



**LDB**  
EMPRESAS

**JACAREÍ**  
AGOSTO 2023



## Sumário

1. PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS .....	3
2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS .....	4
3. Posição de Ativos e Enquadramento.....	5
4. Enquadramento da Carteira.....	11
5. Rentabilidades por Artigo.....	12
6. Análise de Liquidez.....	19
7. Alocação por Artigo .....	20
8. Alocação Por Estratégia .....	20
9. Alocação por Gestor .....	21
10. Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial .....	22
11. Performance dos Fundos.....	25
12. Cotização e Taxas.....	33
13. Indexadores.....	35
14. Movimentações.....	41
15. Análise de Risco .....	43
16. Relatório de Cenário Macroeconômico.....	50
17. Agenda realizada .....	51
18. Acompanhamento fundos estressados .....	54
19. Fundos Estruturados.....	55

## 1. PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS

Em 17 de agosto de 2023 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 agosto de 2023, que é elaborado mensalmente pela Unidade de Gestão de Investimentos.

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



Renata de Souza Santos Esteves

Diretora do Dep. Administrativo-Financeiro – CPA 10



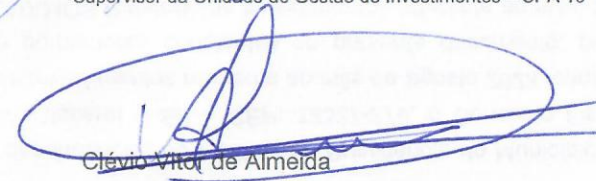
Amauri Arnaldo Junior

Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos – CPA 10



Luis Gustavo Ferreira Bonacina

Assessor da Presidência – CPA 20



Cláudio 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

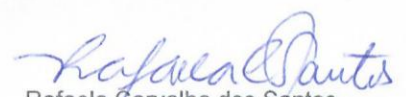
## 2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 21 dias do mês de setembro 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 agosto 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 agosto de 2023.

Jacareí, 21 de setembro de 2023

  
Amauri Arnaldo Junior

Representante do Conselho Fiscal

  
Rafaela Carvalho dos Santos  
Membro do Conselho Fiscal

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**3. Posição de Ativos e Enquadramento**

**RENDA FIXA**

**68,66%**

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%)	0,41	0,03	0,71	7,31	2.194.166,59	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,41	0,03	0,74	7,53	1.072.586,94	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,680000%)	4,02	0,05	0,73	2,03	20.402.947,24	2,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,44	0,03	0,66	6,89	2.223.219,34	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,44	0,03	0,66	6,90	2.219.575,10	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,44	0,03	0,66	6,92	2.218.723,84	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,45	0,03	0,69	7,11	2.207.962,58	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,45	0,03	0,70	7,18	2.209.034,77	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,45	0,03	0,70	7,20	2.208.117,04	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,670000%)	4,00	0,04	0,73	2,03	1.527.867,44	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,45	0,03	0,74	7,55	2.062.585,36	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,45	0,03	0,75	7,56	3.228.018,98	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,44	0,03	0,67	6,96	2.235.903,75	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,44	0,03	0,67	6,97	2.233.170,87	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,44	0,03	0,67	7,00	2.229.039,50	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,285000%)	0,45	0,03	0,70	7,17	2.216.303,84	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,45	0,03	0,70	7,21	2.215.387,44	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,45	0,03	0,70	7,24	2.213.868,54	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,45	0,03	0,74	7,54	5.208.670,59	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,45	0,03	0,75	7,56	2.151.877,03	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	0,41	0,03	0,75	7,59	2.070.069,05	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,45	0,03	0,75	7,60	6.325.011,94	0,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,45	0,03	0,75	7,61	2.064.063,82	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	0,41	0,04	0,77	7,75	4.639.761,37	0,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,45	0,04	0,78	7,83	3.657.169,21	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,280000%)	3,02	0,04	0,78	5,78	3.079.483,62	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	3,07	0,04	0,79	7,93	2.099.099,44	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,000000%)	0,44	0,03	0,67	6,98	2.241.070,87	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,44	0,03	0,67	7,00	2.236.015,98	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,44	0,03	0,68	7,02	2.230.987,10	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,45	0,03	0,70	7,19	2.219.430,87	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,45	0,03	0,70	7,23	2.220.406,22	0,33
TESOURO	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,45	0,03	0,71	7,27	2.218.320,53	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,520000%)	0,45	0,03	0,72	7,33	2.209.589,60	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,45	0,03	0,74	7,54	11.467.797,34	1,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,45	0,03	0,75	7,56	2.150.311,55	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	0,41	0,03	0,75	7,59	5.164.566,08	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,45	0,03	0,75	7,61	2.066.741,50	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,45	0,03	0,75	7,63	16.864.420,10	2,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	0,41	0,04	0,77	7,75	9.273.991,99	1,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,45	0,04	0,78	7,84	8.351.372,58	1,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,268000%)	3,03	0,04	0,78	5,77	7.183.649,24	1,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	3,09	0,04	0,79	7,93	5.251.695,26	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,46	0,03	0,70	7,22	2.161.167,95	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,450000%)	0,46	0,03	0,71	7,29	2.192.504,61	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,45	0,03	0,75	7,60	2.150.360,39	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,45	0,03	0,67	6,99	2.191.561,09	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,45	0,03	0,68	7,07	2.193.121,06	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,45	0,03	0,69	7,11	2.193.920,51	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,46	0,03	0,71	7,31	2.197.835,18	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,710000%)	0,45	0,03	0,73	7,46	3.217.355,39	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,45	0,03	0,66	6,88	2.206.048,55	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,45	0,03	0,68	7,07	2.198.157,29	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,45	0,03	0,69	7,14	2.200.612,44	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,45	0,03	0,69	7,16	2.197.883,06	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,45	0,03	0,74	7,53	3.224.244,02	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,45	0,03	0,66	6,89	2.214.550,92	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,45	0,03	0,66	6,91	2.209.652,91	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,45	0,03	0,69	7,10	2.202.010,23	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,45	0,03	0,69	7,16	2.203.884,61	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,300000%)	0,45	0,03	0,70	7,18	2.204.564,76	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,460000%)	2,85	0,03	0,71	1,97	3.468.214,88	0,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,46	0,03	0,71	7,32	2.201.821,51	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,835000%)	0,45	0,03	0,74	7,55	3.226.032,87	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,45	0,03	0,67	6,95	2.230.611,26	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,45	0,03	0,67	6,96	2.221.217,57	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,45	0,03	0,67	6,99	2.223.197,16	0,33
TESOURO	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,45	0,03	0,69	7,17	2.213.336,44	0,32



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%)	0,45	0,03	0,70	7,19	2.213.868,74	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,46	0,03	0,70	7,23	2.211.116,10	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,46	0,03	0,74	7,55	2.065.810,58	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,45	0,03	0,75	7,56	3.225.787,98	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,46	0,04	0,78	7,81	3.042.407,11	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,45	0,03	0,67	6,94	2.243.269,71	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,45	0,03	0,67	6,97	2.240.354,30	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,45	0,03	0,67	6,99	2.235.792,72	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,45	0,03	0,67	7,01	2.229.704,11	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,45	0,03	0,70	7,18	2.218.299,77	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,46	0,03	0,70	7,23	2.217.067,14	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,46	0,03	0,71	7,26	2.215.616,80	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,510000%)	0,46	0,03	0,72	7,33	2.208.193,64	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,45	0,03	0,74	7,54	8.337.176,37	1,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	0,41	0,03	0,75	7,59	3.096.496,09	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,45	0,03	0,75	7,61	2.066.280,10	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,45	0,03	0,75	7,63	11.263.171,44	1,65

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	0,41	0,04	0,77	7,75	6.695.354,57	0,98
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,46	0,04	0,78	7,84	5.575.629,86	0,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,278000%)	3,04	0,04	0,78	5,78	5.126.370,01	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	0,41	0,04	0,79	7,93	3.057.153,01	0,45
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,42</b>	<b>0,03</b>	<b>0,73</b>	<b>7,44</b>	<b>306.892.838,85</b>	<b>45,02</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	4,94	-0,63	-0,37	0,43	21.089.826,29	3,09	5.279.029.725,18	0,40
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,55	-1,00	-1,29	-0,61	20.991.944,89	3,08	1.858.783.140,34	1,13
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,00</b>	<b>-0,82</b>	<b>-0,83</b>	<b>-0,09</b>	<b>42.081.771,18</b>	<b>6,17</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	5,33	-0,16	0,82	2,20	5.109.984,00	0,75	228.566.994,72	2,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	1,16	2,23	20.446.382,29	3,00	14.734.335.445,36	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,04	1,22	9,04	20.858.341,22	3,06	5.670.273.448,55	0,37
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,07	1,33	9,01	31.528.354,26	4,62	2.938.953.438,08	1,07
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,17</b>	<b>0,04</b>	<b>1,22</b>	<b>8,76</b>	<b>77.943.061,77</b>	<b>11,43</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				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA	0,79	0,03	0,81	2,28	5.114.120,06	0,75		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		6,70 % a.a								
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	0,86	0,01	0,80	2,41	5.120.481,64	0,75		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	0,77	0,03	0,80	2,32	5.116.021,92	0,75		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	1,35	-0,49	0,31	8,20	5.456.442,26	0,80		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	0,78	0,03	0,79	2,22	5.111.122,37	0,75		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 7,00% a.a	1,80	0,02	0,83	8,34	5.965.463,80	0,88		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>1,79</b>	<b>-0,07</b>	<b>0,72</b>	<b>8,19</b>	<b>31.883.652,05</b>	<b>4,68</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 MULTISECTORIAL BVA MASTER III	138,63	16,36	16,36	64,20	12.287,35	0,00	425.043,24	2,89
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>138,63</b>	<b>16,36</b>	<b>16,36</b>	<b>64,20</b>	<b>12.287,35</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	1,18	9,05	3.385.708,49	0,50	10.848.275.865,60	0,03
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,48	0,06	1,61	8,73	5.842.017,78	0,86	3.473.055.743,33	0,17
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>0,55</b>	<b>0,06</b>	<b>1,45</b>	<b>8,50</b>	<b>9.227.726,27</b>	<b>1,35</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,34</b>	<b>-0,05</b>	<b>0,68</b>	<b>7,57</b>	<b>468.041.337,47</b>	<b>68,66</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

13,97%

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	26,63	-0,53	-5,61	6,04	4.342.703,12	0,64	184.603.545,85	2,35
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	24,57	-2,25	-9,24	-7,22	2.108.083,23	0,31	188.361.286,76	1,12
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	23,79	-2,26	-4,58	7,74	7.379.538,98	1,08	265.952.272,90	2,77
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,26	-1,34	-7,18	2,03	4.993.635,20	0,73	1.370.470.559,17	0,36
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,29	-1,72	-4,28	3,69	21.423.026,54	3,14	637.213.786,10	3,36
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,03	-1,38	-5,77	1,34	29.588.803,90	4,34	823.703.571,61	3,59
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22,25	-2,56	-3,34	23,84	5.895.908,42	0,86	341.392.227,27	1,73
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	24,26	-2,05	-6,60	13,97	3.654.490,88	0,54	402.081.467,39	0,91
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	21,57	-2,20	-2,13	29,38	8.729.617,49	1,28	786.608.043,15	1,11
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,01	-0,92	2,41	11,02	7.153.568,51	1,05	236.728.064,47	3,02
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>19,02</b>	<b>-1,64</b>	<b>-4,48</b>	<b>6,46</b>	<b>95.269.376,27</b>	<b>13,97</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>19,02</b>	<b>-1,64</b>	<b>-4,48</b>	<b>6,46</b>	<b>95.269.376,27</b>	<b>13,97</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,31%

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	24,23	0,85	-0,43	31,06	15.771.426,14	2,31	235.828.232,83	6,69
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	41,29	3,47	-4,99	21,14	1.877.242,31	0,28	161.950.670,21	1,16
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,20	1,38	-1,98	-14,05	2.424.504,78	0,36	65.719.736,87	3,69
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	25,84	2,10	-0,93	0,45	2.454.514,44	0,36	59.520.130,10	4,12
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,05	2,56	1,35	27,77	2.741.336,42	0,40	665.927.943,70	0,41
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	22,56	1,94	1,30	6,09	5.258.889,96	0,77	297.474.925,12	1,77
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>18,56</b>	<b>1,49</b>	<b>-0,44</b>	<b>17,64</b>	<b>30.527.914,05</b>	<b>4,48</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	20,95	1,49	3,77	13,23	19.290.760,41	2,83	732.547.750,88	2,63
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>20,95</b>	<b>1,49</b>	<b>3,77</b>	<b>13,23</b>	<b>19.290.760,41</b>	<b>2,83</b>		

Investimentos no Exterior

18,17 1,49 1,15 15,89 49.818.674,46 7,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,06%

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	15,26	0,62	1,78	12,34	7.579.964,73	1,11	50.858.377,89	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	18,18	-0,08	-0,95	23,21	18.663.999,97	2,74	790.575.079,18	2,36
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	17,83	-0,08	-0,89	23,69	31.049.177,09	4,55	528.109.144,51	5,88
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>16,58</b>	<b>0,01</b>	<b>-0,57</b>	<b>21,90</b>	<b>57.293.141,79</b>	<b>8,40</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	0,64	0,64	-5,07	11.297.069,71	1,66	360.376.474,66	3,13
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	439,18	0,00	0,00	-98,70	0,00	0,00	2.615.006,70	0,00
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>50,14</b>	<b>0,64</b>	<b>0,64</b>	<b>-5,19</b>	<b>11.297.069,71</b>	<b>1,66</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>16,11</b>	<b>0,12</b>	<b>-0,37</b>	<b>16,84</b>	<b>68.590.211,50</b>	<b>10,06</b>		
<b>Total</b>			<b>3,73</b>	<b>-0,14</b>	<b>-0,14</b>	<b>8,89</b>	<b>681.719.599,70</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

4. Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	306.892.838,85	45,02	0,00	43,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	42.081.771,18	6,17	0,00	5,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	77.943.061,77	11,43	0,00	12,50	40,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	31.883.652,05	4,68	0,00	2,50	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	12.287,35	0,00	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	9.227.726,27	1,35	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>468.041.337,47</b>	<b>68,66</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	95.269.376,27	13,97	0,00	14,50	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>95.269.376,27</b>	<b>13,97</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	30.527.914,05	4,48	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	19.290.760,41	2,83	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>49.818.674,46</b>	<b>7,31</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	57.293.141,79	8,40	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	11.297.069,71	1,66	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>68.590.211,50</b>	<b>10,06</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>681.719.599,70</b>	<b>100,00</b>					

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**5. Rentabilidades por Artigo**

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,73 64,17	7,44 83,97	1,66 49,88	5,21 77,97	10,19 75,19	2.239.650,71	22.234.204,44
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,83 -72,86	-0,09 -1,02	-0,09 -2,73	-0,09 -1,36	0,44 3,25	-352.235,32	-43.692,82
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,22 106,94	8,76 98,79	3,47 104,45	6,84 102,44	13,52 99,77	912.901,19	8.655.882,30
Artigo 7º IV % do CDI	0,72 63,21	8,19 92,40	1,90 57,35	5,81 87,02		227.975,61	1.334.371,37
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	16,36 1.436,28	64,20 724,03	391,59 11.797,41	95,89 1.436,01	78,77 581,21	1.727,87	4.804,01
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,45 127,53	8,50 95,83	4,00 120,60	7,21 108,00	13,25 97,74	132.148,55	842.044,92
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,48 0,61	6,46 0,99	8,00 1,16	10,47 0,17	3,01 -2,67	-4.464.585,10	6.028.125,62
Artigo 9º II % do CDI	-0,44 -38,76	17,64 198,96	6,56 197,51	10,26 153,68	9,13 67,38	-135.407,17	4.577.738,87
Artigo 9º III % do CDI	3,77 330,50	13,23 149,18	5,31 159,93	10,15 152,06	9,59 70,77	700.006,72	2.253.521,75
Artigo 10º I % do CDI	-0,57 -49,75	21,90 247,04	8,95 269,66	16,87 252,69	22,38 165,10	-326.593,41	10.294.648,54
Artigo 10º II % do CDI	0,64 56,52	-5,19 -58,49	1,24 37,36	0,63 9,50	-7,11 -52,46	72.282,37	-418.402,08
<b>JACAREÍ (Total)</b>						<b>-992.127,98</b>	<b>55.763.246,92</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%)	2.178.634,52	0,00	0,00	0,00	2.194.166,59	15.532,07	152.483,49
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.064.691,44	0,00	0,00	0,00	1.072.586,94	7.895,50	76.659,41
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.255.065,69	0,00	0,00	0,00	20.402.947,24	147.881,55	406.074,81
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.208.670,58	0,00	0,00	0,00	2.223.219,34	14.548,76	145.970,13



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.205.010,65	0,00	0,00	0,00	2.219.575,10	14.564,45	146.004,39
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.204.107,50	0,00	0,00	0,00	2.218.723,84	14.616,34	146.355,02
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.192.871,72	0,00	0,00	0,00	2.207.962,58	15.090,86	149.512,73
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.193.758,64	0,00	0,00	0,00	2.209.034,77	15.276,13	150.851,46
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.192.791,36	0,00	0,00	0,00	2.208.117,04	15.325,68	151.193,24
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.516.804,20	0,00	0,00	0,00	1.527.867,44	11.063,24	30.372,46
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.047.354,78	0,00	0,00	0,00	2.062.585,36	15.230,58	147.712,61
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.204.130,53	0,00	0,00	0,00	3.228.018,98	23.888,45	231.529,97
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.221.058,79	0,00	0,00	0,00	2.235.903,75	14.844,96	148.199,97
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.218.324,27	0,00	0,00	0,00	2.233.170,87	14.846,60	148.156,67
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.214.125,09	0,00	0,00	0,00	2.229.039,50	14.914,41	148.569,60
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.200.987,25	0,00	0,00	0,00	2.216.303,84	15.316,59	151.201,01
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.199.970,39	0,00	0,00	0,00	2.215.387,44	15.417,05	151.888,10
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.198.387,62	0,00	0,00	0,00	2.213.868,54	15.480,92	152.327,11
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.170.230,69	0,00	0,00	0,00	5.208.670,59	38.439,90	372.787,68
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.135.944,18	0,00	0,00	0,00	2.151.877,03	15.932,85	154.390,77
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.054.675,70	0,00	0,00	0,00	2.070.069,05	15.393,35	148.989,09
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.277.878,62	0,00	0,00	0,00	6.325.011,94	47.133,32	455.929,89
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.048.671,86	0,00	0,00	0,00	2.064.063,82	15.391,96	148.871,91
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.604.299,90	0,00	0,00	0,00	4.639.761,37	35.461,47	340.817,20
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.628.853,94	0,00	0,00	0,00	3.657.169,21	28.315,27	271.227,23
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.055.579,02	0,00	0,00	0,00	3.079.483,62	23.904,60	171.293,44
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.082.590,12	0,00	0,00	0,00	2.099.099,44	16.509,32	157.514,89
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.226.133,28	0,00	0,00	0,00	2.241.070,87	14.937,59	148.895,71
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.221.054,78	0,00	0,00	0,00	2.236.015,98	14.961,20	148.974,00
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.216.002,17	0,00	0,00	0,00	2.230.987,10	14.984,93	149.053,61
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.204.035,16	0,00	0,00	0,00	2.219.430,87	15.395,71	151.779,73
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.204.899,08	0,00	0,00	0,00	2.220.406,22	15.507,14	152.599,36
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.202.732,36	0,00	0,00	0,00	2.218.320,53	15.588,17	153.142,24

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.193.870,82	0,00	0,00	0,00	2.209.589,60	15.718,78	153.901,67
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.383.161,52	0,00	0,00	0,00	11.467.797,34	84.635,82	820.700,19
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.134.389,40	0,00	0,00	0,00	2.150.311,55	15.922,15	154.269,96
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.126.163,79	0,00	0,00	0,00	5.164.566,08	38.402,29	371.692,75
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.051.319,55	0,00	0,00	0,00	2.066.741,50	15.421,95	149.124,64
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.738.235,51	0,00	0,00	0,00	16.864.420,10	126.184,59	1.219.228,60
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.203.102,49	0,00	0,00	0,00	9.273.991,99	70.889,50	681.261,65
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.286.672,67	0,00	0,00	0,00	8.351.372,58	64.699,91	619.680,83
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.127.951,82	0,00	0,00	0,00	7.183.649,24	55.697,42	399.204,81
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.210.386,15	0,00	0,00	0,00	5.251.695,26	41.309,11	394.144,46
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.209.166,92	0,00	0,00	63.241,15	2.161.167,95	15.242,18	150.452,69
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.241.056,27	0,00	0,00	64.217,85	2.192.504,61	15.666,19	154.042,16
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.197.372,48	0,00	0,00	63.241,15	2.150.360,39	16.229,06	157.129,31
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.239.626,19	0,00	0,00	62.874,89	2.191.561,09	14.809,79	147.970,31
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.241.187,81	0,00	0,00	63.119,06	2.193.121,06	15.052,31	149.714,27
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.241.987,45	0,00	0,00	63.241,15	2.193.920,51	15.174,21	150.582,74
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.245.908,26	0,00	0,00	63.851,59	2.197.835,18	15.778,51	154.910,38
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.287.649,15	0,00	0,00	94.007,12	3.217.355,39	23.713,36	231.111,14
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.253.350,74	0,00	0,00	61.898,19	2.206.048,55	14.596,00	146.690,90
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.245.467,42	0,00	0,00	62.386,54	2.198.157,29	15.076,41	149.932,17
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.248.049,73	0,00	0,00	62.752,80	2.200.612,44	15.315,51	151.660,41
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.245.281,90	0,00	0,00	62.752,80	2.197.883,06	15.353,96	151.880,72
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.294.330,34	0,00	0,00	94.129,20	3.224.244,02	24.042,88	233.551,91
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.261.048,61	0,00	0,00	61.165,67	2.214.550,92	14.667,98	147.316,22
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.256.103,63	0,00	0,00	61.165,67	2.209.652,91	14.714,95	147.544,14
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.248.706,37	0,00	0,00	61.898,19	2.202.010,23	15.202,05	150.856,73
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.250.755,68	0,00	0,00	62.264,45	2.203.884,61	15.393,38	152.244,01
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.251.495,81	0,00	0,00	62.386,54	2.204.564,76	15.455,49	152.701,09
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.542.425,38	0,00	0,00	99.012,69	3.468.214,88	24.802,19	68.464,74

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.248.997,76	0,00	0,00	62.996,98	2.201.821,51	15.820,73	155.245,53
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.295.910,11	0,00	0,00	94.007,12	3.226.032,87	24.129,88	234.158,27
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.274.392,40	0,00	0,00	58.723,93	2.230.611,26	14.942,79	149.395,71
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.264.900,48	0,00	0,00	58.601,84	2.221.217,57	14.918,93	149.046,34
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.267.135,81	0,00	0,00	58.968,10	2.223.197,16	15.029,45	149.883,40
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.258.188,60	0,00	0,00	60.311,06	2.213.336,44	15.458,90	152.775,48
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.258.890,60	0,00	0,00	60.555,23	2.213.868,74	15.533,37	153.314,44
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.256.304,47	0,00	0,00	60.799,41	2.211.116,10	15.611,04	153.823,80
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.110.058,26	0,00	0,00	59.700,62	2.065.810,58	15.452,94	149.926,75
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.295.007,43	0,00	0,00	93.396,68	3.225.787,98	24.177,23	234.476,24
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.110.072,86	0,00	0,00	91.443,29	3.042.407,11	23.777,54	228.129,96
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.285.403,50	0,00	0,00	57.136,79	2.243.269,71	15.003,00	149.958,81
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.282.672,79	0,00	0,00	57.380,97	2.240.354,30	15.062,48	150.337,26
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.278.204,58	0,00	0,00	57.503,05	2.235.792,72	15.091,19	150.458,95
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.272.210,72	0,00	0,00	57.625,14	2.229.704,11	15.118,53	150.545,68
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.262.101,87	0,00	0,00	59.334,36	2.218.299,77	15.532,26	153.319,85
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.261.240,90	0,00	0,00	59.822,71	2.217.067,14	15.648,95	154.145,11
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.260.068,10	0,00	0,00	60.188,97	2.215.616,80	15.737,67	154.749,95
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.253.113,17	0,00	0,00	60.799,41	2.208.193,64	15.879,88	155.638,60
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.514.399,16	0,00	0,00	239.535,02	8.337.176,37	62.312,23	604.665,11
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.162.904,16	0,00	0,00	89.734,07	3.096.496,09	23.326,00	225.875,03
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.110.741,21	0,00	0,00	60.066,88	2.066.280,10	15.605,77	151.038,38
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.506.459,67	0,00	0,00	328.658,65	11.263.171,44	85.370,42	825.391,66
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.843.716,69	0,00	0,00	200.222,95	6.695.354,57	51.860,83	498.730,65
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.701.183,78	0,00	0,00	169.334,90	5.575.629,86	43.780,98	419.606,82
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.242.065,97	0,00	0,00	156.027,40	5.126.370,01	40.331,44	287.961,23
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.127.271,04	0,00	0,00	94.495,46	3.057.153,01	24.377,43	232.768,89
					306.892.838,85	2.239.650,71	

## 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	21.265.691,55	0,00	0,00	0,00	20.991.944,89	-273.746,66	-133.519,11
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.168.314,95	0,00	0,00	0,00	21.089.826,29	-78.488,66	89.826,29
					42.081.771,18	-352.235,32	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	20.212.906,48	0,00	0,00	0,00	20.446.382,29	233.475,81	446.382,29
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	20.607.428,47	0,00	0,00	0,00	20.858.341,22	250.912,75	3.744.424,47
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5.068.544,00	0,00	0,00	0,00	5.109.984,00	41.440,00	109.984,00
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	28.098.781,63	12.881.500,00	-9.839.000,00	0,00	31.528.354,26	387.072,63	2.495.866,81
					77.943.061,77	912.901,19	

## 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	5.075.380,16	0,00	0,00	0,00	5.116.021,92	40.641,76	116.021,92
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	5.080.038,14	0,00	0,00	0,00	5.120.481,64	40.443,50	120.481,64
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a	5.916.488,59	0,00	0,00	0,00	5.965.463,80	48.975,21	459.240,70
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	5.071.122,20	0,00	0,00	0,00	5.111.122,37	40.000,17	111.122,37
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	5.073.184,15	0,00	0,00	0,00	5.114.120,06	40.935,91	114.120,06
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.439.463,20	0,00	0,00	0,00	5.456.442,26	16.979,06	413.384,68
					31.883.652,05	227.975,61	

## 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	10.559,48	0,00	0,00	0,00	12.287,35	1.727,87	4.804,01
					12.287,35	1.727,87	

## Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	3.346.221,53	0,00	0,00	0,00	3.385.708,49	39.486,96	281.087,96
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	5.749.356,19	0,00	0,00	0,00	5.842.017,78	92.661,59	469.253,07
					9.227.726,27	132.148,55	

## 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	7.733.581,15	0,00	0,00	0,00	7.379.538,98	-354.042,17	530.094,77
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.380.162,24	0,00	0,00	0,00	4.993.635,20	-386.527,04	99.181,09
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	6.099.493,01	0,00	0,00	0,00	5.895.908,42	-203.584,59	731.809,21
INDIE FIC FIA	3.912.625,92	0,00	0,00	0,00	3.654.490,88	-258.135,04	448.024,06
META VALOR FI DE AÇÕES	2.322.824,28	0,00	0,00	0,00	2.108.083,23	-214.741,05	-164.049,11
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	22.380.423,09	0,00	0,00	0,00	21.423.026,54	-957.396,55	1.050.412,70
OCCAM FIC FIA	31.398.975,95	0,00	0,00	0,00	29.588.803,90	-1.810.172,05	392.226,37
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	4.600.945,00	0,00	0,00	0,00	4.342.703,12	-258.241,88	247.504,09
TARPON GT 30 FIC FIA	8.920.020,57	0,00	0,00	0,00	8.729.617,49	-190.403,08	1.982.585,72
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	6.984.910,16	0,00	0,00	0,00	7.153.568,51	168.658,35	710.336,72
					95.269.376,27	-4.464.585,10	

## 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	15.840.318,98	0,00	0,00	0,00	15.771.426,14	-68.892,84	3.737.802,76
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.975.788,07	0,00	0,00	0,00	1.877.242,31	-98.545,76	327.601,19
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.473.468,76	0,00	0,00	0,00	2.424.504,78	-48.963,98	-396.172,77
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.477.594,57	0,00	0,00	0,00	2.454.514,44	-23.080,13	10.909,07
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.704.932,38	0,00	0,00	0,00	2.741.336,42	36.404,04	595.746,01
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	5.191.218,46	0,00	0,00	0,00	5.258.889,96	67.671,50	301.852,61

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					30.527.914,05	-135.407,17	

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	18.590.753,69	0,00	0,00	0,00	19.290.760,41	700.006,72	2.253.521,75
					19.290.760,41	700.006,72	

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	31.329.441,56	0,00	0,00	0,00	31.049.177,09	-280.264,47	5.946.127,49
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	7.447.584,17	0,00	0,00	0,00	7.579.964,73	132.380,56	832.623,72
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	18.842.709,47	0,00	0,00	0,00	18.663.999,97	-178.709,50	3.515.897,33
					57.293.141,79	-326.593,41	

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	11.224.787,34	0,00	0,00	0,00	11.297.069,71	72.282,37	-403.325,85
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	198,95	0,00	-198,95	0,00	0,00	0,00	-15.076,23
					11.297.069,71	72.282,37	

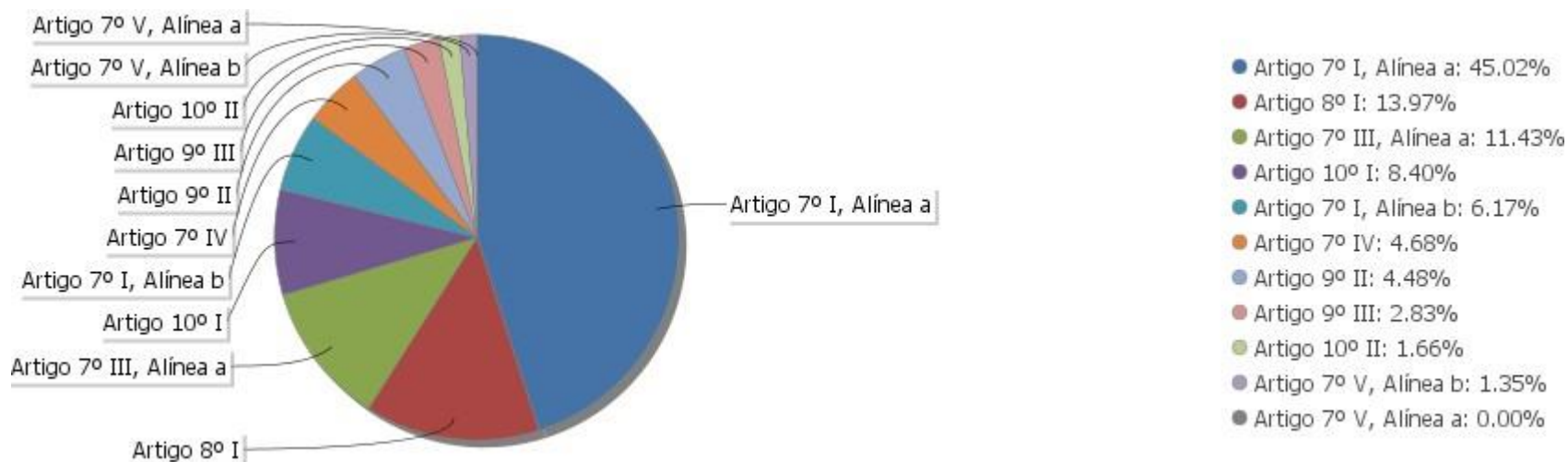
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**6. Análise de  
Liquidez**

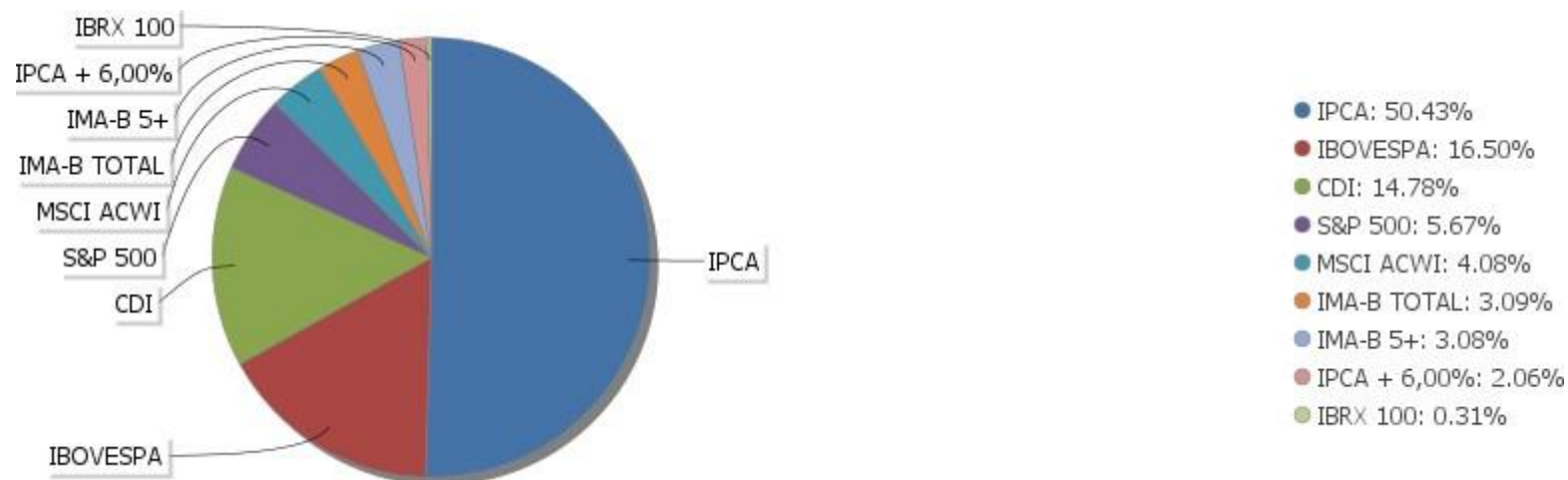
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	270.343.104,93	39,66	270.343.104,93	39,66	
de 31 dias a 365 dias	62.696.983,11	9,20	333.040.088,04	48,85	
acima de 365 dias	348.679.511,66	51,15	681.719.599,70	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

7. Alocação por Artigo



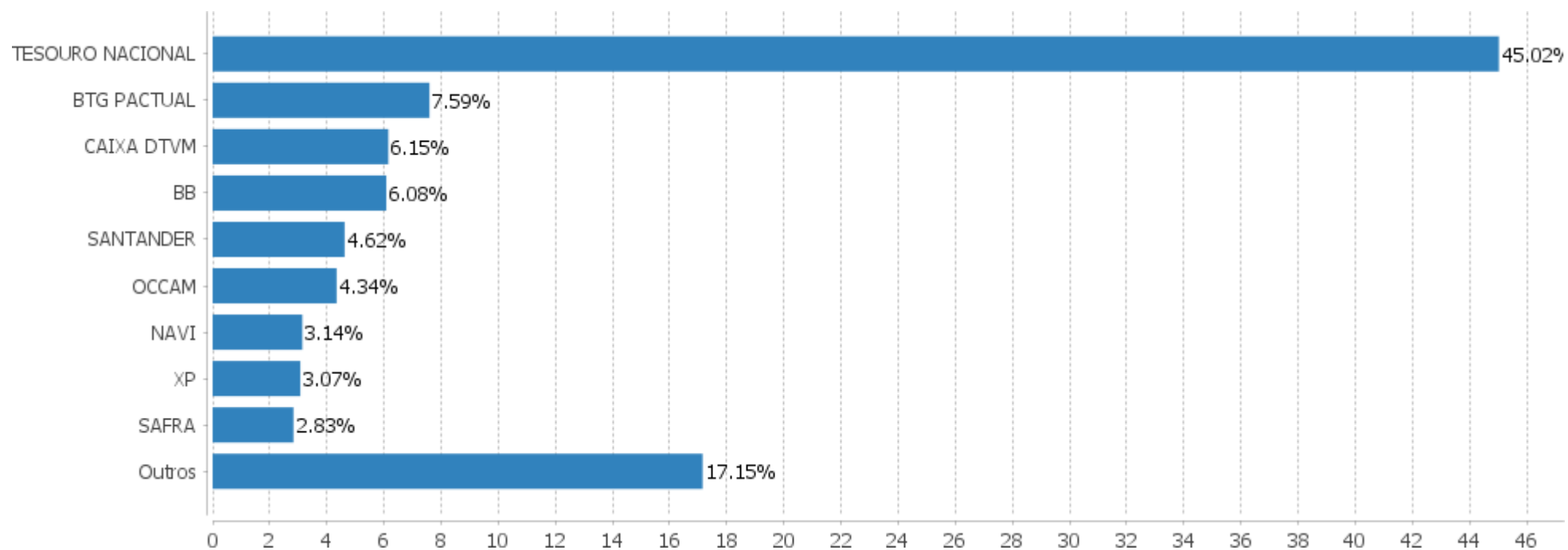
8. Alocação Por Estratégia





EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

9. Alocação por Gestor



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**10. Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial**

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,93	-0,48	0,82	0,85	1,86	2,32	1,43	-0,14					8,89
IPCA + 5,11%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34	0,54	0,69					6,72
p.p. indexador	0,97	-1,68	-0,35	-0,12	1,19	1,99	0,89	-0,83					2,17
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

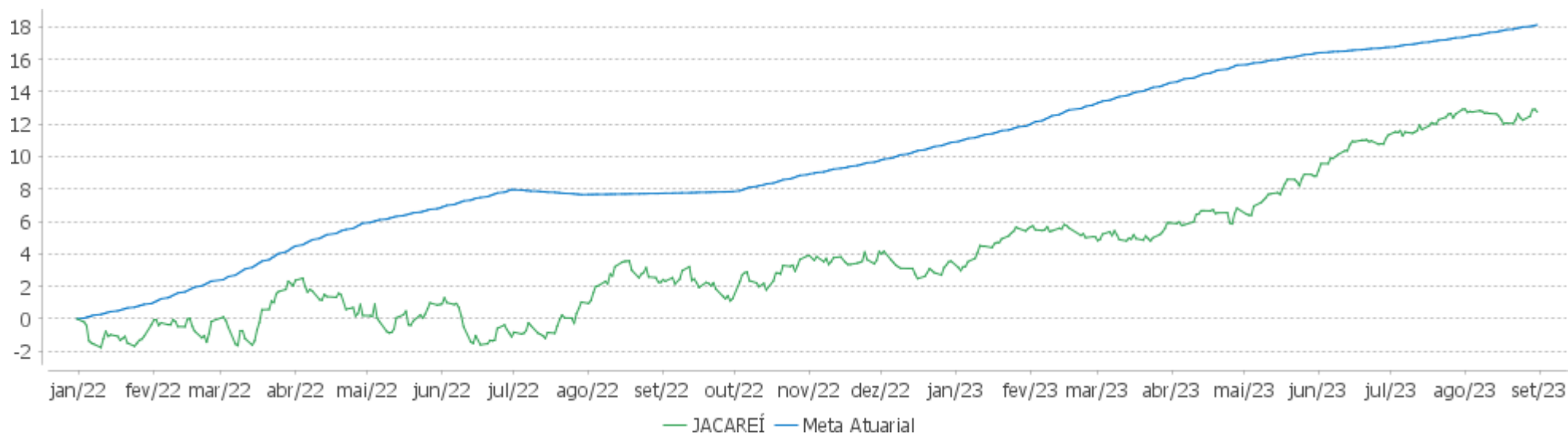
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

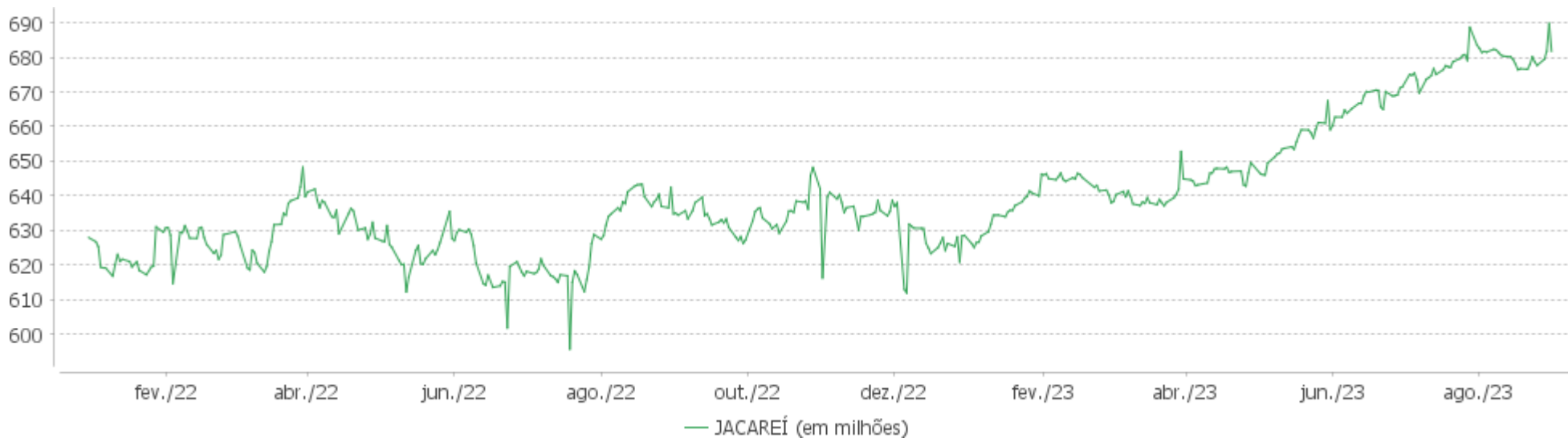
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	8	40,00	03 meses	3,64	1,57	2,07	2,69
Meses abaixo - Meta Atuarial	12	60,00	06 meses	7,33	4,44	2,89	3,09
			12 meses	10,28	9,84	0,44	3,73
	Rentabilidade	Mês	24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,60	2022-10	Desde 31/12/2021	12,75	18,32	-5,57	4,75
Menor rentabilidade da Carteira	-1,97	2022-06					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

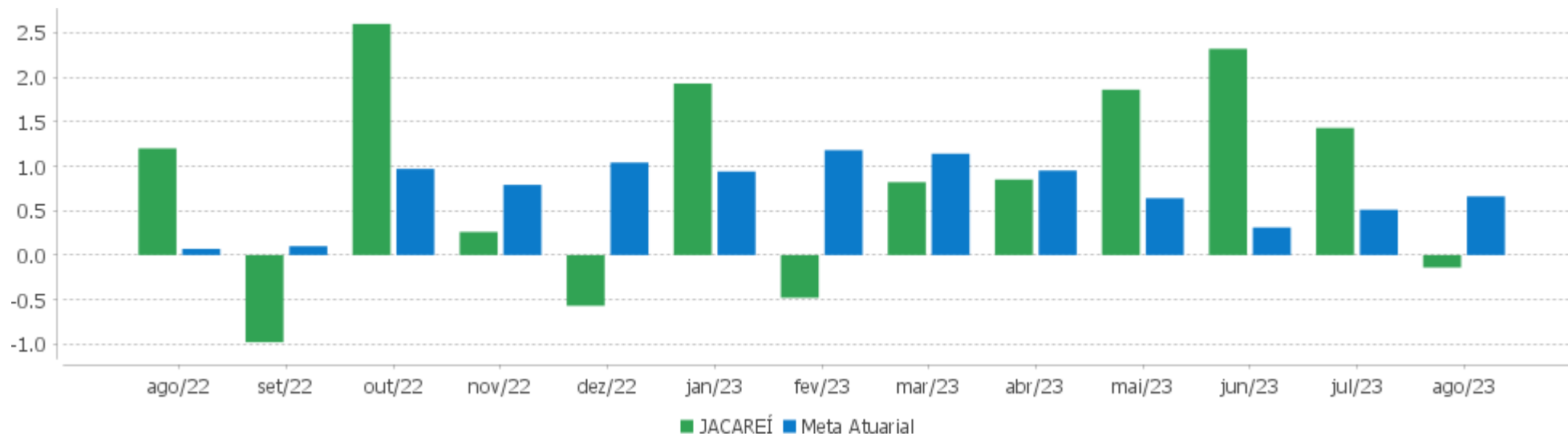


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

11. Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a Var. IPCA p.p.	0,81 0,58	2,28 1,91	1,85 1,58				
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a Var. IPCA p.p.	0,80 0,57	2,41 2,03	1,94 1,67				
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a Var. IPCA p.p.	0,80 0,57	2,32 1,95	1,89 1,62				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,31 0,08	8,20 4,97	1,94 1,67	5,96 4,13			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a Var. IPCA p.p.	0,79 0,56	2,22 1,85	1,80 1,53				
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,83 0,60	8,34 5,11	1,99 1,72	5,82 3,99			
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,61 141,47	8,73 98,50	4,31 129,74	7,66 114,67	13,71 101,16	26,45 105,24	33,50 117,48
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	1,18 103,58	9,05 102,11	3,46 104,28	6,85 102,54	13,93 102,78	27,11 107,84	30,59 107,26
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,54	7,75 4,52	1,77 1,50	5,43 3,60	10,71 6,10	21,27 7,53	
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,59 4,36	1,71 1,44	5,31 3,48	10,45 5,85	20,94 7,20	
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,48	7,31 4,08	1,60 1,33	5,10 3,27	10,02 5,41	23,48 9,74	
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,45	7,07 3,84	1,52 1,25	4,92 3,09	9,65 5,05	26,22 12,48	
NTN-B 150533 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,50	4,44 1,21	1,65 1,38	2,27 0,43	4,15 <b>-0,46</b>		
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,63 4,39	1,72 1,45	5,34 3,51	10,51 5,90	28,20 14,46	
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,56 4,33	1,70 1,43	5,29 3,46	10,42 5,81	24,38 10,64	
NTN-B 150545 (5,915000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,60 4,37	1,71 1,44	5,32 3,49	10,47 5,87	24,48 10,74	
NTN-B 150850 (5,831200%)	0,74	7,54	1,69	5,28	10,39	27,91	

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Variação da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. IPCA p.p.	0,51	4,31	1,42	3,45	5,78	14,18	
NTN-B 150826 (5,190000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,46	7,11 3,88	1,53 1,26	4,95 3,12	9,72 5,11	26,37 12,63	
NTN-B 150830 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,46	7,16 3,93	1,55 1,28	4,99 3,16	9,80 5,20	26,56 12,83	
NTN-B 150840 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,55 4,32	1,69 1,42	5,28 3,45	10,39 5,78	27,93 14,19	
NTN-B 150545 (4,970000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	6,96 3,73	1,48 1,21	4,84 3,01	9,49 4,88	22,67 8,93	
NTN-B 150840 (4,950000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	6,95 3,72	1,47 1,20	4,83 3,00	9,47 4,86	25,80 12,06	
NTN-B 150850 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	6,97 3,74	1,48 1,21	4,85 3,02	9,50 4,89	25,87 12,13	
NTN-B 150555 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,61 4,38	1,71 1,44	5,33 3,50	10,49 5,88	24,51 10,77	
NTN-B 150850 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,23 3,99	1,57 1,30	5,04 3,21	9,90 5,29	26,78 13,04	
NTN-B 150545 (5,922000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,61 4,38	1,71 1,44	5,32 3,49	10,48 5,87	24,50 10,76	
NTN-B 150555 (5,370000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,23 4,00	1,58 1,31	5,05 3,21	9,91 5,30	23,48 9,74	
NTN-B 150535 (4,910000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,43	6,92 3,69	1,46 1,19	4,81 2,98	9,43 4,82	22,43 8,69	
NTN-B 150840 (5,020000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	6,99 3,76	1,49 1,22	4,87 3,04	9,54 4,94	25,96 12,23	
NTN-B 150850 (4,940000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	6,94 3,71	1,47 1,20	4,83 3,00	9,46 4,85	25,77 12,04	
NTN-B 150826 (5,490000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,48	7,31 4,08	1,61 1,34	5,11 3,27	10,03 5,42	27,09 13,35	
NTN-B 150840 (4,970000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	6,96 3,73	1,48 1,21	4,84 3,01	9,49 4,88	25,84 12,11	
NTN-B 150545 (6,280000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,55	7,85 4,62	1,80 1,53	5,50 3,67	7,57 2,96		
NTN-B 150830 (5,460000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,48	4,31 1,08	1,60 1,33	5,09 3,26	6,94 2,33		
NTN-B 150850 (6,261000%)	0,78	7,84	1,80	5,50	10,83	28,95	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,55	4,61	1,53	3,66	6,22	15,22	
NTN-B 150535 (5,320000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,20 3,97	1,56 1,29	5,02 3,19	9,86 5,25	23,26 9,52	
NTN-B 150555 (5,000000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	6,98 3,75	1,48 1,21	4,86 3,03	9,52 4,91	22,79 9,05	
NTN-B 150535 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,50	4,44 1,21	1,65 1,38	2,27 0,44	4,16 -0,45		
NTN-B 150850 (5,010000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	6,99 3,76	1,49 1,22	4,86 3,03	9,53 4,93	25,94 12,20	
NTN-B 150555 (6,261000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,55	7,84 4,61	1,80 1,53	5,50 3,66	10,83 6,22	25,13 11,39	
NTN-B 150545 (6,256000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,55	7,83 4,60	1,80 1,53	5,49 3,66	10,83 6,22	25,13 11,40	
NTN-B 150555 (5,520000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,49	7,33 4,10	1,61 1,34	5,12 3,29	10,06 5,45	23,76 10,02	
NTN-B 150555 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,56 4,33	1,70 1,43	5,29 3,46	10,42 5,81	24,39 10,65	
NTN-B 150545 (5,380000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,24 4,01	1,58 1,31	5,05 3,22	9,92 5,31	23,46 9,72	
NTN-B 150826 (5,009000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	6,99 3,76	1,49 1,22	4,86 3,03	9,53 4,92	25,94 12,20	
NTN-B 150545 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,56	7,93 4,70	1,83 1,56	5,57 3,73	7,65 3,04	17,99 4,26	
NTN-B 150535 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,56 4,33	1,70 1,43	5,29 3,46	10,41 5,80	24,35 10,61	
NTN-B 150555 (5,831200%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,54 4,31	1,69 1,42	5,28 3,45	10,39 5,78	24,33 10,60	
NTN-B 150828 (4,850000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,43	6,88 3,65	1,45 1,18	4,78 2,95	9,37 4,76	25,56 11,82	
NTN-B 150545 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,54 4,31	1,69 1,42	5,28 3,45	10,39 5,78	24,32 10,58	
NTN-B 150555 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,56	7,93 4,70	1,83 1,56	5,57 3,73	7,63 3,02	17,92 4,18	
NTN-B 150828 (5,240000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,46	7,14 3,91	1,54 1,27	4,98 3,15	9,77 5,16	26,49 12,75	
NTN-B 150545 (5,340000%)	0,70	7,21	1,57	5,03	9,88	23,38	

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Variação da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. IPCA p.p.	0,47	3,98	1,30	3,20	5,27	9,64	
NTN-B 150850 (5,921000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,61 4,37	1,71 1,44	5,32 3,49	10,48 5,87	28,13 14,39	
NTN-B 150826 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,50	7,46 4,23	1,66 1,39	5,22 3,39	10,26 5,65	27,62 13,88	
NTN-B 150535 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,43	6,89 3,66	1,45 1,18	4,79 2,95	9,38 4,77	22,33 8,59	
NTN-B 150555 (6,268000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,55	7,84 4,61	1,80 1,53	5,50 3,67	7,55 2,94		
NTN-B 150555 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,54	7,75 4,52	1,77 1,50	5,43 3,60	10,71 6,10	21,26 7,52	
NTN-B 150828 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,46	7,16 3,93	1,55 1,28	4,99 3,16	9,80 5,20	26,56 12,83	
NTN-B 150535 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,18 3,95	1,56 1,29	5,00 3,17	9,82 5,22	23,20 9,46	
NTN-B 150830 (5,835000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,55 4,32	1,69 1,42	5,28 3,45	10,39 5,78	27,92 14,19	
NTN-B 150535 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,55 4,32	1,69 1,42	5,28 3,45	10,39 5,78	24,31 10,57	
NTN-B 150555 (5,315000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,19 3,96	1,56 1,29	5,02 3,19	9,85 5,24	23,38 9,64	
NTN-B 150830 (5,300000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,18 3,95	1,56 1,29	5,01 3,18	9,83 5,23	26,64 12,90	
NTN-B 150830 (5,500000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,48	7,32 4,09	1,61 1,34	5,11 3,28	10,04 5,43	27,12 13,38	
NTN-B 150545 (5,285000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,17 3,94	1,56 1,29	5,00 3,17	9,82 5,21	23,27 9,54	
NTN-B 150824 (5,450000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,48	7,29 4,06	1,60 1,33	5,09 3,25	9,99 5,38	27,00 13,26	
NTN-B 150830 (5,178300%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,46	7,10 3,87	1,53 1,26	4,95 3,12	9,71 5,10	26,34 12,61	
NTN-B 150545 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	7,00 3,77	1,49 1,22	4,87 3,04	9,55 4,95	22,78 9,05	
NTN-B 150545 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,59 4,36	1,71 1,44	5,31 3,48	10,45 5,85	20,92 7,19	
NTN-B 150850 (6,400000%)	0,79	7,93	1,83	5,57	10,98	21,62	



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Variação da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. IPCA p.p.	0,56	4,70	1,56	3,73	6,37	7,88	
NTN-B 150824 (5,912000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,60 4,37	1,71 1,44	5,32 3,49	10,47 5,86	28,11 14,37	
NTN-B 150850 (5,045000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	7,01 3,78	1,50 1,23	4,88 3,05	9,57 4,96	26,02 12,29	
NTN-B 150555 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	7,00 3,77	1,49 1,22	4,87 3,04	9,55 4,95	22,85 9,11	
NTN-B 150840 (5,274000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,46	7,17 3,94	1,55 1,28	5,00 3,16	9,81 5,20	26,57 12,84	
NTN-B 150826 (5,130000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,45	7,07 3,84	1,52 1,25	4,92 3,09	9,66 5,05	26,23 12,49	
NTN-B 150840 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,23 3,99	1,57 1,30	5,04 3,21	9,90 5,29	26,78 13,04	
NTN-B 150850 (5,410000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,48	7,26 4,03	1,59 1,32	5,07 3,23	9,95 5,34	26,90 13,16	
NTN-B 150840 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,56 4,33	1,70 1,43	5,29 3,46	10,41 5,80	27,97 14,23	
NTN-B 150545 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	6,97 3,74	1,48 1,21	4,85 3,02	9,50 4,89	22,69 8,95	
NTN-B 150830 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,43	6,89 3,66	1,45 1,18	4,79 2,95	9,38 4,77	25,58 11,84	
NTN-B 150824 (5,345000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,22 3,98	1,57 1,30	5,03 3,20	9,88 5,27	26,74 13,01	
NTN-B 150840 (5,310000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,19 3,96	1,56 1,29	5,01 3,18	9,84 5,24	26,66 12,92	
NTN-B 150830 (4,900000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,43	6,91 3,68	1,46 1,19	4,81 2,98	9,42 4,81	25,68 11,94	
NTN-B 150545 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,54	7,75 4,52	1,77 1,50	5,43 3,60	10,71 6,10	21,27 7,54	
NTN-B 150850 (5,295500%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	7,18 3,95	1,56 1,29	5,01 3,18	9,83 5,22	26,62 12,89	
NTN-B 150535 (4,880000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,43	6,90 3,67	1,45 1,18	4,80 2,97	9,40 4,79	22,37 8,63	
NTN-B 150555 (5,420000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,48	7,27 4,04	1,59 1,32	5,07 3,24	9,96 5,35	23,57 9,84	
NTN-B 150850 (5,510000%)	0,72	7,33	1,61	5,12	10,05	27,14	

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.	0,49	4,10	1,34	3,28	5,44	13,40	
NTN-B 150555 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,59 4,36	1,71 1,44	5,31 3,48	10,45 5,85	20,94 7,20	
NTN-B 150850 (6,278000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,55	4,65 1,42	1,80 1,53	5,50 3,67	7,56 2,96		
NTN-B 150840 (6,220000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,55	7,81 4,58	1,79 1,52	5,47 3,64	10,79 6,18	28,85 15,12	
NTN-B 150555 (5,060000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,45	7,02 3,79	1,50 1,23	4,89 3,06	9,59 4,98	22,90 9,17	
NTN-B 150828 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,53 4,30	1,69 1,42	5,27 3,44	10,36 5,76	27,86 14,12	
NTN-B 150555 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,63 4,39	1,72 1,45	5,34 3,51	10,51 5,90	24,55 10,82	
NTN-B 150525 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,53 4,30	1,69 1,42	5,27 3,44	10,36 5,76	24,21 10,48	
NTN-B 150535 (5,196100%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,46	7,11 3,88	1,53 1,26	4,96 3,13	9,73 5,12	23,01 9,27	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,37 0,01	11,72 -0,12	2,79 -0,04	10,37 -0,06	13,51 -0,26	19,64 -0,43	23,24 -0,75
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,29 -0,02	13,97 -0,31	2,68 -0,12	14,11 -0,29	14,56 -0,44	15,81 -0,85	17,53 -1,23
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III % do CDI	16,36 1.436,28	64,20 724,03	391,59 11.797,44	95,89 1.436,00	78,77 581,21	-58,99 -234,68	8.531,76 29.917,92
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,16 101,39	8,81 99,38	3,35 100,89	6,69 100,21	13,54 99,91	25,45 101,24	28,93 101,46
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,22 106,87	9,04 101,91	3,56 107,34	7,00 104,85	13,78 101,68	25,89 102,99	29,36 102,95
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	0,82 0,59	2,20 1,84	1,75 1,48				
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,33 116,47	9,01 101,59	3,65 110,08	7,01 104,99	13,83 102,06	26,19 104,20	30,06 105,40
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,18 -2,10	2,03 -3,45	4,64 -2,20	4,03 -6,27	-2,33 -8,01	-28,58 -26,02	-27,65 -44,13
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,13 2,95	29,38 23,91	14,14 7,30	29,69 19,39	27,48 21,80	48,69 51,25	105,39 88,92
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	2,41	11,02	9,01	11,89	10,23	3,90	94,98

## 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.	7,50	5,55	2,17	1,59	4,55	6,46	78,51
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,28 0,81	3,69 -1,78	9,14 2,31	9,71 -0,59	0,58 -5,10	-0,23 2,32	19,64 3,16
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,61 -0,53	6,04 0,57	7,89 1,06	7,09 -3,21	-3,06 -8,74	-23,36 -20,80	-3,13 -19,61
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,34 1,75	23,84 18,37	11,50 4,66	29,79 19,49	19,05 13,37	28,48 31,04	
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,60 -1,51	13,97 8,50	7,95 1,11	19,98 9,68	6,51 0,83	-25,66 -23,11	-19,23 -35,70
META VALOR FI DE AÇÕES Var. IBRX 100 p.p.	-9,24 -4,24	-7,22 -11,84	0,30 -6,55	-2,69 -12,06	-9,71 -13,87	-19,53 -15,17	-22,53 -38,13
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,77 -0,68	1,34 -4,13	6,76 -0,08	5,41 -4,89	-0,36 -6,04	-5,56 -3,00	7,02 -9,46
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-4,58 0,51	7,74 2,26	3,52 -3,32	11,28 0,98	-0,57 -6,25	-21,03 -18,47	-6,05 -22,53
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	3,77 8,85	13,23 7,75	5,31 -1,53	10,15 -0,15	9,59 3,91	-12,05 -9,49	4,24 -12,23
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-1,98 -2,71	-14,05 -20,96	-2,38 -4,91	-15,61 -18,71	-13,10 -19,45	-31,49 -20,07	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-0,43 -1,16	31,06 24,15	12,53 10,00	20,70 17,61	17,87 11,51	-17,62 -6,20	5,32 -0,22
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,30 0,58	6,09 -0,83	0,49 -2,04	3,91 0,82	9,30 2,95	-10,65 0,77	13,48 7,94
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-4,99 -5,72	21,14 14,22	4,25 1,72	7,99 4,90	-4,03 -10,38	-56,90 -45,48	
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-0,93 -1,66	0,45 -6,47	-2,59 -5,12	-3,09 -6,18	-9,37 -15,72	-40,49 -29,07	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,35 0,58	27,77 20,45	5,56 3,77	13,52 8,63	17,77 6,91	-28,49 -56,26	-20,65 -69,16
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	1,78 -0,19	12,34 1,59	2,94 -1,23	9,24 1,93			
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-0,95 -83,25	23,21 261,77	9,79 294,86	17,81 266,74	23,49 173,31	16,89 67,19	52,40 183,74
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-0,89 -2,86	23,69 12,94	10,02 5,86	18,33 11,02	29,21 20,89	22,85 27,47	62,20 46,35
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,64	-5,07	1,38	0,77	-7,00	15,15	42,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,12	-12,39	-0,41	-4,12	-17,86	-12,61	-6,45
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	0,00 0,00	-98,70 -1.113,15	-98,74 -2.974,84	-98,71 -1.478,25	-98,68 -728,13	-97,03 -386,01	-97,90 -343,31
JACAREÍ Var. IPCA + 4,83% p.p.	-0,14 -0,83	8,89 2,17	3,64 2,07	7,33 2,89	10,28 0,35		
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## 12. Cotação e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotação	Liquidação	Cotação	Liquidação	Performance	Administração
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BB 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		
INDIE FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBX_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro e Julho	1,34
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+1 du	D+1 du	D+6 du		
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Não se aplica	Não se aplica				

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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

13. Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,15	9,05	3,44	6,81	13,74	24,03	26,80	33,22	43,08
IRF-M 1+	0,59	12,99	4,10	11,31	16,04	21,61	17,57	30,08	56,68
IRF-M TOTAL	0,76	11,43	3,81	9,56	14,96	22,06	20,53	31,03	52,86
IMA-B 5	0,61	8,75	2,66	5,76	11,97	23,03	28,90	40,81	61,13
IMA-B 5+	-1,27	14,28	2,80	14,40	15,00	16,66	18,76	24,36	71,86
IMA-B TOTAL	-0,38	11,84	2,83	10,43	13,76	20,07	23,99	32,22	68,62
IMA-GERAL TOTAL	0,63	10,39	3,38	8,50	13,72	22,67	24,97	33,10	54,16
IDKA 2	0,77	8,66	2,75	5,42	11,80	22,33	28,55	41,03	58,78
IDKA 20	-3,05	19,50	3,45	24,26	18,37	10,39	11,16	10,89	77,63
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48	14,44	50,95
IBRX 100	-5,01	4,62	6,85	9,37	4,16	-4,36	15,60	14,31	54,15
IBRX 50	-4,76	3,66	7,43	8,45	4,56	-3,16	18,26	15,68	49,30
SMALL CAP	-7,43	8,13	3,26	17,40	-1,94	-23,76	-10,81	-5,44	42,85
Índice Consumo - ICON	-10,42	-0,75	0,30	6,83	-15,38	-41,83	-41,59	-38,22	-6,46
Índice Dividendos - IDIV	-2,83	9,22	8,71	11,58	10,64	15,38	37,76	32,74	99,45

### 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	1,97	10,75	4,16	7,31	8,32	-4,62	15,85	83,19	84,91

#### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	12,06	6,62	14,40	7,95	16,84	15,48	20,93	50,17

#### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,73	6,92	2,53	3,09	6,36	-11,42	5,54	59,73	56,19

#### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	3,23	0,27	1,83	4,61	13,74	24,75	27,79	32,17
INPC	0,20	2,80	0,01	1,55	4,06	13,24	25,04	28,72	32,95
IGPM	-0,14	-5,28	-2,77	-5,42	-7,20	0,77	32,13	49,34	56,73
SELIC	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

#### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	5,97	1,29	3,88	8,78	23,00	40,28	49,45	60,68
IPCA + 5,00%	0,68	6,64	1,54	4,39	9,82	25,37	44,35	55,27	68,52
IPCA + 5,50%	0,72	6,98	1,66	4,64	10,34	26,57	46,42	58,24	72,56
IPCA + 5,89%	0,75	7,25	1,76	4,84	10,74	27,50	48,05	60,59	75,76
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51	61,26	76,67
INPC + 4,00%	0,56	5,52	1,03	3,59	8,20	22,46	40,61	50,54	61,62
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86	62,43	77,71



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%)	2.194.166,59	5,480000	2.187.164,33	5,690000	-7.002,26
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.072.586,94	5,810000	1.074.544,95	5,690000	1.958,01
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.402.947,24	5,680000	20.820.160,76	5,390000	417.213,52
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.223.219,34	4,860000	2.126.790,20	5,404200	-96.429,14
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.219.575,10	4,880000	2.126.790,20	5,404200	-92.784,90
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.218.723,84	4,910000	2.131.211,80	5,404200	-87.512,04
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.207.962,58	5,196100	2.171.006,21	5,404200	-36.956,37
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.209.034,77	5,290000	2.188.692,61	5,404200	-20.342,16
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.208.117,04	5,320000	2.193.114,21	5,404200	-15.002,83
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.527.867,44	5,670000	1.560.825,24	5,404200	32.957,80
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.062.585,36	5,837000	2.135.633,40	5,404200	73.048,04
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.228.018,98	5,855000	3.347.152,14	5,404200	119.133,16
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.235.903,75	4,970000	2.073.331,43	5,597500	-162.572,32
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.233.170,87	4,980000	2.073.331,43	5,597500	-159.839,44
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.229.039,50	5,030000	2.082.172,92	5,597500	-146.866,58
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.216.303,84	5,285000	2.135.221,92	5,597500	-81.081,92
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.215.387,44	5,340000	2.148.484,16	5,597500	-66.903,28
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.213.868,54	5,380000	2.157.325,66	5,597500	-56.542,88
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.208.670,59	5,831000	5.353.527,41	5,597500	144.856,82
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.151.877,03	5,860000	2.219.216,15	5,597500	67.339,12
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.070.069,05	5,897000	2.144.063,41	5,597500	73.994,36
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.325.011,94	5,915000	6.564.812,72	5,597500	239.800,78
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.064.063,82	5,922000	2.144.063,41	5,597500	79.999,59
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.639.761,37	6,140000	4.942.397,73	5,597500	302.636,36
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.657.169,21	6,256000	3.947.729,13	5,597500	290.559,92
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.079.483,62	6,280000	3.333.244,98	5,597500	253.761,36
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.099.099,44	6,400000	2.303.210,39	5,597500	204.110,95
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.241.070,87	5,000000	2.047.566,58	5,627600	-193.504,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.236.015,98	5,030000	2.052.008,15	5,627600	-184.007,83
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.230.987,10	5,060000	2.056.449,73	5,627600	-174.537,37
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.219.430,87	5,315000	2.123.073,37	5,627600	-96.357,50
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.220.406,22	5,370000	2.140.839,68	5,627600	-79.566,54
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.218.320,53	5,420000	2.154.164,40	5,627600	-64.156,13
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.209.589,60	5,520000	2.176.372,28	5,627600	-33.217,32
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.467.797,34	5,831200	11.796.826,10	5,627600	329.028,76
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.150.311,55	5,860000	2.220.788,05	5,627600	70.476,50
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.164.566,08	5,897000	5.360.982,34	5,627600	196.416,26
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.066.741,50	5,927000	2.154.164,40	5,627600	87.422,90
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.864.420,10	5,950000	17.633.057,08	5,627600	768.636,98
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.273.991,99	6,140000	9.949.130,44	5,627600	675.138,45
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.351.372,58	6,261000	9.105.230,99	5,627600	753.858,41
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.183.649,24	6,268000	7.839.381,80	5,627600	655.732,56
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.251.695,26	6,400000	5.831.789,41	5,627600	580.094,15
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.161.167,95	5,345000	2.134.175,84	6,772200	-26.992,11
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.192.504,61	5,450000	2.167.136,09	6,772200	-25.368,52
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.150.360,39	5,912000	2.134.175,84	6,772200	-16.184,55
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.191.561,09	5,009000	2.179.506,29	5,220000	-12.054,80
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.193.121,06	5,130000	2.187.970,39	5,220000	-5.150,67
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.193.920,51	5,190000	2.192.202,44	5,220000	-1.718,07
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.197.835,18	5,490000	2.213.362,70	5,220000	15.527,52
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.217.355,39	5,710000	3.258.679,31	5,220000	41.323,92
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.206.048,55	4,850000	2.167.411,94	5,276000	-38.636,61
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.198.157,29	5,125600	2.184.511,83	5,276000	-13.645,46
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.200.612,44	5,240000	2.197.336,76	5,276000	-3.275,68
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.197.883,06	5,270000	2.197.336,76	5,276000	-546,30
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.224.244,02	5,810000	3.296.005,14	5,276000	71.761,12
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.214.550,92	4,860000	2.168.164,64	5,243400	-46.386,28
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.209.652,91	4,900000	2.168.164,64	5,243400	-41.488,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.202.010,23	5,178300	2.194.130,69	5,243400	-7.879,54
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.203.884,61	5,270000	2.207.113,71	5,243400	3.229,10
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.204.564,76	5,300000	2.211.441,38	5,243400	6.876,62
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.468.214,88	5,460000	3.509.743,56	5,243400	41.528,68
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.201.821,51	5,500000	2.233.079,75	5,243400	31.258,24
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.226.032,87	5,835000	3.332.308,93	5,243400	106.276,06
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.230.611,26	4,950000	2.106.243,60	5,492000	-124.367,66
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.221.217,57	4,970000	2.101.864,72	5,492000	-119.352,85
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.223.197,16	5,020000	2.115.001,37	5,492000	-108.195,79
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.213.336,44	5,274000	2.163.169,11	5,492000	-50.167,33
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.213.868,74	5,310000	2.171.926,88	5,492000	-41.941,86
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.211.116,10	5,360000	2.180.684,64	5,492000	-30.431,46
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.065.810,58	5,837000	2.141.274,68	5,492000	75.464,10
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.225.787,98	5,855000	3.349.846,89	5,492000	124.058,91
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.042.407,11	6,220000	3.279.784,74	5,492000	237.377,63
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.243.269,71	4,940000	2.040.356,96	5,636800	-202.912,75
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.240.354,30	4,980000	2.049.076,43	5,636800	-191.277,87
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.235.792,72	5,010000	2.053.436,17	5,636800	-182.356,55
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.229.704,11	5,045000	2.057.795,91	5,636800	-171.908,20
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.218.299,77	5,295500	2.118.832,23	5,636800	-99.467,54
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.217.067,14	5,360000	2.136.271,17	5,636800	-80.795,97
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.215.616,80	5,410000	2.149.350,39	5,636800	-66.266,41
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.208.193,64	5,510000	2.171.149,07	5,636800	-37.044,57
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.337.176,37	5,831200	8.553.804,17	5,636800	216.627,80
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.096.496,09	5,897000	3.204.406,76	5,636800	107.910,67
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.066.280,10	5,921000	2.144.990,65	5,636800	78.710,55
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.263.171,44	5,950000	11.736.412,25	5,636800	473.240,81
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.695.354,57	6,140000	7.149.968,83	5,636800	454.614,26
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.575.629,86	6,261000	6.046.955,35	5,636800	471.325,49
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.126.370,01	6,278000	5.571.744,00	5,636800	445.373,99

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.057.153,01	6,400000	3.374.436,51	5,636800	317.283,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

14. Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
241	01/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	99.757,34	418,40205584	238,4245933000
242	01/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	905.242,66	3.796,76713493	238,4245933000
243	01/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	42.000,00	0,00	176,15632439	238,4245933000
255	01/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	12,58259460	238,4245933000
256	03/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	15.000,00	62,84261648	238,6915256000
244	07/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	293.000,00	0,00	1.226,16160479	238,9570827000
257	08/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	12,54746682	239,0920848000
245	10/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	23.706,96	99,04255322	239,3613576000
246	10/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	688.632,33	2.876,95698631	239,3613576000
247	10/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	42.165,01	176,15629533	239,3613576000
248	10/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	293.495,70	1.226,16157822	239,3613576000
249	10/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	199.000,00	0,00	831,37897443	239,3613576000
258	10/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	50.000,00	208,88918956	239,3613576000
259	14/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	38.000,00	158,53255399	239,6984029000
250	15/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	3.857.000,00	0,00	16.082,06040062	239,8324533000
260	15/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	17.000,00	70,88281743	239,8324533000
261	18/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	14.000,00	58,27629660	240,2348951000
262	21/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	12,48086948	240,3678689000
263	22/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	6.000,00	24,94807530	240,4995146000
264	24/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,15373070	240,7474323000
251	25/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	12,45443849	240,8779811000
265	25/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	114.000,00	473,26866275	240,8779811000
271	25/08/2023	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	0,00	198,95	2.331,00000000	0,0853471700
252	28/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	302.000,00	0,00	1.253,04718254	241,0124728000
266	28/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	10.000,00	41,49162856	241,0124728000
267	29/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	91.000,00	377,36433107	241,1462677000
253	30/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	7.839.000,00	0,00	32.489,77636179	241,2758990000
268	30/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	34.308,32	142,19538770	241,2758990000

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
269	30/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	6.691,68	27,73455628	241,2758990000
254	31/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	7.377.000,00	30.552,28208559	241,4549584000
270	31/08/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	349.500,00	0,00	1.447,47493411	241,4549584000
<b>Total</b>			<b>12.881.500,00</b>	<b>9.839.198,95</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**15. Análise de Risco**

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

Value-At-Risk (R\$): 9.802.579,42

Value-At-Risk: 1,44%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
JACAREÍ		1,44	1,44			681.719.599,70	100,00

**Renda Fixa**

Value-At-Risk: 0,24%

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%)		0,10	0,00	0,11			2.194.166,59	0,32
NTN-B 150525 (5,810000%)		0,10	0,00	0,11			1.072.586,94	0,16
NTN-B 150533 (5,680000%)		0,23	-0,00	0,25			20.402.947,24	2,99
NTN-B 150535 (4,860000%)		0,10	0,00	0,11			2.223.219,34	0,33
NTN-B 150535 (4,880000%)		0,10	0,00	0,11			2.219.575,10	0,33
NTN-B 150535 (4,910000%)		0,10	0,00	0,11			2.218.723,84	0,33
NTN-B 150535 (5,196100%)		0,10	0,00	0,11			2.207.962,58	0,32
NTN-B 150535 (5,290000%)		0,10	0,00	0,11			2.209.034,77	0,32
NTN-B 150535 (5,320000%)		0,10	0,00	0,11			2.208.117,04	0,32
NTN-B 150535 (5,670000%)		0,22	-0,00	0,25			1.527.867,44	0,22
NTN-B 150535 (5,837000%)		0,10	0,00	0,11			2.062.585,36	0,30
NTN-B 150535 (5,855000%)		0,10	0,00	0,11			3.228.018,98	0,47
NTN-B 150545 (4,970000%)		0,10	0,00	0,11			2.235.903,75	0,33
NTN-B 150545 (4,980000%)		0,10	0,00	0,11			2.233.170,87	0,33
NTN-B 150545 (5,030000%)		0,10	0,00	0,11			2.229.039,50	0,33
NTN-B 150545 (5,285000%)		0,10	0,00	0,11			2.216.303,84	0,33
NTN-B 150545 (5,340000%)		0,10	0,00	0,11			2.215.387,44	0,32
NTN-B 150545 (5,380000%)		0,10	0,00	0,11			2.213.868,54	0,32
NTN-B 150545 (5,831000%)		0,10	0,00	0,11			5.208.670,59	0,76
NTN-B 150545 (5,860000%)		0,10	0,00	0,11			2.151.877,03	0,32

**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%)		0,10	0,00	0,11			2.070.069,05	0,30
NTN-B 150545 (5,915000%)		0,10	0,00	0,11			6.325.011,94	0,93
NTN-B 150545 (5,922000%)		0,10	0,00	0,11			2.064.063,82	0,30
NTN-B 150545 (6,140000%)		0,10	0,00	0,11			4.639.761,37	0,68
NTN-B 150545 (6,256000%)		0,10	0,00	0,11			3.657.169,21	0,54
NTN-B 150545 (6,280000%)		0,10	0,00	0,11			3.079.483,62	0,45
NTN-B 150545 (6,400000%)		0,10	0,00	0,11			2.099.099,44	0,31
NTN-B 150555 (5,000000%)		0,10	0,00	0,11			2.241.070,87	0,33
NTN-B 150555 (5,030000%)		0,10	0,00	0,11			2.236.015,98	0,33
NTN-B 150555 (5,060000%)		0,10	0,00	0,11			2.230.987,10	0,33
NTN-B 150555 (5,315000%)		0,10	0,00	0,11			2.219.430,87	0,33
NTN-B 150555 (5,370000%)		0,10	0,00	0,11			2.220.406,22	0,33
NTN-B 150555 (5,420000%)		0,10	0,00	0,11			2.218.320,53	0,33
NTN-B 150555 (5,520000%)		0,10	0,00	0,11			2.209.589,60	0,32
NTN-B 150555 (5,831200%)		0,10	0,00	0,11			11.467.797,34	1,68
NTN-B 150555 (5,860000%)		0,10	0,00	0,11			2.150.311,55	0,32
NTN-B 150555 (5,897000%)		0,10	0,00	0,11			5.164.566,08	0,76
NTN-B 150555 (5,927000%)		0,10	0,00	0,11			2.066.741,50	0,30
NTN-B 150555 (5,950000%)		0,10	0,00	0,11			16.864.420,10	2,47
NTN-B 150555 (6,140000%)		0,10	0,00	0,11			9.273.991,99	1,36
NTN-B 150555 (6,261000%)		0,10	0,00	0,11			8.351.372,58	1,23
NTN-B 150555 (6,268000%)		0,10	0,00	0,11			7.183.649,24	1,05
NTN-B 150555 (6,400000%)		0,10	0,00	0,11			5.251.695,26	0,77
NTN-B 150824 (5,345000%)		0,10	0,00	0,11			2.161.167,95	0,32
NTN-B 150824 (5,450000%)		0,10	0,00	0,11			2.192.504,61	0,32
NTN-B 150824 (5,912000%)		0,10	0,00	0,11			2.150.360,39	0,32
NTN-B 150826 (5,009000%)		0,10	0,00	0,11			2.191.561,09	0,32
NTN-B 150826 (5,130000%)		0,10	0,00	0,11			2.193.121,06	0,32
NTN-B 150826 (5,190000%)		0,10	0,00	0,11			2.193.920,51	0,32
NTN-B 150826 (5,490000%)		0,10	0,00	0,11			2.197.835,18	0,32



**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%)		0,10	0,00	0,11			3.217.355,39	0,47
NTN-B 150828 (4,850000%)		0,10	0,00	0,11			2.206.048,55	0,32
NTN-B 150828 (5,125600%)		0,10	0,00	0,11			2.198.157,29	0,32
NTN-B 150828 (5,240000%)		0,10	0,00	0,11			2.200.612,44	0,32
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,10	0,00	0,11			2.197.883,06	0,32
NTN-B 150828 (5,810000%)		0,10	0,00	0,11			3.224.244,02	0,47
NTN-B 150830 (4,860000%)		0,10	0,00	0,11			2.214.550,92	0,32
NTN-B 150830 (4,900000%)		0,10	0,00	0,11			2.209.652,91	0,32
NTN-B 150830 (5,178300%)		0,10	0,00	0,11			2.202.010,23	0,32
NTN-B 150830 (5,270000%)		0,10	0,00	0,11			2.203.884,61	0,32
NTN-B 150830 (5,300000%)		0,10	0,00	0,11			2.204.564,76	0,32
NTN-B 150830 (5,460000%)		0,10	0,00	0,11			3.468.214,88	0,51
NTN-B 150830 (5,500000%)		0,10	0,00	0,11			2.201.821,51	0,32
NTN-B 150830 (5,835000%)		0,10	0,00	0,11			3.226.032,87	0,47
NTN-B 150840 (4,950000%)		0,10	0,00	0,11			2.230.611,26	0,33
NTN-B 150840 (4,970000%)		0,10	0,00	0,11			2.221.217,57	0,33
NTN-B 150840 (5,020000%)		0,10	0,00	0,11			2.223.197,16	0,33
NTN-B 150840 (5,274000%)		0,10	0,00	0,11			2.213.336,44	0,32
NTN-B 150840 (5,310000%)		0,10	0,00	0,11			2.213.868,74	0,32
NTN-B 150840 (5,360000%)		0,10	0,00	0,11			2.211.116,10	0,32
NTN-B 150840 (5,837000%)		0,10	0,00	0,11			2.065.810,58	0,30
NTN-B 150840 (5,855000%)		0,10	0,00	0,11			3.225.787,98	0,47
NTN-B 150840 (6,220000%)		0,10	0,00	0,11			3.042.407,11	0,45
NTN-B 150850 (4,940000%)		0,10	0,00	0,11			2.243.269,71	0,33
NTN-B 150850 (4,980000%)		0,10	0,00	0,11			2.240.354,30	0,33
NTN-B 150850 (5,010000%)		0,10	0,00	0,11			2.235.792,72	0,33
NTN-B 150850 (5,045000%)		0,10	0,00	0,11			2.229.704,11	0,33
NTN-B 150850 (5,295500%)		0,10	0,00	0,11			2.218.299,77	0,33
NTN-B 150850 (5,360000%)		0,10	0,00	0,11			2.217.067,14	0,33
NTN-B 150850 (5,410000%)		0,10	0,00	0,11			2.215.616,80	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%)		0,10	0,00	0,11			2.208.193,64	0,32
NTN-B 150850 (5,831200%)		0,10	0,00	0,11			8.337.176,37	1,22
NTN-B 150850 (5,897000%)		0,10	0,00	0,11			3.096.496,09	0,45
NTN-B 150850 (5,921000%)		0,10	0,00	0,11			2.066.280,10	0,30
NTN-B 150850 (5,950000%)		0,10	0,00	0,11			11.263.171,44	1,65
NTN-B 150850 (6,140000%)		0,10	0,00	0,11			6.695.354,57	0,98
NTN-B 150850 (6,261000%)		0,10	0,00	0,11			5.575.629,86	0,82
NTN-B 150850 (6,278000%)		0,10	0,00	0,11			5.126.370,01	0,75
NTN-B 150850 (6,400000%)		0,10	0,00	0,11			3.057.153,01	0,45
<b>Sub-total</b>	0,19	0,09	0,00		-2,17	0,73	306.892.838,85	45,02

## 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		1,86	0,02	0,05			21.089.826,29	3,09
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,87	0,04	0,05			20.991.944,89	3,08
<b>Sub-total</b>	4,61	2,36	0,06		-0,43	-0,83	42.081.771,18	6,17

## 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		1,79	0,00	1,78			5.109.984,00	0,75
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			20.446.382,29	3,00
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			20.858.341,22	3,06
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,03	-0,00	0,03			31.528.354,26	4,62
<b>Sub-total</b>	0,23	0,12	0,00		0,35	1,22	77.943.061,77	11,43

## 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 - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a		0,14	-0,00	0,17			5.114.120,06	0,75
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a		0,15	0,00	0,18			5.120.481,64	0,75
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a		0,14	0,00	0,17			5.116.021,92	0,75

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		0,11	0,00	0,15			5.456.442,26	0,80
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a		0,14	-0,00	0,17			5.111.122,37	0,75
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a		0,10	0,00	0,11			5.965.463,80	0,88
<b>Sub-total</b>	0,38	0,11	0,00		-1,09	0,72	31.883.652,05	4,68

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		4,92	0,00	4,92			12.287,35	0,00
<b>Sub-total</b>	50,16	4,92	0,00		0,30	16,36	12.287,35	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			3.385.708,49	0,50
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,11	-0,00	0,11			5.842.017,78	0,86
<b>Sub-total</b>	0,14	0,07	-0,00		2,27	1,45	9.227.726,27	1,35

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,55%

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		9,08	0,04	5,35			4.342.703,12	0,64
META VALOR FI DE AÇÕES		9,18	0,02	3,90			2.108.083,23	0,31
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		9,47	0,08	5,04			7.379.538,98	1,08
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,58	0,05	3,74			4.993.635,20	0,73
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		8,09	0,20	3,01			21.423.026,54	3,14
OCCAM FIC FIA		7,88	0,28	1,63			29.588.803,90	4,34
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		9,08	0,06	5,03			5.895.908,42	0,86
INDIE FIC FIA		8,87	0,04	4,65			3.654.490,88	0,54

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
TARPON GT 30 FIC FIA		7,91	0,07	6,45			8.729.617,49	1,28
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA		9,03	0,06	7,30			7.153.568,51	1,05
<b>Sub-total</b>	13,16	7,55	0,91		-0,43	-4,48	95.269.376,27	13,97

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,11%

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		8,14	0,02	10,50			7.579.964,73	1,11
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		5,50	0,11	5,50			18.663.999,97	2,74
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		5,51	0,18	5,30			31.049.177,09	4,55
<b>Sub-total</b>	9,99	4,92	0,31		-0,17	-0,57	57.293.141,79	8,40

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		0,06	0,00	0,13			11.297.069,71	1,66
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
<b>Sub-total</b>	2,12	0,06	0,00		-0,23	0,64	11.297.069,71	1,66

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,55%

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		8,29	0,12	7,01			15.771.426,14	2,31
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		12,01	0,01	10,89			1.877.242,31	0,28
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,81	-0,00	8,32			2.424.504,78	0,36
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,73	-0,00	8,66			2.454.514,44	0,36
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA		9,25	-0,00	9,25			2.741.336,42	0,40

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
INVESTIMENTO NO EXTERIOR								
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		7,90	-0,01	7,78			5.258.889,96	0,77
<b>Sub-total</b>	13,19	5,80	0,11		-0,12	-0,44	30.527.914,05	4,48

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		6,69	0,04	11,00			19.290.760,41	2,83
<b>Sub-total</b>	15,57	6,69	0,04		0,17	3,77	19.290.760,41	2,83

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**16. Relatório de Cenário Macroeconômico**

No mês de agosto, no cenário internacional, os juros globais tiveram alta, especialmente os mais longos, seguindo a expectativa de que a atividade econômica mais resiliente nos EUA possa resultar em taxas de juros mais altas por mais tempo. Nos EUA, os dados mostram uma economia sólida, avançando além do esperado, sugerindo que a alta das taxas de juros até agora vem tendo efeito menos restritivo que o previsto. O mercado de trabalho segue aquecido, ainda que em trajetória de desaceleração. Esse ambiente aponta para uma chance menor de recessão. Ainda nos EUA, não houve alteração relevante nas expectativas para a política monetária. É provável que o FED tenha encerrado o ciclo de alta dos juros, com a taxa seguindo em 5,5%, ainda que um ajuste residual seja possível. Ao longo do ano de 2024, espera-se o início de um movimento de redução dos juros, que deve ocorrer de forma suave. Na zona do euro, os dados econômicos seguem demonstrando sinais de fraquezas no lado da atividade, mas ainda exibe uma inflação resiliente, com destaque para desaceleração mais forte do crédito e acomodação da expectativa de crescimento, entretanto, ainda apresenta um fraco desempenho na Alemanha. A China tem realizado esforços para conter a desaceleração do setor de construção civil, que apresenta graves problemas de excesso de oferta, falta de demanda e dificuldades financeiras das empresas. O desempenho do setor será fundamental para ditar os rumos da economia chinesa, com repercussões importantes nos mercados emergentes. Nesse ambiente, a China deverá continuar crescendo abaixo do potencial. Assim, no mês de agosto de 2023, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território negativo, acompanhando o movimento de alta das curvas de juros, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, desvalorizaram -2,96% e -1,77%, 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 +11,91% e +13,97%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +0,73% e +1,97%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +6,36% e +8,32% nos últimos 12 meses.

Localmente, as curvas de juros tiveram alta, acompanhando o movimento do exterior. O mercado passou a refletir expectativas de queda de juros em um ritmo mais lento que o esperado. Assim, o Ibovespa teve retornos negativos, com queda mais acentuada que a das Bolsas globais. O PIB voltou a surpreender favoravelmente no segundo trimestre, superando as expectativas, com contribuição positiva dos setores industrial e de serviços, reforçando a percepção de uma economia resiliente. O setor agropecuário mostrou leve queda, após uma performance forte no primeiro trimestre, quando havia sido o principal fator impulsionando o crescimento naquele período. A inflação continua seguindo em uma direção mais construtiva. O núcleo do IPCA vem passando por desaceleração, com efeito benigno dos preços de bens, enquanto a inflação de serviços passa por descompressão mais gradual. Espera-se uma continuidade desse movimento nos próximos meses, ainda que num ritmo gradual. 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% e a sinalização de que este ritmo deverá ser mantido nas próximas reuniões. O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo a direção dos índices globais. Apresentando um retorno negativo de -5,09% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +5,47% e de +5,68% nos últimos 12 meses.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**17. Agenda realizada**

01 de agosto:

11h00: Reunião com a gestora QLZ MOS através de seus representantes, Aline Fujitani, Fernando Guilguer e Fernando Fanchin. O objetivo da reunião foi a apresentação institucional da gestora, visão geral, apresentação de rating e dos fundos de renda fixa e variável elegíveis para aplicações de RPPS. Participou da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina, Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos e Rossana Vasques, presidente do IPMJ.

02 de agosto:

14h00: Reunião com a gestora Santander Asset Management através de seu representante Jorge Giordano. O objetivo da reunião foi apresentar uma visão geral do mercado e dos fundos de renda fixa e variável. Participou da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina, Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos e Rossana Vasques, presidente do IPMJ.

09 a 11 de agosto:

XVI Encontro Temático Jurídico e Financeiro da APEPREM realizado na cidade de Água de Lindóia. Participaram do evento representantes do Comitê de Investimentos, Conselho Fiscal e Conselho Deliberativo do IPMJ.

14 de agosto:

08h30 às 17h30: Curso de capacitação de conselheiros e membros do Comitê de Investimentos na cidade de São José dos Campos através da Dolar Bills Educacional. Participaram do curso Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Danielle de Paula – Conselheira Deliberativa e Julia Victoria Jesus Simões – estagiária do IPMJ.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

16 de agosto:

9h00: Tricentésima nonagésima (390ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros (CAIF) do Instituto de Previdência do Município de Jacareí (IPMJ), ocorrida em 16 de agosto de 2023, tendo início às 9h15 em formato presencial na sala de reuniões do IPMJ, com as seguintes presenças: Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo 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. Participaram da reunião os estagiários Julia Victoria Jesus Simões e Mario Ariel Montoya Córdova. Pautas da reunião: 1) Análise do relatório de investimentos de julho de 2023; 2) Análise da carteira fechada de julho de 2023; 3) Reunião com a XP Investimentos e a Gestora de fundos Alaska Asset Management; 4) Assuntos diversos.

18 de agosto:

10h00: Reunião com a gestora Western Asset Management através de seus representantes Elder Andrade e Gian Pacífico através da plataforma *Microsoft Teams meeting*. O objetivo da reunião foi a apresentação institucional da gestora, visão geral do mercado, apresentação de fundos de renda fixa, variável e BDRs elegíveis para aplicações de RPPS. Participaram da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina, Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos e os estagiários Julia Victoria Jesus Simões e Mario Ariel Montoya Córdova.

22 de agosto:

14h00: Reunião com a distribuidora de fundos Privatiza Investimentos através de seus representantes Ubirajara Macieira e José França. O objetivo da reunião foi apresentar gestora AZQUEST – BAYES CAPITAL representado presencialmente pelo gestor Marcello Paixão. O propósito da reunião foi a apresentação do fundo AZQUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FIA, bem como apresentar estratégias de diversificação de portfólio com fundos quantitativos. Participaram da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina, Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos e e Rossana Vasques, presidente do IPMJ.

24 de agosto:

10h00: Reunião com a gestora Banestes DTVM Investimentos através de seus representantes Glaucio Almeida, Luiz Carlos Piona e Brunella Marcarini, de forma *on-line*. O objetivo da reunião foi a apresentação institucional da gestora capixaba e uma visão geral do mercado, ofertando opções de aplicações aos RPPS. Participou da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina - Gestor dos Recursos.



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

25 de agosto:

10h00: Reunião com a gestora OCEANA Investimentos através de seus representantes Daniel Tavares e Jose Luiz. O objetivo da reunião foi a apresentação institucional da gestora, visão geral de mercado e apresentação do fundo Oceana Valor 30 FIC FIA. Participou da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina - Gestor dos Recursos.

30 de agosto:

9h00: Tricentésima nonagésima primeira (391ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, ocorrida em 30 de agosto de 2023, tendo início às 9h10, com as seguintes presenças dos membros do CAIF na sala de reuniões do IPMJ: Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Clévio Vitor de Almeida e José Ricardo Vinhas. Ausências justificadas de Victor Adriano Vieira Silva e Rafaela Carvalho dos Santos. Pautas da reunião: 1) Análise parcial da carteira até 28/08/2023; 2) Apresentação de Estudos; 3) Reunião com gestores do Pátria Investimentos LTDA; 4) Credenciamentos; 5) Assuntos Diversos.

19h00: Reunião com a corretora BGC Partners na cidade de São Paulo. O objetivo da reunião foi a apresentação institucional da gestora Dahlia Investimentos, visão geral de mercado e apresentação da equipe de investimentos da gestora. Participaram da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina - Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Fabíola de Melo Silva, Assessora da Presidente e Rossana Vasques, presidente do IPMJ.

31 de agosto:

XP Expert Institucional: Evento realizado na cidade de São Paulo com a participação de várias gestoras.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Em agosto de 2023, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um prejuízo de R\$ 447.872,73 (quatrocentos e quarenta e sete mil e oitocentos e setenta e dois reais e setenta e três centavos negativos) e um rendimento negativo acumulado, R\$ 1.397.048,38 (um milhão e trezentos e noventa e sete mil e quarenta e oito reais e trinta e oito 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 agosto de 2023 é de R\$ 12.287,35 (doze mil e duzentos e oitenta e sete reais e trinta e cinco centavos).

**II. PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP**

Foi realizado no dia 30 de agosto de 2023 uma reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros do Instituto de Previdência do Município de Jacaréí referente ao comunicado de liquidação do fundo, bem como o termo de encerramento datado em 25/08/2023. O documento enviado teve o objetivo de comunicar aos cotistas do referido fundo, gerido pelo Pátria Investimentos Ltda., bem como de seus veículos investidores, a respeito do andamento do processo de liquidação e encerramento dos Fundos. Conforme informado em Comunicado aos Investidores, em 19 de julho de 2023, foi concluído o desinvestimento dos ativos remanescentes da carteira dos Fundos, viabilizando assim a sua liquidação. Nesse sentido, em 25 de agosto de 2023 foi firmado o Termo de Encerramento do Fundo e estão sendo tomadas as medidas formais subsequentes para finalização do processo de liquidação, como a auditoria de encerramento. Em resumo a reunião informou que em 2011 a tese de Shopping Centers (Pátria Special Opportunities I) foi embasada nos seguintes pilares: 1 - em ser o primeiro entrante de shoppings em cidades secundárias do Brasil; 2 - crescimento da classe média, diminuição do desemprego e disponibilidade de crédito; 3 - mercado fragmentado, expansão das redes de varejo. A partir de 2016 houve um período de recessão econômica no país o que ocasionou aumento nas taxas de juros, queda na atividade econômica, atraso na maturação dos Shoppings e por fim uma crescente alavancagem. Em 2020 com o início da pandemia do Covid-19 e o fechamento dos shoppings a partir de março, houve extrema necessidade de caixa, carências de descontos e inadimplência da base de lojistas o que acabou dificultando ainda mais a recuperação da estratégia. Já no ano de 2021 com a segunda onda da pandemia, os shoppings precisaram ser novamente fechados, ocasionando maior atraso na maturação, aumento substancial de consumo de caixa e alta crescente da taxa básica de juros brasileira. Com todo histórico informado a gestora decidiu pela conclusão do desinvestimento através da modalidade "porteira fechada", transferindo todos os ativos, passivos e obrigações. José Augusto Teixeira, gestor representante, reconheceu em nome da gestora Pátria Investimentos LTDA., que a tese em questão foi errada, tendo em vista uma estratégia monoestrutural, algo que nunca mais foi desenvolvida ao longo dos anos pela gestora. Se colocou à disposição para dirimir todas as dúvidas tanto de órgãos internos e externos de fiscalização, sempre destacando a idoneidade da gestora. O IPMJ aportou R\$ 2.823.363,14 (dois milhões e oitocentos e vinte e três mil e trezentos e sessenta e três reais e quatorze centavos). O saldo do fundo em 31 de agosto de 2023 foi de R\$ 0,00, tornando-o liquidado. Importante ressaltar que não há garantia de que quaisquer investimentos ou eventos futuros ocorrerão. Não há garantia de que ao realizar uma aplicação o fundo apresentado, se constituído, conseguirá implementar suas estratégias ou atingirá seus objetivos de investimento e que a rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros. Salientou-se também que houve acompanhamento próximo do Comitê de Investimentos desde o início de sua aplicação através de relatórios, atualizações de credenciamentos com ressalvas e práticas de diligência conforme a Resolução 3.922/2010 e demais atualizações. Insta frisar que os fundos de investimento em participações (FIP) são constituídos sob a forma de condomínio fechado, vedada a subscrição em distribuições de cotas subsequentes, salvo se para manter a mesma proporção já investida nesses fundos. Ademais, seus regimentos são diferentes de um fundo convencional de renda fixa ou renda variável, onde é possível resgatar a qualquer tempo. O IPMJ observou que o

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

fundo de investimento era qualificado como entidade de investimento, conforme regulamentação específica da Comissão de Valores Mobiliários, que o regulamento do fundo, constatou sobre o valor justo dos ativos investidos pelo fundo, inclusive os que foram objeto de integralização de cotas, levando em consideração os laudos de avaliação elaborado por auditores independentes ou analistas de valores mobiliários autorizados pela Comissão de Valores Mobiliários. Não foi cobrado de taxa de performance dos gestores do fundo.

Foi constatado que gestor do fundo de investimento e a gestoras Pátria Investimentos LTDA. estava sob a condição de cotista do fundo em percentual conforme estabelecido na Resolução vigente, não recebendo preferência, privilégio ou tratamento diferenciado de qualquer natureza em relação aos demais cotistas. Verificou-se também que a empresa investida pelo fundo demonstrou os balanços financeiros auditados por auditor independente e registrado na Comissão de Valores Mobiliários e publicadas anualmente e não foi identificado preferência, privilégio ou tratamento diferenciado de qualquer natureza ao gestor ou pessoas ligadas em relação aos demais cotistas. Por fim, conforme constatado em documentos apresentados pela gestora, foi comprovado que o gestor do fundo já realizou, nos últimos 35 anos, desinvestimentos integrais de, pelo menos, 3 (três) sociedades investidas no Brasil por meio de fundo de investimento em participações, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos em seus respectivos regulamentos.

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

O Fundo KINEA PRIVATE EQUITY apresenta um valor total aplicado de R\$ 9.095.886,00 (nove milhões e noventa e cinco mil e oitocentos e oitenta e seis reais), e um rendimento acumulado de R\$ 2.608.809,53 (dois milhões e seiscentos e oito mil e oitocentos e nove reais e cinquenta e três centavos). O saldo acumulado em 31 de agosto de 2023 é de R\$ 11.297.069,71 (onze milhões e duzentos e noventa e sete mil e sessenta e nove reais e setenta e um centavos) com um rendimento no mês de agosto de R\$ 72.282,37 (setenta e dois mil e duzentos e oitenta e dois reais e trinta e sete centavos).