



**LDB**  
EMPRESAS

**JACAREÍ**  
NOVEMBRO 2023



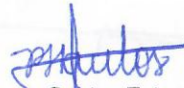
## Sumário

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 .....	42
16. Relatório de Cenário Macroeconômico .....	49
17. Agenda realizada.....	50
18. Acompanhamento fundos estressados .....	51
FIDC MULSTISETORIAL MASTER III .....	51
19. Fundos Estruturados.....	51
(FIP) KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA .....	51

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

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



Renata de Souza Santos Esteves

Diretora do Dep. Administrativo-Financeiro – CPA 10



Amauri Arnaldo Junior

Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos – CPA 10



Luis Gustavo Ferreira Bonacina

Assessor da Presidência – CPA 20



Clévio Vitor de Almeida

Membro do CAIF – CGRPPS – CPA 10

**AUSENTE**

Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do CAIF

**AUSÊNCIA  
JUSTIFICADA**

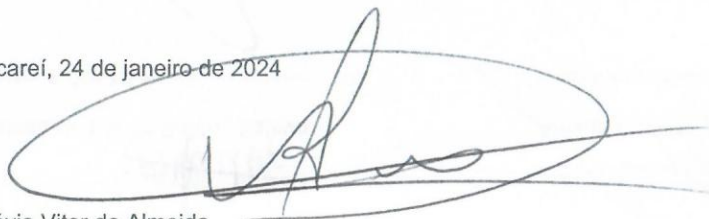
José Ricardo Vinhas

Membro do CAIF

## 2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 24 dias do mês de janeiro de 2024 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 2023/2025, reuniu-se para análise do Relatório de Investimentos referente ao mês de novembro 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 novembro de 2023.

Jacareí, 24 de janeiro de 2024



Clévio Vitor de Almeida

Representante do Conselho Fiscal



Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do Conselho Fiscal

**AUSÊNCIA  
JUSTIFICADA**

José Edson Silva Souza

Membro do Conselho Fiscal



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**3. Posição de Ativos e Enquadramento**

**RENDA FIXA** **68,41%**

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%)	0,33	0,04	0,67	9,50	2.175.170,92	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,33	0,04	0,69	9,81	1.063.967,21	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,680000%)	2,86	0,05	0,68	4,16	20.244.659,51	2,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,33	0,03	0,62	8,91	2.206.037,44	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,33	0,03	0,62	8,93	2.202.426,60	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,33	0,03	0,62	8,96	2.201.592,00	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,33	0,03	0,65	9,23	2.190.993,59	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,33	0,03	0,65	9,32	2.192.077,83	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,33	0,03	0,65	9,35	2.191.173,20	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,670000%)	2,84	0,04	0,68	4,16	1.516.175,58	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,33	0,04	0,69	9,83	2.046.811,43	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,33	0,04	0,70	9,85	3.203.332,03	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,33	0,03	0,63	9,02	2.221.019,56	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,33	0,03	0,63	9,03	2.218.286,19	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,33	0,03	0,63	9,07	2.214.089,39	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,285000%)	0,33	0,03	0,65	9,31	2.200.946,20	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,33	0,03	0,66	9,37	2.199.926,02	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,33	0,03	0,66	9,40	2.198.336,70	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,33	0,04	0,69	9,83	5.169.838,50	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,33	0,04	0,70	9,86	2.135.772,40	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	0,33	0,04	0,70	9,89	2.054.496,85	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,33	0,04	0,70	9,91	6.277.309,29	0,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,33	0,04	0,70	9,92	2.048.483,97	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	0,33	0,04	0,72	10,12	4.603.656,30	0,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,33	0,04	0,73	10,23	3.628.240,35	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,280000%)	0,33	0,04	0,73	8,14	3.055.043,03	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	0,33	0,04	0,74	10,37	2.082.152,55	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,000000%)	0,33	0,03	0,63	9,05	2.227.430,12	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,33	0,03	0,63	9,07	2.222.311,48	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,33	0,03	0,63	9,10	2.217.219,17	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,33	0,03	0,65	9,34	2.204.909,15	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,33	0,04	0,66	9,39	2.205.696,27	0,32
TESOURO	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,33	0,04	0,66	9,44	2.203.454,98	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,520000%)	0,33	0,04	0,67	9,54	2.194.445,35	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,33	0,04	0,69	9,83	11.383.571,70	1,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,33	0,04	0,70	9,86	2.134.418,26	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	0,33	0,04	0,70	9,89	5.126.087,49	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,33	0,04	0,70	9,92	2.051.239,87	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,33	0,04	0,70	9,94	16.737.307,19	2,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	0,33	0,04	0,72	10,12	9.201.163,87	1,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,33	0,04	0,73	10,23	8.284.075,38	1,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,268000%)	0,33	0,04	0,73	8,13	7.125.681,10	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	0,33	0,04	0,74	10,37	5.208.120,12	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,34	0,03	0,66	9,37	2.204.619,52	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,450000%)	0,33	0,04	0,66	9,47	2.237.125,06	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,33	0,04	0,70	9,91	2.196.447,44	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,33	0,03	0,63	9,05	2.233.895,51	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,33	0,03	0,64	9,17	2.236.109,53	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,33	0,03	0,64	9,22	2.237.234,49	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,33	0,04	0,67	9,51	2.242.769,77	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%)	0,33	0,04	0,68	9,72	3.284.793,99	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,33	0,03	0,62	8,90	2.247.838,12	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,33	0,03	0,64	9,16	2.241.221,55	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,33	0,03	0,65	9,27	2.244.315,46	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,33	0,03	0,65	9,30	2.241.685,98	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,33	0,04	0,69	9,81	3.292.580,20	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,33	0,03	0,62	8,91	2.256.554,57	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,33	0,03	0,62	8,95	2.251.770,91	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,33	0,03	0,64	9,21	2.245.423,99	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,33	0,03	0,65	9,30	2.247.807,05	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,300000%)	0,33	0,03	0,65	9,33	2.248.657,35	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,460000%)	2,84	0,04	0,67	4,05	3.538.881,36	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,33	0,04	0,67	9,52	2.246.891,75	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,835000%)	0,33	0,04	0,69	9,83	3.294.593,62	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,33	0,03	0,63	9,00	2.273.390,92	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,33	0,03	0,63	9,02	2.263.923,42	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,33	0,03	0,63	9,06	2.266.201,41	0,33
TESOURO	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,33	0,03	0,65	9,30	2.257.469,43	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%)	0,33	0,03	0,65	9,34	2.258.199,22	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,33	0,03	0,66	9,39	2.255.649,69	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,34	0,04	0,69	9,83	2.109.722,70	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,33	0,04	0,70	9,85	3.294.495,06	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,33	0,04	0,72	10,20	3.109.798,07	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,33	0,03	0,63	8,99	2.286.240,76	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,33	0,03	0,63	9,03	2.283.480,02	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,33	0,03	0,63	9,05	2.278.986,96	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,33	0,03	0,63	9,09	2.272.965,70	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,33	0,03	0,65	9,32	2.262.642,74	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,33	0,03	0,66	9,39	2.261.722,04	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,33	0,04	0,66	9,43	2.260.502,76	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,510000%)	0,33	0,04	0,67	9,53	2.253.446,45	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,33	0,04	0,69	9,83	8.514.283,72	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	0,33	0,04	0,70	9,89	3.162.751,65	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,33	0,04	0,70	9,91	2.110.609,94	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,33	0,04	0,70	9,94	11.505.557,92	1,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	0,33	0,04	0,72	10,12	6.842.415,48	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,33	0,04	0,73	10,23	5.699.662,15	0,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,278000%)	3,03	0,04	0,73	8,14	5.240.611,00	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	0,33	0,04	0,74	10,37	3.126.153,95	0,46
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,33</b>	<b>0,04</b>	<b>0,68</b>	<b>9,69</b>	<b>308.391.246,52</b>	<b>45,03</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,62	0,13	2,61	1,38	21.290.380,19	3,11	5.111.389.321,24	0,42
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,19	0,18	3,38	-0,26	21.066.238,17	3,08	1.555.151.477,87	1,35
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,82</b>	<b>0,16</b>	<b>2,99</b>	<b>0,56</b>	<b>42.356.618,36</b>	<b>6,18</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	10,12	-3,37	-1,14	1,50	5.075.060,50	0,74	227.004.888,64	2,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,91	5,20	21.039.375,57	3,07	15.351.200.547,79	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,05	0,99	12,34	21.489.405,49	3,14	5.804.930.459,21	0,37
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,05	0,94	12,28	27.981.927,79	4,09	2.894.940.806,12	0,97
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,49</b>	<b>-0,18</b>	<b>0,81</b>	<b>11,73</b>	<b>75.585.769,35</b>	<b>11,04</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	0,77	0,05	0,77	4,82	5.240.815,33	0,77		

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	0,76	0,02	0,74	4,71	5.235.443,99	0,76		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	0,72	0,03	0,75	4,69	5.234.263,74	0,76		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	9,34	0,07	0,81	10,93	5.594.265,14	0,82		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	0,75	0,02	0,72	4,60	5.229.880,54	0,76		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 7,00% a.a	16,16	0,05	0,79	10,95	6.109.212,75	0,89		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>4,52</b>	<b>0,04</b>	<b>0,76</b>	<b>10,77</b>	<b>32.643.881,49</b>	<b>4,77</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLURAL	GENIAL	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	354,06	-19,20	-7,84	832,98	33.504,03	0,00	1.158.970,29	2,89
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>354,06</b>	<b>-19,20</b>	<b>-7,84</b>	<b>832,98</b>	<b>33.504,03</b>	<b>0,00</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,04	0,05	0,94	12,33	3.487.572,98	0,51	13.233.154.738,80	0,03
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,49	0,05	1,16	12,42	6.040.238,62	0,88	3.954.142.849,62	0,15
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>0,45</b>	<b>0,05</b>	<b>1,08</b>	<b>12,02</b>	<b>9.527.811,60</b>	<b>1,39</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,55</b>	<b>0,01</b>	<b>0,92</b>	<b>9,89</b>	<b>468.538.831,35</b>	<b>68,41</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

14,01%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SUL AMERICA	BEM	SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	24,07	1,42	10,48	3,74	4.248.238,34	0,62	184.774.185,45	2,30
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	22,69	0,88	12,74	-5,83	2.139.579,83	0,31	177.962.983,27	1,20
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	21,40	1,05	11,05	7,43	7.358.650,29	1,07	248.175.195,31	2,97
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,83	0,58	11,94	10,48	5.407.449,71	0,79	1.307.551.624,78	0,41
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	17,27	0,68	11,30	13,63	23.476.331,19	3,43	681.913.058,77	3,44
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	15,86	0,91	10,65	10,35	26.578.825,96	3,88	774.123.386,50	3,43
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	19,99	0,44	13,02	37,76	6.558.688,18	0,96	458.461.047,30	1,43
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	23,10	1,10	13,89	19,84	3.842.620,96	0,56	404.565.743,87	0,95
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	19,90	0,60	8,07	41,43	9.542.367,11	1,39	850.660.216,43	1,12
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	19,98	-0,58	0,40	6,10	6.836.587,26	1,00	273.902.221,53	2,50
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>16,73</b>	<b>0,71</b>	<b>10,13</b>	<b>13,51</b>	<b>95.989.338,83</b>	<b>14,01</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>16,73</b>	<b>0,71</b>	<b>10,13</b>	<b>13,51</b>	<b>95.989.338,83</b>	<b>14,01</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,35%

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	18,66	0,44	12,47	35,25	16.276.006,20	2,38	233.893.887,96	6,96
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	33,79	0,13	14,65	21,49	1.882.679,74	0,27	111.329.792,38	1,69
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,40	1,15	-4,03	-24,04	2.142.591,57	0,31	50.914.922,32	4,21
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,69	1,44	11,34	-3,44	2.359.561,40	0,34	57.097.744,38	4,13
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	23,39	0,34	12,46	32,68	2.846.840,95	0,42	668.266.745,39	0,43
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	17,19	0,63	8,80	7,58	5.332.563,50	0,78	301.036.151,21	1,77
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>14,19</b>	<b>0,57</b>	<b>10,54</b>	<b>18,84</b>	<b>30.840.243,36</b>	<b>4,50</b>		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	14,82	1,17	6,24	14,53	19.512.200,10	2,85	649.301.092,13	3,01
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>14,82</b>	<b>1,17</b>	<b>6,24</b>	<b>14,53</b>	<b>19.512.200,10</b>	<b>2,85</b>		

Investimentos no Exterior

13,29 0,80 8,84 17,13 50.352.443,46 7,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,23%

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	14,26	-0,03	2,77	15,23	7.774.991,92	1,14	52.166.929,19	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13,93	0,40	9,32	26,49	19.160.534,37	2,80	755.319.514,64	2,54
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,96	0,41	9,34	27,12	31.912.199,31	4,66	495.199.406,31	6,44
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>12,22</b>	<b>0,35</b>	<b>8,42</b>	<b>25,21</b>	<b>58.847.725,60</b>	<b>8,59</b>		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	50,22	1,00	1,00	-5,89	11.199.437,72	1,64	354.980.421,15	3,15
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>50,22</b>	<b>1,00</b>	<b>1,00</b>	<b>-6,01</b>	<b>11.199.437,72</b>	<b>1,64</b>		

Investimentos Estruturados

13,52 0,45 7,16 19,32 70.047.163,32 10,23

Total

3,26 0,21 3,32 11,81 684.927.776,96 100,00



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

4. Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	308.391.246,52	45,03	0,00	43,00	70,00	58,39	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	42.356.618,36	6,18	0,00	5,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	75.585.769,35	11,04	0,00	12,50	40,00	13,33	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	32.643.881,49	4,77	0,00	2,50	20,00	1,70	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	33.504,03	0,00	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	9.527.811,60	1,39	0,00	2,00	5,00	1,67	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>468.538.831,35</b>	<b>68,41</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	95.989.338,83	14,01	0,00	14,50	30,00	4,92	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>95.989.338,83</b>	<b>14,01</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	30.840.243,36	4,50	0,00	4,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	19.512.200,10	2,85	0,00	6,00	10,00	5,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>50.352.443,46</b>	<b>7,35</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	58.847.725,60	8,59	0,00	8,00	10,00	8,39	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	11.199.437,72	1,64	0,00	2,00	5,00	1,61	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>70.047.163,32</b>	<b>10,23</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>684.927.776,96</b>	<b>100,00</b>					

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**5. Rentabilidades por Artigo**

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,68 74,36	9,69 80,47	2,09 71,66	3,78 59,70	10,62 79,83	2.106.003,02	28.633.637,82
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,99 325,70	0,56 4,67	0,65 22,38	0,56 8,87	0,56 4,22	1.229.367,39	231.154,36
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,81 88,73	11,73 97,44	2,74 93,77	6,30 99,43	13,00 97,74	601.526,89	10.688.989,88
Artigo 7º IV % do CDI	0,76 83,17	10,77 89,45	2,38 81,71	4,33 68,42	11,86 89,14	247.285,32	2.094.600,81
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-7,84 <b>-854,35</b>	832,98 6.916,61	468,21 16.045,92	2.693,27 42.520,24	882,49 6.634,40	<b>-2.132,21</b>	194.912,89
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,08 117,89	12,02 99,85	3,25 111,45	7,39 116,59	13,30 100,02	101.983,13	1.142.130,25
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	10,13 <b>-2,41</b>	13,51 <b>-2,53</b>	6,61 <b>-3,40</b>	15,14 <b>-2,40</b>	9,29 <b>-3,91</b>	9.079.100,79	12.063.688,17
Artigo 9º II % do CDI	10,54 1.148,97	18,84 156,47	1,02 35,06	7,65 120,71	15,21 114,31	2.941.859,11	4.890.068,18
Artigo 9º III % do CDI	6,24 679,69	14,53 120,62	1,15 39,34	6,52 102,89	9,18 69,01	1.145.697,31	2.474.961,44
Artigo 10º I % do CDI	8,42 917,25	25,21 209,35	2,71 92,99	11,91 187,98	20,24 152,13	4.569.288,04	11.849.232,35
Artigo 10º II % do CDI	1,00 108,54	-6,01 <b>-49,86</b>	-0,86 <b>-29,62</b>	0,37 5,77	-7,21 <b>-54,17</b>	110.466,92	<b>-516.034,07</b>
<b>JACAREÍ (Total)</b>						<b>22.130.445,71</b>	<b>73.747.342,08</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150525 (5,480000%)	2.224.148,10	0,00	0,00	63.581,01	2.175.170,92	14.603,83	197.068,83
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.087.794,83	0,00	0,00	31.237,09	1.063.967,21	7.409,47	99.276,77
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.688.056,02	0,00	0,00	582.313,48	20.244.659,51	138.916,97	830.100,56
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.251.437,02	0,00	0,00	59.153,70	2.206.037,44	13.754,12	187.941,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.247.814,89	0,00	0,00	59.153,70	2.202.426,60	13.765,41	188.009,59
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.247.057,64	0,00	0,00	59.276,68	2.201.592,00	13.811,04	188.499,86
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.237.151,10	0,00	0,00	60.383,51	2.190.993,59	14.226,00	192.927,25
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.238.561,22	0,00	0,00	60.875,43	2.192.077,83	14.392,04	194.769,95
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.237.736,54	0,00	0,00	60.998,41	2.191.173,20	14.435,07	195.247,81
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.549.194,14	0,00	0,00	43.412,18	1.516.175,58	10.393,62	62.092,78
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.091.918,08	0,00	0,00	59.399,66	2.046.811,43	14.293,01	191.338,34
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.274.016,21	0,00	0,00	93.096,37	3.203.332,03	22.412,19	299.939,39
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.264.669,62	0,00	0,00	57.677,93	2.221.019,56	14.027,87	190.993,71
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.261.935,03	0,00	0,00	57.677,93	2.218.286,19	14.029,09	190.949,92
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.257.925,93	0,00	0,00	57.923,90	2.214.089,39	14.087,36	191.543,39
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.245.910,52	0,00	0,00	59.399,66	2.200.946,20	14.435,34	195.243,03
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.245.172,67	0,00	0,00	59.768,61	2.199.926,02	14.521,96	196.195,29
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.243.772,87	0,00	0,00	60.014,57	2.198.336,70	14.578,40	196.809,84
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.282.694,58	0,00	0,00	148.929,59	5.169.838,50	36.073,51	482.885,18
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.182.557,99	0,00	0,00	61.736,30	2.135.772,40	14.950,71	200.022,44
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.099.701,47	0,00	0,00	59.645,63	2.054.496,85	14.441,01	193.062,52
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.415.726,59	0,00	0,00	182.626,30	6.277.309,29	44.209,00	590.853,54
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.093.690,98	0,00	0,00	59.645,63	2.048.483,97	14.438,62	192.937,69
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.707.936,88	0,00	0,00	137.492,39	4.603.656,30	33.211,81	442.204,52
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.711.566,67	0,00	0,00	109.821,74	3.628.240,35	26.495,42	352.120,11
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.125.400,71	0,00	0,00	92.727,43	3.055.043,03	22.369,75	239.580,28
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.130.790,18	0,00	0,00	64.072,93	2.082.152,55	15.435,30	204.640,93
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.270.008,62	0,00	0,00	56.694,09	2.227.430,12	14.115,59	191.949,05
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.264.992,85	0,00	0,00	56.817,07	2.222.311,48	14.135,70	192.086,57
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.260.003,31	0,00	0,00	56.940,05	2.217.219,17	14.155,91	192.225,73
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.249.184,67	0,00	0,00	58.784,76	2.204.909,15	14.509,24	196.042,77
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.250.364,79	0,00	0,00	59.276,68	2.205.696,27	14.608,16	197.166,09
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.248.421,84	0,00	0,00	59.645,63	2.203.454,98	14.678,77	197.922,32

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.239.917,57	0,00	0,00	60.260,53	2.194.445,35	14.788,31	199.017,95
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.630.784,01	0,00	0,00	326.636,66	11.383.571,70	79.424,35	1.063.111,21
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.180.966,98	0,00	0,00	61.490,34	2.134.418,26	14.941,62	199.867,01
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.238.494,58	0,00	0,00	148.437,67	5.126.087,49	36.030,58	481.651,83
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.096.422,11	0,00	0,00	59.645,63	2.051.239,87	14.463,39	193.268,64
NTN-B 150555 (5,950000%)	17.107.211,64	0,00	0,00	488.233,26	16.737.307,19	118.328,81	1.580.348,95
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.410.254,98	0,00	0,00	275.476,70	9.201.163,87	66.385,59	883.910,23
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.475.649,35	0,00	0,00	252.110,38	8.284.075,38	60.536,41	804.494,01
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.290.630,43	0,00	0,00	217.060,88	7.125.681,10	52.111,55	558.297,55
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.330.979,85	0,00	0,00	161.473,62	5.208.120,12	38.613,89	512.042,94
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.190.241,25	0,00	0,00	0,00	2.204.619,52	14.378,27	193.904,26
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.222.360,12	0,00	0,00	0,00	2.237.125,06	14.764,94	198.662,61
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.181.191,15	0,00	0,00	0,00	2.196.447,44	15.256,29	203.216,36
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.219.888,79	0,00	0,00	0,00	2.233.895,51	14.006,72	190.304,73
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.221.885,68	0,00	0,00	0,00	2.236.109,53	14.223,85	192.702,74
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.222.902,53	0,00	0,00	0,00	2.237.234,49	14.331,96	193.896,72
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.227.899,10	0,00	0,00	0,00	2.242.769,77	14.870,67	199.844,97
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.262.474,44	0,00	0,00	0,00	3.284.793,99	22.319,55	298.549,74
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.234.014,02	0,00	0,00	0,00	2.247.838,12	13.824,10	188.480,47
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.226.973,26	0,00	0,00	0,00	2.241.221,55	14.248,29	192.996,43
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.229.853,95	0,00	0,00	0,00	2.244.315,46	14.461,51	195.363,43
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.227.190,22	0,00	0,00	0,00	2.241.685,98	14.495,76	195.683,64
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.269.960,44	0,00	0,00	0,00	3.292.580,20	22.619,76	301.888,09
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.242.659,11	0,00	0,00	0,00	2.256.554,57	13.895,46	189.319,87
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.237.837,00	0,00	0,00	0,00	2.251.770,91	13.933,91	189.662,14
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.231.057,87	0,00	0,00	0,00	2.245.423,99	14.366,12	194.270,49
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.233.274,10	0,00	0,00	0,00	2.247.807,05	14.532,95	196.166,45
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.234.066,23	0,00	0,00	0,00	2.248.657,35	14.591,12	196.793,68
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.515.496,13	0,00	0,00	0,00	3.538.881,36	23.385,23	139.131,22

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.231.977,07	0,00	0,00	0,00	2.246.891,75	14.914,68	200.315,77
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.271.898,47	0,00	0,00	0,00	3.294.593,62	22.695,15	302.719,02
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.259.236,99	0,00	0,00	0,00	2.273.390,92	14.153,93	192.175,37
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.249.794,38	0,00	0,00	0,00	2.263.923,42	14.129,04	191.752,19
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.251.972,50	0,00	0,00	0,00	2.266.201,41	14.228,91	192.887,65
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.242.866,75	0,00	0,00	0,00	2.257.469,43	14.602,68	196.908,47
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.243.530,87	0,00	0,00	0,00	2.258.199,22	14.668,35	197.644,92
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.240.913,00	0,00	0,00	0,00	2.255.649,69	14.736,69	198.357,39
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.095.188,55	0,00	0,00	0,00	2.109.722,70	14.534,15	193.838,87
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.271.752,93	0,00	0,00	0,00	3.294.495,06	22.742,13	303.183,32
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.087.489,82	0,00	0,00	0,00	3.109.798,07	22.308,25	295.520,92
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.272.024,01	0,00	0,00	0,00	2.286.240,76	14.216,75	192.929,86
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.269.211,21	0,00	0,00	0,00	2.283.480,02	14.268,81	193.462,98
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.264.694,65	0,00	0,00	0,00	2.278.986,96	14.292,31	193.653,19
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.258.651,54	0,00	0,00	0,00	2.272.965,70	14.314,16	193.807,27
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.247.970,02	0,00	0,00	0,00	2.262.642,74	14.672,72	197.662,82
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.246.945,08	0,00	0,00	0,00	2.261.722,04	14.776,96	198.800,01
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.245.649,08	0,00	0,00	0,00	2.260.502,76	14.853,68	199.635,91
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.238.470,86	0,00	0,00	0,00	2.253.446,45	14.975,59	200.891,41
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.455.662,02	0,00	0,00	0,00	8.514.283,72	58.621,70	781.772,46
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.140.818,92	0,00	0,00	0,00	3.162.751,65	21.932,73	292.130,59
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.095.935,91	0,00	0,00	0,00	2.110.609,94	14.674,03	195.368,22
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.425.326,47	0,00	0,00	0,00	11.505.557,92	80.231,45	1.067.778,14
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.793.734,94	0,00	0,00	0,00	6.842.415,48	48.680,54	645.791,56
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.658.603,44	0,00	0,00	0,00	5.699.662,15	41.058,71	543.639,11
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.202.789,83	0,00	0,00	0,00	5.240.611,00	37.821,17	402.202,22
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.103.308,45	0,00	0,00	0,00	3.126.153,95	22.845,50	301.769,83
	311.186.269,21	0,00	0,00	4.901.025,71	308.391.246,52	2.106.003,02	

**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	20.378.061,85	0,00	0,00	0,00	21.066.238,17	688.176,32	-59.225,83
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.749.189,12	0,00	0,00	0,00	21.290.380,19	541.191,07	290.380,19
	41.127.250,97	0,00	0,00	0,00	42.356.618,36	1.229.367,39	

## 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	20.848.725,65	0,00	0,00	0,00	21.039.375,57	190.649,92	1.039.375,57
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	21.279.613,16	0,00	0,00	0,00	21.489.405,49	209.792,33	4.375.488,74
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5.133.628,50	0,00	0,00	0,00	5.075.060,50	-58.568,00	75.060,50
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	24.761.175,15	11.317.100,00	-8.356.000,00	0,00	27.981.927,79	259.652,64	3.339.840,34
	72.023.142,46	11.317.100,00	-8.356.000,00	0,00	75.585.769,35	601.526,89	

## 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	5.195.537,84	0,00	0,00	0,00	5.234.263,74	38.725,90	234.263,74
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	5.200.870,85	0,00	0,00	0,00	5.240.815,33	39.944,48	240.815,33
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a	6.061.383,50	0,00	0,00	0,00	6.109.212,75	47.829,25	602.989,65
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	5.192.475,15	0,00	0,00	0,00	5.229.880,54	37.405,39	229.880,54
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	5.197.186,13	0,00	0,00	0,00	5.235.443,99	38.257,86	235.443,99
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.549.142,70	0,00	0,00	0,00	5.594.265,14	45.122,44	551.207,56
	32.396.596,17	0,00	0,00	0,00	32.643.881,49	247.285,32	

## 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	41.464,91	0,00	0,00	5.828,67	33.504,03	-2.132,21	194.912,89
	41.464,91	0,00	0,00	5.828,67	33.504,03	-2.132,21	

## 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	3.454.987,13	0,00	0,00	0,00	3.487.572,98	32.585,85	382.952,45
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	5.970.841,34	0,00	0,00	0,00	6.040.238,62	69.397,28	667.473,91
	9.425.828,47	0,00	0,00	0,00	9.527.811,60	101.983,13	

## 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	6.626.542,82	0,00	0,00	0,00	7.358.650,29	732.107,47	509.206,08
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.830.792,30	0,00	0,00	0,00	5.407.449,71	576.657,41	512.995,60
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	5.802.869,62	0,00	0,00	0,00	6.558.688,18	755.818,56	1.394.588,97
INDIE FIC FIA	3.374.060,74	0,00	0,00	0,00	3.842.620,96	468.560,22	636.154,14
META VALOR FI DE AÇÕES	1.897.877,32	0,00	0,00	0,00	2.139.579,83	241.702,51	-132.552,51
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	21.093.540,42	0,00	0,00	0,00	23.476.331,19	2.382.790,77	3.103.717,35
OCCAM FIC FIA	29.115.633,81	0,00	-5.315.599,99	0,00	26.578.825,96	2.778.792,14	2.697.848,42
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	3.845.290,49	0,00	0,00	0,00	4.248.238,34	402.947,85	153.039,31
TARPON GT 30 FIC FIA	8.830.106,91	0,00	0,00	0,00	9.542.367,11	712.260,20	2.795.335,34
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	6.809.123,60	0,00	0,00	0,00	6.836.587,26	27.463,66	393.355,47
	92.225.838,03	0,00	-5.315.599,99	0,00	95.989.338,83	9.079.100,79	

## 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	14.471.476,61	0,00	0,00	0,00	16.276.006,20	1.804.529,59	4.242.382,82
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.642.175,08	0,00	0,00	0,00	1.882.679,74	240.504,66	333.038,62
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.232.618,63	0,00	0,00	0,00	2.142.591,57	-90.027,06	-678.085,98
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.119.309,12	0,00	0,00	0,00	2.359.561,40	240.252,28	-84.043,97
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.531.404,59	0,00	0,00	0,00	2.846.840,95	315.436,36	701.250,54
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	4.901.400,22	0,00	0,00	0,00	5.332.563,50	431.163,28	375.526,15

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	27.898.384,25	0,00	0,00	0,00	30.840.243,36	2.941.859,11	

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	18.366.502,79	0,00	0,00	0,00	19.512.200,10	1.145.697,31	2.474.961,44
	18.366.502,79	0,00	0,00	0,00	19.512.200,10	1.145.697,31	

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	29.184.904,68	0,00	0,00	0,00	31.912.199,31	2.727.294,63	6.809.149,71
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	7.565.793,48	0,00	0,00	0,00	7.774.991,92	209.198,44	1.027.650,91
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	17.527.739,40	0,00	0,00	0,00	19.160.534,37	1.632.794,97	4.012.431,73
	54.278.437,56	0,00	0,00	0,00	58.847.725,60	4.569.288,04	

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	11.088.970,80	0,00	0,00	0,00	11.199.437,72	110.466,92	-500.957,84
	11.088.970,80	0,00	0,00	0,00	11.199.437,72	110.466,92	

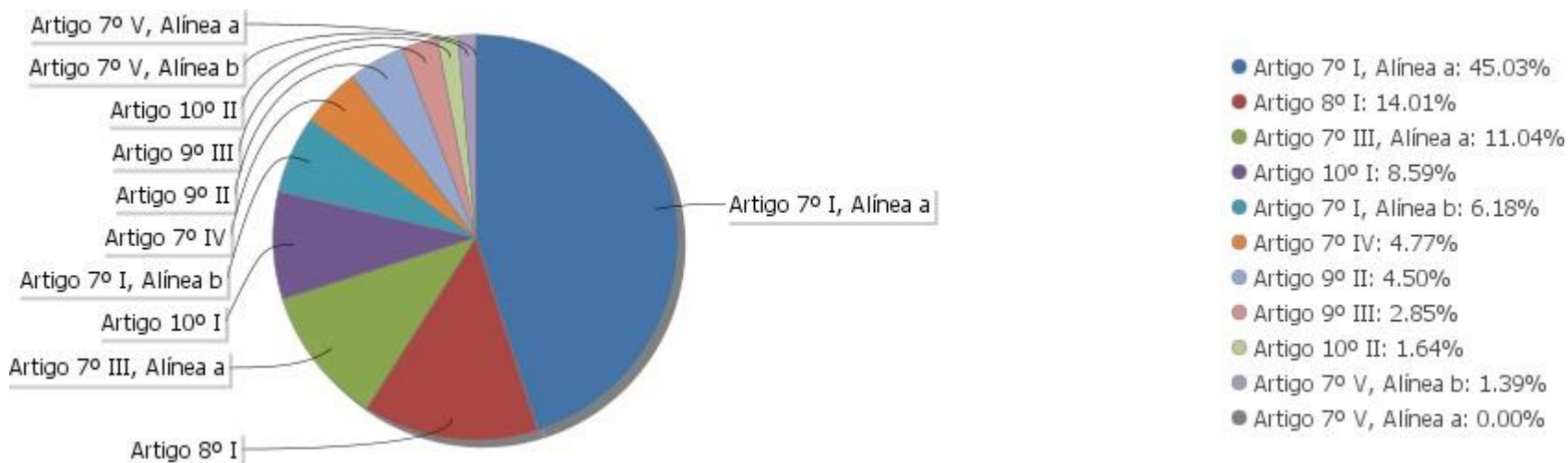
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## 6. Análise de Liquidez

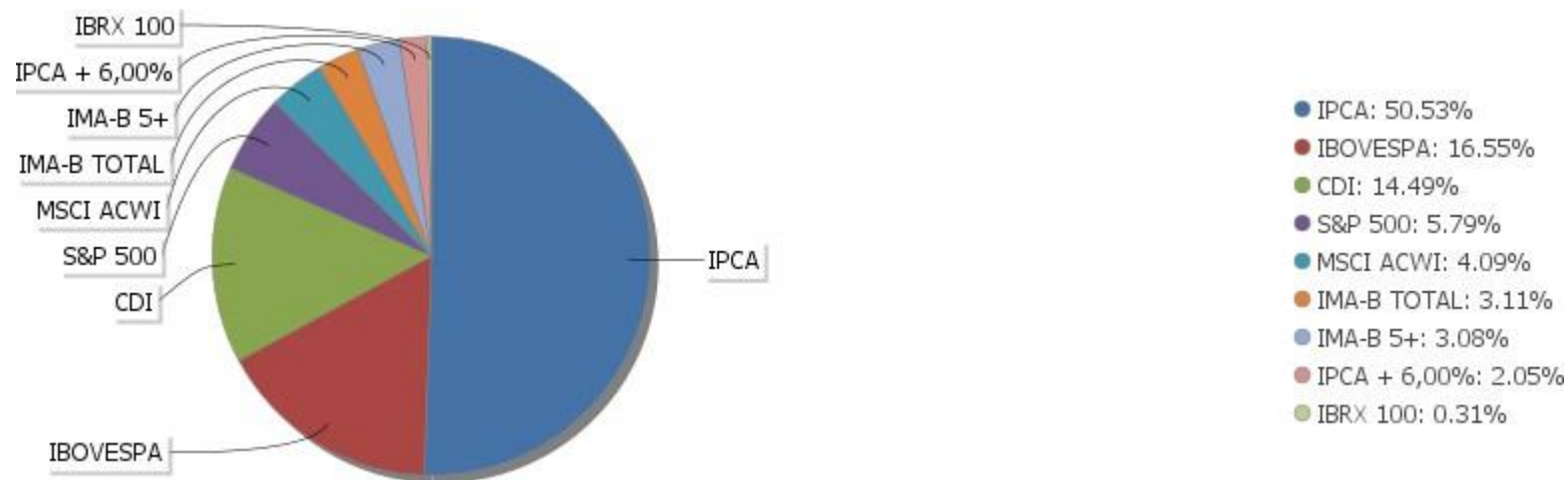
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	267.705.867,98	39,09	267.705.867,98	39,09	15,00
de 31 dias a 365 dias	66.550.474,77	9,72	334.256.342,75	48,80	20,00
acima de 365 dias	350.671.434,21	51,20	684.927.776,96	100,00	25,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

7. Alocação por Artigo

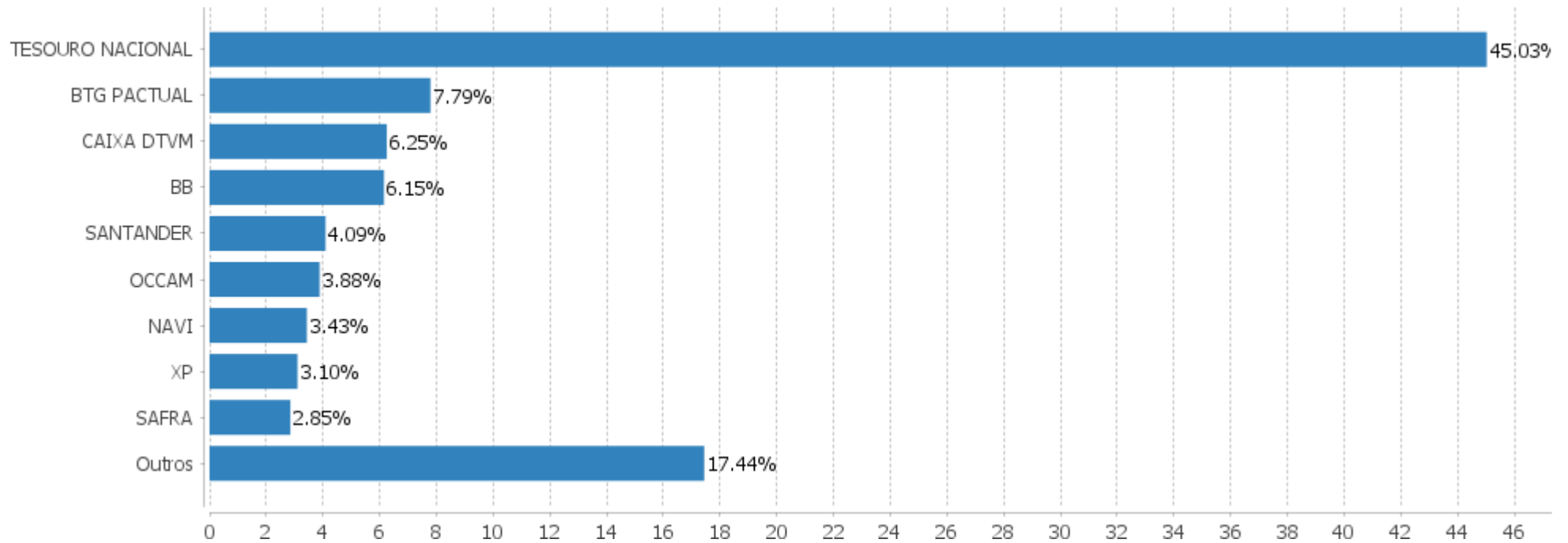


8. Alocação Por Estratégia



## 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	3,32		11,81
IPCA + 5,11%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34	0,54	0,69	0,66	0,66	0,68		8,86
p.p. indexador	0,97	-1,68	-0,35	-0,12	1,19	1,99	0,89	-0,83	-0,73	-1,19	2,64		2,95
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	9	39,13	03 meses	2,68	2,01	0,68	3,69
Meses abaixo - Meta Atuarial	14	60,87	06 meses	6,42	3,60	2,81	3,20
			12 meses	11,17	9,99	1,18	3,26
			24 meses				
Desde 31/12/2021				15,77	20,70	-4,92	4,63

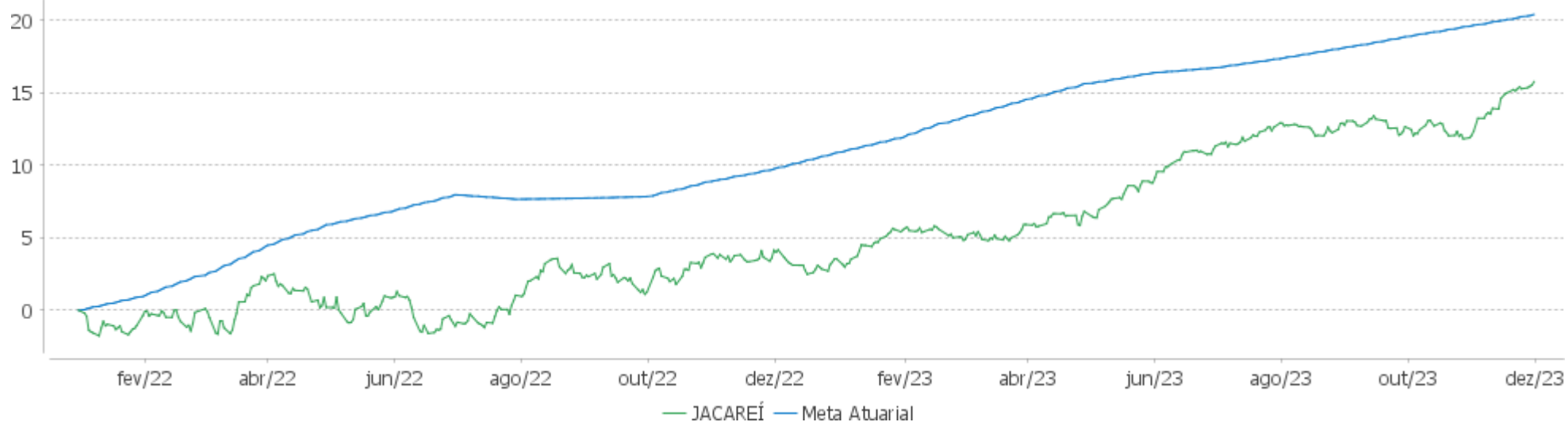
  

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,32	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-1,97	2022-06

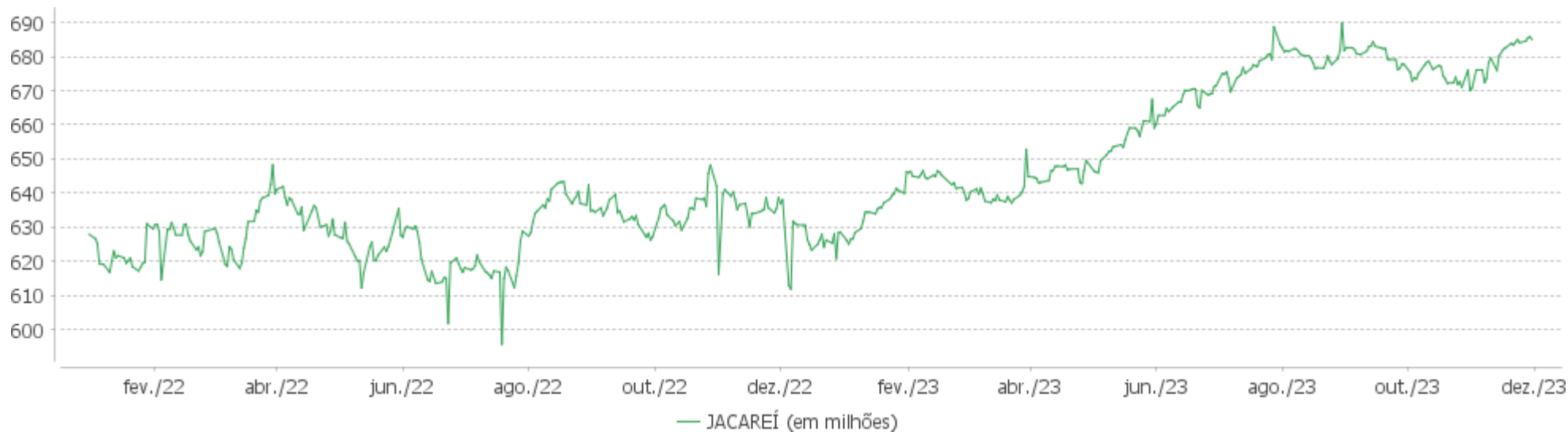


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

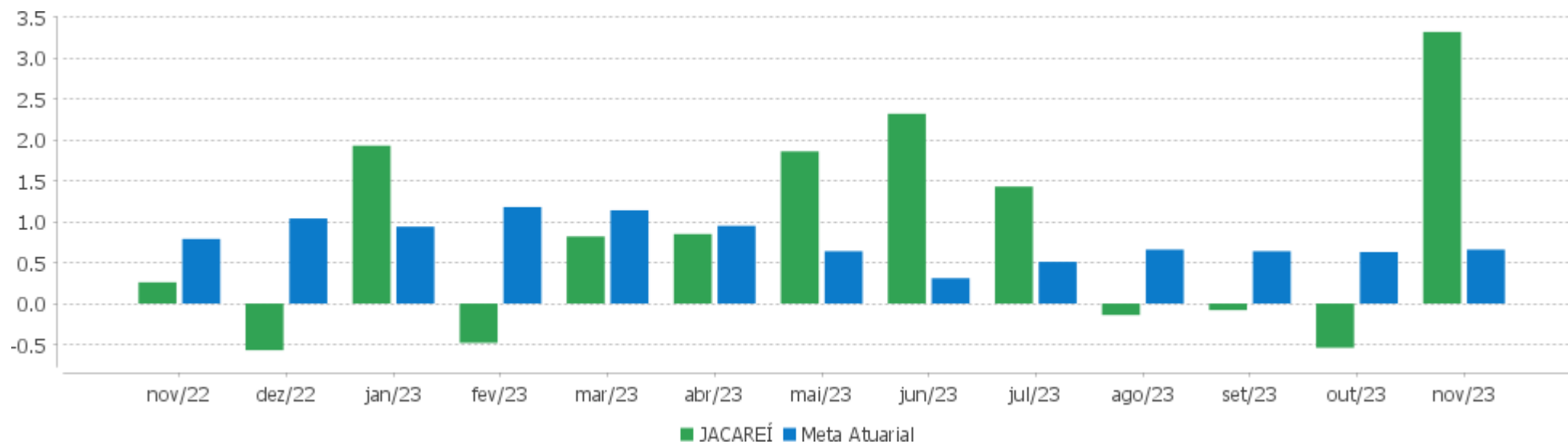


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

11. Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a Var. IPCA p.p.	0,77 0,49	4,82 3,66	2,35 1,57	4,33 3,28			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a Var. IPCA p.p.	0,74 0,46	4,71 3,55	2,37 1,59	4,27 3,22			
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a Var. IPCA p.p.	0,75 0,47	4,69 3,53	2,31 1,53	4,25 3,20			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,81 0,53	10,93 6,89	2,53 1,74	4,51 3,46			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a Var. IPCA p.p.	0,72 0,44	4,60 3,44	2,32 1,54	4,17 3,11			
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,79 0,51	10,95 6,91	2,41 1,63	4,44 3,39	12,00 7,31		
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,16 126,64	12,42 103,16	3,39 116,28	7,85 123,86	13,74 103,32	28,27 105,22	36,39 114,95
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,94 102,77	12,33 102,42	3,01 103,11	6,57 103,79	13,64 102,51	28,07 104,46	34,10 107,72
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,44	10,12 6,08	2,20 1,41	4,00 2,95	11,10 6,41	18,04 7,18	
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,89 5,85	2,14 1,36	3,88 2,83	10,84 6,16	17,72 6,86	
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,36	9,16 5,13	1,96 1,18	3,50 2,45	10,04 5,36	22,86 12,00	
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,39	9,50 5,46	2,04 1,26	3,68 2,62	10,41 5,73	23,68 12,82	
NTN-B 150533 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,40	6,62 2,59	2,09 1,31	3,78 2,72	7,53 2,85		
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,94 5,90	2,15 1,37	3,91 2,86	10,90 6,22	24,79 13,93	
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,86 5,82	2,13 1,35	3,87 2,81	10,81 6,12	24,58 13,72	
NTN-B 150545 (5,915000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,91 5,87	2,14 1,36	3,89 2,84	10,86 6,18	24,70 13,84	
NTN-B 150850 (5,831200%)	0,69	9,83	2,12	3,85	10,77	24,51	

**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.	0,41	5,79	1,34	2,80	6,09	13,65	
NTN-B 150826 (5,190000%)	0,64	9,22	1,97	3,54	10,11	23,01	
Var. IPCA p.p.	0,36	5,19	1,19	2,48	5,42	12,15	
NTN-B 150830 (5,270000%)	0,65	9,30	1,99	3,58	10,19	23,19	
Var. IPCA p.p.	0,37	5,26	1,21	2,52	5,51	12,33	
NTN-B 150840 (5,837000%)	0,69	9,83	2,13	3,85	10,78	24,52	
Var. IPCA p.p.	0,41	5,80	1,34	2,80	6,10	13,66	
NTN-B 150545 (4,970000%)	0,63	9,02	1,92	3,43	9,88	22,49	
Var. IPCA p.p.	0,35	4,98	1,14	2,37	5,19	11,63	
NTN-B 150840 (4,950000%)	0,63	9,00	1,92	3,42	9,86	22,45	
Var. IPCA p.p.	0,35	4,96	1,14	2,36	5,17	11,59	
NTN-B 150850 (4,980000%)	0,63	9,03	1,92	3,43	9,89	22,52	
Var. IPCA p.p.	0,35	4,99	1,14	2,38	5,20	11,66	
NTN-B 150555 (5,927000%)	0,70	9,92	2,15	3,90	10,87	24,73	
Var. IPCA p.p.	0,42	5,88	1,36	2,84	6,19	13,87	
NTN-B 150850 (5,360000%)	0,66	9,39	2,01	3,62	10,28	23,40	
Var. IPCA p.p.	0,38	5,35	1,23	2,57	5,60	12,54	
NTN-B 150545 (5,922000%)	0,70	9,92	2,15	3,90	10,87	24,72	
Var. IPCA p.p.	0,42	5,88	1,36	2,84	6,19	13,86	
NTN-B 150535 (4,910000%)	0,62	8,96	1,91	3,40	9,81	22,35	
Var. IPCA p.p.	0,34	4,92	1,13	2,34	5,13	11,49	
NTN-B 150555 (5,370000%)	0,66	9,39	2,02	3,62	10,29	23,43	
Var. IPCA p.p.	0,38	5,36	1,23	2,57	5,61	12,57	
NTN-B 150840 (5,020000%)	0,63	9,06	1,93	3,45	9,93	22,61	
Var. IPCA p.p.	0,35	5,03	1,15	2,40	5,25	11,75	
NTN-B 150850 (4,940000%)	0,63	8,99	1,92	3,41	9,85	22,42	
Var. IPCA p.p.	0,35	4,95	1,13	2,36	5,16	11,56	
NTN-B 150840 (4,970000%)	0,63	9,02	1,92	3,43	9,88	22,49	
Var. IPCA p.p.	0,35	4,98	1,14	2,37	5,19	11,63	
NTN-B 150826 (5,490000%)	0,67	9,51	2,04	3,68	10,42	23,71	
Var. IPCA p.p.	0,39	5,47	1,26	2,63	5,74	12,85	
NTN-B 150545 (6,280000%)	0,73	10,25	2,23	4,07	11,24	18,24	
Var. IPCA p.p.	0,45	6,21	1,45	3,02	6,56	7,38	
NTN-B 150830 (5,460000%)	0,67	6,44	2,04	3,67	7,32		
Var. IPCA p.p.	0,39	2,40	1,26	2,62	2,64		
NTN-B 150850 (6,261000%)	0,73	10,23	2,22	4,06	11,22	25,52	

**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	6,20	1,44	3,01	6,54	14,66	
NTN-B 150535 (5,670000%)	0,68	6,62	2,09	3,77	7,53		
Var. IPCA p.p.	0,40	2,58	1,30	2,72	2,84		
NTN-B 150555 (5,000000%)	0,63	9,05	1,93	3,44	9,91	22,56	
Var. IPCA p.p.	0,35	5,01	1,15	2,39	5,22	11,70	
NTN-B 150535 (5,320000%)	0,65	9,35	2,00	3,60	10,24	23,31	
Var. IPCA p.p.	0,37	5,31	1,22	2,55	5,56	12,45	
NTN-B 150850 (5,010000%)	0,63	9,05	1,93	3,45	9,92	22,59	
Var. IPCA p.p.	0,35	5,02	1,15	2,39	5,24	11,73	
NTN-B 150555 (6,261000%)	0,73	10,23	2,22	4,06	11,22	25,52	
Var. IPCA p.p.	0,45	6,20	1,44	3,01	6,54	14,66	
NTN-B 150545 (6,256000%)	0,73	10,23	2,22	4,06	11,22	25,51	
Var. IPCA p.p.	0,45	6,19	1,44	3,01	6,53	14,65	
NTN-B 150555 (5,520000%)	0,67	9,54	2,05	3,70	10,45	23,78	
Var. IPCA p.p.	0,39	5,50	1,27	2,64	5,77	12,92	
NTN-B 150555 (5,860000%)	0,70	9,86	2,13	3,87	10,81	24,58	
Var. IPCA p.p.	0,42	5,82	1,35	2,81	6,12	13,72	
NTN-B 150545 (5,380000%)	0,66	9,40	2,02	3,63	10,30	23,45	
Var. IPCA p.p.	0,38	5,37	1,24	2,58	5,62	12,59	
NTN-B 150826 (5,009000%)	0,63	9,05	1,93	3,45	9,92	22,58	
Var. IPCA p.p.	0,35	5,02	1,15	2,39	5,23	11,72	
NTN-B 150545 (6,400000%)	0,74	10,37	2,26	4,13	11,37	18,41	
Var. IPCA p.p.	0,46	6,33	1,47	3,08	6,68	7,55	
NTN-B 150555 (5,831200%)	0,69	9,83	2,12	3,85	10,77	24,51	
Var. IPCA p.p.	0,41	5,79	1,34	2,80	6,09	13,65	
NTN-B 150535 (5,855000%)	0,70	9,85	2,13	3,86	10,80	24,56	
Var. IPCA p.p.	0,42	5,81	1,35	2,81	6,12	13,70	
NTN-B 150828 (4,850000%)	0,62	8,90	1,89	3,37	9,75	22,21	
Var. IPCA p.p.	0,34	4,87	1,11	2,31	5,07	11,35	
NTN-B 150545 (5,831000%)	0,69	9,83	2,12	3,85	10,77	24,51	
Var. IPCA p.p.	0,41	5,79	1,34	2,80	6,09	13,65	
NTN-B 150555 (6,400000%)	0,74	10,37	2,26	4,13	11,37	18,36	
Var. IPCA p.p.	0,46	6,33	1,47	3,08	6,68	7,50	
NTN-B 150828 (5,240000%)	0,65	9,27	1,99	3,56	10,16	23,12	
Var. IPCA p.p.	0,37	5,23	1,20	2,51	5,48	12,26	
NTN-B 150545 (5,340000%)	0,66	9,37	2,01	3,61	10,26	23,36	

**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.	0,38	5,33	1,23	2,56	5,58	12,50	
NTN-B 150850 (5,921000%)	0,70	9,91	2,15	3,90	10,87	24,72	
Var. IPCA p.p.	0,42	5,88	1,36	2,84	6,19	13,86	
NTN-B 150535 (4,860000%)	0,62	8,91	1,90	3,37	9,76	22,24	
Var. IPCA p.p.	0,34	4,88	1,11	2,32	5,08	11,38	
NTN-B 150826 (5,710000%)	0,68	9,72	2,10	3,79	10,65	24,22	
Var. IPCA p.p.	0,40	5,68	1,31	2,74	5,97	13,36	
NTN-B 150555 (6,268000%)	0,73	10,24	2,23	4,07	11,23	18,19	
Var. IPCA p.p.	0,45	6,20	1,44	3,01	6,55	7,33	
NTN-B 150555 (6,140000%)	0,72	10,12	2,20	4,00	11,10	21,58	
Var. IPCA p.p.	0,44	6,08	1,41	2,95	6,41	10,72	
NTN-B 150828 (5,270000%)	0,65	9,30	1,99	3,58	10,19	23,19	
Var. IPCA p.p.	0,37	5,26	1,21	2,52	5,51	12,33	
NTN-B 150535 (5,290000%)	0,65	9,32	2,00	3,59	10,21	23,24	
Var. IPCA p.p.	0,37	5,28	1,22	2,53	5,53	12,38	
NTN-B 150830 (5,835000%)	0,69	9,83	2,13	3,85	10,78	24,52	
Var. IPCA p.p.	0,41	5,80	1,34	2,80	6,10	13,66	
NTN-B 150535 (5,837000%)	0,69	9,83	2,13	3,85	10,78	24,52	
Var. IPCA p.p.	0,41	5,80	1,34	2,80	6,10	13,66	
NTN-B 150830 (5,300000%)	0,65	9,33	2,00	3,59	10,22	23,26	
Var. IPCA p.p.	0,37	5,29	1,22	2,54	5,54	12,40	
NTN-B 150555 (5,315000%)	0,65	9,34	2,00	3,60	10,24	23,30	
Var. IPCA p.p.	0,37	5,30	1,22	2,54	5,55	12,44	
NTN-B 150545 (5,285000%)	0,65	9,31	2,00	3,58	10,21	23,23	
Var. IPCA p.p.	0,37	5,28	1,21	2,53	5,52	12,37	
NTN-B 150830 (5,500000%)	0,67	9,52	2,05	3,69	10,43	23,73	
Var. IPCA p.p.	0,39	5,48	1,26	2,63	5,75	12,87	
NTN-B 150830 (5,178300%)	0,64	9,21	1,97	3,53	10,09	22,98	
Var. IPCA p.p.	0,36	5,18	1,19	2,48	5,41	12,12	
NTN-B 150824 (5,450000%)	0,66	9,47	2,04	3,66	10,38	23,61	
Var. IPCA p.p.	0,38	5,43	1,25	2,61	5,69	12,75	
NTN-B 150545 (5,030000%)	0,63	9,07	1,94	3,46	9,94	22,63	
Var. IPCA p.p.	0,35	5,04	1,15	2,40	5,26	11,77	
NTN-B 150545 (5,897000%)	0,70	9,89	2,14	3,88	10,84	21,13	
Var. IPCA p.p.	0,42	5,85	1,36	2,83	6,16	10,27	
NTN-B 150850 (6,400000%)	0,74	10,37	2,26	4,13	11,37	18,38	

**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.	0,46	6,33	1,48	3,08	6,68	7,52	
NTN-B 150824 (5,912000%)	0,70	9,91	2,14	3,89	10,86	24,70	
Var. IPCA p.p.	0,42	5,87	1,36	2,84	6,18	13,84	
NTN-B 150850 (5,045000%)	0,63	9,09	1,94	3,47	9,96	22,67	
Var. IPCA p.p.	0,35	5,05	1,16	2,41	5,27	11,81	
NTN-B 150555 (5,030000%)	0,63	9,07	1,94	3,46	9,94	22,63	
Var. IPCA p.p.	0,35	5,04	1,15	2,40	5,26	11,77	
NTN-B 150840 (5,274000%)	0,65	9,30	1,99	3,58	10,19	23,20	
Var. IPCA p.p.	0,37	5,27	1,21	2,52	5,51	12,34	
NTN-B 150826 (5,130000%)	0,64	9,17	1,96	3,51	10,04	22,87	
Var. IPCA p.p.	0,36	5,13	1,18	2,45	5,36	12,01	
NTN-B 150840 (5,360000%)	0,66	9,39	2,01	3,62	10,28	23,40	
Var. IPCA p.p.	0,38	5,35	1,23	2,57	5,60	12,54	
NTN-B 150850 (5,410000%)	0,66	9,43	2,03	3,64	10,34	23,52	
Var. IPCA p.p.	0,38	5,39	1,24	2,59	5,65	12,66	
NTN-B 150840 (5,855000%)	0,70	9,85	2,13	3,86	10,80	24,56	
Var. IPCA p.p.	0,42	5,81	1,35	2,81	6,12	13,70	
NTN-B 150545 (4,980000%)	0,63	9,03	1,92	3,43	9,89	22,52	
Var. IPCA p.p.	0,35	4,99	1,14	2,38	5,20	11,66	
NTN-B 150830 (4,860000%)	0,62	8,91	1,90	3,37	9,76	22,24	
Var. IPCA p.p.	0,34	4,88	1,11	2,32	5,08	11,38	
NTN-B 150824 (5,345000%)	0,66	9,37	2,01	3,61	10,27	23,37	
Var. IPCA p.p.	0,38	5,33	1,23	2,56	5,58	12,51	
NTN-B 150840 (5,310000%)	0,65	9,34	2,00	3,60	10,23	23,29	
Var. IPCA p.p.	0,37	5,30	1,22	2,54	5,55	12,43	
NTN-B 150545 (6,140000%)	0,72	10,12	2,20	4,00	11,10	21,59	
Var. IPCA p.p.	0,44	6,08	1,41	2,95	6,41	10,73	
NTN-B 150830 (4,900000%)	0,62	8,95	1,91	3,39	9,80	22,33	
Var. IPCA p.p.	0,34	4,91	1,12	2,34	5,12	11,47	
NTN-B 150850 (5,295500%)	0,65	9,32	2,00	3,59	10,22	23,25	
Var. IPCA p.p.	0,37	5,29	1,22	2,53	5,53	12,39	
NTN-B 150535 (4,880000%)	0,62	8,93	1,90	3,38	9,78	22,28	
Var. IPCA p.p.	0,34	4,89	1,12	2,33	5,10	11,42	
NTN-B 150555 (5,420000%)	0,66	9,44	2,03	3,65	10,35	23,54	
Var. IPCA p.p.	0,38	5,40	1,25	2,60	5,66	12,68	
NTN-B 150850 (5,510000%)	0,67	9,53	2,05	3,69	10,44	23,75	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,39	5,49	1,27	2,64	5,76	12,89	
NTN-B 150555 (5,897000%)	0,70	9,89	2,14	3,88	10,84	21,14	
Var. IPCA p.p.	0,42	5,85	1,36	2,83	6,16	10,28	
NTN-B 150850 (6,278000%)	0,73	6,98	2,23	4,07	7,94	14,71	
Var. IPCA p.p.	0,45	2,94	1,45	3,02	3,26	3,85	
NTN-B 150840 (6,220000%)	0,72	10,20	2,22	4,04	11,18	25,42	
Var. IPCA p.p.	0,44	6,16	1,43	2,99	6,50	14,56	
NTN-B 150555 (5,950000%)	0,70	9,94	2,15	3,91	10,90	24,79	
Var. IPCA p.p.	0,42	5,90	1,37	2,86	6,22	13,93	
NTN-B 150555 (5,060000%)	0,63	9,10	1,94	3,47	9,97	22,70	
Var. IPCA p.p.	0,35	5,06	1,16	2,42	5,29	11,84	
NTN-B 150828 (5,810000%)	0,69	9,81	2,12	3,84	10,75	24,46	
Var. IPCA p.p.	0,41	5,77	1,34	2,79	6,07	13,60	
NTN-B 150525 (5,810000%)	0,69	9,81	2,12	3,84	10,75	24,46	
Var. IPCA p.p.	0,41	5,77	1,34	2,79	6,07	13,60	
NTN-B 150535 (5,196100%)	0,65	9,23	1,98	3,54	10,11	23,02	
Var. IPCA p.p.	0,37	5,19	1,19	2,49	5,43	12,16	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,61	12,78	0,95	3,77	12,52	20,02	23,64
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,17	-0,04	-0,08	-0,21	-0,39	-0,73
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,38	14,37	0,35	3,04	13,01	17,36	17,96
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,38	-0,06	-0,19	-0,37	-0,78	-1,12
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	-7,84	832,98	468,21	2.693,28	882,49	109,30	12.918,93
% do CDI	-854,35	6.916,61	16.045,94	42.520,35	6.634,40	406,82	40.810,11
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,91	11,97	2,90	6,35	13,22	27,07	32,22
% do CDI	99,64	99,37	99,39	100,19	99,42	100,75	101,79
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,99	12,34	3,03	6,70	13,60	27,62	32,92
% do CDI	107,42	102,42	103,69	105,72	102,27	102,80	103,99
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	-1,14	1,50	-0,68	1,05			
Var. IPCA p.p.	-1,42	0,35	-1,47	-0,00			
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,94	12,28	3,00	6,77	13,56	27,76	33,44
% do CDI	102,73	101,98	102,96	106,85	101,94	103,33	105,64
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	11,94	10,48	8,29	13,31	7,10	4,60	-24,40
Var. IBOVESPA p.p.	-0,60	-5,55	-1,73	-4,23	-6,10	-20,34	-41,33
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	0,40	6,10	-4,43	4,18	4,70	22,55	77,11
Var. IBOVESPA p.p.	-12,14	-9,93	-14,44	-13,35	-8,50	-2,39	60,18
TARPON GT 30 FIC FIA	8,07	41,43	9,31	24,77	34,69	77,11	102,33



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.	-4,47	25,40	-0,70	7,23	21,49	52,17	85,39
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	11,30	13,63	9,58	19,60	8,09	24,84	28,35
Var. IBOVESPA p.p.	-1,24	-2,41	-0,43	2,07	-5,10	-0,10	11,42
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	13,02	37,76	11,24	24,03	33,24	44,16	71,36
Var. IBOVESPA p.p.	0,49	21,73	1,23	6,50	20,04	19,23	54,43
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	10,48	3,74	-2,18	5,55	1,19	-6,20	-3,77
Var. IBOVESPA p.p.	-2,06	-12,30	-12,19	-11,99	-12,00	-31,13	-20,70
INDIE FIC FIA	13,89	19,84	5,15	13,50	14,63	2,65	-19,05
Var. IBOVESPA p.p.	1,35	3,80	-4,87	-4,03	1,43	-22,29	-35,98
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	11,05	7,43	-0,28	3,23	4,16	-0,63	-12,91
Var. IBOVESPA p.p.	-1,49	-8,60	-10,30	-14,31	-9,04	-25,56	-29,84
META VALOR FI DE AÇÕES	12,74	-5,83	1,49	1,80	-9,56	-4,27	-24,35
Var. IBRX 100 p.p.	0,36	-20,80	-8,40	-15,62	-21,52	-27,61	-40,30
OCCAM FIC FIA	10,65	10,35	8,89	16,25	7,41	19,36	10,81
Var. IBOVESPA p.p.	-1,88	-5,69	-1,13	-1,29	-5,79	-5,57	-6,12
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	6,24	14,53	1,15	6,52	9,18	-17,53	7,13
Var. IBOVESPA p.p.	-6,30	-1,51	-8,87	-11,02	-4,02	-42,47	-9,80
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-4,03	-24,04	-11,63	-13,73	-21,83	-44,83	-41,52
Var. MSCI ACWI p.p.	-10,47	-32,54	-13,11	-17,78	-24,44	-28,77	-45,48
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	8,80	7,58	1,40	1,90	7,79	-14,99	7,70
Var. MSCI ACWI p.p.	2,36	-0,92	-0,08	-2,15	5,19	1,07	3,73
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	12,47	35,25	3,20	16,13	27,89	-11,79	4,85
Var. MSCI ACWI p.p.	6,03	26,76	1,72	12,09	25,28	4,28	0,89
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	14,65	21,49	0,29	4,55	13,06	-60,55	-52,26
Var. MSCI ACWI p.p.	8,21	12,99	-1,19	0,51	10,46	-44,49	-56,23
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,34	-3,44	-3,87	-6,36	-4,58	-45,05	-34,99
Var. MSCI ACWI p.p.	4,90	-11,94	-5,35	-10,41	-7,18	-28,99	-38,95
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,46	32,68	3,85	9,62	28,43	-29,26	-21,97
Var. IPCA + 6,00% p.p.	11,72	22,99	1,64	5,58	17,49	-53,79	-68,08
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	2,77	15,23	2,57	5,58	17,12		
Var. S&P 500 p.p.	-3,53	2,70	0,96	-0,26	12,75		
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	9,32	26,49	2,66	12,71	20,37	17,43	52,14
% do CDI	1.015,01	219,94	91,17	200,63	153,13	64,87	164,70
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9,34	27,12	2,78	13,07	20,94	23,37	61,39
Var. S&P 500 p.p.	3,05	14,59	1,17	7,23	16,57	35,54	44,64
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	1,00	-4,58	0,52	1,90	-5,80	18,15	47,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,25	-14,28	-1,70	-2,14	-16,74	-6,39	0,95
JACAREÍ	3,32	11,81	2,68	6,42	11,17		
Var. IPCA + 4,83% p.p.	2,64	2,95	0,68	2,81	1,16		
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

12. Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+1 du	D+0	D+5 du	D+7 du	Cobrança semestral, no último dia útil de dezembro e junho ou no resgate total ou parcial das cotas, o que ocorrer primeiro	2,00
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	D+0	D+0	D+0	D+0		0,35
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2 du		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	Não se aplica	Não se aplica				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+2		
INDIE FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBX_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro e Julho	1,34
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+1 du	D+1 du	D+6 du		
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Não se aplica	Não se aplica				

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		
META VALOR FI DE AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,50
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	-	1,50
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	-	3,00
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO			D+0	D+0		0,40
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3		
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA			D+30	D+32	-	2,00
TARPON GT 30 FIC FIA	D+1 du	D+1 du	D+30	D+32	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro	
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1	D+1	D+30	D+32	-	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**13. Indexadores**

**Renda Fixa**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,00	12,22	2,91	6,45	13,55	26,81	29,79	34,92	44,24
IRF-M 1+	3,14	16,50	3,11	7,34	18,39	28,00	22,52	29,87	50,14
IRF-M TOTAL	2,47	14,81	3,03	6,96	16,50	27,30	24,84	31,46	48,61
IMA-B 5	1,80	10,51	1,62	4,32	11,55	22,27	29,18	38,75	57,20
IMA-B 5+	3,39	14,75	0,42	3,23	13,39	18,13	19,09	19,90	55,21
IMA-B TOTAL	2,62	12,95	0,99	3,85	12,73	20,41	24,38	28,75	57,75
IMA-GERAL TOTAL	1,84	12,96	2,33	5,79	13,83	24,95	27,59	32,92	50,36
IDKA 2	1,83	10,52	1,71	4,50	11,89	21,85	29,05	39,45	56,01
IDKA 20	4,68	19,28	-0,18	3,26	15,32	14,32	11,40	6,27	50,57
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66	35,59	43,85

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93	17,65	42,26
IBRX 100	12,38	14,97	9,89	17,42	11,95	23,34	15,95	17,94	44,76
IBRX 50	12,01	14,01	9,98	18,15	11,10	25,06	17,97	19,06	41,25
SMALL CAP	12,46	9,41	1,19	4,49	6,11	-3,54	-16,27	-12,84	24,96
Índice Consumo - ICON	16,33	0,95	1,71	2,02	-4,39	-24,66	-41,54	-39,36	-12,99
Índice Dividendos - IDIV	10,70	18,65	8,63	18,08	16,73	35,80	36,27	36,20	80,93

**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	6,29	12,53	1,61	5,84	4,37	-12,16	16,75	69,92	111,42

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,66	10,79	-1,13	5,41	10,79	23,20	13,10	9,91	38,08

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	6,44	8,50	1,48	4,05	2,60	-16,06	3,97	48,41	80,72

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,28	4,04	0,78	1,05	4,68	10,86	22,77	28,06	32,25
INPC	0,10	3,14	0,33	0,34	3,85	10,06	22,12	28,46	32,79
IGPM	0,59	-3,89	1,46	-1,35	-3,46	2,23	20,51	50,06	56,02
SELIC	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,65	35,58	43,84

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	7,81	1,74	3,06	8,85	19,89	38,03	49,69	60,78
IPCA + 5,00%	0,67	8,75	1,98	3,55	9,90	22,20	42,03	55,50	68,63
IPCA + 5,50%	0,71	9,23	2,10	3,80	10,42	23,36	44,06	58,47	72,66
IPCA + 5,89%	0,74	9,59	2,19	3,99	10,82	24,28	45,66	60,82	75,87
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11	61,48	76,78
INPC + 4,00%	0,41	6,88	1,29	2,33	7,99	19,02	37,30	50,17	61,43
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34	62,00	77,50

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%)	2.175.170,92	5,480000	2.164.490,40	5,849800	-10.680,52
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.063.967,21	5,810000	1.063.405,34	5,849800	-561,87
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.244.659,51	5,680000	20.316.539,18	5,627200	71.879,67
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.206.037,44	4,860000	2.073.763,08	5,622000	-132.274,36
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.202.426,60	4,880000	2.073.763,08	5,622000	-128.663,52
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.201.592,00	4,910000	2.078.074,44	5,622000	-123.517,56
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.190.993,59	5,196100	2.116.876,66	5,622000	-74.116,93
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.192.077,83	5,290000	2.134.122,09	5,622000	-57.955,74
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.191.173,20	5,320000	2.138.433,44	5,622000	-52.739,76
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.516.175,58	5,670000	1.521.909,29	5,622000	5.733,71
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.046.811,43	5,837000	2.082.385,79	5,622000	35.574,36
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.203.332,03	5,855000	3.263.697,82	5,622000	60.365,79
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.221.019,56	4,970000	2.029.644,66	5,715700	-191.374,90
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.218.286,19	4,980000	2.029.644,66	5,715700	-188.641,53
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.214.089,39	5,030000	2.038.299,86	5,715700	-175.789,53
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.200.946,20	5,285000	2.090.231,07	5,715700	-110.715,13
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.199.926,02	5,340000	2.103.213,87	5,715700	-96.712,15
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.198.336,70	5,380000	2.111.869,07	5,715700	-86.467,63
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.169.838,50	5,831000	5.240.724,27	5,715700	70.885,77
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.135.772,40	5,860000	2.172.455,48	5,715700	36.683,08
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.054.496,85	5,897000	2.098.886,27	5,715700	44.389,42
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.277.309,29	5,915000	6.426.486,82	5,715700	149.177,53
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.048.483,97	5,922000	2.098.886,27	5,715700	50.402,30
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.603.656,30	6,140000	4.838.257,42	5,715700	234.601,12
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.628.240,35	6,256000	3.864.547,29	5,715700	236.306,94
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.055.043,03	6,280000	3.263.010,82	5,715700	207.967,79
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.082.152,55	6,400000	2.254.679,89	5,715700	172.527,34
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.227.430,12	5,000000	1.998.121,58	5,751000	-229.308,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.222.311,48	5,030000	2.002.455,90	5,751000	-219.855,58
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.217.219,17	5,060000	2.006.790,22	5,751000	-210.428,95
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.204.909,15	5,315000	2.071.805,02	5,751000	-133.104,13
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.205.696,27	5,370000	2.089.142,30	5,751000	-116.553,97
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.203.454,98	5,420000	2.102.145,26	5,751000	-101.309,72
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.194.445,35	5,520000	2.123.816,87	5,751000	-70.628,48
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.383.571,70	5,831200	11.511.954,27	5,751000	128.382,57
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.134.418,26	5,860000	2.167.160,07	5,751000	32.741,81
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.126.087,49	5,897000	5.231.524,40	5,751000	105.436,91
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.051.239,87	5,927000	2.102.145,26	5,751000	50.905,39
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.737.307,19	5,950000	17.207.250,93	5,751000	469.943,74
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.201.163,87	6,140000	9.708.877,10	5,751000	507.713,23
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.284.075,38	6,261000	8.885.356,27	5,751000	601.280,89
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.125.681,10	6,268000	7.650.075,03	5,751000	524.393,93
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.208.120,12	6,400000	5.690.962,33	5,751000	482.842,21
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.204.619,52	5,345000	2.185.189,52	6,701600	-19.430,00
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.237.125,06	5,450000	2.218.937,62	6,701600	-18.187,44
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.196.447,44	5,912000	2.185.189,52	6,701600	-11.257,92
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.233.895,51	5,009000	2.207.746,97	5,503700	-26.148,54
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.236.109,53	5,130000	2.216.320,74	5,503700	-19.788,79
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.237.234,49	5,190000	2.220.607,63	5,503700	-16.626,86
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.242.769,77	5,490000	2.242.042,07	5,503700	-727,70
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.284.793,99	5,710000	3.300.903,24	5,503700	16.109,25
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.247.838,12	4,850000	2.190.093,15	5,515400	-57.744,97
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.241.221,55	5,125600	2.207.371,99	5,515400	-33.849,56
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.244.315,46	5,240000	2.220.331,13	5,515400	-23.984,33
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.241.685,98	5,270000	2.220.331,13	5,515400	-21.354,85
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.292.580,20	5,810000	3.330.496,69	5,515400	37.916,49
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.256.554,57	4,860000	2.182.182,48	5,494700	-74.372,09
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.251.770,91	4,900000	2.182.182,48	5,494700	-69.588,43



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.245.423,99	5,178300	2.208.316,40	5,494700	-37.107,59
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.247.807,05	5,270000	2.221.383,36	5,494700	-26.423,69
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.248.657,35	5,300000	2.225.739,02	5,494700	-22.918,33
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.538.881,36	5,460000	3.532.435,11	5,494700	-6.446,25
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.246.891,75	5,500000	2.247.517,28	5,494700	625,53
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.294.593,62	5,835000	3.353.853,31	5,494700	59.259,69
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.273.390,92	4,950000	2.103.838,00	5,701700	-169.552,92
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.263.923,42	4,970000	2.099.464,12	5,701700	-164.459,30
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.266.201,41	5,020000	2.112.585,77	5,701700	-153.615,64
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.257.469,43	5,274000	2.160.698,49	5,701700	-96.770,94
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.258.199,22	5,310000	2.169.446,26	5,701700	-88.752,96
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.255.649,69	5,360000	2.178.194,02	5,701700	-77.455,67
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.109.722,70	5,837000	2.138.829,07	5,701700	29.106,37
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.294.495,06	5,855000	3.346.020,94	5,701700	51.525,88
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.109.798,07	6,220000	3.276.038,80	5,701700	166.240,73
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.286.240,76	4,940000	2.050.535,60	5,756800	-235.705,16
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.283.480,02	4,980000	2.059.298,57	5,756800	-224.181,45
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.278.986,96	5,010000	2.063.680,06	5,756800	-215.306,90
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.272.965,70	5,045000	2.068.061,55	5,756800	-204.904,15
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.262.642,74	5,295500	2.129.402,36	5,756800	-133.240,38
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.261.722,04	5,360000	2.146.928,30	5,756800	-114.793,74
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.260.502,76	5,410000	2.160.072,76	5,756800	-100.430,00
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.253.446,45	5,510000	2.181.980,19	5,756800	-71.466,26
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.514.283,72	5,831200	8.596.476,18	5,756800	82.192,46
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.162.751,65	5,897000	3.220.392,45	5,756800	57.640,80
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.110.609,94	5,921000	2.155.691,27	5,756800	45.081,33
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.505.557,92	5,950000	11.794.961,20	5,756800	289.403,28
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.842.415,48	6,140000	7.185.637,58	5,756800	343.222,10
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.699.662,15	6,261000	6.077.121,54	5,756800	377.459,39
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.240.611,00	6,278000	5.599.539,53	5,756800	358.928,53

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.126.153,95	6,400000	3.391.270,42	5,756800	265.116,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

14. Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
344	01/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.022.000,00	4.145,97477390	246,5041530000
357	01/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	23.000,00	93,30471605	246,5041530000
343	07/11/2023	OCCAM FIC FIA	0,00	5.315.599,99	1.600.523,47620114	3,3211634000
345	08/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	485.000,00	0,00	1.963,76656020	246,9743654000
346	09/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	5.315.600,00	0,00	21.512,42101414	247,0944575000
347	10/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.049.000,00	4.243,29408744	247,2135983000
358	10/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	34.000,00	137,53288749	247,2135983000
348	13/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.310.000,00	13.383,09923287	247,3268667000
359	13/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	66.000,00	266,85333818	247,3268667000
349	16/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	4.900.000,00	0,00	19.793,74381684	247,5529665000
360	17/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	17.000,00	68,64194161	247,6619921000
350	22/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	10.000,00	40,32415143	247,9903394000
351	24/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	10.000,00	40,28687992	248,2197683000
361	24/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	98.000,00	394,81142324	248,2197683000
352	28/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000,00	4,02481206	248,4588065000
353	28/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	300.000,00	0,00	1.207,44361702	248,4588065000
354	29/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	10.000,00	40,22738924	248,5868506000
362	29/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	81.000,00	325,84185288	248,5868506000
355	30/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.334.702,82	9.387,28710671	248,7090033000
356	30/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	290.297,18	1.167,21620910	248,7090033000
363	30/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	316.500,00	0,00	1.272,57154265	248,7090033000
<b>Total</b>			<b>11.317.100,00</b>	<b>13.671.599,99</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**15. Análise de Risco**

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

Value-At-Risk (R\$): 11.252.178,46

Value-At-Risk: 1,64%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
JACAREÍ		1,64		1,64			684.927.776,96	100,00

**Renda Fixa**

Value-At-Risk: 0,24%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,480000%)		0,06	-0,00	0,06			2.175.170,92	0,32
NTN-B 150525 (5,810000%)		0,06	-0,00	0,06			1.063.967,21	0,16
NTN-B 150533 (5,680000%)		0,07	-0,00	0,07			20.244.659,51	2,96
NTN-B 150535 (4,860000%)		0,06	-0,00	0,06			2.206.037,44	0,32
NTN-B 150535 (4,880000%)		0,06	-0,00	0,06			2.202.426,60	0,32
NTN-B 150535 (4,910000%)		0,06	-0,00	0,06			2.201.592,00	0,32
NTN-B 150535 (5,196100%)		0,06	-0,00	0,06			2.190.993,59	0,32
NTN-B 150535 (5,290000%)		0,06	-0,00	0,06			2.192.077,83	0,32
NTN-B 150535 (5,320000%)		0,06	-0,00	0,06			2.191.173,20	0,32
NTN-B 150535 (5,670000%)		0,06	-0,00	0,06			1.516.175,58	0,22
NTN-B 150535 (5,837000%)		0,06	-0,00	0,06			2.046.811,43	0,30
NTN-B 150535 (5,855000%)		0,06	-0,00	0,06			3.203.332,03	0,47
NTN-B 150545 (4,970000%)		0,06	-0,00	0,06			2.221.019,56	0,32
NTN-B 150545 (4,980000%)		0,06	-0,00	0,06			2.218.286,19	0,32
NTN-B 150545 (5,030000%)		0,06	-0,00	0,06			2.214.089,39	0,32
NTN-B 150545 (5,285000%)		0,06	-0,00	0,06			2.200.946,20	0,32
NTN-B 150545 (5,340000%)		0,06	-0,00	0,06			2.199.926,02	0,32
NTN-B 150545 (5,380000%)		0,06	-0,00	0,06			2.198.336,70	0,32
NTN-B 150545 (5,831000%)		0,06	-0,00	0,06			5.169.838,50	0,75
NTN-B 150545 (5,860000%)		0,06	-0,00	0,06			2.135.772,40	0,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (5,897000%)		0,06	-0,00	0,06			2.054.496,85	0,30
NTN-B 150545 (5,915000%)		0,06	-0,00	0,06			6.277.309,29	0,92
NTN-B 150545 (5,922000%)		0,06	-0,00	0,06			2.048.483,97	0,30
NTN-B 150545 (6,140000%)		0,06	-0,00	0,06			4.603.656,30	0,67
NTN-B 150545 (6,256000%)		0,06	-0,00	0,06			3.628.240,35	0,53
NTN-B 150545 (6,280000%)		0,06	-0,00	0,06			3.055.043,03	0,45
NTN-B 150545 (6,400000%)		0,06	-0,00	0,06			2.082.152,55	0,30
NTN-B 150555 (5,000000%)		0,06	-0,00	0,06			2.227.430,12	0,33
NTN-B 150555 (5,030000%)		0,06	-0,00	0,06			2.222.311,48	0,32
NTN-B 150555 (5,060000%)		0,06	-0,00	0,06			2.217.219,17	0,32
NTN-B 150555 (5,315000%)		0,06	-0,00	0,06			2.204.909,15	0,32
NTN-B 150555 (5,370000%)		0,06	-0,00	0,06			2.205.696,27	0,32
NTN-B 150555 (5,420000%)		0,06	-0,00	0,06			2.203.454,98	0,32
NTN-B 150555 (5,520000%)		0,06	-0,00	0,06			2.194.445,35	0,32
NTN-B 150555 (5,831200%)		0,06	-0,00	0,06			11.383.571,70	1,66
NTN-B 150555 (5,860000%)		0,06	-0,00	0,06			2.134.418,26	0,31
NTN-B 150555 (5,897000%)		0,06	-0,00	0,06			5.126.087,49	0,75
NTN-B 150555 (5,927000%)		0,06	-0,00	0,06			2.051.239,87	0,30
NTN-B 150555 (5,950000%)		0,06	-0,00	0,06			16.737.307,19	2,44
NTN-B 150555 (6,140000%)		0,06	-0,00	0,06			9.201.163,87	1,34
NTN-B 150555 (6,261000%)		0,06	-0,00	0,06			8.284.075,38	1,21
NTN-B 150555 (6,268000%)		0,06	-0,00	0,06			7.125.681,10	1,04
NTN-B 150555 (6,400000%)		0,06	-0,00	0,06			5.208.120,12	0,76
NTN-B 150824 (5,345000%)		0,06	-0,00	0,06			2.204.619,52	0,32
NTN-B 150824 (5,450000%)		0,06	-0,00	0,06			2.237.125,06	0,33
NTN-B 150824 (5,912000%)		0,06	-0,00	0,06			2.196.447,44	0,32
NTN-B 150826 (5,009000%)		0,06	-0,00	0,06			2.233.895,51	0,33
NTN-B 150826 (5,130000%)		0,06	-0,00	0,06			2.236.109,53	0,33
NTN-B 150826 (5,190000%)		0,06	-0,00	0,06			2.237.234,49	0,33
NTN-B 150826 (5,490000%)		0,06	-0,00	0,06			2.242.769,77	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,710000%)		0,06	-0,00	0,06			3.284.793,99	0,48
NTN-B 150828 (4,850000%)		0,06	-0,00	0,06			2.247.838,12	0,33
NTN-B 150828 (5,125600%)		0,06	-0,00	0,06			2.241.221,55	0,33
NTN-B 150828 (5,240000%)		0,06	-0,00	0,06			2.244.315,46	0,33
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,06	-0,00	0,06			2.241.685,98	0,33
NTN-B 150828 (5,810000%)		0,06	-0,00	0,06			3.292.580,20	0,48
NTN-B 150830 (4,860000%)		0,06	-0,00	0,06			2.256.554,57	0,33
NTN-B 150830 (4,900000%)		0,06	-0,00	0,06			2.251.770,91	0,33
NTN-B 150830 (5,178300%)		0,06	-0,00	0,06			2.245.423,99	0,33
NTN-B 150830 (5,270000%)		0,06	-0,00	0,06			2.247.807,05	0,33
NTN-B 150830 (5,300000%)		0,06	-0,00	0,06			2.248.657,35	0,33
NTN-B 150830 (5,460000%)		0,06	-0,00	0,06			3.538.881,36	0,52
NTN-B 150830 (5,500000%)		0,06	-0,00	0,06			2.246.891,75	0,33
NTN-B 150830 (5,835000%)		0,06	-0,00	0,06			3.294.593,62	0,48
NTN-B 150840 (4,950000%)		0,06	-0,00	0,06			2.273.390,92	0,33
NTN-B 150840 (4,970000%)		0,06	-0,00	0,06			2.263.923,42	0,33
NTN-B 150840 (5,020000%)		0,06	-0,00	0,06			2.266.201,41	0,33
NTN-B 150840 (5,274000%)		0,06	-0,00	0,06			2.257.469,43	0,33
NTN-B 150840 (5,310000%)		0,06	-0,00	0,06			2.258.199,22	0,33
NTN-B 150840 (5,360000%)		0,06	-0,00	0,06			2.255.649,69	0,33
NTN-B 150840 (5,837000%)		0,06	-0,00	0,06			2.109.722,70	0,31
NTN-B 150840 (5,855000%)		0,06	-0,00	0,06			3.294.495,06	0,48
NTN-B 150840 (6,220000%)		0,06	-0,00	0,06			3.109.798,07	0,45
NTN-B 150850 (4,940000%)		0,06	-0,00	0,06			2.286.240,76	0,33
NTN-B 150850 (4,980000%)		0,06	-0,00	0,06			2.283.480,02	0,33
NTN-B 150850 (5,010000%)		0,06	-0,00	0,06			2.278.986,96	0,33
NTN-B 150850 (5,045000%)		0,06	-0,00	0,06			2.272.965,70	0,33
NTN-B 150850 (5,295500%)		0,06	-0,00	0,06			2.262.642,74	0,33
NTN-B 150850 (5,360000%)		0,06	-0,00	0,06			2.261.722,04	0,33
NTN-B 150850 (5,410000%)		0,06	-0,00	0,06			2.260.502,76	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,510000%)		0,06	-0,00	0,06			2.253.446,45	0,33
NTN-B 150850 (5,831200%)		0,06	-0,00	0,06			8.514.283,72	1,24
NTN-B 150850 (5,897000%)		0,06	-0,00	0,06			3.162.751,65	0,46
NTN-B 150850 (5,921000%)		0,06	-0,00	0,06			2.110.609,94	0,31
NTN-B 150850 (5,950000%)		0,06	-0,00	0,06			11.505.557,92	1,68
NTN-B 150850 (6,140000%)		0,06	-0,00	0,06			6.842.415,48	1,00
NTN-B 150850 (6,261000%)		0,06	-0,00	0,06			5.699.662,15	0,83
NTN-B 150850 (6,278000%)		0,06	-0,00	0,06			5.240.611,00	0,77
NTN-B 150850 (6,400000%)		0,06	-0,00	0,06			3.126.153,95	0,46
<b>Sub-total</b>	0,10	0,06	-0,00		-2,45	0,68	308.391.246,52	45,03

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,01	0,04	0,03			21.290.380,19	3,11
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,23	0,06	0,04			21.066.238,17	3,08
<b>Sub-total</b>	5,20	2,61	0,09		0,40	2,99	42.356.618,36	6,18

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF		2,40	0,00	2,40			5.075.060,50	0,74
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			21.039.375,57	3,07
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			21.489.405,49	3,14
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,03	-0,00	0,03			27.981.927,79	4,09
<b>Sub-total</b>	1,59	0,16	0,00		-0,07	0,81	75.585.769,35	11,04

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a		0,16	0,00	0,16			5.240.815,33	0,77
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a		0,16	0,00	0,16			5.235.443,99	0,76
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a		0,16	0,00	0,16			5.234.263,74	0,76

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a		0,15	-0,00	0,15			5.594.265,14	0,82
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a		0,16	0,00	0,16			5.229.880,54	0,76
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a		0,17	-0,00	0,17			6.109.212,75	0,89
<b>Sub-total</b>	0,10	0,12	0,00		-1,62	0,76	32.643.881,49	4,77

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III		11,53	0,00	11,53			33.504,03	0,00
<b>Sub-total</b>	90,98	11,53	0,00		-0,10	-7,84	33.504,03	0,00

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV		0,03	-0,00	0,03			3.487.572,98	0,51
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,11	0,00	0,11			6.040.238,62	0,88
<b>Sub-total</b>	0,14	0,07	0,00		1,20	1,08	9.527.811,60	1,39

**Renda Variável**

Value-At-Risk: 7,14%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA		8,16	0,04	4,87			4.248.238,34	0,62
META VALOR FI DE AÇÕES		10,55	0,03	5,22			2.139.579,83	0,31
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		9,48	0,08	5,20			7.358.650,29	1,07
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,25	0,05	3,88			5.407.449,71	0,79
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		7,04	0,19	3,13			23.476.331,19	3,43
OCCAM FIC FIA		7,00	0,23	1,45			26.578.825,96	3,88
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		7,96	0,06	4,12			6.558.688,18	0,96
INDIE FIC FIA		10,22	0,05	5,49			3.842.620,96	0,56



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TARPON GT 30 FIC FIA		8,46	0,09	5,46			9.542.367,11	1,39
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA		8,92	0,06	7,41			6.836.587,26	1,00
<b>Sub-total</b>	14,52	7,14	0,87		0,63	10,13	95.989.338,83	14,01

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 4,66%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO		3,77	0,01	8,27			7.774.991,92	1,14
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		6,29	0,15	6,29			19.160.534,37	2,80
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		6,33	0,25	5,57			31.912.199,31	4,66
<b>Sub-total</b>	12,03	5,55	0,40		0,62	8,42	58.847.725,60	8,59

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME		0,06	-0,00	0,07			11.199.437,72	1,64
<b>Sub-total</b>	3,52	0,06	-0,00		0,02	1,00	11.199.437,72	1,64

**Investimentos no Exterior**

Value-At-Risk: 6,02%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		10,26	0,19	8,39			16.276.006,20	2,38
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		13,82	0,02	12,28			1.882.679,74	0,27
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,21	-0,01	9,40			2.142.591,57	0,31
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,03	-0,00	8,24			2.359.561,40	0,34
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,97	0,01	8,97			2.846.840,95	0,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		6,75	0,00	7,24			5.332.563,50	0,78
<b>Sub-total</b>	11,43	7,06	0,21		0,84	10,54	30.840.243,36	4,50
Artigo 9º III								
Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		6,02	0,06	9,47			19.512.200,10	2,85
<b>Sub-total</b>	9,03	6,02	0,06		0,59	6,24	19.512.200,10	2,85

(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 novembro, no cenário internacional, caminhou para uma direção mais construtiva com os juros globais de longo prazo apresentando uma queda substancial, refletindo a evolução positiva do cenário nos EUA e o aumento da expectativa de que FED tenha encerrado o ciclo de alta de juros. Com isso, os índices de ações globais apresentaram valorização, enquanto o dólar perdeu força em comparação às demais moedas. Nos EUA, a inflação teve um resultado favorável, inclusive com seu núcleo surpreendendo para baixo, mantendo a tendência de desinflação. Além disso, embora a resiliência e o crescimento do PIB tenha sido um fator surpresa ao longo do ano, os sinais mais recentes mostram moderação, inclusive no mercado de trabalho. Assim, a expectativa é de que os dados se mantenham nessa tendência e o enfraquecimento da atividade se torne mais claro nos próximos trimestres. Adicionalmente, nesse contexto, ficou reforçada a expectativa de que o FED tenha de fato encerrado o ciclo de alta dos juros, com a taxa básica devendo permanecer nos atuais patamares por algum tempo. Contudo, a trajetória da inflação ainda demanda uma postura cautelosa. Na economia chinesa, o governo segue introduzindo estímulo através de uma política monetária, creditícia e fiscal cada vez mais agressiva. No entanto, os dados de atividade seguem sem mostrar reação. Destacando assim, um cenário ainda de cautela com a trajetória econômica. Assim, no mês de novembro de 2023, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +9,07% e +8,92%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos de +10,06% e +11,95%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +6,44% e +6,29%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +2,60% e +4,37% nos últimos 12 meses.

Localmente, as curvas de juros acompanharam o movimento global, sustentadas também pelos dados de inflação e atividade e pela redução dos ruídos na condução da política fiscal. Na parte fiscal, a manutenção da meta de superávit primário, após os ruídos observados até meados de novembro, mostrou a força do Ministro da Fazenda junto ao presidente. Ainda assim, os desafios para se atingir a meta continuam elevados, com o avanço lento da pauta de aumento de receitas e resistência em relação a um contingenciamento elevado, sugerindo que essa discussão poderá ser retomada em 2024. A atividade econômica continuou a dar sinais de moderação, o que deverá ser ratificado por uma contração do PIB do terceiro trimestre em relação ao trimestre anterior. Ao mesmo tempo, a inflação continua a mostrar uma composição benigna, mas com impacto modesto sobre as expectativas. O Banco Central continua a dar sinais de continuidade do processo de flexibilização monetária, mas mantendo o atual ritmo de corte de 0,50% da taxa de juros básica. Assim, é esperado que na próxima reunião a ser realizada pelo Copom em dezembro a taxa Selic seja reduzida. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo o movimento dos índices globais. Apresentando um retorno positivo de +12,54% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +16,04% e de +13,20% nos últimos 12 meses.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**17. Agenda realizada**

14 de novembro:

10h00: Reunião com os representantes da SICREDI VANGUARDA. O objetivo da reunião foi a apresentação de fundos elegíveis em renda fixa da instituição e uma visão geral do mercado para o ano de 2024. Participaram da reunião 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.

16 de novembro:

9h00: Tricentésima nonagésima sexta (396ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros (CAIF) do Instituto de Previdência do Município de Jacareí (IPMJ), ocorrida em 16 de novembro de 2023, tendo início às 14h11 na sala de reuniões do IPMJ, com as seguintes presenças: Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos e Clévio Vitor de Almeida. Ausências justificadas de José Ricardo Vinhas e Rafaela Carvalho dos Santos. Pautas da reunião: 1) Análise do relatório de investimentos de outubro de 2023; 2) Análise da carteira fechada de outubro de 2023; 3) Credenciamentos; 4) Reunião com a Mongeral Aegon; 5) Assuntos diversos.

29 de novembro:

9h00: Tricentésima nonagésima sétima (397ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, ocorrida em 29 de novembro de 2023, tendo início às 9h20, com as seguintes presenças dos membros do CAIF na sala de reuniões do IPMJ: Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Clévio Vitor de Almeida e Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos. Participaram de forma on-line José Ricardo Vinhas e Rafaela Carvalho dos Santos. Ausência justificadas de Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos. Pautas da reunião: 1) Análise parcial da carteira até 24/11/2023; 2) Apresentação do Relatório Semestral de Diligência de Verificação de Lastros; 3) Assuntos Diversos.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Em novembro 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 06/11/2023 foi realizado amortizações no montante de R\$ 4.552,34 (quatro mil e quinhentos e cinquenta e dois reais e trinta e quatro centavos), R\$ 919,62 (novecentos e dezenove reais e sessenta e dois centavos) e R\$ 356,71 (trezentos e cinquenta e seis reais e setenta e um centavos), totalizando R\$ 5.828,67 (cinco mil e oitocentos e vinte e oito reais e sessenta e sete centavos) que foram aplicados no fundo SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI.

O total de amortizações já entregue é de R\$ 7.077.662,13 (sete milhões e setenta e sete mil e seiscentos e sessenta e dois reais e treze centavos). O saldo em 30 de novembro de 2023 é de R\$ 33.504,03 (trinta e três mil e quinhentos e quatro reais e três centavos).

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

O Fundo KINEA PRIVATE EQUITY apresenta um valor total aplicado de R\$ 9.095.886,00 (nove milhões e noventa e cinco mil e oitocentos e oitenta e seis reais), e um rendimento acumulado de R\$ 2.103.551,72 (dois milhões e cento e três mil e quinhentos e cinquenta e um reais e setenta e dois centavos).

O saldo acumulado em 30 de novembro de 2023 é de R\$ 11.199.437,72 (onze milhões e cento e noventa e nove mil e quatrocentos e trinta e sete reais e setenta e dois centavos) com um rendimento no mês de novembro de R\$ 110.466,92 (cento e dez mil e quatrocentos e sessenta e seis reais e noventa e dois centavos).