



LDB
EMPRESAS

JACAREÍ
OUTUBRO 2023



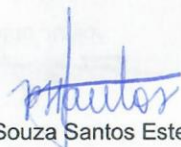
Sumário

1.	PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS	3
2.	RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS	4
3.	Posição de Ativos e Enquadramento	1
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	52
I.	FIDC MULSTISETORIAL MASTER III	52
19.	Fundos Estruturados.....	52
II.	(FIP) KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	52

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 outubro de 2023, que é elaborado mensalmente pela Unidade de Gestão de Investimentos.

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



Renata de Souza Santos Esteves

Diretora do Dep. Administrativo-Financeiro – CPA 10



Luis Gustavo Ferreira Bonacina

Assessor da Presidência – CPA 20

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**

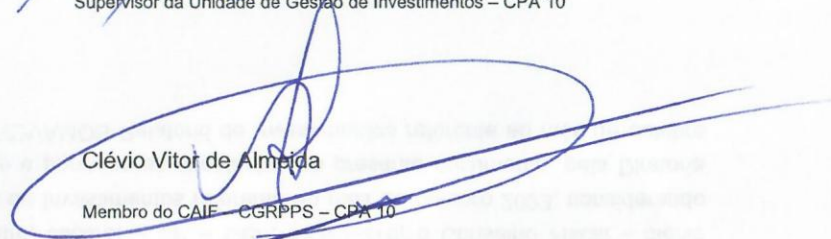
Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do CAIF



Amauri Arnaldo Junior

Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos – CPA 10



Clévio Vitor de Almeida

Membro do CAIF – CGRPPS – CPA 10

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**

José Ricardo Vinhas

Membro do CAIF

2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

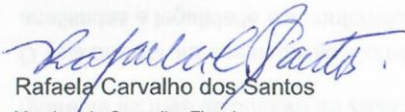
Aos 17 dias do mês de novembro de 2023 nas dependências do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, situado na rua Antônio Afonso, nº 513 – Centro, Jacareí – SP – CEP: 12327-270, o Conselho Fiscal – biênio 2021/2023, reuniu-se para análise do Relatório de Investimentos referente ao mês de outubro 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 outubro de 2023.

Jacareí, 17 de novembro 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

69,58%

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%)	0,36	0,03	0,69	8,77	2.224.148,10	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,36	0,04	0,71	9,06	1.087.794,83	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,680000%)	4,02	0,05	0,70	3,46	20.688.056,02	3,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,40	0,03	0,64	8,24	2.251.437,02	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,40	0,03	0,64	8,26	2.247.814,89	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,40	0,03	0,64	8,29	2.247.057,64	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,40	0,03	0,67	8,53	2.237.151,10	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,40	0,03	0,67	8,61	2.238.561,22	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,40	0,03	0,68	8,64	2.237.736,54	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,670000%)	4,00	0,04	0,70	3,45	1.549.194,14	0,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,40	0,04	0,72	9,08	2.091.918,08	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,40	0,04	0,72	9,09	3.274.016,21	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,40	0,03	0,65	8,34	2.264.669,62	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,40	0,03	0,65	8,35	2.261.935,03	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,40	0,03	0,65	8,39	2.257.925,93	0,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,285000%)	0,40	0,03	0,67	8,61	2.245.910,52	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,40	0,03	0,68	8,65	2.245.172,67	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,40	0,03	0,68	8,69	2.243.772,87	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,40	0,04	0,72	9,07	5.282.694,58	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,40	0,04	0,72	9,10	2.182.557,99	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	0,36	0,04	0,72	9,13	2.099.701,47	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,40	0,04	0,72	9,14	6.415.726,59	0,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,40	0,04	0,72	9,15	2.093.690,98	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	0,36	0,04	0,74	9,34	4.707.936,88	0,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,41	0,04	0,75	9,44	3.711.566,67	0,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,280000%)	3,02	0,04	0,75	7,36	3.125.400,71	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	3,06	0,04	0,76	9,56	2.130.790,18	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,000000%)	0,40	0,03	0,65	8,36	2.270.008,62	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,40	0,03	0,65	8,39	2.264.992,85	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,40	0,03	0,65	8,41	2.260.003,31	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,40	0,03	0,68	8,63	2.249.184,67	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,40	0,03	0,68	8,68	2.250.364,79	0,34
TESOURO	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,41	0,03	0,68	8,72	2.248.421,84	0,34

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%)	0,41	0,03	0,69	8,81	2.239.917,57	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,40	0,04	0,72	9,07	11.630.784,01	1,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,40	0,04	0,72	9,10	2.180.966,98	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	0,36	0,04	0,72	9,13	5.238.494,58	0,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,40	0,04	0,72	9,16	2.096.422,11	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,40	0,04	0,73	9,17	17.107.211,64	2,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	0,36	0,04	0,74	9,34	9.410.254,98	1,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,41	0,04	0,75	9,44	8.475.649,35	1,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,268000%)	3,03	0,04	0,75	7,35	7.290.630,43	1,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	3,08	0,04	0,76	9,56	5.330.979,85	0,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,42	0,03	0,68	8,66	2.190.241,25	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,450000%)	0,41	0,03	0,69	8,75	2.222.360,12	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,41	0,04	0,72	9,14	2.181.191,15	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,40	0,03	0,65	8,37	2.219.888,79	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,41	0,03	0,66	8,47	2.221.885,68	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,41	0,03	0,67	8,53	2.222.902,53	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,41	0,03	0,69	8,78	2.227.899,10	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%)	0,41	0,03	0,71	8,97	3.262.474,44	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,40	0,03	0,64	8,23	2.234.014,02	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,41	0,03	0,66	8,47	2.226.973,26	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,41	0,03	0,67	8,57	2.229.853,95	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,41	0,03	0,67	8,59	2.227.190,22	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,41	0,04	0,71	9,06	3.269.960,44	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,40	0,03	0,64	8,24	2.242.659,11	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,40	0,03	0,64	8,28	2.237.837,00	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,41	0,03	0,66	8,51	2.231.057,87	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,41	0,03	0,67	8,59	2.233.274,10	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,300000%)	0,41	0,03	0,67	8,62	2.234.066,23	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,460000%)	2,84	0,03	0,69	3,36	3.515.496,13	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,41	0,03	0,69	8,79	2.231.977,07	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,835000%)	0,41	0,04	0,72	9,08	3.271.898,47	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,40	0,03	0,65	8,32	2.259.236,99	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,40	0,03	0,65	8,34	2.249.794,38	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,40	0,03	0,65	8,38	2.251.972,50	0,34
TESOURO	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,41	0,03	0,67	8,60	2.242.866,75	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%)	0,41	0,03	0,67	8,63	2.243.530,87	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,41	0,03	0,68	8,67	2.240.913,00	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,41	0,04	0,72	9,08	2.095.188,55	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,41	0,04	0,72	9,09	3.271.752,93	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,41	0,04	0,75	9,41	3.087.489,82	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,40	0,03	0,65	8,31	2.272.024,01	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,40	0,03	0,65	8,35	2.269.211,21	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,40	0,03	0,65	8,37	2.264.694,65	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,40	0,03	0,65	8,40	2.258.651,54	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,41	0,03	0,67	8,62	2.247.970,02	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,41	0,03	0,68	8,67	2.246.945,08	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,41	0,03	0,68	8,71	2.245.649,08	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,510000%)	0,41	0,03	0,69	8,80	2.238.470,86	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,41	0,04	0,72	9,07	8.455.662,02	1,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	0,36	0,04	0,72	9,13	3.140.818,92	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,41	0,04	0,72	9,15	2.095.935,91	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,41	0,04	0,73	9,17	11.425.326,47	1,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	0,36	0,04	0,74	9,34	6.793.734,94	1,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,42	0,04	0,75	9,44	5.658.603,44	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,278000%)	3,03	0,04	0,75	7,36	5.202.789,83	0,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	0,36	0,04	0,76	9,56	3.103.308,45	0,46
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,37	0,04	0,70	8,95	311.186.269,21	46,44

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,19	-0,09	-0,66	-1,19	20.749.189,12	3,10	5.036.600.197,80	0,41
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,99	-0,15	-0,99	-3,51	20.378.061,85	3,04	1.473.904.353,82	1,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,47	-0,12	-0,83	-2,36	41.127.250,97	6,14		

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	5,05	0,41	0,25	2,67	5.133.628,50	0,77	229.624.594,02	2,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,99	4,24	20.848.725,65	3,11	15.296.039.303,73	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,05	0,99	11,24	21.279.613,16	3,18	5.784.928.154,82	0,37
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,05	1,01	11,23	24.761.175,15	3,70	2.862.461.637,51	0,87
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,21	0,07	0,95	10,83	72.023.142,46	10,75		

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	0,84	0,34	0,79	4,02	5.200.870,85	0,78		

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	0,82	0,37	0,82	3,94	5.197.186,13	0,78		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	0,78	0,34	0,79	3,91	5.195.537,84	0,78		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	9,75	0,42	0,88	10,04	5.549.142,70	0,83		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	0,81	0,36	0,81	3,85	5.192.475,15	0,77		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 7,00% a.a	16,21	0,35	0,82	10,08	6.061.383,50	0,90		
Sub-total Artigo 7º IV			4,70	0,36	0,82	9,93	32.396.596,17	4,83		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLURAL	GENIAL	FIDC MULTISETORIAL BVA MASTER III	353,22	-78,97	-61,58	912,36	41.464,91	0,01	1.434.352,64	2,89
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			353,22	-78,97	-61,58	912,36	41.464,91	0,01		

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	1,02	11,29	3.454.987,13	0,52	12.459.026.720,45	0,03
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,49	0,06	1,07	11,13	5.970.841,34	0,89	3.791.509.102,63	0,16
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,54	0,05	1,05	10,83	9.425.828,47	1,41		
Renda Fixa			0,55	0,02	0,62	8,89	466.200.552,19	69,58		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

13,76%

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	25,82	1,49	-7,35	-6,10	3.845.290,49	0,57	167.491.717,23	2,30
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	23,79	1,29	-6,52	-16,47	1.897.877,32	0,28	165.682.328,70	1,15
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	23,02	0,81	-7,30	-3,25	6.626.542,82	0,99	228.269.839,50	2,90
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	18,85	0,78	-3,86	-1,30	4.830.792,30	0,72	1.324.423.181,38	0,36
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	17,89	0,55	-2,97	2,10	21.093.540,42	3,15	613.937.709,09	3,44
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	16,84	0,38	-2,37	-0,28	29.115.633,81	4,35	711.500.329,57	4,09
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	21,08	0,11	-3,03	21,89	5.802.869,62	0,87	375.460.858,43	1,55
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	23,71	0,67	-8,59	5,23	3.374.060,74	0,50	362.963.547,42	0,93
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	21,30	0,50	-6,04	30,87	8.830.106,91	1,32	793.042.647,69	1,11
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,19	-0,65	-7,60	5,68	6.809.123,60	1,02	273.503.555,60	2,49
Sub-total Artigo 8º I			17,68	0,46	-4,29	3,06	92.225.838,03	13,76		
Renda Variável			17,68	0,46	-4,29	3,06	92.225.838,03	13,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,90%

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	22,00	0,86	-2,68	20,26	14.471.476,61	2,16	209.993.239,85	6,89
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	37,00	2,93	-9,79	5,97	1.642.175,08	0,25	97.112.745,43	1,69
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,29	-0,89	-5,84	-20,85	2.232.618,63	0,33	54.554.124,95	4,09
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,54	0,14	-7,96	-13,27	2.119.309,12	0,32	51.295.017,44	4,13
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	25,72	0,68	-4,04	17,98	2.531.404,59	0,38	600.007.581,21	0,42
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	19,02	-0,21	-3,95	-1,12	4.901.400,22	0,73	277.036.853,08	1,77
Sub-total Artigo 9º II			16,73	0,58	-4,15	7,51	27.898.384,25	4,16		

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	18,88	0,43	-2,05	7,80	18.366.502,79	2,74	624.028.529,44	2,94
Sub-total Artigo 9º III			18,88	0,43	-2,05	7,80	18.366.502,79	2,74		
Investimentos no Exterior			16,53	0,52	-3,33	7,62	46.264.887,04	6,90		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,76%

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	14,17	0,07	0,57	12,13	7.565.793,48	1,13	50.763.297,42	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	15,66	0,69	-1,74	15,71	17.527.739,40	2,62	695.782.914,33	2,52
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	15,68	0,69	-1,69	16,26	29.184.904,68	4,36	486.158.774,15	6,00
Sub-total Artigo 10º I			13,65	0,60	-1,40	15,49	54.278.437,56	8,10		

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	-0,35	-0,35	-6,82	11.088.970,80	1,65	353.738.120,58	3,13
Sub-total Artigo 10º II			50,22	-0,35	-0,35	-6,93	11.088.970,80	1,65		

Investimentos Estruturados			14,24	0,44	-1,22	11,35	65.367.408,36	9,76		
-----------------------------------	--	--	--------------	-------------	--------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

Total			3,29	0,15	-0,54	8,22	670.058.685,62	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	311.186.269,21	46,44	0,00	43,00	70,00	58,39	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	41.127.250,97	6,14	0,00	5,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	72.023.142,46	10,75	0,00	12,50	40,00	13,33	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	32.396.596,17	4,83	0,00	2,50	20,00	1,70	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	41.464,91	0,01	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	9.425.828,47	1,41	0,00	2,00	5,00	1,67	5,00
	Total Renda Fixa	466.200.552,19	69,58					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	92.225.838,03	13,76	0,00	14,50	30,00	4,92	30,00
	Total Renda Variável	92.225.838,03	13,76					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	27.898.384,25	4,16	0,00	4,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	18.366.502,79	2,74	0,00	6,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	46.264.887,04	6,90					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	54.278.437,56	8,10	0,00	8,00	10,00	8,39	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	11.088.970,80	1,65	0,00	2,00	5,00	1,61	5,00
	Total Investimentos Estruturados	65.367.408,36	9,76					15,00
Total		670.058.685,62	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	0,70 70,65	8,95 81,17	2,14 68,08	4,16 63,49	11,03 82,19	2.177.773,89	26.527.634,80
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,83 -82,71	-2,36 -21,38	-3,08 -97,95	-2,36 -35,98	-2,36 -17,57	-342.161,35	-998.213,03
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,95 94,76	10,83 98,26	3,15 100,13	6,71 102,47	13,24 98,66	700.923,13	10.087.462,99
Artigo 7º IV % do CDI	0,82 82,17	9,93 90,11	2,34 74,45	4,76 72,66	12,31 91,78	263.409,48	1.847.315,49
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-61,58 -6.172,59	912,36 8.275,94	617,44 19.639,80	1.341,30 20.475,81	896,58 6.682,24	7.364,27	197.045,10
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,05 105,33	10,83 98,20	3,63 115,49	7,47 114,09	12,98 96,74	98.010,57	1.040.147,12
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,29 -1,35	3,06 -0,04	-7,53 -0,31	10,55 2,21	-7,09 -4,59	-4.131.023,06	2.984.587,38
Artigo 9º II % do CDI	-4,15 -415,58	7,51 68,10	-9,02 -286,82	0,98 14,96	9,73 72,54	-1.206.608,56	1.948.209,07
Artigo 9º III % do CDI	-2,05 -205,81	7,80 70,77	-1,21 -38,37	1,98 30,19	9,50 70,77	-384.995,08	1.329.264,13
Artigo 10º I % do CDI	-1,40 -140,09	15,49 140,51	-5,80 -184,45	4,66 71,16	16,10 119,97	-769.299,08	7.279.944,31
Artigo 10º II % do CDI	-0,35 -35,08	-6,93 -62,88	-1,21 -38,49	0,18 2,72	-8,78 -65,45	-38.943,60	-626.500,99
JACAREÍ (Total)						-3.625.549,39	51.616.896,37

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%)	2.208.947,24	0,00	0,00	0,00	2.224.148,10	15.200,86	182.465,00
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.080.079,93	0,00	0,00	0,00	1.087.794,83	7.714,90	91.867,30
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.543.438,50	0,00	0,00	0,00	20.688.056,02	144.617,52	691.183,59
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.237.148,91	0,00	0,00	0,00	2.251.437,02	14.288,11	174.187,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.233.513,58	0,00	0,00	0,00	2.247.814,89	14.301,31	174.244,18
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.232.707,70	0,00	0,00	0,00	2.247.057,64	14.349,94	174.688,82
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.222.358,93	0,00	0,00	0,00	2.237.151,10	14.792,17	178.701,25
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.223.596,71	0,00	0,00	0,00	2.238.561,22	14.964,51	180.377,91
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.222.723,83	0,00	0,00	0,00	2.237.736,54	15.012,71	180.812,74
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.538.377,14	0,00	0,00	0,00	1.549.194,14	10.817,00	51.699,16
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.077.036,28	0,00	0,00	0,00	2.091.918,08	14.881,80	177.045,33
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.250.678,17	0,00	0,00	0,00	3.274.016,21	23.338,04	277.527,20
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.250.100,22	0,00	0,00	0,00	2.264.669,62	14.569,40	176.965,84
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.247.364,45	0,00	0,00	0,00	2.261.935,03	14.570,58	176.920,83
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.243.292,91	0,00	0,00	0,00	2.257.925,93	14.633,02	177.456,03
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.230.906,02	0,00	0,00	0,00	2.245.910,52	15.004,50	180.807,69
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.230.074,10	0,00	0,00	0,00	2.245.172,67	15.098,57	181.673,33
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.228.613,52	0,00	0,00	0,00	2.243.772,87	15.159,35	182.231,44
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.245.135,67	0,00	0,00	0,00	5.282.694,58	37.558,91	446.811,67
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.166.991,57	0,00	0,00	0,00	2.182.557,99	15.566,42	185.071,73
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.084.665,66	0,00	0,00	0,00	2.099.701,47	15.035,81	178.621,51
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.369.690,26	0,00	0,00	0,00	6.415.726,59	46.036,33	546.644,54
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.078.657,58	0,00	0,00	0,00	2.093.690,98	15.033,40	178.499,07
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.673.331,30	0,00	0,00	0,00	4.707.936,88	34.605,58	408.992,71
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.683.947,06	0,00	0,00	0,00	3.711.566,67	27.619,61	325.624,69
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.102.088,07	0,00	0,00	0,00	3.125.400,71	23.312,64	217.210,53
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.114.696,97	0,00	0,00	0,00	2.130.790,18	16.093,21	189.205,63
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.255.350,56	0,00	0,00	0,00	2.270.008,62	14.658,06	177.833,46
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.250.315,44	0,00	0,00	0,00	2.264.992,85	14.677,41	177.950,87
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.245.304,53	0,00	0,00	0,00	2.260.003,31	14.698,78	178.069,82
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.234.103,16	0,00	0,00	0,00	2.249.184,67	15.081,51	181.533,53
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.235.177,59	0,00	0,00	0,00	2.250.364,79	15.187,20	182.557,93
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.233.162,46	0,00	0,00	0,00	2.248.421,84	15.259,38	183.243,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.224.538,60	0,00	0,00	0,00	2.239.917,57	15.378,97	184.229,64
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.548.092,02	0,00	0,00	0,00	11.630.784,01	82.691,99	983.686,86
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.165.412,30	0,00	0,00	0,00	2.180.966,98	15.554,68	184.925,39
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.200.984,07	0,00	0,00	0,00	5.238.494,58	37.510,51	445.621,25
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.081.360,01	0,00	0,00	0,00	2.096.422,11	15.062,10	178.805,25
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.983.998,66	0,00	0,00	0,00	17.107.211,64	123.212,98	1.462.020,14
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.341.085,58	0,00	0,00	0,00	9.410.254,98	69.169,40	817.524,64
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.412.548,16	0,00	0,00	0,00	8.475.649,35	63.101,19	743.957,60
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.236.310,66	0,00	0,00	0,00	7.290.630,43	54.319,77	506.186,00
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.290.712,28	0,00	0,00	0,00	5.330.979,85	40.267,57	473.429,05
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.175.504,63	0,00	0,00	0,00	2.190.241,25	14.736,62	179.525,99
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.207.223,38	0,00	0,00	0,00	2.222.360,12	15.136,74	183.897,67
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.165.546,45	0,00	0,00	0,00	2.181.191,15	15.644,70	187.960,07
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.205.539,06	0,00	0,00	0,00	2.219.888,79	14.349,73	176.298,01
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.207.311,82	0,00	0,00	0,00	2.221.885,68	14.573,86	178.478,89
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.208.216,08	0,00	0,00	0,00	2.222.902,53	14.686,45	179.564,76
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.212.655,20	0,00	0,00	0,00	2.227.899,10	15.243,90	184.974,30
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.239.588,41	0,00	0,00	0,00	3.262.474,44	22.886,03	276.230,19
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.219.852,07	0,00	0,00	0,00	2.234.014,02	14.161,95	174.656,37
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.212.373,44	0,00	0,00	0,00	2.226.973,26	14.599,82	178.748,14
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.215.035,28	0,00	0,00	0,00	2.229.853,95	14.818,67	180.901,92
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.212.337,48	0,00	0,00	0,00	2.227.190,22	14.852,74	181.187,88
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.246.768,37	0,00	0,00	0,00	3.269.960,44	23.192,07	279.268,33
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.228.426,54	0,00	0,00	0,00	2.242.659,11	14.232,57	175.424,41
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.223.564,12	0,00	0,00	0,00	2.237.837,00	14.272,88	175.728,23
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.216.339,73	0,00	0,00	0,00	2.231.057,87	14.718,14	179.904,37
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.218.379,04	0,00	0,00	0,00	2.233.274,10	14.895,06	181.633,50
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.219.112,47	0,00	0,00	0,00	2.234.066,23	14.953,76	182.202,56
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.491.523,22	0,00	0,00	0,00	3.515.496,13	23.972,91	115.745,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.216.686,54	0,00	0,00	0,00	2.231.977,07	15.290,53	185.401,09
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.248.629,01	0,00	0,00	0,00	3.271.898,47	23.269,46	280.023,87
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.244.738,66	0,00	0,00	0,00	2.259.236,99	14.498,33	178.021,44
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.235.319,71	0,00	0,00	0,00	2.249.794,38	14.474,67	177.623,15
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.237.395,94	0,00	0,00	0,00	2.251.972,50	14.576,56	178.658,74
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.227.898,91	0,00	0,00	0,00	2.242.866,75	14.967,84	182.305,79
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.228.495,98	0,00	0,00	0,00	2.243.530,87	15.034,89	182.976,57
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.225.808,42	0,00	0,00	0,00	2.240.913,00	15.104,58	183.620,70
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.080.284,06	0,00	0,00	0,00	2.095.188,55	14.904,49	179.304,72
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.248.431,50	0,00	0,00	0,00	3.271.752,93	23.321,43	280.441,19
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.064.599,86	0,00	0,00	0,00	3.087.489,82	22.889,96	273.212,67
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.257.460,21	0,00	0,00	0,00	2.272.024,01	14.563,80	178.713,11
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.254.593,91	0,00	0,00	0,00	2.269.211,21	14.617,30	179.194,17
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.250.055,09	0,00	0,00	0,00	2.264.694,65	14.639,56	179.360,88
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.243.987,47	0,00	0,00	0,00	2.258.651,54	14.664,07	179.493,11
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.232.931,20	0,00	0,00	0,00	2.247.970,02	15.038,82	182.990,10
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.231.801,08	0,00	0,00	0,00	2.246.945,08	15.144,00	184.023,05
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.230.424,10	0,00	0,00	0,00	2.245.649,08	15.224,98	184.782,23
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.223.118,21	0,00	0,00	0,00	2.238.470,86	15.352,65	185.915,82
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.395.547,42	0,00	0,00	0,00	8.455.662,02	60.114,60	723.150,76
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.118.330,02	0,00	0,00	0,00	3.140.818,92	22.488,90	270.197,86
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.080.887,55	0,00	0,00	0,00	2.095.935,91	15.048,36	180.694,19
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.343.035,75	0,00	0,00	0,00	11.425.326,47	82.290,72	987.546,69
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.743.793,28	0,00	0,00	0,00	6.793.734,94	49.941,66	597.111,02
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.616.472,46	0,00	0,00	0,00	5.658.603,44	42.130,98	502.580,40
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.163.985,99	0,00	0,00	0,00	5.202.789,83	38.803,84	364.381,05
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.079.867,84	0,00	0,00	0,00	3.103.308,45	23.440,61	278.924,33
	309.008.495,32	0,00	0,00	0,00	311.186.269,21	2.177.773,89	

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	20.581.430,07	0,00	0,00	0,00	20.378.061,85	-203.368,22	-747.402,15
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.887.982,25	0,00	0,00	0,00	20.749.189,12	-138.793,13	-250.810,88
	41.469.412,32	0,00	0,00	0,00	41.127.250,97	-342.161,35	

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	20.644.708,52	0,00	0,00	0,00	20.848.725,65	204.017,13	848.725,65
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	21.070.781,79	0,00	0,00	0,00	21.279.613,16	208.831,37	4.165.696,41
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5.120.643,00	0,00	0,00	0,00	5.133.628,50	12.985,50	133.628,50
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	28.311.386,02	6.150.700,00	-9.976.000,00	0,00	24.761.175,15	275.089,13	3.080.187,70
	75.147.519,33	6.150.700,00	-9.976.000,00	0,00	72.023.142,46	700.923,13	

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	5.155.015,24	0,00	0,00	0,00	5.195.537,84	40.522,60	195.537,84
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	5.159.895,90	0,00	0,00	0,00	5.200.870,85	40.974,95	200.870,85
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a	6.012.150,34	0,00	0,00	0,00	6.061.383,50	49.233,16	555.160,40
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	5.150.895,58	0,00	0,00	0,00	5.192.475,15	41.579,57	192.475,15
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	5.154.722,51	0,00	0,00	0,00	5.197.186,13	42.463,62	197.186,13
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.500.507,12	0,00	0,00	0,00	5.549.142,70	48.635,58	506.085,12
	32.133.186,69	0,00	0,00	0,00	32.396.596,17	263.409,48	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	197.164,17	0,00	0,00	163.063,53	41.464,91	7.364,27	197.045,10
	197.164,17	0,00	0,00	163.063,53	41.464,91	7.364,27	

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	3.420.015,38	0,00	0,00	0,00	3.454.987,13	34.971,75	350.366,60
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	5.907.802,52	0,00	0,00	0,00	5.970.841,34	63.038,82	598.076,63
	9.327.817,90	0,00	0,00	0,00	9.425.828,47	98.010,57	

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	7.148.615,99	0,00	0,00	0,00	6.626.542,82	-522.073,17	-222.901,39
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.024.774,19	0,00	0,00	0,00	4.830.792,30	-193.981,89	-63.661,81
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	5.984.406,39	0,00	0,00	0,00	5.802.869,62	-181.536,77	638.770,41
INDIE FIC FIA	3.691.165,59	0,00	0,00	0,00	3.374.060,74	-317.104,85	167.593,92
META VALOR FI DE AÇÕES	2.030.259,73	0,00	0,00	0,00	1.897.877,32	-132.382,41	-374.255,02
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	21.738.818,01	0,00	0,00	0,00	21.093.540,42	-645.277,59	720.926,58
OCCAM FIC FIA	29.821.164,69	0,00	0,00	0,00	29.115.633,81	-705.530,88	-80.943,72
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	4.150.215,63	0,00	0,00	0,00	3.845.290,49	-304.925,14	-249.908,54
TARPON GT 30 FIC FIA	9.397.866,60	0,00	0,00	0,00	8.830.106,91	-567.759,69	2.083.075,14
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	7.369.574,27	0,00	0,00	0,00	6.809.123,60	-560.450,67	365.891,81
	96.356.861,09	0,00	0,00	0,00	92.225.838,03	-4.131.023,06	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	14.870.080,26	0,00	0,00	0,00	14.471.476,61	-398.603,65	2.437.853,23
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.820.305,59	0,00	0,00	0,00	1.642.175,08	-178.130,51	92.533,96
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.370.991,18	0,00	0,00	0,00	2.232.618,63	-138.372,55	-588.058,92
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.302.563,95	0,00	0,00	0,00	2.119.309,12	-183.254,83	-324.296,25
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.637.951,63	0,00	0,00	0,00	2.531.404,59	-106.547,04	385.814,18
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	5.103.100,20	0,00	0,00	0,00	4.901.400,22	-201.699,98	-55.637,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	29.104.992,81	0,00	0,00	0,00	27.898.384,25	-1.206.608,56	

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	18.751.497,87	0,00	0,00	0,00	18.366.502,79	-384.995,08	1.329.264,13
	18.751.497,87	0,00	0,00	0,00	18.366.502,79	-384.995,08	

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	29.687.177,00	0,00	0,00	0,00	29.184.904,68	-502.272,32	4.081.855,08
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	7.523.054,19	0,00	0,00	0,00	7.565.793,48	42.739,29	818.452,47
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	17.837.505,45	0,00	0,00	0,00	17.527.739,40	-309.766,05	2.379.636,76
	55.047.736,64	0,00	0,00	0,00	54.278.437,56	-769.299,08	

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	11.127.914,40	0,00	0,00	0,00	11.088.970,80	-38.943,60	-611.424,76
	11.127.914,40	0,00	0,00	0,00	11.088.970,80	-38.943,60	

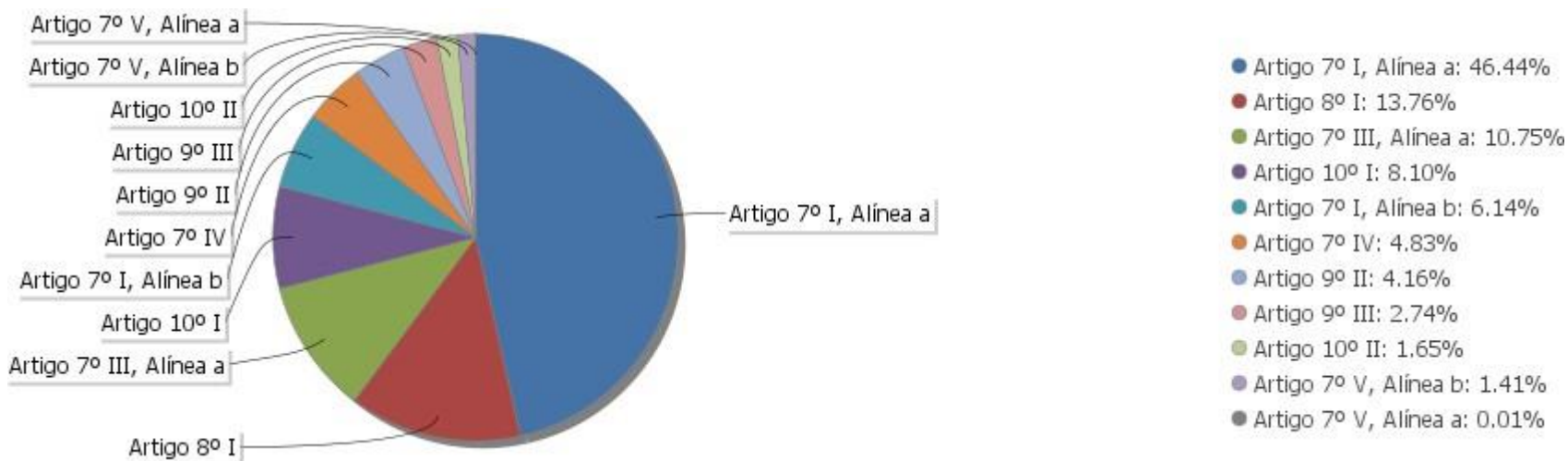
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

6. Análise de Liquidez

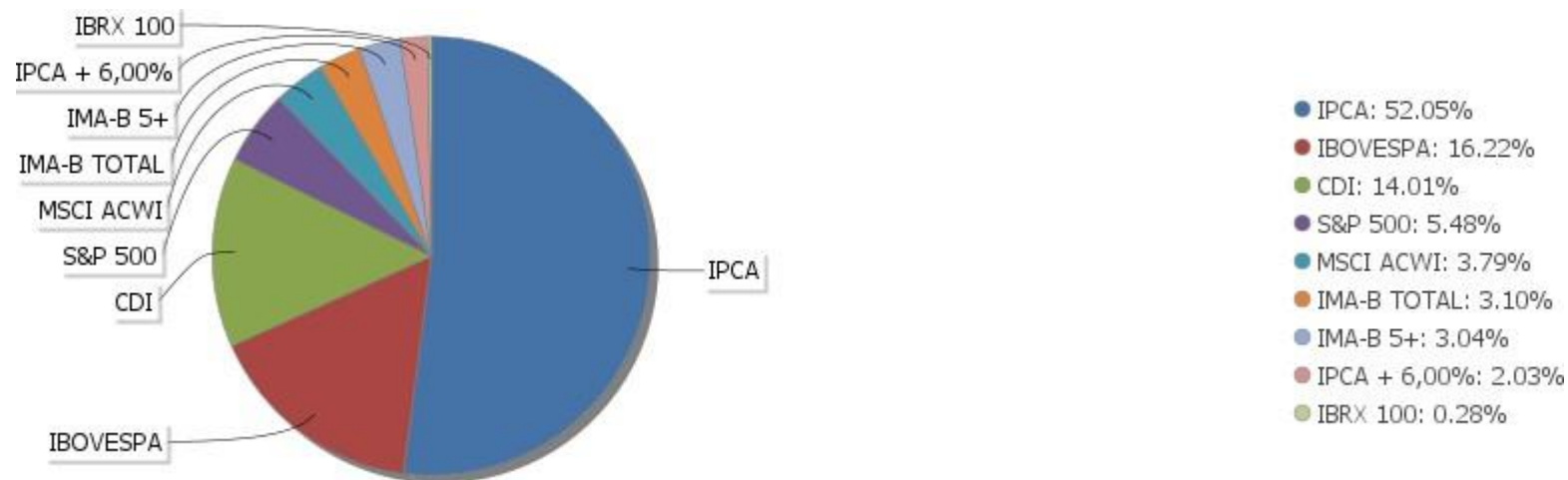
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	255.667.436,86	38,16	255.667.436,86	38,16	15,00
de 31 dias a 365 dias	61.179.576,60	9,13	316.847.013,46	47,29	20,00
acima de 365 dias	353.211.672,16	52,71	670.058.685,62	100,00	25,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

7. Alocação por Artigo

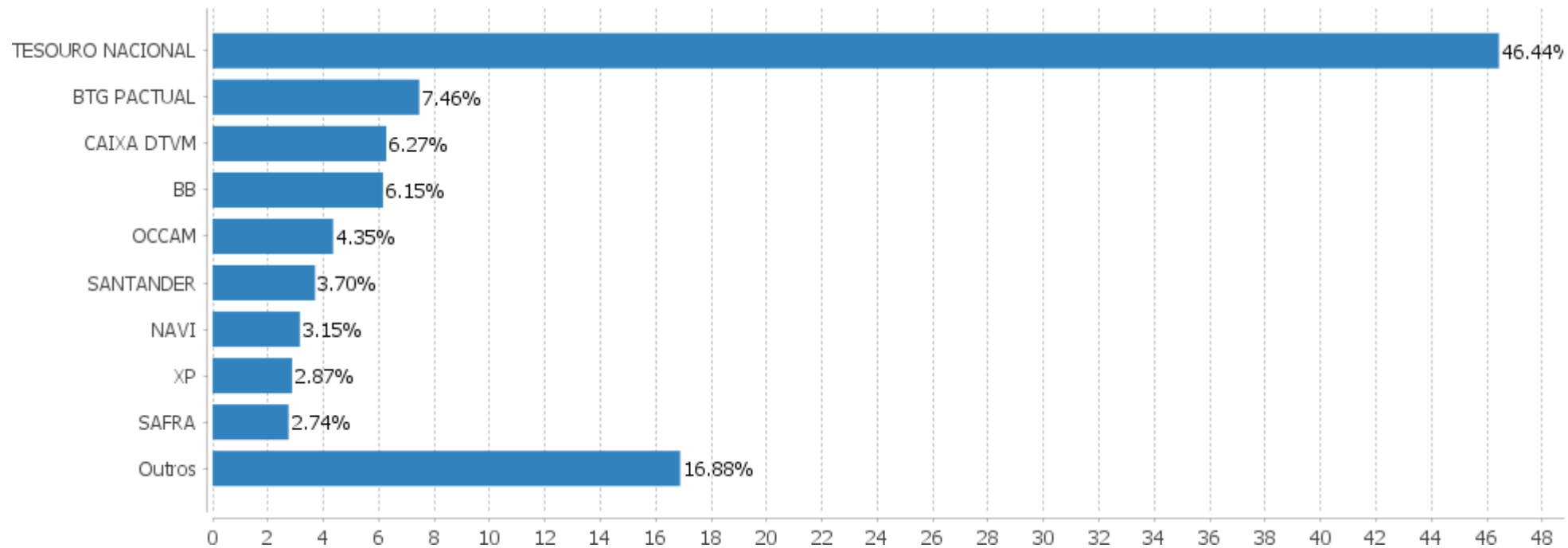


8. Alocação Por Estratégia



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	-0,54			8,22
IPCA + 5,11%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34	0,54	0,69	0,66	0,66			8,13
p.p. indexador	0,97	-1,68	-0,35	-0,12	1,19	1,99	0,89	-0,83	-0,73	-1,19			0,09
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

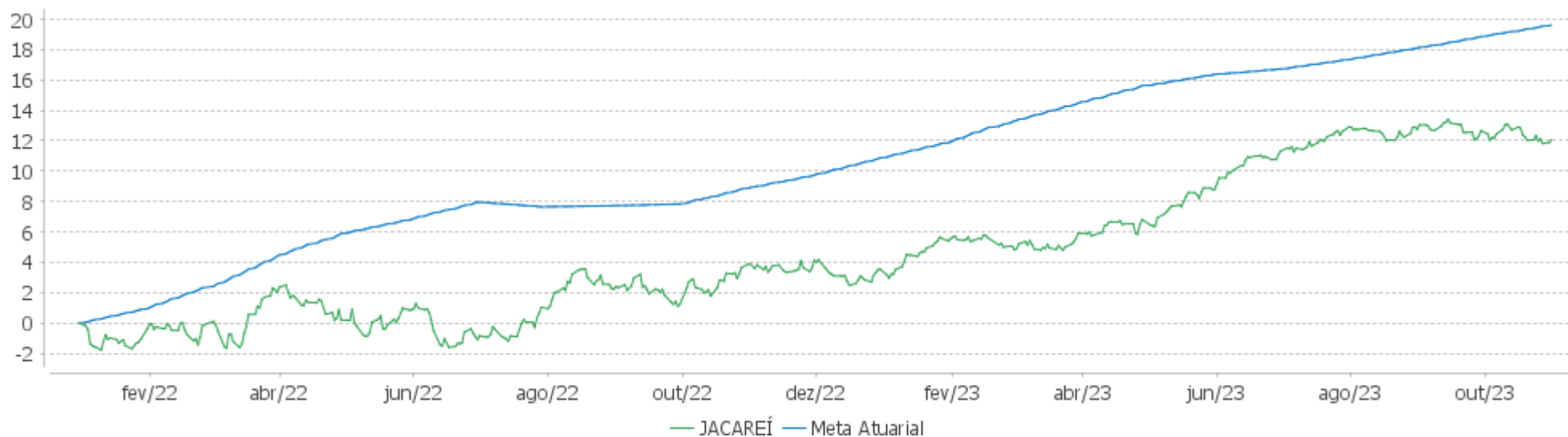
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	8	36,36	03 meses	-0,76	2,01	-2,77	3,12
Meses abaixo - Meta Atuarial	14	63,64	06 meses	4,92	3,59	1,32	3,09
			12 meses	7,88	10,10	-2,23	3,29
			24 meses				
Desde 31/12/2021				12,06	19,88	-7,83	4,65

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,60	2022-10
Menor rentabilidade da Carteira	-1,97	2022-06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

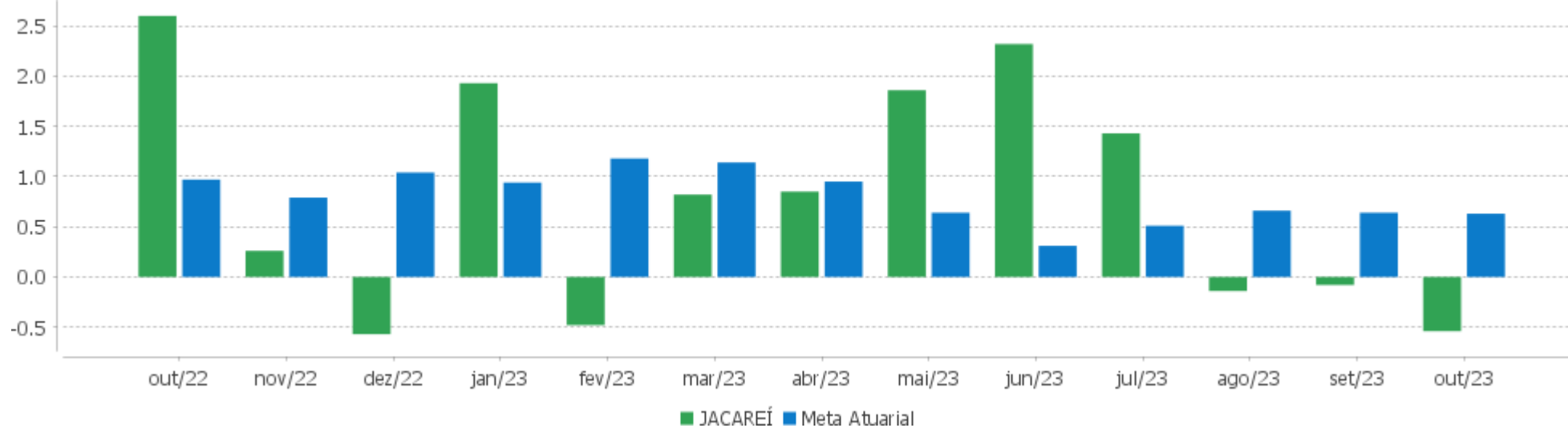


Patrimônio Líquido



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.	0,79 0,55	4,02 3,14	2,38 1,65				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a Var. IPCA p.p.	0,82 0,58	3,94 3,07	2,44 1,71				
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a Var. IPCA p.p.	0,79 0,55	3,91 3,03	2,37 1,64				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,88 0,64	10,04 6,29	2,02 1,28	4,94 3,93			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a Var. IPCA p.p.	0,81 0,57	3,85 2,97	2,39 1,66				
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,82 0,58	10,08 6,33	2,45 1,72	4,83 3,82	12,43 7,61		
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,07 106,96	11,13 100,97	3,85 122,54	7,97 121,69	13,66 101,84	27,57 104,24	35,88 117,05
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	1,02 102,51	11,29 102,37	3,25 103,39	6,80 103,74	13,78 102,68	27,89 105,42	33,11 108,00
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,50	9,34 5,59	2,25 1,52	4,38 3,38	11,53 6,71	19,22 7,62	
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,13 5,38	2,19 1,46	4,26 3,26	11,28 6,46	18,90 7,30	
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,45	8,77 5,03	2,09 1,36	4,05 3,05	10,84 6,02	21,40 9,80	
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,42	8,47 4,72	2,00 1,27	3,88 2,87	10,47 5,65	24,09 12,49	
NTN-B 150533 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,46	5,90 2,15	2,14 1,41	1,25 0,24	4,92 0,11		
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,10 5,35	2,18 1,45	4,24 3,24	11,24 6,42	22,28 10,68	
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,49	9,17 5,43	2,20 1,47	4,29 3,29	11,33 6,51	26,04 14,44	
NTN-B 150545 (5,915000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,14 5,40	2,20 1,46	4,27 3,27	11,29 6,48	22,39 10,79	
NTN-B 150850 (5,831200%)	0,72	9,07	2,18	4,23	11,21	25,76	

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	5,33	1,44	3,23	6,39	14,16	
NTN-B 150826 (5,190000%)	0,67	8,53	2,02	3,91	10,54	24,24	
Var. IPCA p.p.	0,43	4,78	1,29	2,91	5,72	12,64	
NTN-B 150840 (5,837000%)	0,72	9,08	2,18	4,23	11,21	25,77	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,33	1,44	3,23	6,39	14,17	
NTN-B 150830 (5,270000%)	0,67	8,59	2,04	3,95	10,62	24,43	
Var. IPCA p.p.	0,43	4,85	1,31	2,95	5,80	12,83	
NTN-B 150545 (4,970000%)	0,65	8,34	1,96	3,80	10,31	20,60	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,59	1,23	2,80	5,49	9,00	
NTN-B 150840 (4,950000%)	0,65	8,32	1,96	3,79	10,28	23,68	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,57	1,23	2,78	5,47	12,08	
NTN-B 150850 (4,980000%)	0,65	8,35	1,97	3,80	10,32	23,75	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,60	1,23	2,80	5,50	12,15	
NTN-B 150555 (5,927000%)	0,72	9,16	2,20	4,28	11,31	22,41	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,41	1,47	3,27	6,49	10,81	
NTN-B 150850 (5,360000%)	0,68	8,67	2,06	3,99	10,71	24,64	
Var. IPCA p.p.	0,44	4,92	1,33	2,99	5,89	13,04	
NTN-B 150545 (5,922000%)	0,72	9,15	2,20	4,28	11,30	22,40	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,40	1,47	3,27	6,48	10,80	
NTN-B 150535 (4,910000%)	0,64	8,29	1,95	3,77	10,24	20,37	
Var. IPCA p.p.	0,40	4,54	1,22	2,76	5,42	8,77	
NTN-B 150840 (5,020000%)	0,65	8,38	1,98	3,82	10,36	23,84	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,63	1,24	2,82	5,54	12,24	
NTN-B 150555 (5,370000%)	0,68	8,68	2,06	4,00	10,72	21,40	
Var. IPCA p.p.	0,44	4,93	1,33	3,00	5,90	9,80	
NTN-B 150850 (4,940000%)	0,65	8,31	1,96	3,78	10,27	23,65	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,56	1,22	2,78	5,45	12,05	
NTN-B 150826 (5,490000%)	0,69	8,78	2,09	4,06	10,85	24,95	
Var. IPCA p.p.	0,45	5,03	1,36	3,06	6,03	13,35	
NTN-B 150545 (6,280000%)	0,75	9,46	2,29	4,45	8,37	15,89	
Var. IPCA p.p.	0,51	5,71	1,55	3,45	3,55	4,29	
NTN-B 150840 (4,970000%)	0,65	8,34	1,96	3,80	10,31	23,73	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,59	1,23	2,80	5,49	12,12	
NTN-B 150830 (5,460000%)	0,69	5,73	2,08	4,04	7,74		
Var. IPCA p.p.	0,45	1,98	1,35	3,04	2,92		
NTN-B 150850 (6,261000%)	0,75	9,44	2,28	4,45	11,66	26,78	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,51	5,69	1,55	3,44	6,84	15,18	
NTN-B 150555 (5,000000%)	0,65	8,36	1,97	3,81	10,34	20,72	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,61	1,24	2,81	5,52	9,12	
NTN-B 150535 (5,320000%)	0,68	8,64	2,05	3,97	10,67	21,19	
Var. IPCA p.p.	0,44	4,89	1,32	2,97	5,85	9,59	
NTN-B 150535 (5,670000%)	0,70	5,90	2,14	1,25	4,93		
Var. IPCA p.p.	0,46	2,15	1,40	0,25	0,12		
NTN-B 150850 (5,010000%)	0,65	8,37	1,97	3,82	10,35	23,82	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,62	1,24	2,82	5,53	12,22	
NTN-B 150555 (6,261000%)	0,75	9,44	2,28	4,45	11,66	23,02	
Var. IPCA p.p.	0,51	5,69	1,55	3,44	6,84	11,42	
NTN-B 150545 (6,256000%)	0,75	9,44	2,28	4,44	11,65	23,03	
Var. IPCA p.p.	0,51	5,69	1,55	3,44	6,83	11,43	
NTN-B 150555 (5,520000%)	0,69	8,81	2,10	4,07	10,88	21,67	
Var. IPCA p.p.	0,45	5,06	1,37	3,07	6,06	10,07	
NTN-B 150555 (5,860000%)	0,72	9,10	2,18	4,24	11,24	22,29	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,35	1,45	3,24	6,42	10,69	
NTN-B 150545 (5,380000%)	0,68	8,69	2,06	4,00	10,73	21,38	
Var. IPCA p.p.	0,44	4,94	1,33	3,00	5,92	9,78	
NTN-B 150826 (5,009000%)	0,65	8,37	1,97	3,82	10,35	23,82	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,62	1,24	2,81	5,53	12,22	
NTN-B 150545 (6,400000%)	0,76	9,56	2,31	4,51	8,45	16,01	
Var. IPCA p.p.	0,52	5,81	1,58	3,51	3,63	4,41	
NTN-B 150535 (5,855000%)	0,72	9,09	2,18	4,24	11,23	22,25	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,35	1,45	3,24	6,41	10,65	
NTN-B 150555 (5,831200%)	0,72	9,07	2,18	4,23	11,21	22,24	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,33	1,44	3,23	6,39	10,64	
NTN-B 150828 (4,850000%)	0,64	8,23	1,93	3,74	10,18	23,44	
Var. IPCA p.p.	0,40	4,49	1,20	2,73	5,36	11,84	
NTN-B 150545 (5,831000%)	0,72	9,07	2,18	4,23	11,21	22,23	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,33	1,44	3,23	6,39	10,63	
NTN-B 150555 (6,400000%)	0,76	9,56	2,31	4,51	8,43	15,94	
Var. IPCA p.p.	0,52	5,81	1,58	3,51	3,61	4,34	
NTN-B 150828 (5,240000%)	0,67	8,57	2,03	3,93	10,59	24,36	
Var. IPCA p.p.	0,43	4,82	1,30	2,93	5,77	12,76	
NTN-B 150545 (5,340000%)	0,68	8,65	2,05	3,98	10,69	21,30	

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	4,91	1,32	2,98	5,87	9,70	
NTN-B 150850 (5,921000%)	0,72	9,15	2,20	4,28	11,30	25,97	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,40	1,47	3,27	6,48	14,37	
NTN-B 150826 (5,710000%)	0,71	8,97	2,15	4,17	11,08	25,47	
Var. IPCA p.p.	0,47	5,22	1,41	3,17	6,26	13,87	
NTN-B 150535 (4,860000%)	0,64	8,24	1,94	3,74	10,19	20,27	
Var. IPCA p.p.	0,40	4,49	1,20	2,74	5,37	8,67	
NTN-B 150555 (6,268000%)	0,75	9,45	2,28	4,45	8,35	15,84	
Var. IPCA p.p.	0,51	5,70	1,55	3,45	3,53	4,23	
NTN-B 150555 (6,140000%)	0,74	9,34	2,25	4,38	11,53	19,22	
Var. IPCA p.p.	0,50	5,59	1,52	3,38	6,71	7,62	
NTN-B 150828 (5,270000%)	0,67	8,59	2,04	3,95	10,62	24,43	
Var. IPCA p.p.	0,43	4,85	1,31	2,95	5,80	12,83	
NTN-B 150535 (5,290000%)	0,67	8,61	2,04	3,96	10,64	21,13	
Var. IPCA p.p.	0,43	4,86	1,31	2,96	5,82	9,53	
NTN-B 150830 (5,835000%)	0,72	9,08	2,18	4,23	11,21	25,77	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,33	1,44	3,23	6,39	14,17	
NTN-B 150555 (5,315000%)	0,68	8,63	2,05	3,97	10,67	21,30	
Var. IPCA p.p.	0,44	4,88	1,32	2,97	5,85	9,70	
NTN-B 150535 (5,837000%)	0,72	9,08	2,18	4,23	11,21	22,22	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,33	1,44	3,23	6,39	10,62	
NTN-B 150830 (5,300000%)	0,67	8,62	2,04	3,96	10,65	24,50	
Var. IPCA p.p.	0,43	4,87	1,31	2,96	5,83	12,90	
NTN-B 150830 (5,500000%)	0,69	8,79	2,09	4,06	10,86	24,98	
Var. IPCA p.p.	0,45	5,04	1,36	3,06	6,04	13,37	
NTN-B 150545 (5,285000%)	0,67	8,61	2,04	3,96	10,63	21,20	
Var. IPCA p.p.	0,43	4,86	1,31	2,95	5,82	9,60	
NTN-B 150824 (5,450000%)	0,69	8,75	2,08	4,04	10,81	24,86	
Var. IPCA p.p.	0,45	5,00	1,35	3,04	5,99	13,26	
NTN-B 150830 (5,178300%)	0,66	8,51	2,01	3,90	10,52	24,22	
Var. IPCA p.p.	0,42	4,77	1,28	2,90	5,70	12,61	
NTN-B 150545 (5,897000%)	0,72	9,13	2,19	4,26	11,28	18,89	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,38	1,46	3,26	6,46	7,29	
NTN-B 150545 (5,030000%)	0,65	8,39	1,98	3,83	10,37	20,72	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,64	1,25	2,83	5,55	9,11	
NTN-B 150850 (6,400000%)	0,76	9,56	2,31	4,51	11,80	19,57	

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.	0,52	5,81	1,58	3,51	6,98	7,97	
NTN-B 150824 (5,912000%)	0,72	9,14	2,20	4,27	11,29	25,95	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,39	1,46	3,27	6,47	14,35	
NTN-B 150850 (5,045000%)	0,65	8,40	1,98	3,84	10,38	23,90	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,65	1,25	2,83	5,56	12,30	
NTN-B 150555 (5,030000%)	0,65	8,39	1,98	3,83	10,37	20,78	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,64	1,25	2,83	5,55	9,18	
NTN-B 150840 (5,274000%)	0,67	8,60	2,04	3,95	10,62	24,44	
Var. IPCA p.p.	0,43	4,85	1,31	2,95	5,80	12,84	
NTN-B 150826 (5,130000%)	0,66	8,47	2,00	3,88	10,47	24,10	
Var. IPCA p.p.	0,42	4,73	1,27	2,88	5,65	12,50	
NTN-B 150840 (5,360000%)	0,68	8,67	2,06	3,99	10,71	24,64	
Var. IPCA p.p.	0,44	4,92	1,33	2,99	5,89	13,04	
NTN-B 150850 (5,410000%)	0,68	8,71	2,07	4,02	10,77	24,76	
Var. IPCA p.p.	0,44	4,97	1,34	3,02	5,95	13,16	
NTN-B 150840 (5,855000%)	0,72	9,09	2,18	4,24	11,23	25,82	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,35	1,45	3,24	6,41	14,21	
NTN-B 150545 (4,980000%)	0,65	8,35	1,97	3,80	10,32	20,62	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,60	1,23	2,80	5,50	9,02	
NTN-B 150830 (4,860000%)	0,64	8,24	1,94	3,74	10,19	23,47	
Var. IPCA p.p.	0,40	4,49	1,20	2,74	5,37	11,87	
NTN-B 150840 (5,310000%)	0,67	8,63	2,05	3,97	10,66	24,53	
Var. IPCA p.p.	0,43	4,88	1,32	2,97	5,84	12,93	
NTN-B 150824 (5,345000%)	0,68	8,66	2,06	3,99	10,70	24,61	
Var. IPCA p.p.	0,44	4,91	1,32	2,98	5,88	13,01	
NTN-B 150545 (6,140000%)	0,74	9,34	2,25	4,38	11,53	19,23	
Var. IPCA p.p.	0,50	5,59	1,52	3,38	6,71	7,63	
NTN-B 150830 (4,900000%)	0,64	8,28	1,95	3,76	10,23	23,56	
Var. IPCA p.p.	0,40	4,53	1,21	2,76	5,41	11,96	
NTN-B 150850 (5,295500%)	0,67	8,62	2,04	3,96	10,65	24,49	
Var. IPCA p.p.	0,43	4,87	1,31	2,96	5,83	12,89	
NTN-B 150535 (4,880000%)	0,64	8,26	1,94	3,75	10,21	20,31	
Var. IPCA p.p.	0,40	4,51	1,21	2,75	5,39	8,71	
NTN-B 150555 (5,420000%)	0,68	8,72	2,07	4,02	10,78	21,49	
Var. IPCA p.p.	0,44	4,97	1,34	3,02	5,96	9,89	
NTN-B 150850 (5,510000%)	0,69	8,80	2,10	4,07	10,87	25,00	

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.	0,45	5,05	1,36	3,07	6,05	13,40	
NTN-B 150555 (5,897000%)	0,72	9,13	2,19	4,26	11,28	18,90	
Var. IPCA p.p.	0,48	5,38	1,46	3,26	6,46	7,30	
NTN-B 150850 (6,278000%)	0,75	6,21	2,28	4,45	8,36	15,87	
Var. IPCA p.p.	0,51	2,46	1,55	3,45	3,54	4,27	
NTN-B 150840 (6,220000%)	0,75	9,41	2,27	4,42	11,61	26,68	
Var. IPCA p.p.	0,51	5,66	1,54	3,42	6,79	15,08	
NTN-B 150555 (5,950000%)	0,73	9,17	2,20	4,29	11,33	22,46	
Var. IPCA p.p.	0,49	5,43	1,47	3,29	6,51	10,86	
NTN-B 150828 (5,810000%)	0,71	9,06	2,17	4,22	11,18	25,71	
Var. IPCA p.p.	0,47	5,31	1,44	3,22	6,37	14,11	
NTN-B 150555 (5,060000%)	0,65	8,41	1,99	3,84	10,40	20,83	
Var. IPCA p.p.	0,41	4,67	1,25	2,84	5,58	9,23	
NTN-B 150525 (5,810000%)	0,71	9,06	2,17	4,22	11,18	22,12	
Var. IPCA p.p.	0,47	5,31	1,44	3,22	6,37	10,52	
NTN-B 150535 (5,196100%)	0,67	8,53	2,02	3,91	10,54	20,94	
Var. IPCA p.p.	0,43	4,78	1,29	2,91	5,72	9,34	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,66	9,92	-1,98	3,69	8,75	20,99	22,90
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,14	-0,01	-0,06	-0,23	-0,41	-0,72
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,99	10,63	-4,17	3,78	7,96	18,56	16,96
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,01	-0,35	-0,06	-0,19	-0,42	-0,81	-1,20
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	-61,58	912,36	617,44	1.341,30	896,58	131,25	20.684,37
% do CDI	-6.172,59	8.275,94	19.639,81	20.475,78	6.682,23	496,20	67.477,07
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,99	10,95	3,15	6,60	13,35	26,71	31,23
% do CDI	99,06	99,36	100,06	100,68	99,46	100,98	101,88
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,99	11,24	3,26	6,97	13,64	27,19	31,84
% do CDI	99,35	101,94	103,75	106,34	101,62	102,77	103,87
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	0,25	2,67	1,28				
Var. IPCA p.p.	0,01	1,81	0,55				
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1,01	11,23	3,40	7,03	13,68	27,37	32,41
% do CDI	101,44	101,90	108,03	107,33	101,93	103,46	105,73
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-3,86	-1,30	-10,21	8,75	-12,06	-12,83	-26,60
Var. IBOVESPA p.p.	-0,93	-4,41	-3,00	0,41	-9,57	-22,14	-47,03
TARPON GT 30 FIC FIA	-6,04	30,87	-1,01	30,79	11,87	52,68	119,78
Var. IBOVESPA p.p.	-3,11	27,77	6,21	22,44	14,37	43,37	99,36
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	-7,60	5,68	-2,52	18,65	1,95	9,92	94,53

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.	-4,67	2,57	4,70	10,31	4,44	0,60	74,11
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	-2,97	2,10	-5,75	12,79	-6,78	14,51	30,61
Var. IBOVESPA p.p.	-0,03	-1,01	1,47	4,45	-4,29	5,19	10,19
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	-7,35	-6,10	-16,42	1,58	-21,38	-18,94	-2,21
Var. IBOVESPA p.p.	-4,41	-9,21	-9,21	-6,76	-18,88	-28,26	-22,63
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	-3,03	21,89	-4,86	21,99	7,80	40,31	74,15
Var. IBOVESPA p.p.	-0,10	18,78	2,35	13,65	10,29	30,99	53,72
INDIE FIC FIA	-8,59	5,23	-13,76	10,53	-8,16	-15,26	-21,01
Var. IBOVESPA p.p.	-5,66	2,12	-6,55	2,19	-5,67	-24,57	-41,44
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-7,30	-3,25	-14,31	1,85	-16,40	-13,17	-9,50
Var. IBOVESPA p.p.	-4,37	-6,36	-7,10	-6,50	-13,91	-22,49	-29,93
META VALOR FI DE AÇÕES	-6,52	-16,47	-18,29	-5,39	-25,67	-14,68	-24,61
Var. IBRX 100 p.p.	-3,49	-18,78	-11,19	-13,63	-22,19	-22,59	-43,74
OCCAM FIC FIA	-2,37	-0,28	-7,27	5,51	-8,03	4,99	12,04
Var. IBOVESPA p.p.	0,57	-3,38	-0,06	-2,83	-5,54	-4,33	-8,38
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-2,05	7,80	-1,21	1,98	9,50	-22,21	3,31
Var. IBOVESPA p.p.	0,88	4,70	6,01	-6,36	11,99	-31,52	-17,12
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-5,84	-20,85	-9,74	-13,84	-11,40	-43,74	
Var. MSCI ACWI p.p.	-3,73	-22,79	-5,77	-12,15	-15,85	-20,31	
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	-3,95	-1,12	-5,58	-3,90	7,16	-23,69	3,87
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,85	-3,06	-1,62	-2,20	2,70	-0,25	2,62
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-2,68	20,26	-8,64	7,19	18,21	-24,58	1,25
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,58	18,32	-4,68	8,88	13,76	-1,14	0,00
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	-9,79	5,97	-16,89	2,76	-6,68	-65,54	-50,54
Var. MSCI ACWI p.p.	-7,68	4,03	-12,92	4,46	-11,14	-42,10	-51,79
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-7,96	-13,27	-14,46	-11,92	-6,06	-52,86	-37,79
Var. MSCI ACWI p.p.	-5,85	-15,21	-10,50	-10,23	-10,51	-29,42	-39,03
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-4,04	17,98	-6,42	4,14	22,16	-38,88	-28,12
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-4,77	9,10	-8,65	0,10	11,08	-64,24	-75,12
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	0,57	12,13	1,59	5,40			
Var. S&P 500 p.p.	1,79	6,26	4,11	3,67			
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-1,74	15,71	-6,98	4,31	16,73	6,88	54,06
% do CDI	-174,08	142,50	-221,98	65,87	124,68	26,01	176,37
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-1,69	16,26	-6,85	4,68	17,46	12,36	63,55
Var. S&P 500 p.p.	-0,47	10,39	-4,32	2,96	13,26	30,74	51,17
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	-0,35	-5,52	0,16	1,71	-7,40	16,87	47,30

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.	-1,08	-14,41	-2,07	-2,32	-18,49	-8,50	0,29
JACAREÍ	-0,54	8,22	-0,76	4,92	7,88		
Var. IPCA + 4,83% p.p.	-1,19	0,09	-2,77	1,32	-2,28		
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00

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 cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance sera 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	0,96	11,12	3,06	6,61	13,48	26,55	28,80	34,03	43,59
IRF-M 1+	0,12	12,95	0,56	7,03	13,15	26,82	19,34	24,87	47,27
IRF-M TOTAL	0,37	12,04	1,31	6,68	12,95	26,45	22,28	27,70	46,46
IMA-B 5	-0,31	8,55	0,43	3,06	9,21	23,11	28,57	35,91	54,63
IMA-B 5+	-0,98	10,98	-4,11	3,97	8,37	19,37	18,16	11,25	52,40
IMA-B TOTAL	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40	23,62	22,38	55,11
IMA-GERAL TOTAL	0,30	10,92	1,11	5,71	11,71	24,89	26,20	29,58	48,76
IDKA 2	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65	28,32	36,96	53,47
IDKA 20	-1,16	13,95	-7,55	5,69	7,85	15,86	10,01	-4,59	48,02
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43	5,52	29,42
IBRX 100	-3,03	2,31	-7,11	8,24	-3,47	7,90	19,13	5,97	32,25
IBRX 50	-2,99	1,78	-6,48	8,57	-2,99	9,63	22,40	7,19	28,83
SMALL CAP	-7,40	-2,72	-16,71	5,49	-16,24	-16,19	-13,16	-18,52	16,44
Índice Consumo - ICON	-8,90	-13,22	-21,67	-1,55	-29,56	-40,09	-45,26	-46,32	-22,15
Índice Dividendos - IDIV	-3,15	7,18	-4,65	7,57	6,28	23,78	40,83	25,93	75,34

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	-1,22	5,87	-2,52	1,73	4,20	-18,39	12,38	74,39	110,39

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,97	10,06	-1,30	10,41	5,49	17,94	14,06	13,03	40,73

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,10	1,94	-3,96	-1,70	4,45	-23,43	1,25	50,47	78,73

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,24	3,75	0,73	1,00	4,82	11,60	23,51	28,35	31,61
INPC	0,12	3,04	0,43	0,60	4,14	10,87	23,15	29,03	32,32
IGPM	0,50	-4,46	0,73	-3,74	-4,57	1,65	23,73	49,63	54,34
SELIC	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

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	7,18	1,74	3,04	9,00	20,69	38,87	50,04	59,99
IPCA + 5,00%	0,65	8,03	1,99	3,54	10,04	23,02	42,90	55,86	67,80
IPCA + 5,50%	0,69	8,46	2,11	3,79	10,56	24,19	44,94	58,84	71,82
IPCA + 5,89%	0,72	8,79	2,21	3,98	10,97	25,11	46,55	61,19	75,01
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00	61,85	75,91
INPC + 4,00%	0,45	6,44	1,44	2,62	8,29	19,90	38,47	50,83	60,87
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58	62,71	76,88

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%)	2.224.148,10	5,480000	2.200.820,98	6,252800	-23.327,12
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.087.794,83	5,810000	1.081.254,41	6,252800	-6.540,42
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.688.056,02	5,680000	20.363.625,08	5,909300	-324.430,94
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.251.437,02	4,860000	2.076.949,15	5,875700	-174.487,87
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.247.814,89	4,880000	2.076.949,15	5,875700	-170.865,74
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.247.057,64	4,910000	2.081.267,14	5,875700	-165.790,50
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.237.151,10	5,196100	2.120.128,97	5,875700	-117.022,13
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.238.561,22	5,290000	2.137.400,90	5,875700	-101.160,32
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.237.736,54	5,320000	2.141.718,88	5,875700	-96.017,66
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.549.194,14	5,670000	1.524.247,51	5,875700	-24.946,63
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.091.918,08	5,837000	2.085.585,12	5,875700	-6.332,96
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.274.016,21	5,855000	3.268.712,08	5,875700	-5.304,13
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.264.669,62	4,970000	2.017.518,25	5,952700	-247.151,37
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.261.935,03	4,980000	2.017.518,25	5,952700	-244.416,78
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.257.925,93	5,030000	2.026.121,74	5,952700	-231.804,19
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.245.910,52	5,285000	2.077.742,68	5,952700	-168.167,84
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.245.172,67	5,340000	2.090.647,91	5,952700	-154.524,76
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.243.772,87	5,380000	2.099.251,40	5,952700	-144.521,47
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.282.694,58	5,831000	5.209.412,80	5,952700	-73.281,78
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.182.557,99	5,860000	2.159.475,83	5,952700	-23.082,16
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.099.701,47	5,897000	2.086.346,17	5,952700	-13.355,30
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.415.726,59	5,915000	6.388.090,84	5,952700	-27.635,75
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.093.690,98	5,922000	2.086.346,17	5,952700	-7.344,81
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.707.936,88	6,140000	4.809.350,55	5,952700	101.413,67
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.711.566,67	6,256000	3.841.457,99	5,952700	129.891,32
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.125.400,71	6,280000	3.243.515,48	5,952700	118.114,77
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.130.790,18	6,400000	2.241.208,98	5,952700	110.418,80
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.270.008,62	5,000000	1.973.002,02	6,000700	-297.006,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.264.992,85	5,030000	1.977.281,85	6,000700	-287.711,00
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.260.003,31	5,060000	1.981.561,68	6,000700	-278.441,63
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.249.184,67	5,315000	2.045.759,14	6,000700	-203.425,53
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.250.364,79	5,370000	2.062.878,46	6,000700	-187.486,33
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.248.421,84	5,420000	2.075.717,96	6,000700	-172.703,88
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.239.917,57	5,520000	2.097.117,11	6,000700	-142.800,46
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.630.784,01	5,831200	11.367.230,70	6,000700	-263.553,31
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.180.966,98	5,860000	2.139.915,42	6,000700	-41.051,56
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.238.494,58	5,897000	5.165.755,82	6,000700	-72.738,76
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.096.422,11	5,927000	2.075.717,96	6,000700	-20.704,15
NTN-B 150555 (5,950000%)	17.107.211,64	5,950000	16.990.928,42	6,000700	-116.283,22
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.410.254,98	6,140000	9.586.821,07	6,000700	176.566,09
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.475.649,35	6,261000	8.773.653,22	6,000700	298.003,87
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.290.630,43	6,268000	7.553.901,43	6,000700	263.271,00
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.330.979,85	6,400000	5.619.417,89	6,000700	288.438,04
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.190.241,25	5,345000	2.167.768,86	6,763200	-22.472,39
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.222.360,12	5,450000	2.201.247,91	6,763200	-21.112,21
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.181.191,15	5,912000	2.167.768,86	6,763200	-13.422,29
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.219.888,79	5,009000	2.157.870,28	6,167000	-62.018,51
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.221.885,68	5,130000	2.166.250,36	6,167000	-55.635,32
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.222.902,53	5,190000	2.170.440,40	6,167000	-52.462,13
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.227.899,10	5,490000	2.191.390,60	6,167000	-36.508,50
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.262.474,44	5,710000	3.226.330,32	6,167000	-36.144,12
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.234.014,02	4,850000	2.136.123,99	5,977300	-97.890,03
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.226.973,26	5,125600	2.152.977,04	5,977300	-73.996,22
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.229.853,95	5,240000	2.165.616,83	5,977300	-64.237,12
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.227.190,22	5,270000	2.165.616,83	5,977300	-61.573,39
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.269.960,44	5,810000	3.248.425,24	5,977300	-21.535,20
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.242.659,11	4,860000	2.124.286,36	5,875600	-118.372,75
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.237.837,00	4,900000	2.124.286,36	5,875600	-113.550,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.231.057,87	5,178300	2.149.726,91	5,875600	-81.330,96
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.233.274,10	5,270000	2.162.447,19	5,875600	-70.826,91
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.234.066,23	5,300000	2.166.687,28	5,875600	-67.378,95
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.515.496,13	5,460000	3.438.715,04	5,875600	-76.781,09
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.231.977,07	5,500000	2.187.887,74	5,875600	-44.089,33
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.271.898,47	5,835000	3.264.871,25	5,875600	-7.027,22
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.259.236,99	4,950000	2.039.390,55	5,940400	-219.846,44
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.249.794,38	4,970000	2.035.150,66	5,940400	-214.643,72
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.251.972,50	5,020000	2.047.870,35	5,940400	-204.102,15
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.242.866,75	5,274000	2.094.509,22	5,940400	-148.357,53
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.243.530,87	5,310000	2.102.989,01	5,940400	-140.541,86
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.240.913,00	5,360000	2.111.468,81	5,940400	-129.444,19
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.095.188,55	5,837000	2.073.309,73	5,940400	-21.878,82
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.271.752,93	5,855000	3.243.521,36	5,940400	-28.231,57
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.087.489,82	6,220000	3.175.683,01	5,940400	88.193,19
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.272.024,01	4,940000	1.972.014,87	6,006200	-300.009,14
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.269.211,21	4,980000	1.980.442,28	6,006200	-288.768,93
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.264.694,65	5,010000	1.984.655,99	6,006200	-280.038,66
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.258.651,54	5,045000	1.988.869,70	6,006200	-269.781,84
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.247.970,02	5,295500	2.047.861,60	6,006200	-200.108,42
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.246.945,08	5,360000	2.064.716,42	6,006200	-182.228,66
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.245.649,08	5,410000	2.077.357,55	6,006200	-168.291,53
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.238.470,86	5,510000	2.098.426,08	6,006200	-140.044,78
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.455.662,02	5,831200	8.267.293,11	6,006200	-188.368,91
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.140.818,92	5,897000	3.097.074,64	6,006200	-43.744,28
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.095.935,91	5,921000	2.073.143,84	6,006200	-22.792,07
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.425.326,47	5,950000	11.343.299,21	6,006200	-82.027,26
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.793.734,94	6,140000	6.910.479,46	6,006200	116.744,52
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.658.603,44	6,261000	5.844.411,59	6,006200	185.808,15
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.202.789,83	6,278000	5.385.117,53	6,006200	182.327,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.103.308,45	6,400000	3.261.409,21	6,006200	158.100,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

14. Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
303	02/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.035.000,00	4.241,08334262	244,0414197000
304	02/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	20.000,00	81,95330131	244,0414197000
327	02/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	4.000,00	16,39066026	244,0414197000
305	03/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	38.000,00	155,64119660	244,1512969000
306	04/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	17.000,00	69,59508995	244,2701060000
307	05/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	8.000,00	32,73458999	244,3898030000
328	05/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	15.000,00	61,37735624	244,3898030000
329	06/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	49.000,00	200,40054499	244,5103131000
308	09/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	574.700,00	0,00	2.349,33773835	244,6221293000
309	10/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	215.139,50	879,10243986	244,7263143000
310	10/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	203.460,31	831,37896545	244,7263143000
311	10/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	55.455,43	226,60182726	244,7263143000
312	10/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	574.944,76	2.349,33771484	244,7263143000
313	10/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	191.000,00	0,00	780,46368061	244,7263143000
330	10/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	37.000,00	151,18929938	244,7263143000
331	10/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	32.000,00	130,75831298	244,7263143000
314	11/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,08442364	244,8325856000
332	11/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	27.000,00	110,27943823	244,8325856000
315	17/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	5.000,00	20,39163383	245,1985967000
316	20/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	9.000,00	36,65171168	245,5546982000
333	20/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	13.000,00	52,94136131	245,5546982000
334	23/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,07026343	245,6843437000
317	24/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	8,13660279	245,8028309000
318	25/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	12,19906003	245,9205868000
335	25/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	84.000,00	341,57368073	245,9205868000
336	25/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,06635334	245,9205868000
337	26/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,06436806	246,0407091000
319	27/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	306.000,00	0,00	1.243,12127475	246,1545838000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
338	27/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	42.268,96	171,71713542	246,1545838000
339	27/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	14.079,20	57,19657860	246,1545838000
340	27/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	63.651,84	258,58482510	246,1545838000
320	30/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	4.711.000,00	0,00	19.129,50542758	246,2687819000
342	31/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	368.000,00	0,00	1.493,59115782	246,3860328000
321	31/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	726.359,12	2.948,05314955	246,3860328000
322	31/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	176.255,83	715,36453587	246,3860328000
323	31/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.310.630,50	5.319,41882056	246,3860328000
324	31/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	172.223,89	699,00021541	246,3860328000
325	31/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	306.287,71	1.243,12123751	246,3860328000
326	31/10/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	4.713.242,95	19.129,50542057	246,3860328000
Total			6.150.700,00	9.976.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

15. Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 9.724.174,43 Value-At-Risk: 1,45%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
JACAREÍ		1,45		1,45			670.058.685,62	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,24%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,480000%)		0,05	-0,00	0,06			2.224.148,10	0,33
NTN-B 150525 (5,810000%)		0,05	-0,00	0,06			1.087.794,83	0,16
NTN-B 150533 (5,680000%)		0,06	-0,00	0,06			20.688.056,02	3,09
NTN-B 150535 (4,860000%)		0,05	-0,00	0,06			2.251.437,02	0,34
NTN-B 150535 (4,880000%)		0,05	-0,00	0,06			2.247.814,89	0,34
NTN-B 150535 (4,910000%)		0,05	-0,00	0,06			2.247.057,64	0,34
NTN-B 150535 (5,196100%)		0,05	-0,00	0,06			2.237.151,10	0,33
NTN-B 150535 (5,290000%)		0,05	-0,00	0,06			2.238.561,22	0,33
NTN-B 150535 (5,320000%)		0,05	-0,00	0,06			2.237.736,54	0,33
NTN-B 150535 (5,670000%)		0,05	-0,00	0,06			1.549.194,14	0,23
NTN-B 150535 (5,837000%)		0,05	-0,00	0,06			2.091.918,08	0,31
NTN-B 150535 (5,855000%)		0,05	-0,00	0,06			3.274.016,21	0,49
NTN-B 150545 (4,970000%)		0,05	-0,00	0,06			2.264.669,62	0,34
NTN-B 150545 (4,980000%)		0,05	-0,00	0,06			2.261.935,03	0,34
NTN-B 150545 (5,030000%)		0,05	-0,00	0,06			2.257.925,93	0,34
NTN-B 150545 (5,285000%)		0,05	-0,00	0,06			2.245.910,52	0,34
NTN-B 150545 (5,340000%)		0,05	-0,00	0,06			2.245.172,67	0,34
NTN-B 150545 (5,380000%)		0,05	-0,00	0,06			2.243.772,87	0,33
NTN-B 150545 (5,831000%)		0,05	-0,00	0,06			5.282.694,58	0,79
NTN-B 150545 (5,860000%)		0,05	-0,00	0,06			2.182.557,99	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (5,897000%)		0,05	-0,00	0,06			2.099.701,47	0,31
NTN-B 150545 (5,915000%)		0,05	-0,00	0,06			6.415.726,59	0,96
NTN-B 150545 (5,922000%)		0,05	-0,00	0,06			2.093.690,98	0,31
NTN-B 150545 (6,140000%)		0,05	-0,00	0,06			4.707.936,88	0,70
NTN-B 150545 (6,256000%)		0,05	-0,00	0,06			3.711.566,67	0,55
NTN-B 150545 (6,280000%)		0,05	-0,00	0,06			3.125.400,71	0,47
NTN-B 150545 (6,400000%)		0,05	-0,00	0,06			2.130.790,18	0,32
NTN-B 150555 (5,000000%)		0,05	-0,00	0,06			2.270.008,62	0,34
NTN-B 150555 (5,030000%)		0,05	-0,00	0,06			2.264.992,85	0,34
NTN-B 150555 (5,060000%)		0,05	-0,00	0,06			2.260.003,31	0,34
NTN-B 150555 (5,315000%)		0,05	-0,00	0,06			2.249.184,67	0,34
NTN-B 150555 (5,370000%)		0,05	-0,00	0,06			2.250.364,79	0,34
NTN-B 150555 (5,420000%)		0,05	-0,00	0,06			2.248.421,84	0,34
NTN-B 150555 (5,520000%)		0,05	-0,00	0,06			2.239.917,57	0,33
NTN-B 150555 (5,831200%)		0,05	-0,00	0,06			11.630.784,01	1,74
NTN-B 150555 (5,860000%)		0,05	-0,00	0,06			2.180.966,98	0,33
NTN-B 150555 (5,897000%)		0,05	-0,00	0,06			5.238.494,58	0,78
NTN-B 150555 (5,927000%)		0,05	-0,00	0,06			2.096.422,11	0,31
NTN-B 150555 (5,950000%)		0,05	-0,00	0,06			17.107.211,64	2,55
NTN-B 150555 (6,140000%)		0,05	-0,00	0,06			9.410.254,98	1,40
NTN-B 150555 (6,261000%)		0,05	-0,00	0,06			8.475.649,35	1,26
NTN-B 150555 (6,268000%)		0,05	-0,00	0,06			7.290.630,43	1,09
NTN-B 150555 (6,400000%)		0,05	-0,00	0,06			5.330.979,85	0,80
NTN-B 150824 (5,345000%)		0,05	-0,00	0,06			2.190.241,25	0,33
NTN-B 150824 (5,450000%)		0,05	-0,00	0,06			2.222.360,12	0,33
NTN-B 150824 (5,912000%)		0,05	-0,00	0,06			2.181.191,15	0,33
NTN-B 150826 (5,009000%)		0,05	-0,00	0,06			2.219.888,79	0,33
NTN-B 150826 (5,130000%)		0,05	-0,00	0,06			2.221.885,68	0,33
NTN-B 150826 (5,190000%)		0,05	-0,00	0,06			2.222.902,53	0,33
NTN-B 150826 (5,490000%)		0,05	-0,00	0,06			2.227.899,10	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%)		0,05	-0,00	0,06			3.262.474,44	0,49
NTN-B 150828 (4,850000%)		0,05	-0,00	0,06			2.234.014,02	0,33
NTN-B 150828 (5,125600%)		0,05	-0,00	0,06			2.226.973,26	0,33
NTN-B 150828 (5,240000%)		0,05	-0,00	0,06			2.229.853,95	0,33
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,05	-0,00	0,06			2.227.190,22	0,33
NTN-B 150828 (5,810000%)		0,05	-0,00	0,06			3.269.960,44	0,49
NTN-B 150830 (4,860000%)		0,05	-0,00	0,06			2.242.659,11	0,33
NTN-B 150830 (4,900000%)		0,05	-0,00	0,06			2.237.837,00	0,33
NTN-B 150830 (5,178300%)		0,05	-0,00	0,06			2.231.057,87	0,33
NTN-B 150830 (5,270000%)		0,05	-0,00	0,06			2.233.274,10	0,33
NTN-B 150830 (5,300000%)		0,05	-0,00	0,06			2.234.066,23	0,33
NTN-B 150830 (5,460000%)		0,05	-0,00	0,06			3.515.496,13	0,52
NTN-B 150830 (5,500000%)		0,05	-0,00	0,06			2.231.977,07	0,33
NTN-B 150830 (5,835000%)		0,05	-0,00	0,06			3.271.898,47	0,49
NTN-B 150840 (4,950000%)		0,05	-0,00	0,06			2.259.236,99	0,34
NTN-B 150840 (4,970000%)		0,05	-0,00	0,06			2.249.794,38	0,34
NTN-B 150840 (5,020000%)		0,05	-0,00	0,06			2.251.972,50	0,34
NTN-B 150840 (5,274000%)		0,05	-0,00	0,06			2.242.866,75	0,33
NTN-B 150840 (5,310000%)		0,05	-0,00	0,06			2.243.530,87	0,33
NTN-B 150840 (5,360000%)		0,05	-0,00	0,06			2.240.913,00	0,33
NTN-B 150840 (5,837000%)		0,05	-0,00	0,06			2.095.188,55	0,31
NTN-B 150840 (5,855000%)		0,05	-0,00	0,06			3.271.752,93	0,49
NTN-B 150840 (6,220000%)		0,05	-0,00	0,06			3.087.489,82	0,46
NTN-B 150850 (4,940000%)		0,05	-0,00	0,06			2.272.024,01	0,34
NTN-B 150850 (4,980000%)		0,05	-0,00	0,06			2.269.211,21	0,34
NTN-B 150850 (5,010000%)		0,05	-0,00	0,06			2.264.694,65	0,34
NTN-B 150850 (5,045000%)		0,05	-0,00	0,06			2.258.651,54	0,34
NTN-B 150850 (5,295500%)		0,05	-0,00	0,06			2.247.970,02	0,34
NTN-B 150850 (5,360000%)		0,05	-0,00	0,06			2.246.945,08	0,34
NTN-B 150850 (5,410000%)		0,05	-0,00	0,06			2.245.649,08	0,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,510000%)		0,05	-0,00	0,06			2.238.470,86	0,33
NTN-B 150850 (5,831200%)		0,05	-0,00	0,06			8.455.662,02	1,26
NTN-B 150850 (5,897000%)		0,05	-0,00	0,06			3.140.818,92	0,47
NTN-B 150850 (5,921000%)		0,05	-0,00	0,06			2.095.935,91	0,31
NTN-B 150850 (5,950000%)		0,05	-0,00	0,06			11.425.326,47	1,71
NTN-B 150850 (6,140000%)		0,05	-0,00	0,06			6.793.734,94	1,01
NTN-B 150850 (6,261000%)		0,05	-0,00	0,06			5.658.603,44	0,84
NTN-B 150850 (6,278000%)		0,05	-0,00	0,06			5.202.789,83	0,78
NTN-B 150850 (6,400000%)		0,05	-0,00	0,06			3.103.308,45	0,46
Sub-total	0,19	0,05	-0,00		-1,54	0,70	311.186.269,21	46,44

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		2,00	0,03	0,03			20.749.189,12	3,10
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,15	0,05	0,03			20.378.061,85	3,04
Sub-total	7,97	2,57	0,09		-0,23	-0,83	41.127.250,97	6,14

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		1,71	0,01	1,72			5.133.628,50	0,77
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			20.848.725,65	3,11
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			21.279.613,16	3,18
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,03	-0,00	0,03			24.761.175,15	3,70
Sub-total	0,34	0,13	0,01		-0,15	0,95	72.023.142,46	10,75

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			5.200.870,85	0,78
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a		0,15	0,00	0,15			5.197.186,13	0,78
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a		0,15	0,00	0,15			5.195.537,84	0,78

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		0,16	-0,00	0,17			5.549.142,70	0,83
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a		0,15	0,00	0,15			5.192.475,15	0,77
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a		0,16	-0,00	0,17			6.061.383,50	0,90
Sub-total	1,22	0,11	0,00		-0,15	0,82	32.396.596,17	4,83

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III		15,63	0,00	15,63			41.464,91	0,01
Sub-total	588,72	15,63	0,00		-0,11	-61,58	41.464,91	0,01

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			3.454.987,13	0,52
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,11	-0,00	0,11			5.970.841,34	0,89
Sub-total	0,14	0,07	-0,00		0,37	1,05	9.425.828,47	1,41

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,33%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA		8,55	0,04	5,07			3.845.290,49	0,57
META VALOR FI DE AÇÕES		9,07	0,02	4,37			1.897.877,32	0,28
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		9,82	0,08	5,66			6.626.542,82	0,99
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,93	0,05	4,12			4.830.792,30	0,72
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		7,39	0,17	3,35			21.093.540,42	3,15
OCCAM FIC FIA		7,61	0,27	1,54			29.115.633,81	4,35
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		8,17	0,05	4,14			5.802.869,62	0,87
INDIE FIC FIA		9,73	0,04	5,56			3.374.060,74	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TARPON GT 30 FIC FIA		8,50	0,08	5,97			8.830.106,91	1,32
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA		8,88	0,06	7,10			6.809.123,60	1,02
Sub-total	15,96	7,33	0,85		-0,33	-4,29	92.225.838,03	13,76

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,29%

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		3,65	0,00	8,50			7.565.793,48	1,13
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		6,01	0,12	6,01			17.527.739,40	2,62
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		6,05	0,20	5,28			29.184.904,68	4,36
Sub-total	13,35	5,17	0,32		-0,18	-1,40	54.278.437,56	8,10

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		0,04	-0,00	0,07			11.088.970,80	1,65
Sub-total	1,21	0,04	-0,00		-1,11	-0,35	11.088.970,80	1,65

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,07%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		9,87	0,15	7,90			14.471.476,61	2,16
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		13,18	0,01	11,44			1.642.175,08	0,25
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,97	-0,00	9,05			2.232.618,63	0,33
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		7,86	-0,00	8,18			2.119.309,12	0,32
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,24	0,00	9,24			2.531.404,59	0,38

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		7,12	-0,01	7,67			4.901.400,22	0,73
Sub-total	14,60	6,74	0,15		-0,35	-4,15	27.898.384,25	4,16

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		6,69	0,04	10,50			18.366.502,79	2,74
Sub-total	14,76	6,69	0,04		-0,21	-2,05	18.366.502,79	2,74

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

16. Relatório de Cenário Macroeconômico

No mês de outubro, no cenário internacional, o desempenho dos mercados globais foi determinado pelo aumento de aversão a risco, com os sinais de resiliência da economia dos EUA e o conflito no Oriente Médio. Com isso, os juros globais tiveram alta e os índices de ações apresentaram retornos negativos no mês. Nos EUA, a atividade econômica segue surpreendendo de forma negativa para o controle inflacionário, apresentando resiliência, com o crescimento do PIB no terceiro trimestre do ano, em um momento em que se esperaria desaceleração em função do aperto monetário. Adicionalmente, o FED sugere que, encerrado o ciclo altista dos juros deveremos ter as taxas básicas estáveis por um período prolongado, possivelmente até meados do segundo semestre de 2024. Nesse sentido, a trajetória da inflação ainda demanda uma postura cautelosa. Na Zona do Euro, a economia segue em desaceleração, com estagnação do PIB por quatro trimestres e rápida desaceleração do crédito. Ao mesmo tempo, a inflação mostra sinais de queda mais contundente. Na economia chinesa, os estímulos adotados desde o segundo trimestre não estão surtindo efeitos claros na economia, com o setor de construção seguindo muito fraco. Destacando assim, um cenário ainda de cautela com a trajetória da economia, com perspectiva de crescimento abaixo do potencial. Por fim, a guerra entre Hamas e Israel é novo elemento de incerteza e é mais uma indicação da deterioração do quadro geopolítico. A escalada do conflito e os patamares restritivos de juros ao redor do mundo são fatores que podem pressionar o desempenho das Bolsas internacionais. Assim, no mês de outubro de 2023, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território negativo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, desvalorizaram -3,07% e -2,20%, 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 +8,57% e +8,31%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de -2,10% e -1,22%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +4,45% e +4,20% nos últimos 12 meses.

No Brasil, as curvas de juros tiveram alta, refletindo o movimento observado no exterior e as incertezas quanto à política fiscal. Assim, em relação ao mês anterior, não houve uma mudança significativa na conjuntura doméstica. Os ruídos em relação à política fiscal se elevaram, com o presidente se posicionando de forma a ir contra o contingenciamento de gastos necessário caso a estabilidade do resultado primário seja definida como a meta para 2024. Essa atitude elevou o questionamento sobre a capacidade da nova regra fiscal promover uma consolidação fiscal e torna ainda mais importante a busca por aumento de receitas nos próximos anos. A atividade econômica segue em desaceleração, o que é compatível com a trajetória da política monetária. Assim, há a expectativa de estabilidade ou leve queda para o PIB do terceiro trimestre. Em relação à inflação, ainda são presentes os sinais construtivos, inclusive com quando observado a trajetória de desaceleração da inflação de serviços. O Banco Central deu continuidade ao ciclo de afrouxamento monetário, reduzindo os juros com um corte de 0,50% da taxa Selic para 12,25%. No entanto, alguns fatores vêm gerando aumento da incerteza na expectativa de duração do ciclo de afrouxamento monetário e, inclusive, a própria comunicação do Copom após este último encontro se mostrou mais conservadora. O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo o movimento dos índices globais. Apresentando um retorno negativo de -2,94% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +3,11% e negativo de -2,49% nos últimos 12 meses.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

17. Agenda realizada

17 de outubro:

13h30: Reunião com a Estoril Investimentos – Agente Autônomos. O objetivo da reunião foi a apresentação institucional da gestora FINACAP INVESTIMENTOS, visão geral do mercado, apresentação de fundos elegíveis para aplicações de RPPS. Participou da reunião Luís Gustavo Ferreira Bonacina, Gestor dos Recursos.

18 de outubro:

9h00: Tricentésima nonagésima quarta (394^a) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros (CAIF) do Instituto de Previdência do Município de Jacareí (IPMJ), ocorrida em 18 de outubro 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, Clévio Vitor de Almeida e Rafaela Carvalho dos Santos. Ausência justificada de José Ricardo Vinhas. Pautas da reunião: 1) Análise do relatório de investimentos de setembro de 2023; 2) Análise da carteira fechada de setembro de 2023; 3) Análise prévia da Política de Investimentos 2024 (meta de investimentos e alocações objetivas); 4) Live BGC Partners sobre cenário macroeconômico; 5) Assuntos diversos.

24 de outubro:

11h00: Live da reunião anual Kinea do FIP KINEA IV: O objetivo da reunião foi a apresentação de vários executivos do fundo para atualização de resultados: Participaram da Live os gestores Cristiano Lauretti - Sócio e Head da Kinea Private Equity, Luiz Trivelato - CEO da +A Educação, Carlos Lazar - CSO da Wiser, Antônio Napp - Finance and IR Director da Panvel, Ricardo Chisman - Presidente da Matera, Camilo Cabianca - Sócio da Kinea Private Equity e Rafael Siqueira – CFO da Cobasi. Representando o IPMJ, participou da live o Supervisor de Investimentos Amauri Arnaldo Junior.

26 de outubro:

9h00: Tricentésima nonagésima quinta (395^a) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, ocorrida em 26 de outubro de 2023, tendo início às 9h02, com as seguintes presenças dos membros do CAIF na sala de reuniões do IPMJ: Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Clévio Vitor de Almeida e José Ricardo Vinhas. Ausências justificadas de Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e Rafaela Carvalho dos Santos. Pautas da reunião: 1) Análise parcial da carteira até 24/10/2023; 2) Apresentação da Política de Investimentos 2024; 3) Assuntos Diversos.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Em outubro de 2023, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um total aplicado de R\$ 7.368.930,01 (sete milhões e trezentos e sessenta e oito mil e novecentos e trinta reais e um centavo).

No dia 05/10/2023 foi realizado amortizações no montante de R\$ 127.356,77 (cento e vinte e sete mil e trezentos e cinquenta e seis reais e setenta e sete centavos), R\$ 25.727,34 (vinte e cinco mil e setecentos e vinte e sete reais e trinta e quatro centavos) e R\$ 9.979,42 (nove mil e novecentos e setenta e nove reais e quarenta e dois centavos), totalizando R\$ 163.063,53 (cento e sessenta e três mil e sessenta e três reais e cinquenta e três centavos) que foram aplicados no fundo SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI.

O total de amortizações já entregue é de R\$ 7.071.833,46 (sete milhões e setenta e um mil e oitocentos e trinta e três reais e quarenta e seis centavos). O saldo em 31 de outubro de 2023 é de R\$ 41.464,91 (quarenta e um mil e quatrocentos e sessenta e quatro reais e noventa e um centavos).

19. Fundos Estruturados**II. (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\$ 1.993.084,80 (um milhão e novecentos e noventa e três mil e oitenta e quatro reais e oitenta centavos).

O saldo acumulado em 31 de outubro de 2023 é de R\$ 11.088.970,80 (onze milhões e oitenta e oito mil e novecentos e setenta reais e oitenta centavos) com um rendimento negativo no mês de outubro de R\$ -38.943,51 (trinta e oito mil e novecentos e quarenta e três reais e cinquenta e um centavos negativos).