



LDB
EMPRESAS

JACAREÍ
SETEMBRO 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
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	53
19. Fundos Estruturados	53

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 setembro 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



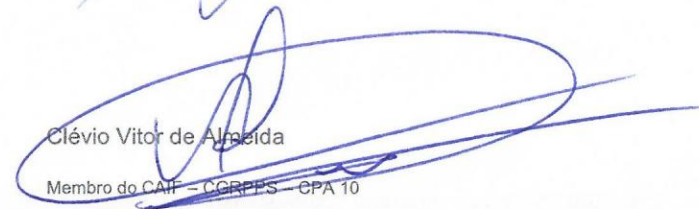
Amauri Arnaldo Junior

Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos – CPA 10



Luis Gustavo Ferreira Bonacina

Assessor da Presidência – CPA 20



Clévio Vitor de Almeida

Membro do CAIF – CCRPPS – CPA 10



Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do CAIF

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**

José Ricardo Vinhas

Membro do CAIF

2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 25 dias do mês de outubro 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 setembro 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 setembro de 2023.

Jacareí, 25 de outubro 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

68,95%

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%)	0,37	0,04	0,67	8,03	2.208.947,24	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,37	0,04	0,70	8,28	1.080.079,93	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,680000%)	4,03	0,05	0,69	2,73	20.543.438,50	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,41	0,03	0,63	7,56	2.237.148,91	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,41	0,03	0,63	7,57	2.233.513,58	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,41	0,03	0,63	7,59	2.232.707,70	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,41	0,04	0,65	7,81	2.222.358,93	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,41	0,04	0,66	7,88	2.223.596,71	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,41	0,04	0,66	7,91	2.222.723,83	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,670000%)	4,01	0,05	0,69	2,73	1.538.377,14	0,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,41	0,04	0,70	8,30	2.077.036,28	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,41	0,04	0,70	8,32	3.250.678,17	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,41	0,04	0,63	7,64	2.250.100,22	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,41	0,04	0,64	7,65	2.247.364,45	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,41	0,04	0,64	7,69	2.243.292,91	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%)	0,41	0,04	0,66	7,88	2.230.906,02	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,41	0,04	0,66	7,92	2.230.074,10	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,41	0,04	0,67	7,95	2.228.613,52	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,41	0,04	0,70	8,30	5.245.135,67	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,41	0,04	0,70	8,32	2.166.991,57	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	0,37	0,04	0,71	8,35	2.084.665,66	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,41	0,04	0,71	8,36	6.369.690,26	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,41	0,04	0,71	8,37	2.078.657,58	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	0,37	0,04	0,72	8,53	4.673.331,30	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,42	0,04	0,73	8,62	3.683.947,06	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,280000%)	3,03	0,04	0,73	6,56	3.102.088,07	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	3,07	0,04	0,74	8,73	2.114.696,97	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,000000%)	0,41	0,04	0,64	7,66	2.255.350,56	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,41	0,04	0,64	7,69	2.250.315,44	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,41	0,04	0,64	7,71	2.245.304,53	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,41	0,04	0,66	7,90	2.234.103,16	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,41	0,04	0,67	7,95	2.235.177,59	0,33
TESOURO	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,42	0,04	0,67	7,98	2.233.162,46	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%)	0,42	0,04	0,68	8,06	2.224.538,60	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,41	0,04	0,70	8,30	11.548.092,02	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,41	0,04	0,70	8,32	2.165.412,30	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	0,37	0,04	0,71	8,35	5.200.984,07	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,41	0,04	0,71	8,37	2.081.360,01	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,41	0,04	0,71	8,39	16.983.998,66	2,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	0,37	0,04	0,72	8,53	9.341.085,58	1,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,42	0,04	0,73	8,63	8.412.548,16	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,268000%)	3,04	0,04	0,73	6,55	7.236.310,66	1,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	3,09	0,04	0,74	8,73	5.290.712,28	0,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,43	0,04	0,66	7,93	2.175.504,63	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,450000%)	0,42	0,04	0,67	8,01	2.207.223,38	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,42	0,04	0,71	8,36	2.165.546,45	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,41	0,04	0,64	7,67	2.205.539,06	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,42	0,04	0,65	7,76	2.207.311,82	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,42	0,04	0,65	7,81	2.208.216,08	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,42	0,04	0,67	8,04	2.212.655,20	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,710000%)	0,42	0,04	0,69	8,21	3.239.588,41	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,41	0,03	0,63	7,55	2.219.852,07	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,42	0,04	0,65	7,76	2.212.373,44	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,42	0,04	0,66	7,85	2.215.035,28	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,42	0,04	0,66	7,87	2.212.337,48	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,42	0,04	0,70	8,28	3.246.768,37	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,41	0,03	0,63	7,56	2.228.426,54	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,41	0,03	0,63	7,59	2.223.564,12	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,42	0,04	0,65	7,80	2.216.339,73	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,42	0,04	0,66	7,87	2.218.379,04	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,300000%)	0,42	0,04	0,66	7,89	2.219.112,47	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,460000%)	2,85	0,04	0,67	2,65	3.491.523,22	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,42	0,04	0,68	8,04	2.216.686,54	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,835000%)	0,42	0,04	0,70	8,30	3.248.629,01	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,41	0,04	0,63	7,62	2.244.738,66	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,41	0,04	0,63	7,64	2.235.319,71	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,41	0,04	0,64	7,68	2.237.395,94	0,33
TESOURO	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,42	0,04	0,66	7,87	2.227.898,91	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,310000%)	0,42	0,04	0,66	7,90	2.228.495,98	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,42	0,04	0,66	7,94	2.225.808,42	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,42	0,04	0,70	8,30	2.080.284,06	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,42	0,04	0,70	8,32	3.248.431,50	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,43	0,04	0,73	8,59	3.064.599,86	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,41	0,04	0,63	7,62	2.257.460,21	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,41	0,04	0,64	7,65	2.254.593,91	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,41	0,04	0,64	7,67	2.250.055,09	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,42	0,04	0,64	7,70	2.243.987,47	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,42	0,04	0,66	7,89	2.232.931,20	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,42	0,04	0,66	7,94	2.231.801,08	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,42	0,04	0,67	7,98	2.230.424,10	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,510000%)	0,42	0,04	0,68	8,05	2.223.118,21	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,42	0,04	0,70	8,30	8.395.547,42	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	0,37	0,04	0,71	8,35	3.118.330,02	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,42	0,04	0,71	8,37	2.080.887,55	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,42	0,04	0,71	8,39	11.343.035,75	1,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	0,37	0,04	0,72	8,53	6.743.793,28	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,43	0,04	0,73	8,63	5.616.472,46	0,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,278000%)	3,04	0,04	0,73	6,56	5.163.985,99	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	0,37	0,04	0,74	8,73	3.079.867,84	0,45
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,39	0,04	0,69	8,19	309.008.495,32	45,60

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	4,96	0,51	-0,96	-0,53	20.887.982,25	3,08	5.222.821.325,49	0,40
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,64	0,79	-1,96	-2,55	20.581.430,07	3,04	1.516.152.288,42	1,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,64	0,65	-1,46	-1,54	41.469.412,32	6,12		

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	5,14	0,06	0,21	2,41	5.120.643,00	0,76	229.043.752,42	2,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,97	3,22	20.644.708,52	3,05	15.259.689.366,93	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	1,02	10,15	21.070.781,79	3,11	5.816.586.914,15	0,36
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,05	1,02	10,12	28.311.386,02	4,18	2.788.665.794,77	1,02
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,19	0,05	0,95	9,79	75.147.519,33	11,09		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	0,76	0,04	0,77	3,20	5.159.895,90	0,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	0,71	0,07	0,79	3,09	5.154.722,51	0,76		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	0,69	0,04	0,76	3,10	5.155.015,24	0,76		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	10,23	6,71	0,81	9,07	5.500.507,12	0,81		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	0,70	0,07	0,78	3,02	5.150.895,58	0,76		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 7,00% a.a	16,26	12,08	0,78	9,19	6.012.150,34	0,89		
Sub-total Artigo 7º IV			4,78	3,23	0,78	9,04	32.133.186,69	4,74		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLURAL	GENIAL	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	311,15	1.504,61	1.504,61	2.534,71	197.164,17	0,03	6.820.295,90	2,89
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			311,15	1.504,61	1.504,61	2.534,71	197.164,17	0,03		

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	0,04	0,05	1,01	10,16	3.420.015,38	0,50	11.575.339.472,72	0,03
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,49	0,05	1,13	9,96	5.907.802,52	0,87	3.688.052.122,78	0,16
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,55	0,05	1,08	9,67	9.327.817,90	1,38		
Renda Fixa			0,50	0,35	0,59	8,21	467.283.595,73	68,95		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

14,22%

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	26,11	1,18	-4,43	1,34	4.150.215,63	0,61	181.015.079,36	2,29
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	24,38	0,66	-3,69	-10,65	2.030.259,73	0,30	177.644.530,89	1,14
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	23,52	0,84	-3,13	4,37	7.148.615,99	1,05	258.469.727,26	2,77
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	19,99	0,58	0,62	2,66	5.024.774,19	0,74	1.378.543.679,32	0,36
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	18,76	0,53	1,47	5,22	21.738.818,01	3,21	638.055.205,41	3,41
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,50	0,59	0,79	2,14	29.821.164,69	4,40	774.960.951,78	3,85
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	21,89	0,57	1,50	25,70	5.984.406,39	0,88	366.712.423,98	1,63
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	23,86	1,04	1,00	15,12	3.691.165,59	0,54	401.185.094,20	0,92
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	21,52	1,21	7,65	39,29	9.397.866,60	1,39	851.822.609,19	1,10
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,18	0,51	3,02	14,38	7.369.574,27	1,09	241.389.175,71	3,05
Sub-total Artigo 8º I			18,63	0,69	1,14	7,68	96.356.861,09	14,22		
Renda Variável			18,63	0,69	1,14	7,68	96.356.861,09	14,22		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,06%

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	23,18	0,45	-5,72	23,57	14.870.080,26	2,19	219.244.938,37	6,78
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	39,47	2,72	-3,03	17,47	1.820.305,59	0,27	107.698.562,46	1,69
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,50	-0,27	-2,21	-15,94	2.370.991,18	0,35	60.961.663,70	3,89
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,70	0,84	-6,19	-5,77	2.302.563,95	0,34	55.741.231,93	4,13
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,81	2,40	-3,77	22,95	2.637.951,63	0,39	634.297.137,32	0,42
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	22,05	1,53	-2,96	2,95	5.103.100,20	0,75	288.512.148,38	1,77
Sub-total Artigo 9º II			17,89	0,92	-4,66	12,16	29.104.992,81	4,29		

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	20,29	-0,62	-2,80	10,06	18.751.497,87	2,77	693.152.671,17	2,71
Sub-total Artigo 9º III			20,29	-0,62	-2,80	10,06	18.751.497,87	2,77		

Investimentos no Exterior

17,59 0,31 -3,94 11,33 47.856.490,68 7,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,77%

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	14,75	-0,47	-0,75	11,50	7.523.054,19	1,11	50.476.532,56	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	16,95	-0,24	-4,43	17,75	17.837.505,45	2,63	737.074.939,35	2,42
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	17,00	-0,24	-4,39	18,26	29.687.177,00	4,38	499.498.993,21	5,94
Sub-total Artigo 10º I			15,25	-0,27	-3,92	17,13	55.047.736,64	8,12		

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	50,32	-1,50	-1,50	-6,49	11.127.914,40	1,64	358.051.269,19	3,11
Sub-total Artigo 10º II			50,32	-1,50	-1,50	-6,61	11.127.914,40	1,64		

Investimentos Estruturados			15,25	-0,48	-3,52	12,73	66.175.651,04	9,77		
Total			3,55	0,31	-0,08	8,80	677.672.598,57	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

4. Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	309.008.495,32	45,60	0,00	43,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	41.469.412,32	6,12	0,00	5,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	75.147.519,33	11,09	0,00	12,50	40,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	32.133.186,69	4,74	0,00	2,50	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	197.164,17	0,03	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	9.327.817,90	1,38	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	467.283.595,73	68,95					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	96.356.861,09	14,22	0,00	14,50	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	96.356.861,09	14,22					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	29.104.992,81	4,29	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	18.751.497,87	2,77	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	47.856.490,68	7,06					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	55.047.736,64	8,12	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	11.127.914,40	1,64	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	66.175.651,04	9,77					15,00
Total		677.672.598,57	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

5. Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,69 70,73	8,19 82,45	1,90 58,92	4,40 68,04	10,83 80,59	2.115.656,47	24.349.860,91
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,46 -149,30	-1,54 -15,56	-1,54 -47,97	-1,54 -23,88	-1,54 -11,49	-612.358,86	-656.051,68
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,95 97,66	9,79 98,66	3,35 104,07	6,64 102,69	13,34 99,21	730.657,56	9.386.539,86
Artigo 7º IV % do CDI	0,78 80,30	9,04 91,06	2,03 63,05	5,24 80,95	12,19 90,68	249.534,64	1.583.906,01
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	1.504,61 154.369,06	2.534,71 25.531,88	3.397,10 105.505,71	4.593,23 71.027,22	2.706,76 20.134,73	184.876,82	189.680,83
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,08 111,29	9,67 97,44	3,87 120,16	7,24 111,94	13,18 98,06	100.091,63	942.136,55
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,14 0,43	7,68 1,46	0,11 1,40	16,60 2,19	4,76 -1,18	1.087.484,82	7.115.610,44
Artigo 9º II % do CDI	-4,66 -478,21	12,16 122,46	-0,88 -27,22	2,84 43,94	15,17 112,86	-1.422.921,24	3.154.817,63
Artigo 9º III % do CDI	-2,80 -286,81	10,06 101,35	2,42 75,29	4,91 75,91	14,38 106,97	-539.262,54	1.714.259,21
Artigo 10º I % do CDI	-3,92 -402,09	17,13 172,51	-1,49 -46,31	8,14 125,86	28,02 208,42	-2.245.405,15	8.049.243,39
Artigo 10º II % do CDI	-1,50 -153,62	-6,61 -66,54	-0,83 -25,66	-0,38 -5,94	-8,25 -61,36	-169.155,31	-587.557,39
JACAREÍ (Total)						-520.801,16	55.242.445,76

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%)	2.194.166,59	0,00	0,00	0,00	2.208.947,24	14.780,65	167.264,14
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.072.586,94	0,00	0,00	0,00	1.080.079,93	7.492,99	84.152,40
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.402.947,24	0,00	0,00	0,00	20.543.438,50	140.491,26	546.566,07
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.223.219,34	0,00	0,00	0,00	2.237.148,91	13.929,57	159.899,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.219.575,10	0,00	0,00	0,00	2.233.513,58	13.938,48	159.942,87
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.218.723,84	0,00	0,00	0,00	2.232.707,70	13.983,86	160.338,88
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.207.962,58	0,00	0,00	0,00	2.222.358,93	14.396,35	163.909,08
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.209.034,77	0,00	0,00	0,00	2.223.596,71	14.561,94	165.413,40
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.208.117,04	0,00	0,00	0,00	2.222.723,83	14.606,79	165.800,03
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.527.867,44	0,00	0,00	0,00	1.538.377,14	10.509,70	40.882,16
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.062.585,36	0,00	0,00	0,00	2.077.036,28	14.450,92	162.163,53
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.228.018,98	0,00	0,00	0,00	3.250.678,17	22.659,19	254.189,16
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.235.903,75	0,00	0,00	0,00	2.250.100,22	14.196,47	162.396,44
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.233.170,87	0,00	0,00	0,00	2.247.364,45	14.193,58	162.350,25
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.229.039,50	0,00	0,00	0,00	2.243.292,91	14.253,41	162.823,01
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.216.303,84	0,00	0,00	0,00	2.230.906,02	14.602,18	165.803,19
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.215.387,44	0,00	0,00	0,00	2.230.074,10	14.686,66	166.574,76
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.213.868,54	0,00	0,00	0,00	2.228.613,52	14.744,98	167.072,09
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.208.670,59	0,00	0,00	0,00	5.245.135,67	36.465,08	409.252,76
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.151.877,03	0,00	0,00	0,00	2.166.991,57	15.114,54	169.505,31
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.070.069,05	0,00	0,00	0,00	2.084.665,66	14.596,61	163.585,70
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.325.011,94	0,00	0,00	0,00	6.369.690,26	44.678,32	500.608,21
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.064.063,82	0,00	0,00	0,00	2.078.657,58	14.593,76	163.465,67
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.639.761,37	0,00	0,00	0,00	4.673.331,30	33.569,93	374.387,13
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.657.169,21	0,00	0,00	0,00	3.683.947,06	26.777,85	298.005,08
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.079.483,62	0,00	0,00	0,00	3.102.088,07	22.604,45	193.897,89
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.099.099,44	0,00	0,00	0,00	2.114.696,97	15.597,53	173.112,42
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.241.070,87	0,00	0,00	0,00	2.255.350,56	14.279,69	163.175,40
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.236.015,98	0,00	0,00	0,00	2.250.315,44	14.299,46	163.273,46
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.230.987,10	0,00	0,00	0,00	2.245.304,53	14.317,43	163.371,04
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.219.430,87	0,00	0,00	0,00	2.234.103,16	14.672,29	166.452,02
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.220.406,22	0,00	0,00	0,00	2.235.177,59	14.771,37	167.370,73
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.218.320,53	0,00	0,00	0,00	2.233.162,46	14.841,93	167.984,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.209.589,60	0,00	0,00	0,00	2.224.538,60	14.949,00	168.850,67
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.467.797,34	0,00	0,00	0,00	11.548.092,02	80.294,68	900.994,87
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.150.311,55	0,00	0,00	0,00	2.165.412,30	15.100,75	169.370,71
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.164.566,08	0,00	0,00	0,00	5.200.984,07	36.417,99	408.110,74
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.066.741,50	0,00	0,00	0,00	2.081.360,01	14.618,51	163.743,15
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.864.420,10	0,00	0,00	0,00	16.983.998,66	119.578,56	1.338.807,16
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.273.991,99	0,00	0,00	0,00	9.341.085,58	67.093,59	748.355,24
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.351.372,58	0,00	0,00	0,00	8.412.548,16	61.175,58	680.856,41
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.183.649,24	0,00	0,00	0,00	7.236.310,66	52.661,42	451.866,23
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.251.695,26	0,00	0,00	0,00	5.290.712,28	39.017,02	433.161,48
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.161.167,95	0,00	0,00	0,00	2.175.504,63	14.336,68	164.789,37
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.192.504,61	0,00	0,00	0,00	2.207.223,38	14.718,77	168.760,93
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.150.360,39	0,00	0,00	0,00	2.165.546,45	15.186,06	172.315,37
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.191.561,09	0,00	0,00	0,00	2.205.539,06	13.977,97	161.948,28
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.193.121,06	0,00	0,00	0,00	2.207.311,82	14.190,76	163.905,03
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.193.920,51	0,00	0,00	0,00	2.208.216,08	14.295,57	164.878,31
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.197.835,18	0,00	0,00	0,00	2.212.655,20	14.820,02	169.730,40
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.217.355,39	0,00	0,00	0,00	3.239.588,41	22.233,02	253.344,16
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.206.048,55	0,00	0,00	0,00	2.219.852,07	13.803,52	160.494,42
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.198.157,29	0,00	0,00	0,00	2.212.373,44	14.216,15	164.148,32
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.200.612,44	0,00	0,00	0,00	2.215.035,28	14.422,84	166.083,25
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.197.883,06	0,00	0,00	0,00	2.212.337,48	14.454,42	166.335,14
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.224.244,02	0,00	0,00	0,00	3.246.768,37	22.524,35	256.076,26
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.214.550,92	0,00	0,00	0,00	2.228.426,54	13.875,62	161.191,84
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.209.652,91	0,00	0,00	0,00	2.223.564,12	13.911,21	161.455,35
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.202.010,23	0,00	0,00	0,00	2.216.339,73	14.329,50	165.186,23
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.203.884,61	0,00	0,00	0,00	2.218.379,04	14.494,43	166.738,44
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.204.564,76	0,00	0,00	0,00	2.219.112,47	14.547,71	167.248,80
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.468.214,88	0,00	0,00	0,00	3.491.523,22	23.308,34	91.773,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.201.821,51	0,00	0,00	0,00	2.216.686,54	14.865,03	170.110,56
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.226.032,87	0,00	0,00	0,00	3.248.629,01	22.596,14	256.754,41
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.230.611,26	0,00	0,00	0,00	2.244.738,66	14.127,40	163.523,11
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.221.217,57	0,00	0,00	0,00	2.235.319,71	14.102,14	163.148,48
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.223.197,16	0,00	0,00	0,00	2.237.395,94	14.198,78	164.082,18
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.213.336,44	0,00	0,00	0,00	2.227.898,91	14.562,47	167.337,95
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.213.868,74	0,00	0,00	0,00	2.228.495,98	14.627,24	167.941,68
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.211.116,10	0,00	0,00	0,00	2.225.808,42	14.692,32	168.516,12
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.065.810,58	0,00	0,00	0,00	2.080.284,06	14.473,48	164.400,23
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.225.787,98	0,00	0,00	0,00	3.248.431,50	22.643,52	257.119,76
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.042.407,11	0,00	0,00	0,00	3.064.599,86	22.192,75	250.322,71
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.243.269,71	0,00	0,00	0,00	2.257.460,21	14.190,50	164.149,31
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.240.354,30	0,00	0,00	0,00	2.254.593,91	14.239,61	164.576,87
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.235.792,72	0,00	0,00	0,00	2.250.055,09	14.262,37	164.721,32
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.229.704,11	0,00	0,00	0,00	2.243.987,47	14.283,36	164.829,04
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.218.299,77	0,00	0,00	0,00	2.232.931,20	14.631,43	167.951,28
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.217.067,14	0,00	0,00	0,00	2.231.801,08	14.733,94	168.879,05
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.215.616,80	0,00	0,00	0,00	2.230.424,10	14.807,30	169.557,25
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.208.193,64	0,00	0,00	0,00	2.223.118,21	14.924,57	170.563,17
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.337.176,37	0,00	0,00	0,00	8.395.547,42	58.371,05	663.036,16
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.096.496,09	0,00	0,00	0,00	3.118.330,02	21.833,93	247.708,96
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.066.280,10	0,00	0,00	0,00	2.080.887,55	14.607,45	165.645,83
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.263.171,44	0,00	0,00	0,00	11.343.035,75	79.864,31	905.255,97
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.695.354,57	0,00	0,00	0,00	6.743.793,28	48.438,71	547.169,36
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.575.629,86	0,00	0,00	0,00	5.616.472,46	40.842,60	460.449,42
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.126.370,01	0,00	0,00	0,00	5.163.985,99	37.615,98	325.577,21
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.057.153,01	0,00	0,00	0,00	3.079.867,84	22.714,83	255.483,72
					309.008.495,32	2.115.656,47	

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	20.991.944,89	0,00	0,00	0,00	20.581.430,07	-410.514,82	-544.033,93
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.089.826,29	0,00	0,00	0,00	20.887.982,25	-201.844,04	-112.017,75
					41.469.412,32	-612.358,86	

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	20.446.382,29	0,00	0,00	0,00	20.644.708,52	198.326,23	644.708,52
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	20.858.341,22	0,00	0,00	0,00	21.070.781,79	212.440,57	3.956.865,04
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5.109.984,00	0,00	0,00	0,00	5.120.643,00	10.659,00	120.643,00
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	31.528.354,26	1.487.800,00	-5.014.000,00	0,00	28.311.386,02	309.231,76	2.805.098,57
					75.147.519,33	730.657,56	

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	5.116.021,92	0,00	0,00	0,00	5.155.015,24	38.993,32	155.015,24
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	5.120.481,64	0,00	0,00	0,00	5.159.895,90	39.414,26	159.895,90
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a	5.965.463,80	0,00	0,00	0,00	6.012.150,34	46.686,54	505.927,24
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	5.111.122,37	0,00	0,00	0,00	5.150.895,58	39.773,21	150.895,58
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	5.114.120,06	0,00	0,00	0,00	5.154.722,51	40.602,45	154.722,51
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.456.442,26	0,00	0,00	0,00	5.500.507,12	44.064,86	457.449,54
					32.133.186,69	249.534,64	

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	12.287,35	0,00	0,00	0,00	197.164,17	184.876,82	189.680,83
					197.164,17	184.876,82	

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	3.385.708,49	0,00	0,00	0,00	3.420.015,38	34.306,89	315.394,85
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	5.842.017,78	0,00	0,00	0,00	5.907.802,52	65.784,74	535.037,81
					9.327.817,90	100.091,63	

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	7.379.538,98	0,00	0,00	0,00	7.148.615,99	-230.922,99	299.171,78
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.993.635,20	0,00	0,00	0,00	5.024.774,19	31.138,99	130.320,08
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	5.895.908,42	0,00	0,00	0,00	5.984.406,39	88.497,97	820.307,18
INDIE FIC FIA	3.654.490,88	0,00	0,00	0,00	3.691.165,59	36.674,71	484.698,77
META VALOR FI DE AÇÕES	2.108.083,23	0,00	0,00	0,00	2.030.259,73	-77.823,50	-241.872,61
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	21.423.026,54	0,00	0,00	0,00	21.738.818,01	315.791,47	1.366.204,17
OCCAM FIC FIA	29.588.803,90	0,00	0,00	0,00	29.821.164,69	232.360,79	624.587,16
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	4.342.703,12	0,00	0,00	0,00	4.150.215,63	-192.487,49	55.016,60
TARPON GT 30 FIC FIA	8.729.617,49	0,00	0,00	0,00	9.397.866,60	668.249,11	2.650.834,83
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	7.153.568,51	0,00	0,00	0,00	7.369.574,27	216.005,76	926.342,48
					96.356.861,09	1.087.484,82	

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	15.771.426,14	0,00	0,00	0,00	14.870.080,26	-901.345,88	2.836.456,88
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.877.242,31	0,00	0,00	0,00	1.820.305,59	-56.936,72	270.664,47
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.424.504,78	0,00	0,00	0,00	2.370.991,18	-53.513,60	-449.686,37
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.454.514,44	0,00	0,00	0,00	2.302.563,95	-151.950,49	-141.041,42
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.741.336,42	0,00	0,00	0,00	2.637.951,63	-103.384,79	492.361,22
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	5.258.889,96	0,00	0,00	0,00	5.103.100,20	-155.789,76	146.062,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					29.104.992,81	-1.422.921,24	

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	19.290.760,41	0,00	0,00	0,00	18.751.497,87	-539.262,54	1.714.259,21
					18.751.497,87	-539.262,54	

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	31.049.177,09	0,00	0,00	0,00	29.687.177,00	-1.362.000,09	4.584.127,40
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	7.579.964,73	0,00	0,00	0,00	7.523.054,19	-56.910,54	775.713,18
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	18.663.999,97	0,00	0,00	0,00	17.837.505,45	-826.494,52	2.689.402,81
					55.047.736,64	-2.245.405,15	

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	11.297.069,71	0,00	0,00	0,00	11.127.914,40	-169.155,31	-572.481,16
					11.127.914,40	-169.155,31	

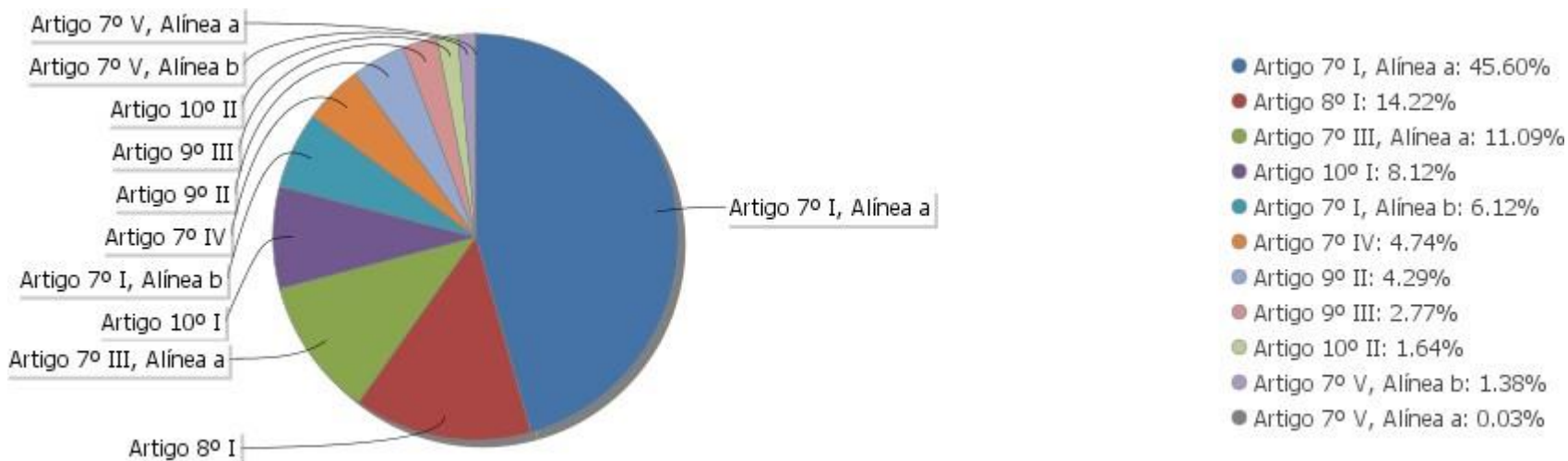
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

6. Análise de Liquidez

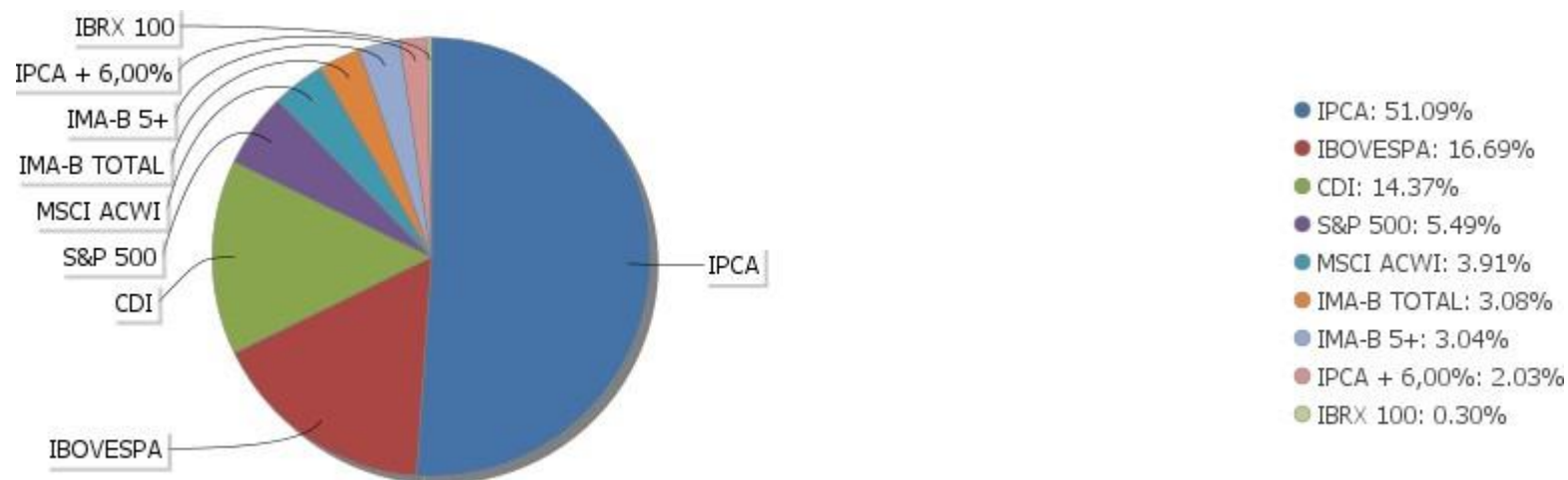
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	262.925.538,45	38,80	262.925.538,45	38,80	
de 31 dias a 365 dias	63.905.095,14	9,43	326.830.633,59	48,23	
acima de 365 dias	350.841.964,95	51,77	677.672.598,57	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

7. Alocação por Artigo

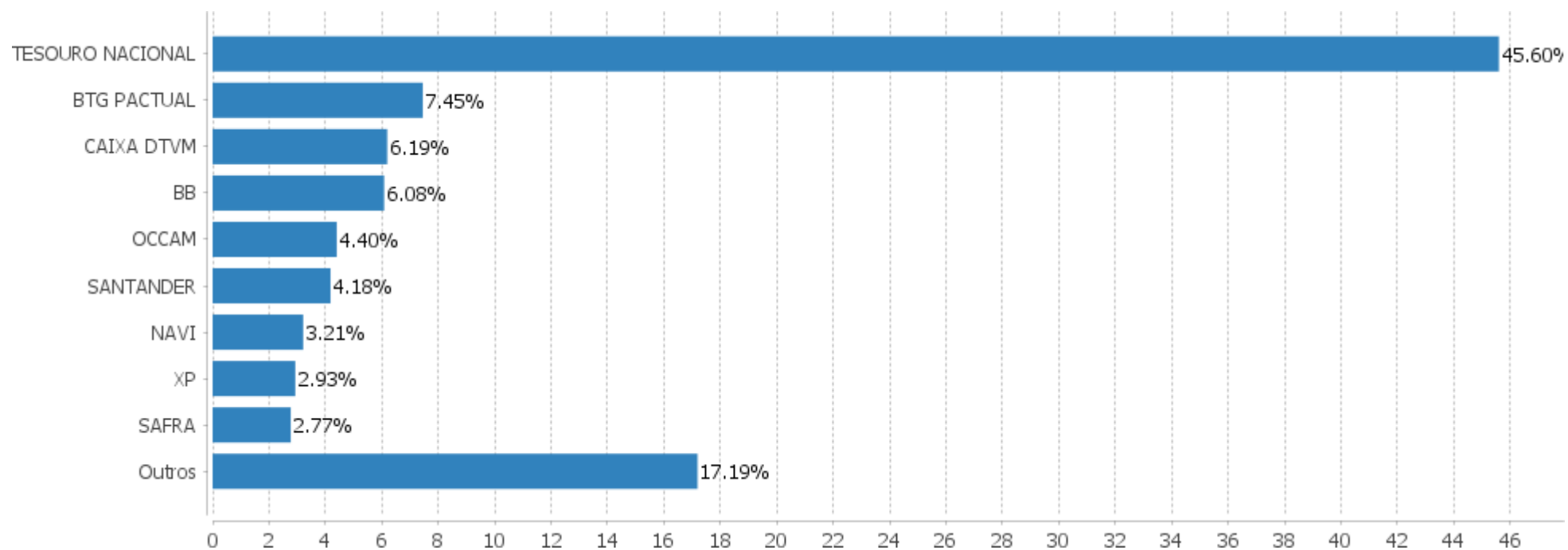


8. Alocação Por Estratégia



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	-0,08				8,80
IPCA + 5,11%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34	0,54	0,69	0,66				7,42
p.p. indexador	0,97	-1,68	-0,35	-0,12	1,19	1,99	0,89	-0,83	-0,73				1,38
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

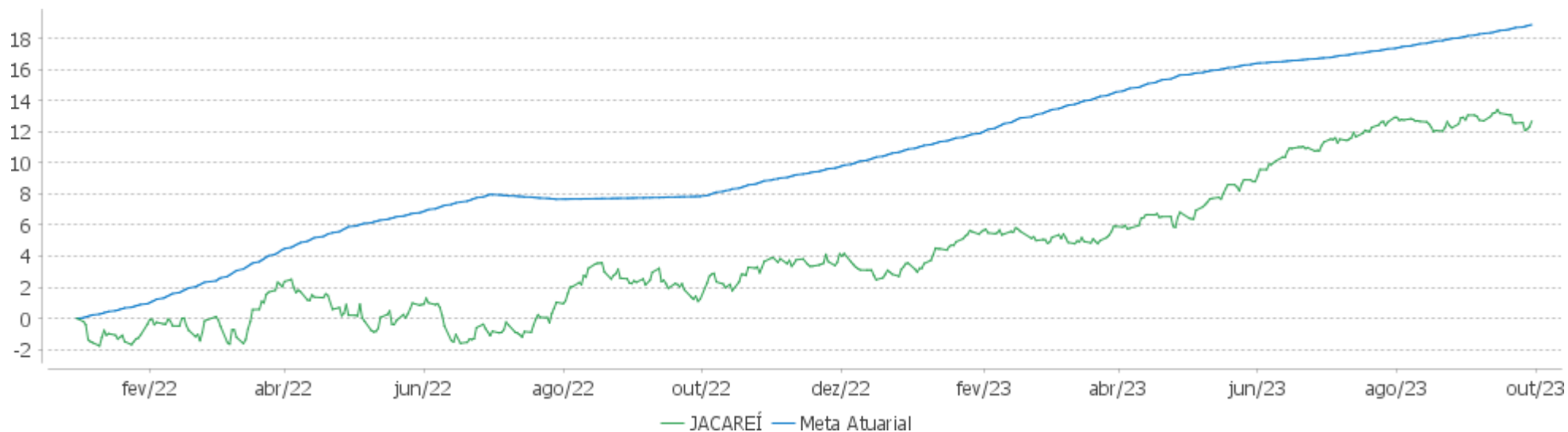
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	8	38,10	03 meses	1,21	1,89	-0,69	2,87
Meses abaixo - Meta Atuarial	13	61,90	06 meses	6,38	3,91	2,46	3,12
			12 meses	11,28	10,44	0,83	3,55
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,60	2022-10	Desde 31/12/2021	12,66	19,10	-6,44	4,69
Menor rentabilidade da Carteira	-1,97	2022-06					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

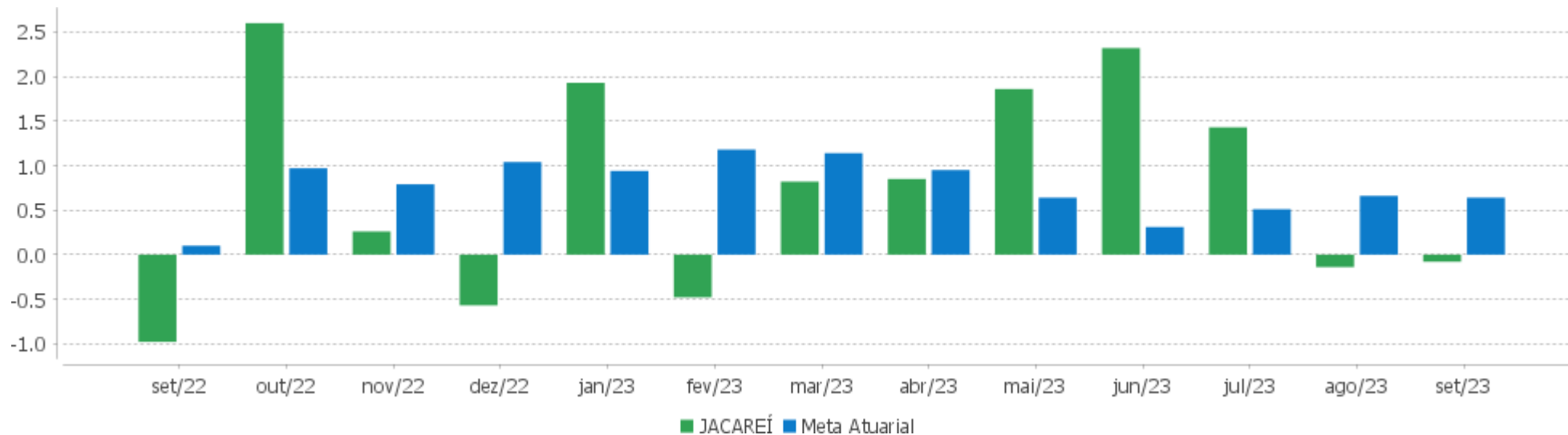


Patrimônio Líquido



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 - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a Var. IPCA p.p.	0,77 0,51	3,20 2,56	2,11 1,50				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a Var. IPCA p.p.	0,79 0,53	3,09 2,46	2,08 1,47				
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a Var. IPCA p.p.	0,76 0,50	3,10 2,46	2,11 1,50				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,81 0,55	9,07 5,57	1,65 1,04	5,61 4,23			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a Var. IPCA p.p.	0,78 0,52	3,02 2,38	2,03 1,42				
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,78 0,52	9,19 5,69	2,19 1,58	5,07 3,69	12,30 7,12		
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,13 115,53	9,96 100,31	4,15 128,81	7,76 120,03	13,69 101,84	27,09 104,99	34,57 116,94
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	1,01 103,96	10,16 102,33	3,36 104,50	6,67 103,18	13,82 102,81	27,49 106,51	31,85 107,72
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,46	8,53 5,03	2,01 1,40	4,62 3,24	11,34 6,16	20,13 7,41	
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,35 4,85	1,95 1,34	4,50 3,13	11,09 5,90	19,81 7,08	
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,41	8,03 4,53	1,85 1,24	4,30 2,92	10,66 5,47	22,33 9,60	
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,39	7,76 4,26	1,76 1,15	4,12 2,75	10,29 5,10	25,04 12,32	
NTN-B 150533 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,43	5,16 1,66	1,89 1,28	1,48 0,11	4,75 -0,43		
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,39 4,89	1,96 1,35	4,53 3,15	11,15 5,96	27,00 14,28	
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,32 4,82	1,94 1,33	4,48 3,11	11,05 5,87	23,22 10,49	
NTN-B 150545 (5,915000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,36 4,86	1,95 1,34	4,51 3,13	11,11 5,92	23,32 10,60	
NTN-B 150850 (5,831200%)	0,70	8,30	1,93	4,47	11,02	26,72	

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.	0,44	4,80	1,32	3,09	5,84	14,00	
NTN-B 150826 (5,190000%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,39	7,81 4,31	1,78 1,16	4,16 2,78	10,35 5,17	25,20 12,47	
NTN-B 150840 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,30 4,80	1,93 1,32	4,47 3,10	11,03 5,84	26,73 14,01	
NTN-B 150830 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,87 4,37	1,79 1,18	4,19 2,82	10,44 5,25	25,39 12,66	
NTN-B 150545 (4,970000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,37	7,64 4,14	1,72 1,11	4,05 2,67	10,13 4,94	21,53 8,80	
NTN-B 150840 (4,950000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,37	7,62 4,13	1,72 1,10	4,04 2,66	10,10 4,92	24,63 11,90	
NTN-B 150850 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,38	7,65 4,15	1,72 1,11	4,05 2,68	10,14 4,95	24,70 11,97	
NTN-B 150850 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,94 4,44	1,82 1,21	4,24 2,86	10,53 5,35	25,60 12,87	
NTN-B 150555 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,37 4,87	1,96 1,34	4,52 3,14	11,12 5,94	23,35 10,62	
NTN-B 150545 (5,922000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,37 4,87	1,95 1,34	4,51 3,14	11,12 5,93	23,33 10,61	
NTN-B 150555 (5,370000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,41	7,95 4,45	1,82 1,21	4,24 2,87	10,54 5,36	22,33 9,61	
NTN-B 150840 (5,020000%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,38	7,68 4,18	1,73 1,12	4,07 2,70	10,18 4,99	24,79 12,07	
NTN-B 150535 (4,910000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,37	7,59 4,09	1,71 1,10	4,02 2,64	10,06 4,88	21,29 8,57	
NTN-B 150850 (4,940000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,37	7,62 4,12	1,71 1,10	4,03 2,66	10,09 4,91	24,60 11,88	
NTN-B 150840 (4,970000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,37	7,64 4,14	1,72 1,11	4,05 2,67	10,13 4,94	24,68 11,95	
NTN-B 150545 (6,280000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	8,64 5,14	2,04 1,43	4,69 3,31	8,19 3,00	16,78 4,05	
NTN-B 150826 (5,490000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,41	8,04 4,54	1,85 1,24	4,30 2,93	10,67 5,48	25,91 13,18	
NTN-B 150830 (5,460000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,41	5,01 1,51	1,84 1,23	4,29 2,91	7,56 2,37		
NTN-B 150850 (6,261000%)	0,73	8,63	2,04	4,68	11,47	27,75	

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.	0,47	5,13	1,43	3,30	6,28	15,02	
NTN-B 150555 (5,000000%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,38	7,66 4,16	1,73 1,12	4,06 2,69	10,16 4,97	21,65 8,92	
NTN-B 150535 (5,320000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,91 4,41	1,81 1,20	4,22 2,84	10,49 5,30	22,12 9,39	
NTN-B 150535 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,43	5,16 1,66	1,89 1,28	1,48 0,11	4,76 -0,42		
NTN-B 150850 (5,010000%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,38	7,67 4,17	1,73 1,12	4,07 2,69	10,17 4,98	24,77 12,04	
NTN-B 150545 (6,256000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	8,62 5,12	2,04 1,42	4,68 3,30	11,46 6,28	23,96 11,24	
NTN-B 150555 (6,261000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	8,63 5,13	2,04 1,43	4,68 3,30	11,47 6,28	23,96 11,23	
NTN-B 150555 (5,520000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,42	8,06 4,56	1,86 1,24	4,32 2,94	10,70 5,51	22,61 9,88	
NTN-B 150555 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,32 4,82	1,94 1,33	4,48 3,11	11,05 5,87	23,23 10,50	
NTN-B 150545 (5,380000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,41	7,95 4,45	1,82 1,21	4,25 2,87	10,55 5,37	22,31 9,58	
NTN-B 150826 (5,009000%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,38	7,67 4,17	1,73 1,12	4,07 2,69	10,17 4,98	24,77 12,04	
NTN-B 150545 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,48	8,73 5,23	2,07 1,46	4,75 3,37	8,27 3,08	16,89 4,17	
NTN-B 150555 (5,831200%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,30 4,80	1,93 1,32	4,47 3,09	11,02 5,84	23,18 10,45	
NTN-B 150535 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,32 4,82	1,94 1,33	4,48 3,11	11,05 5,86	23,19 10,46	
NTN-B 150828 (4,850000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,37	7,55 4,05	1,69 1,08	3,99 2,61	10,00 4,81	24,39 11,67	
NTN-B 150555 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,48	8,73 5,23	2,07 1,46	4,75 3,37	8,24 3,06	16,82 4,09	
NTN-B 150545 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,30 4,80	1,93 1,32	4,47 3,09	11,02 5,84	23,16 10,44	
NTN-B 150828 (5,240000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,85 4,35	1,79 1,18	4,18 2,80	10,41 5,22	25,31 12,59	
NTN-B 150545 (5,340000%)	0,66	7,92	1,81	4,23	10,51	22,23	

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.	0,40	4,42	1,20	2,85	5,32	9,51	
NTN-B 150850 (5,921000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,37 4,87	1,95 1,34	4,51 3,14	11,11 5,93	26,94 14,21	
NTN-B 150555 (6,268000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	8,63 5,13	2,04 1,43	4,68 3,31	8,17 2,98	16,72 3,99	
NTN-B 150535 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,37	7,56 4,06	1,69 1,08	3,99 2,62	10,01 4,83	21,19 8,46	
NTN-B 150826 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,43	8,21 4,71	1,90 1,29	4,41 3,03	10,90 5,71	26,43 13,71	
NTN-B 150555 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,46	8,53 5,03	2,01 1,40	4,62 3,24	11,34 6,16	20,13 7,40	
NTN-B 150828 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,87 4,37	1,79 1,18	4,20 2,82	10,44 5,25	25,39 12,66	
NTN-B 150535 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,88 4,39	1,80 1,19	4,20 2,83	10,46 5,27	22,06 9,33	
NTN-B 150830 (5,835000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,30 4,80	1,93 1,32	4,47 3,10	11,03 5,84	26,73 14,00	
NTN-B 150555 (5,315000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,90 4,40	1,81 1,19	4,22 2,84	10,48 5,30	22,23 9,50	
NTN-B 150535 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,30 4,80	1,93 1,32	4,47 3,10	11,03 5,84	23,15 10,43	
NTN-B 150830 (5,300000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,89 4,39	1,80 1,19	4,21 2,83	10,47 5,28	25,46 12,73	
NTN-B 150830 (5,500000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,42	8,04 4,55	1,85 1,24	4,31 2,93	10,68 5,49	25,93 13,21	
NTN-B 150545 (5,285000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,88 4,38	1,80 1,19	4,20 2,83	10,45 5,27	22,13 9,40	
NTN-B 150824 (5,450000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,41	8,01 4,51	1,84 1,23	4,28 2,91	10,62 5,44	25,81 13,09	
NTN-B 150830 (5,178300%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,39	7,80 4,30	1,77 1,16	4,15 2,77	10,34 5,16	25,17 12,44	
NTN-B 150545 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,38	7,69 4,19	1,74 1,12	4,08 2,70	10,19 5,00	21,64 8,92	
NTN-B 150545 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,35 4,85	1,95 1,34	4,50 3,13	11,09 5,90	19,80 7,07	
NTN-B 150850 (6,400000%)	0,74	8,73	2,07	4,75	11,61	20,48	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,48	5,23	1,46	3,37	6,43	7,75	
NTN-B 150824 (5,912000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,36 4,86	1,95 1,34	4,51 3,13	11,11 5,92	26,91 14,19	
NTN-B 150850 (5,045000%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,38	7,70 4,20	1,74 1,13	4,08 2,71	10,20 5,02	24,85 12,13	
NTN-B 150555 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,38	7,69 4,19	1,74 1,12	4,08 2,70	10,19 5,00	21,71 8,98	
NTN-B 150840 (5,274000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,87 4,37	1,80 1,18	4,20 2,82	10,44 5,26	25,40 12,67	
NTN-B 150826 (5,130000%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,39	7,76 4,26	1,76 1,15	4,13 2,75	10,29 5,11	25,05 12,33	
NTN-B 150840 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,94 4,44	1,82 1,21	4,24 2,86	10,53 5,35	25,60 12,87	
NTN-B 150850 (5,410000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,41	7,98 4,48	1,83 1,22	4,26 2,89	10,58 5,40	25,72 12,99	
NTN-B 150840 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,32 4,82	1,94 1,33	4,48 3,11	11,05 5,86	26,78 14,05	
NTN-B 150545 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,38	7,65 4,15	1,72 1,11	4,05 2,68	10,14 4,95	21,55 8,82	
NTN-B 150830 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,37	7,56 4,06	1,69 1,08	3,99 2,62	10,01 4,83	24,42 11,69	
NTN-B 150824 (5,345000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,93 4,43	1,81 1,20	4,23 2,86	10,52 5,33	25,56 12,84	
NTN-B 150840 (5,310000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,90 4,40	1,80 1,19	4,21 2,84	10,48 5,29	25,48 12,76	
NTN-B 150545 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,46	8,53 5,03	2,01 1,40	4,62 3,24	11,34 6,16	20,14 7,42	
NTN-B 150830 (4,900000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,37	7,59 4,09	1,70 1,09	4,01 2,64	10,05 4,87	24,51 11,78	
NTN-B 150850 (5,295500%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,89 4,39	1,80 1,19	4,21 2,83	10,46 5,28	25,45 12,72	
NTN-B 150535 (4,880000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,37	7,57 4,07	1,70 1,09	4,00 2,63	10,03 4,85	21,23 8,51	
NTN-B 150555 (5,420000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,41	7,98 4,48	1,83 1,22	4,27 2,89	10,59 5,41	22,42 9,70	
NTN-B 150850 (5,510000%)	0,68	8,05	1,85	4,31	10,69	25,96	

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.	0,42	4,55	1,24	2,94	5,50	13,23	
NTN-B 150850 (6,278000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	5,42 1,92	2,04 1,43	4,69 3,31	8,18 3,00	16,75 4,03	
NTN-B 150555 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,35 4,85	1,95 1,34	4,50 3,13	11,09 5,90	19,81 7,09	
NTN-B 150840 (6,220000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	8,59 5,10	2,03 1,42	4,66 3,28	11,43 6,24	27,65 14,92	
NTN-B 150555 (5,060000%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,38	7,71 4,21	1,74 1,13	4,09 2,72	10,22 5,03	21,76 9,03	
NTN-B 150828 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,28 4,78	1,93 1,32	4,46 3,08	11,00 5,81	26,67 13,94	
NTN-B 150555 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,39 4,89	1,96 1,35	4,53 3,15	11,14 5,96	23,39 10,67	
NTN-B 150525 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,28 4,78	1,93 1,32	4,46 3,08	11,00 5,81	23,06 10,33	
NTN-B 150535 (5,196100%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,39	7,81 4,31	1,78 1,17	4,16 2,78	10,36 5,18	21,87 9,14	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,96 -0,01	10,65 -0,14	-0,53 -0,01	6,49 -0,06	10,76 -0,28	18,68 -0,41	23,96 -0,74
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,96 -0,03	11,74 -0,34	-2,55 -0,09	7,96 -0,21	9,74 -0,42	15,04 -0,84	18,37 -1,22
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III % do CDI	1.504,61 154.369,19	2.534,71 25.531,89	3.397,10 105.505,68	4.593,23 71.027,20	2.706,76 20.134,72	505,45 1.958,81	78.567,84 265.732,77
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,97 99,52	9,87 99,39	3,22 100,12	6,49 100,34	13,40 99,70	26,08 101,09	30,15 101,99
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,02 104,49	10,15 102,21	3,42 106,25	6,85 105,96	13,67 101,70	26,52 102,77	30,71 103,86
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	0,21 -0,05	2,41 1,79	2,55 1,93				
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,02 104,64	10,12 101,93	3,52 109,39	6,89 106,60	13,72 102,05	26,84 104,03	31,33 105,95
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,62 -0,09	2,66 -3,56	-3,74 -2,45	10,79 -3,62	-1,41 -7,34	-21,17 -26,20	-24,97 -48,19
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,65 6,94	39,29 33,06	11,58 12,87	45,55 31,14	32,33 26,40	58,35 53,32	129,33 106,12
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	3,02	14,38	8,16	23,03	17,39	13,25	110,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	2,31	8,15	9,45	8,62	11,45	8,21	87,43
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,47 0,76	5,22 -1,01	0,47 1,76	17,17 2,76	2,92 -3,01	6,06 1,02	30,71 7,50
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,43 -5,14	1,34 -4,88	-2,32 -1,03	10,25 -4,16	-5,25 -11,18	-25,18 -30,21	1,68 -21,53
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,50 0,79	25,70 19,48	3,31 4,60	33,12 18,71	19,17 13,23	31,43 26,40	
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,00 0,29	15,12 8,89	-2,12 -0,83	26,25 11,84	9,41 3,47	-20,62 -25,65	-13,28 -36,50
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-3,13 -3,84	4,37 -1,86	-5,87 -4,59	11,01 -3,40	-2,78 -8,71	-19,25 -24,28	-4,71 -27,93
META VALOR FI DE AÇÕES Var. IBRX 100 p.p.	-3,69 -4,54	-10,65 -16,15	-8,66 -7,64	0,31 -13,47	-14,60 -19,69	-15,77 -19,47	-21,11 -43,28
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,79 0,07	2,14 -4,09	-2,31 -1,02	9,30 -5,11	0,55 -5,38	2,27 -2,77	14,40 -8,81
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-2,80 -3,51	10,06 3,84	2,42 3,71	4,91 -9,50	14,38 8,45	-13,81 -18,84	3,96 -19,25
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-2,21 0,40	-15,94 -20,07	-1,77 -1,72	-14,47 -14,57	-12,32 -22,25	-36,21 -21,44	
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-2,96 -0,35	2,95 -1,18	0,08 0,13	-0,04 -0,14	13,53 3,59	-14,54 0,24	10,80 7,62
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-5,72 -3,11	23,57 19,44	-0,38 -0,33	8,15 8,05	26,65 16,72	-18,22 -3,44	2,39 -0,78
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-3,03 -0,43	17,47 13,34	-2,82 -2,77	6,05 5,95	0,98 -8,96	-57,64 -42,86	
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-6,19 -3,58	-5,77 -9,90	-5,56 -5,51	-7,34 -7,44	-4,87 -14,81	-44,55 -29,77	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-3,77 -4,50	22,95 14,85	1,01 -1,11	6,67 2,32	25,17 13,72	-31,61 -58,21	-25,87 -73,78
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-0,75 2,46	11,50 4,31	0,63 0,51	5,94 3,09			
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-4,43 -454,33	17,75 178,83	-1,92 -59,57	8,25 127,64	29,14 216,76	17,10 66,27	53,11 179,64
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-4,39 -1,17	18,26 11,08	-1,76 -1,88	8,64 5,79	30,05 19,28	23,09 31,44	62,53 49,33
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	-0,13	-5,19	0,69	1,14	-6,86	16,27	44,81

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.	-0,85	-13,29	-1,42	-3,21	-18,31	-10,33	-3,10
JACAREÍ	-0,08	8,80	1,21	6,38	11,28		
Var. IPCA + 4,83% p.p.	-0,73	1,38	-0,69	2,46	0,76		
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

12 Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BB 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
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	0,93	10,06	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	12,82	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	11,62	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	8,89	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	10,59	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	8,97	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	15,28	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	5,50	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	4,92	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	5,06	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-4,75	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	10,67	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

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	-3,22	7,19	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	12,28	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	4,13	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	3,50	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	2,91	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-4,93	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	6,57	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	7,34	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	7,72	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	8,01	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	5,97	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70	62,65	77,41

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%)	2.208.947,24	5,480000	2.200.654,42	5,740000	-8.292,82
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.080.079,93	5,810000	1.081.172,58	5,740000	1.092,65
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.543.438,50	5,680000	20.523.670,51	5,691900	-19.767,99
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.237.148,91	4,860000	2.093.286,84	5,686500	-143.862,07
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.233.513,58	4,880000	2.093.286,84	5,686500	-140.226,74
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.232.707,70	4,910000	2.097.638,78	5,686500	-135.068,92
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.222.358,93	5,196100	2.136.806,31	5,686500	-85.552,62
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.223.596,71	5,290000	2.154.214,10	5,686500	-69.382,61
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.222.723,83	5,320000	2.158.566,05	5,686500	-64.157,78
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.538.377,14	5,670000	1.536.237,53	5,686500	-2.139,61
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.077.036,28	5,837000	2.101.990,73	5,686500	24.954,45
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.250.678,17	5,855000	3.294.424,40	5,686500	43.746,23
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.250.100,22	4,970000	2.032.720,04	5,825200	-217.380,18
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.247.364,45	4,980000	2.032.720,04	5,825200	-214.644,41
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.243.292,91	5,030000	2.041.388,35	5,825200	-201.904,56
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.230.906,02	5,285000	2.093.398,25	5,825200	-137.507,77
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.230.074,10	5,340000	2.106.400,72	5,825200	-123.673,38
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.228.613,52	5,380000	2.115.069,04	5,825200	-113.544,48
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.245.135,67	5,831000	5.248.665,17	5,825200	3.529,50
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.166.991,57	5,860000	2.175.747,25	5,825200	8.755,68
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.084.665,66	5,897000	2.102.066,56	5,825200	17.400,90
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.369.690,26	5,915000	6.436.224,43	5,825200	66.534,17
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.078.657,58	5,922000	2.102.066,56	5,825200	23.408,98
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.673.331,30	6,140000	4.845.588,49	5,825200	172.257,19
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.683.947,06	6,256000	3.870.402,97	5,825200	186.455,91
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.102.088,07	6,280000	3.267.955,03	5,825200	165.866,96
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.114.696,97	6,400000	2.258.096,25	5,825200	143.399,28
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.255.350,56	5,000000	1.995.965,44	5,862000	-259.385,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.250.315,44	5,030000	2.000.295,08	5,862000	-250.020,36
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.245.304,53	5,060000	2.004.624,73	5,862000	-240.679,80
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.234.103,16	5,315000	2.069.569,37	5,862000	-164.533,79
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.235.177,59	5,370000	2.086.887,94	5,862000	-148.289,65
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.233.162,46	5,420000	2.099.876,87	5,862000	-133.285,59
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.224.538,60	5,520000	2.121.525,09	5,862000	-103.013,51
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.548.092,02	5,831200	11.499.531,91	5,862000	-48.560,11
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.165.412,30	5,860000	2.164.821,52	5,862000	-590,78
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.200.984,07	5,897000	5.225.879,15	5,862000	24.895,08
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.081.360,01	5,927000	2.099.876,87	5,862000	18.516,86
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.983.998,66	5,950000	17.188.682,86	5,862000	204.684,20
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.341.085,58	6,140000	9.698.400,40	5,862000	357.314,82
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.412.548,16	6,261000	8.875.768,23	5,862000	463.220,07
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.236.310,66	6,268000	7.641.819,96	5,862000	405.509,30
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.290.712,28	6,400000	5.684.821,31	5,862000	394.109,03
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.175.504,63	5,345000	2.157.991,38	6,346000	-17.513,25
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.207.223,38	5,450000	2.191.319,43	6,346000	-15.903,95
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.165.546,45	5,912000	2.157.991,38	6,346000	-7.555,07
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.205.539,06	5,009000	2.172.942,34	5,596700	-32.596,72
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.207.311,82	5,130000	2.181.380,95	5,596700	-25.930,87
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.208.216,08	5,190000	2.185.600,25	5,596700	-22.615,83
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.212.655,20	5,490000	2.206.696,78	5,596700	-5.958,42
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.239.588,41	5,710000	3.248.865,24	5,596700	9.276,83
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.219.852,07	4,850000	2.151.477,96	5,620000	-68.374,11
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.212.373,44	5,125600	2.168.452,14	5,620000	-43.921,30
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.215.035,28	5,240000	2.181.182,78	5,620000	-33.852,50
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.212.337,48	5,270000	2.181.182,78	5,620000	-31.154,70
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.246.768,37	5,810000	3.271.774,17	5,620000	25.005,80
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.228.426,54	4,860000	2.142.016,34	5,588200	-86.410,20
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.223.564,12	4,900000	2.142.016,34	5,588200	-81.547,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.216.339,73	5,178300	2.167.669,23	5,588200	-48.670,50
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.218.379,04	5,270000	2.180.495,67	5,588200	-37.883,37
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.219.112,47	5,300000	2.184.771,16	5,588200	-34.341,31
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.491.523,22	5,460000	3.467.415,67	5,588200	-24.107,55
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.216.686,54	5,500000	2.206.148,56	5,588200	-10.537,98
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.248.629,01	5,835000	3.292.120,92	5,588200	43.491,91
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.244.738,66	4,950000	2.058.807,96	5,777400	-185.930,70
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.235.319,71	4,970000	2.054.527,69	5,777400	-180.792,02
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.237.395,94	5,020000	2.067.368,49	5,777400	-170.027,45
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.227.898,91	5,274000	2.114.451,41	5,777400	-113.447,50
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.228.495,98	5,310000	2.123.011,95	5,777400	-105.484,03
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.225.808,42	5,360000	2.131.572,48	5,777400	-94.235,94
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.080.284,06	5,837000	2.093.050,08	5,777400	12.766,02
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.248.431,50	5,855000	3.274.403,51	5,777400	25.972,01
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.064.599,86	6,220000	3.205.919,25	5,777400	141.319,39
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.257.460,21	4,940000	1.996.852,85	5,853300	-260.607,36
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.254.593,91	4,980000	2.005.386,40	5,853300	-249.207,51
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.250.055,09	5,010000	2.009.653,18	5,853300	-240.401,91
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.243.987,47	5,045000	2.013.919,96	5,853300	-230.067,51
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.232.931,20	5,295500	2.073.654,88	5,853300	-159.276,32
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.231.801,08	5,360000	2.090.722,00	5,853300	-141.079,08
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.230.424,10	5,410000	2.103.522,34	5,853300	-126.901,76
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.223.118,21	5,510000	2.124.856,23	5,853300	-98.261,98
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.395.547,42	5,831200	8.371.421,55	5,853300	-24.125,87
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.118.330,02	5,897000	3.136.082,99	5,853300	17.752,97
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.080.887,55	5,921000	2.099.255,56	5,853300	18.368,01
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.343.035,75	5,950000	11.486.170,64	5,853300	143.134,89
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.743.793,28	6,140000	6.997.518,52	5,853300	253.725,24
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.616.472,46	6,261000	5.918.023,28	5,853300	301.550,82
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.163.985,99	6,278000	5.452.944,31	5,853300	288.958,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.079.867,84	6,400000	3.302.487,40	5,853300	222.619,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

14. Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
272	01/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	255.208,49	1.056,38586790	241,5864295000
273	01/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	302.719,19	1.253,04716257	241,5864295000
274	01/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	468.072,32	1.937,49425814	241,5864295000
275	01/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	22.000,00	0,00	91,06471769	241,5864295000
290	01/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	5.000,00	20,69652675	241,5864295000
291	05/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,13512697	241,8305429000
276	06/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	196.500,00	0,00	812,12833665	241,9568326000
292	06/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	20.000,00	82,65937269	241,9568326000
277	11/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	836.240,58	3.452,59028001	242,2067237000
278	11/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	22.056,48	91,06468913	242,2067237000
279	11/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	196.702,94	812,12832161	242,2067237000
280	11/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	485.000,00	0,00	2.002,42170238	242,2067237000
293	11/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	35.000,00	144,50465893	242,2067237000
281	14/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	155.500,00	0,00	641,06758235	242,5641294000
294	14/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	31.000,00	127,80125436	242,5641294000
295	14/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	6.000,00	24,73572665	242,5641294000
282	15/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	9.000,00	37,08452579	242,6888253000
296	15/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	20.000,00	82,41005730	242,6888253000
283	20/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,11432870	243,0530163000
297	20/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	14.000,00	57,60060177	243,0530163000
298	22/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	6.000,00	24,66041469	243,3049109000
284	25/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	40.000,00	164,31938844	243,4283646000
299	25/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	113.000,00	464,20227234	243,4283646000
300	26/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	12,31813138	243,5434326000
285	28/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	303.000,00	0,00	1.242,85620150	243,7932881000
301	28/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	84.000,00	344,55419448	243,7932881000
286	29/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.647.181,14	6.753,02043100	243,9176894000
287	29/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	488.426,07	2.002,42168250	243,9176894000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
288	29/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	106.238,18	435,54930461	243,9176894000
289	29/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	303.154,61	1.242,85618950	243,9176894000
302	29/09/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	325.800,00	0,00	1.335,69648352	243,9176894000
Total			1.487.800,00	5.014.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

15 . Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.463.836,49

Value-At-Risk: 1,40%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
JACAREÍ		1,40		1,40			677.672.598,57	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,23%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,480000%)		0,07	0,00	0,07			2.208.947,24	0,33
NTN-B 150525 (5,810000%)		0,07	0,00	0,07			1.080.079,93	0,16
NTN-B 150533 (5,680000%)		0,23	-0,00	0,24			20.543.438,50	3,03
NTN-B 150535 (4,860000%)		0,07	0,00	0,07			2.237.148,91	0,33
NTN-B 150535 (4,880000%)		0,07	0,00	0,07			2.233.513,58	0,33
NTN-B 150535 (4,910000%)		0,07	0,00	0,07			2.232.707,70	0,33
NTN-B 150535 (5,196100%)		0,07	0,00	0,07			2.222.358,93	0,33
NTN-B 150535 (5,290000%)		0,07	0,00	0,07			2.223.596,71	0,33
NTN-B 150535 (5,320000%)		0,07	0,00	0,07			2.222.723,83	0,33
NTN-B 150535 (5,670000%)		0,21	-0,00	0,21			1.538.377,14	0,23
NTN-B 150535 (5,837000%)		0,07	0,00	0,07			2.077.036,28	0,31
NTN-B 150535 (5,855000%)		0,07	0,00	0,07			3.250.678,17	0,48
NTN-B 150545 (4,970000%)		0,07	0,00	0,07			2.250.100,22	0,33
NTN-B 150545 (4,980000%)		0,07	0,00	0,07			2.247.364,45	0,33
NTN-B 150545 (5,030000%)		0,07	0,00	0,07			2.243.292,91	0,33
NTN-B 150545 (5,285000%)		0,07	0,00	0,07			2.230.906,02	0,33
NTN-B 150545 (5,340000%)		0,07	0,00	0,07			2.230.074,10	0,33
NTN-B 150545 (5,380000%)		0,07	0,00	0,07			2.228.613,52	0,33
NTN-B 150545 (5,831000%)		0,07	0,00	0,07			5.245.135,67	0,77
NTN-B 150545 (5,860000%)		0,07	0,00	0,07			2.166.991,57	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (5,897000%)		0,07	0,00	0,07			2.084.665,66	0,31
NTN-B 150545 (5,915000%)		0,07	0,00	0,07			6.369.690,26	0,94
NTN-B 150545 (5,922000%)		0,07	0,00	0,07			2.078.657,58	0,31
NTN-B 150545 (6,140000%)		0,07	0,00	0,07			4.673.331,30	0,69
NTN-B 150545 (6,256000%)		0,07	0,00	0,07			3.683.947,06	0,54
NTN-B 150545 (6,280000%)		0,07	0,00	0,07			3.102.088,07	0,46
NTN-B 150545 (6,400000%)		0,07	0,00	0,07			2.114.696,97	0,31
NTN-B 150555 (5,000000%)		0,07	0,00	0,07			2.255.350,56	0,33
NTN-B 150555 (5,030000%)		0,07	0,00	0,07			2.250.315,44	0,33
NTN-B 150555 (5,060000%)		0,07	0,00	0,07			2.245.304,53	0,33
NTN-B 150555 (5,315000%)		0,07	0,00	0,07			2.234.103,16	0,33
NTN-B 150555 (5,370000%)		0,07	0,00	0,07			2.235.177,59	0,33
NTN-B 150555 (5,420000%)		0,07	0,00	0,07			2.233.162,46	0,33
NTN-B 150555 (5,520000%)		0,07	0,00	0,07			2.224.538,60	0,33
NTN-B 150555 (5,831200%)		0,07	0,00	0,07			11.548.092,02	1,70
NTN-B 150555 (5,860000%)		0,07	0,00	0,07			2.165.412,30	0,32
NTN-B 150555 (5,897000%)		0,07	0,00	0,07			5.200.984,07	0,77
NTN-B 150555 (5,927000%)		0,07	0,00	0,07			2.081.360,01	0,31
NTN-B 150555 (5,950000%)		0,07	0,00	0,07			16.983.998,66	2,51
NTN-B 150555 (6,140000%)		0,07	0,00	0,07			9.341.085,58	1,38
NTN-B 150555 (6,261000%)		0,07	0,00	0,07			8.412.548,16	1,24
NTN-B 150555 (6,268000%)		0,07	0,00	0,07			7.236.310,66	1,07
NTN-B 150555 (6,400000%)		0,07	0,00	0,07			5.290.712,28	0,78
NTN-B 150824 (5,345000%)		0,07	0,00	0,07			2.175.504,63	0,32
NTN-B 150824 (5,450000%)		0,07	0,00	0,07			2.207.223,38	0,33
NTN-B 150824 (5,912000%)		0,07	0,00	0,07			2.165.546,45	0,32
NTN-B 150826 (5,009000%)		0,07	0,00	0,07			2.205.539,06	0,33
NTN-B 150826 (5,130000%)		0,07	0,00	0,07			2.207.311,82	0,33
NTN-B 150826 (5,190000%)		0,07	0,00	0,07			2.208.216,08	0,33
NTN-B 150826 (5,490000%)		0,07	0,00	0,07			2.212.655,20	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,710000%)		0,07	0,00	0,07			3.239.588,41	0,48
NTN-B 150828 (4,850000%)		0,07	0,00	0,07			2.219.852,07	0,33
NTN-B 150828 (5,125600%)		0,07	0,00	0,07			2.212.373,44	0,33
NTN-B 150828 (5,240000%)		0,07	0,00	0,07			2.215.035,28	0,33
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,07	0,00	0,07			2.212.337,48	0,33
NTN-B 150828 (5,810000%)		0,07	0,00	0,07			3.246.768,37	0,48
NTN-B 150830 (4,860000%)		0,07	0,00	0,07			2.228.426,54	0,33
NTN-B 150830 (4,900000%)		0,07	0,00	0,07			2.223.564,12	0,33
NTN-B 150830 (5,178300%)		0,07	0,00	0,07			2.216.339,73	0,33
NTN-B 150830 (5,270000%)		0,07	0,00	0,07			2.218.379,04	0,33
NTN-B 150830 (5,300000%)		0,07	0,00	0,07			2.219.112,47	0,33
NTN-B 150830 (5,460000%)		0,07	0,00	0,07			3.491.523,22	0,52
NTN-B 150830 (5,500000%)		0,07	0,00	0,07			2.216.686,54	0,33
NTN-B 150830 (5,835000%)		0,07	0,00	0,07			3.248.629,01	0,48
NTN-B 150840 (4,950000%)		0,07	0,00	0,07			2.244.738,66	0,33
NTN-B 150840 (4,970000%)		0,07	0,00	0,07			2.235.319,71	0,33
NTN-B 150840 (5,020000%)		0,07	0,00	0,07			2.237.395,94	0,33
NTN-B 150840 (5,274000%)		0,07	0,00	0,07			2.227.898,91	0,33
NTN-B 150840 (5,310000%)		0,07	0,00	0,07			2.228.495,98	0,33
NTN-B 150840 (5,360000%)		0,07	0,00	0,07			2.225.808,42	0,33
NTN-B 150840 (5,837000%)		0,07	0,00	0,07			2.080.284,06	0,31
NTN-B 150840 (5,855000%)		0,07	0,00	0,07			3.248.431,50	0,48
NTN-B 150840 (6,220000%)		0,07	0,00	0,07			3.064.599,86	0,45
NTN-B 150850 (4,940000%)		0,07	0,00	0,07			2.257.460,21	0,33
NTN-B 150850 (4,980000%)		0,07	0,00	0,07			2.254.593,91	0,33
NTN-B 150850 (5,010000%)		0,07	0,00	0,07			2.250.055,09	0,33
NTN-B 150850 (5,045000%)		0,07	0,00	0,07			2.243.987,47	0,33
NTN-B 150850 (5,295500%)		0,07	0,00	0,07			2.232.931,20	0,33
NTN-B 150850 (5,360000%)		0,07	0,00	0,07			2.231.801,08	0,33
NTN-B 150850 (5,410000%)		0,07	0,00	0,07			2.230.424,10	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,510000%)		0,07	0,00	0,07			2.223.118,21	0,33
NTN-B 150850 (5,831200%)		0,07	0,00	0,07			8.395.547,42	1,24
NTN-B 150850 (5,897000%)		0,07	0,00	0,07			3.118.330,02	0,46
NTN-B 150850 (5,921000%)		0,07	0,00	0,07			2.080.887,55	0,31
NTN-B 150850 (5,950000%)		0,07	0,00	0,07			11.343.035,75	1,67
NTN-B 150850 (6,140000%)		0,07	0,00	0,07			6.743.793,28	1,00
NTN-B 150850 (6,261000%)		0,07	0,00	0,07			5.616.472,46	0,83
NTN-B 150850 (6,278000%)		0,07	0,00	0,07			5.163.985,99	0,76
NTN-B 150850 (6,400000%)		0,07	0,00	0,07			3.079.867,84	0,45
Sub-total	0,13	0,06	0,00		-2,13	0,69	309.008.495,32	45,60

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,83	0,03	0,04			20.887.982,25	3,08
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,95	0,05	0,03			20.581.430,07	3,04
Sub-total	6,91	2,38	0,08		-0,35	-1,46	41.469.412,32	6,12

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF		1,81	0,00	1,80			5.120.643,00	0,76
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			20.644.708,52	3,05
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			21.070.781,79	3,11
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,02	-0,00	0,02			28.311.386,02	4,18
Sub-total	0,30	0,12	0,00		-0,08	0,95	75.147.519,33	11,09

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a		0,15	-0,00	0,16			5.159.895,90	0,76
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a		0,15	-0,00	0,15			5.154.722,51	0,76
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a		0,15	-0,00	0,15			5.155.015,24	0,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a		0,18	-0,00	0,19			5.500.507,12	0,81
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a		0,14	-0,00	0,15			5.150.895,58	0,76
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a		0,10	-0,00	0,11			6.012.150,34	0,89
Sub-total	16,13	0,11	-0,00		-0,01	0,78	32.133.186,69	4,74

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III		16,61	0,00	16,61			197.164,17	0,03
Sub-total	985,19	16,61	0,00		1,53	1.504,61	197.164,17	0,03

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV		0,02	0,00	0,02			3.420.015,38	0,50
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,10	-0,00	0,10			5.907.802,52	0,87
Sub-total	0,04	0,06	-0,00		2,85	1,08	9.327.817,90	1,38

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,08%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA		8,92	0,04	5,48			4.150.215,63	0,61
META VALOR FI DE AÇÕES		9,31	0,02	4,32			2.030.259,73	0,30
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		9,39	0,08	5,28			7.148.615,99	1,05
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,28	0,04	3,79			5.024.774,19	0,74
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		7,40	0,19	3,01			21.738.818,01	3,21
OCCAM FIC FIA		7,30	0,27	1,28			29.821.164,69	4,40
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		7,93	0,06	4,19			5.984.406,39	0,88
INDIE FIC FIA		8,79	0,04	4,68			3.691.165,59	0,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TARPON GT 30 FIC FIA		7,86	0,08	6,08			9.397.866,60	1,39
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA		8,34	0,06	7,12			7.369.574,27	1,09
Sub-total	15,35	7,08	0,88		0,01	1,14	96.356.861,09	14,22

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,76%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO		5,19	0,01	8,82			7.523.054,19	1,11
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		5,23	0,10	5,23			17.837.505,45	2,63
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		5,24	0,17	5,31			29.687.177,00	4,38
Sub-total	9,20	4,52	0,28		-0,53	-3,92	55.047.736,64	8,12

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME		0,09	-0,00	0,11			11.127.914,40	1,64
Sub-total	5,36	0,09	-0,00		-0,46	-1,50	11.127.914,40	1,64

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,42%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		7,78	0,11	6,63			14.870.080,26	2,19
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		12,63	0,01	11,22			1.820.305,59	0,27
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		7,64	-0,00	7,38			2.370.991,18	0,35
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,37	-0,00	8,46			2.302.563,95	0,34
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,21	0,00	9,21			2.637.951,63	0,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		7,77	-0,00	7,70			5.103.100,20	0,75
Sub-total	9,57	5,78	0,11		-0,59	-4,66	29.104.992,81	4,29

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		6,57	0,05	10,38			18.751.497,87	2,77
Sub-total	10,83	6,57	0,05		-0,35	-2,80	18.751.497,87	2,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

16. Relatório de Cenário Macroeconômico

No mês de setembro, no cenário internacional, foi marcado pela alta nas curvas de juros, refletindo um discurso mais duro dos bancos centrais e a sinalização de que as taxas devem seguir em níveis elevados por mais tempo, dados os patamares de inflação ainda pressionados e a atividade econômica resiliente. Nos EUA, os dados mostram uma atividade econômica ainda sólida, com o mercado de trabalho ainda aquecido e previsão de crescimento do PIB no terceiro trimestre do ano. Além disso, os gastos de diversos programas mostraram avanço enquanto a arrecadação teve importante queda, levando a uma situação de déficit elevado. Ainda nos EUA, o FED manteve a sinalização de uma alta adicional de 0,25% dos juros básicos ainda em 2023, e surpreendeu com uma revisão para cima dos juros para os anos seguintes, indicando uma trajetória de cortes mais lenta do que as expectativas apontavam. Assim, vai se consolidando uma perspectiva de juros em patamares elevados por mais tempo. Adicionalmente, o FED reduziu seu balanço através da venda de títulos. Este desequilíbrio no mercado de títulos vem provocando elevação das taxas de juros, sobretudo em títulos mais longos. Na economia chinesa, houve alívio com os últimos dados de atividade que demonstraram certa estabilidade e maior assertividade do governo chinês no suporte ao setor imobiliário. Ainda assim, há um cenário de cautela com a trajetória da economia, com perspectiva de crescimento abaixo do potencial. Assim, no mês de setembro 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 -4,27% e -4,87%, 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 +18,69% e +19,59%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de -2,61% e -3,22%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +9,93% e +10,76% nos últimos 12 meses.

No Brasil, as curvas de juros tiveram alta, refletindo o movimento observado no exterior e impactada pelas incertezas a respeito da evolução da política fiscal. Nesse momento, o mercado se questiona quanto à capacidade do governo conseguir entregar suas metas fiscais em um momento de expectativas de inflação ainda desancoradas. A dinâmica do cenário fiscal brasileiro segue desafiadora. Uma vez que a lenta tramitação das medidas para elevar as receitas no Congresso e dificuldade de cortar despesas continuam apontando para uma baixa probabilidade que o governo consiga atingir a meta de estabilidade do resultado primário em 2024. A inflação ainda segue uma evolução construtiva, inclusive com desaceleração do núcleo do IPCA um pouco mais acentuada do que o esperado. Entretanto, ainda é esperado um ritmo gradual de queda inflacionária. O Banco Central deu continuidade ao ciclo de afrouxamento monetário, reduzindo os juros com um corte de 0,50% da taxa Selic para 12,75%. Além disso, houve a sinalização de que este ritmo deverá ser mantido nas próximas reuniões, sendo suficiente para haja a convergência do IPCA para a meta. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, apesar do movimento dos índices globais. Apresentando um retorno positivo de +0,71% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +6,22% e de +5,93% nos últimos 12 meses.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

17. Agenda realizada

01 de setembro:

XP Expert: Evento realizado na cidade de São Paulo com a participação de várias gestoras e palestras na área de Investimentos. Participaram do evento Luís Gustavo Ferreira Bonacina, Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Fabíola Melo – Assessora da Presidência e Rossana Vasques, presidente do IPMJ.

02 de setembro:

XP Expert: Evento realizado na cidade de São Paulo com a participação de várias gestoras e palestras na área de Investimentos. Participaram do evento Luís Gustavo Ferreira Bonacina, Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Fabíola Melo – Assessora da Presidência e Rossana Vasques, presidente do IPMJ.

05 de setembro:

10h30: Reunião com a gestora Safra Asset Management através dos seus representantes Edmilson Alves e Sergio Ribeiro. 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 e Rossana Vasques, Presidente do IPMJ.

06 de setembro:

10h00: Reunião com a MARSCHÉ Agente Autônomo de Investimentos através do seu representante Paulo Rossetti. O objetivo da reunião foi a apresentação institucional, visão geral do mercado, apresentação dos fundos Vokin GBV Aconcágua FIC FIA e Inter Corporate FI RF CP. Participaram da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina, Gestor dos Recursos e Rossana Vasques, Presidente do IPMJ.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

13 de setembro:

9h00: Tricentésima nonagésima segunda (392ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, ocorrida em 13 de setembro de 2023, tendo início às 9h25, 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 Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, José Ricardo Vinhas e Clévio Vitor de Almeida. Ausência justificada de Rafaela Carvalho dos Santos. Pautas da reunião: 1) Reunião com gestores da Kínitro Capital; 2) Assuntos Diversos.

14 de setembro:

9h00: Tricentésima nonagésima terceira (393ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros (CAIF) do Instituto de Previdência do Município de Jacareí (IPMJ), ocorrida em 14 de setembro de 2023, tendo início às 9h20 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 e Clévio Vitor de Almeida. Ausências justificadas de José Ricardo Vinhas e Rafaela Carvalho dos Santos. Pautas da reunião: 1) Análise do relatório de investimentos de agosto de 2023; 2) Análise da carteira fechada de agosto de 2023; 3) Assuntos diversos.

29 de setembro:

11h00: Reunião com a gestora VINCI PARTNERS na cidade de São Paulo com seus representantes Eduardo Reichert e Marcelo Genco. O objetivo da reunião foi a apresentação institucional da gestora e uma visão geral do mercado, ofertando opções de aplicações de FIPs e demais estratégias ao RPPS. Participaram 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.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Em setembro de 2023, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um prejuízo de R\$ 262.995,91 (duzentos e sessenta e dois mil e novecentos e noventa e cinco reais e noventa e um centavos negativos) e um rendimento negativo acumulado, R\$ 1.475.167,47 (um milhão e quatrocentos e setenta e cinco mil e cento e sessenta e sete reais e quarenta e sete centavos negativos), o total de amortizações já entregue é de R\$ 6.908.769,93 (seis milhões e novecentos e oito mil e setecentos e sessenta e nove reais e noventa e três centavos). O total aplicado representa um valor de R\$ 7.368.930,01 (sete milhões e trezentos e sessenta e oito mil e novecentos e trinta reais e um centavo). O saldo em 30 de setembro de 2023 é de R\$ 197.164,17 (cento e noventa e sete mil e cento e sessenta e quatro reais e dezessete centavos).

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

O Fundo KINEA PRIVATE EQUITY apresenta um valor total aplicado de R\$ 9.095.886,00 (nove milhões e noventa e cinco mil e oitocentos e oitenta e seis reais), e um rendimento acumulado de R\$ 2.608.809,53 (dois milhões e seiscentos e oito mil e oitocentos e nove reais e cinquenta e três centavos). O saldo acumulado em 30 de setembro de 2023 é de R\$ 11.127.914,40 (onze milhões e cento e vinte e sete mil e novecentos e quatorze reais e quarenta centavos) com um rendimento no mês de setembro de R\$ 169.155,31 (cento e sessenta e nove mil e cento e cinquenta e cinco reais e trinta e um centavos negativos).

Por fim, no mês de setembro a Gestora comunicou aos cotistas do fundo sobre a amortização que ocorreu no dia 13 de setembro de 2023. A distribuição dos recursos foi referente ao recebimento dos dividendos de Wiser, dos JCP de Panvel e +A Educação, de um % do caixa do Fundo e, principalmente, dos dividendos extraordinários da Matera. Nos últimos anos, a Matera tem apresentado níveis de crescimento e rentabilidade saudáveis e vem acumulando valores excedentes em caixa. A distribuição dos dividendos extraordinários tem como principais objetivos a otimização da estrutura de capital da Companhia e a remuneração de seus acionistas pelo capital investido. O valor a ser distribuído representa 1,55% do Capital Comprometido Total do FIP Kinea IV. O IPMJ recebeu R\$ 154.865,00 (cento e cinquenta e quatro mil e oitocentos e sessenta e cinco reais).