclusão do desinvestimento dos 4 shopping centers remanescentes do portfólio (Taubaté - SP, Lages - SC, Varginha - MG e Bragança Paulista - SP), bem como da holding Portfólio Centro-Sul ("Shoppings" e "Holding", respectivamente). Em 19 de julho de 2023, os fundos acionistas da Holding, incluindo o Fundo, alienaram suas respectivas participações na Holding. A transação foi realizada na modalidade "porteira fechada", com a transferência de todos os ativos, passivos e obrigações da Holding e de seus Shoppings, concluindo o desinvestimento da totalidade dos ativos da tese de investimento de shopping centers. Informações e os próximos passos para liquidação do Fundo serão detalhados em breve. Em 24/07/2023 foi divulgado um Fato Relevante em cumprimento ao Art. 53 da Instrução CVM n. 578/16, onde comunicou aos cotistas do Fundo e ao mercado que o Administrador ajustou, em 19 de julho de 2023, o patrimônio líquido do Fundo, causando uma variação no valor de cota de 3,93180807 para 0,09399439. De acordo com a gestora, o ajuste refletiu o desinvestimento integral da Portfólio Centro Sul S.A., companhia anteriormente investida pelo Fundo. O CAIF segue acompanhando os desdobramentos do comunicado e solicitou ao Gestor de Recursos uma reunião com os representantes da gestora Pátria Investimentos LTDA.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Fundos Estruturados

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

No dia 07/07/2023 o administrador do fundo Kinea Private Equity IV Feeder Institucional I Fundo de Investimento em Participações Multiestratégia, comunicou aos cotistas a distribuição de recursos provenientes de juros sobre o capital próprio da companhia +A Educação e dividendos da empresa Matera. O valor a ser distribuído representa 0,19% do capital comprometido totalizando R\$ 19.310,74 (dezenove mil e trezentos e dez reais e setenta e quatro centavos) do FIP.

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\$ 2.608.809,53 (dois milhões e seiscentos e oito mil e oitocentos e nove reais e cinquenta e três centavos). O saldo acumulado em 31 de julho de 2023 é de R\$ 11.224.787,34 (onze milhões e duzentos e vinte e quatro mil setecentos e oitenta e sete reais e trinta e quatro centavos) com um rendimento no mês de junho de R\$ 608,10 (seiscentos e oito reais e dez centavos).