



LDB
EMPRESAS

JACAREÍ
DEZEMBRO 2023



1. PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS	3
2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS.....	4
3. Posição de Ativos e Enquadramento.....	5
4. Enquadramento da Carteira	11
5. Rentabilidades por Artigo	12
6. Análise de Liquidez	19
7. Alocação por Artigo	20
8. Alocação Por Estratégia	20
9. Alocação por Gestor.....	21
10. Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial	22
11. Performance dos Fundos.....	25
12. Cotização e Taxas	33
13. Indexadores	35
14. Curva x Mercado	37
15. Movimentações.....	41
16. Análise de Risco	43
17. RELATÓRIO CENÁRIO MACROECONÔMICO.....	49
18. AGENDA REALIZADA.....	50
19. Acompanhamento fundos estressados	51
FIDC MULSTISETORIAL MASTER III.....	51
20. Acompanhamento 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 dezembro 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 Unidade de Gestão de Investimentos – CP RPPS CGINV I / CPA 10




Luis Gustavo Ferreira Bonacina

Assessor da Presidência – CPA 20



Clévio Vitor de Almeida

Membro do CAIF – CGRPPS



Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do CAIF



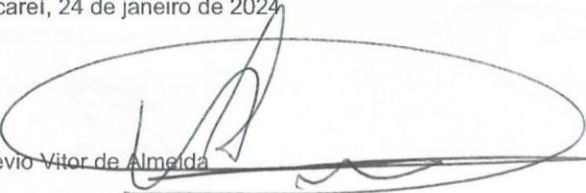
José Ricardo Vinhas

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 dezembro 2023, considerando as explicações dos investimentos, rentabilidade e pormenores constantes no presente documento, pela Diretoria Administrativo – Financeira deste Instituto, APROVAMOS o Relatório de Investimentos referente ao mês de dezembro de 2023.

Jacareí, 24 de janeiro de 2024



Clévio Vitor de Almeida

Representante do Conselho Fiscal – CGRPPS



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

67,27%

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%)	0,32	0,12	0,82	10,40	2.193.007,46	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,32	0,12	0,85	10,74	1.072.970,80	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,680000%)	2,87	0,23	0,94	5,14	20.433.974,81	2,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,36	0,21	0,87	9,86	2.225.180,29	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,36	0,21	0,87	9,88	2.221.580,09	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,36	0,21	0,87	9,91	2.220.803,35	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,36	0,22	0,90	10,21	2.210.721,38	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,36	0,22	0,91	10,31	2.212.015,41	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,36	0,22	0,91	10,35	2.211.166,37	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,670000%)	2,86	0,24	0,95	5,14	1.530.521,76	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,37	0,23	0,96	10,89	2.066.508,88	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,37	0,23	0,96	10,91	3.234.214,85	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,39	0,27	0,94	10,04	2.241.856,80	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,39	0,27	0,94	10,05	2.239.121,05	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,39	0,27	0,94	10,10	2.234.999,44	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%)	0,40	0,28	0,97	10,38	2.222.310,67	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,40	0,28	0,98	10,43	2.221.402,79	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,40	0,28	0,98	10,48	2.219.888,58	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,41	0,30	1,03	10,96	5.222.881,13	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,41	0,30	1,03	10,99	2.157.747,75	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	0,41	0,30	1,03	11,03	2.075.712,79	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,41	0,30	1,03	11,05	6.342.244,70	0,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,41	0,30	1,04	11,05	2.069.687,57	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	0,41	0,31	1,06	11,28	4.652.310,77	0,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,41	0,31	1,07	11,41	3.667.002,21	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,280000%)	0,41	0,31	1,07	9,30	3.087.752,44	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	0,42	0,31	1,08	11,56	2.104.692,10	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,000000%)	0,42	0,31	0,98	10,12	2.249.336,33	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,42	0,32	0,99	10,15	2.244.235,71	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,42	0,32	0,99	10,18	2.239.161,59	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,43	0,32	1,02	10,45	2.227.305,75	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,43	0,33	1,02	10,51	2.228.222,29	0,32
TESOURO	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,43	0,33	1,03	10,56	2.226.071,63	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%)	0,43	0,33	1,04	10,67	2.217.188,81	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,43	0,34	1,07	11,00	11.505.072,05	1,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,43	0,34	1,07	11,03	2.157.259,01	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	0,43	0,34	1,07	11,07	5.181.126,33	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,44	0,34	1,08	11,10	2.073.325,82	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,44	0,34	1,08	11,13	16.917.877,49	2,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	0,44	0,35	1,10	11,33	9.302.140,29	1,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,44	0,35	1,11	11,46	8.375.950,17	1,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,268000%)	0,44	0,35	1,11	9,33	7.204.750,60	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	0,44	0,35	1,12	11,60	5.266.566,39	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,33	0,10	0,79	10,23	2.222.028,30	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,450000%)	0,32	0,10	0,80	10,34	2.254.968,48	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,32	0,10	0,83	10,82	2.214.733,21	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,33	0,13	0,80	9,93	2.251.767,69	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,33	0,13	0,81	10,05	2.254.221,52	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,33	0,13	0,81	10,11	2.255.467,01	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,33	0,14	0,84	10,43	2.261.605,91	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	0,14	0,86	10,66	3.312.980,10	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,33	0,15	0,80	9,78	2.265.883,83	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,33	0,15	0,83	10,07	2.259.745,91	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,33	0,15	0,84	10,19	2.263.087,18	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,33	0,15	0,84	10,22	2.260.493,00	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,34	0,16	0,89	10,78	3.321.728,45	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,34	0,17	0,83	9,82	2.275.321,15	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,34	0,17	0,84	9,86	2.270.580,35	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,35	0,18	0,86	10,15	2.264.751,75	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,35	0,18	0,87	10,25	2.267.344,89	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,300000%)	0,35	0,18	0,87	10,28	2.268.262,92	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,460000%)	2,85	0,19	0,89	4,97	3.570.251,39	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,35	0,19	0,89	10,49	2.266.891,56	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,835000%)	0,35	0,19	0,92	10,84	3.324.922,08	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,38	0,24	0,91	9,99	2.293.994,43	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,38	0,24	0,91	10,01	2.284.484,43	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,38	0,24	0,91	10,06	2.286.899,04	0,33
TESOURO	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,38	0,25	0,94	10,33	2.278.664,79	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%)	0,38	0,25	0,94	10,37	2.279.482,13	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,38	0,25	0,95	10,42	2.277.022,72	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,39	0,27	0,99	10,93	2.130.712,89	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,39	0,27	1,00	10,95	3.327.329,25	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,39	0,28	1,03	11,33	3.141.907,14	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,41	0,29	0,96	10,03	2.308.169,92	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,41	0,30	0,96	10,08	2.305.477,66	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,41	0,30	0,97	10,11	2.301.012,19	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,41	0,30	0,97	10,15	2.295.016,81	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,41	0,31	1,00	10,41	2.285.179,12	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,41	0,31	1,00	10,48	2.284.397,46	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,42	0,31	1,01	10,53	2.283.281,28	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,510000%)	0,42	0,31	1,02	10,64	2.276.381,35	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,42	0,32	1,05	10,98	8.603.699,80	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	0,42	0,32	1,06	11,05	3.196.172,68	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,42	0,32	1,06	11,08	2.132.961,38	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,42	0,32	1,06	11,11	11.627.740,05	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%)	0,43	0,33	1,08	11,31	6.916.356,46	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,43	0,33	1,09	11,44	5.761.934,14	0,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,278000%)	3,05	0,33	1,09	9,32	5.297.952,94	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	0,43	0,34	1,11	11,59	3.160.729,54	0,46
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,39	0,28	0,99	10,78	311.451.862,78	45,01

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	4,45	0,10	2,73	4,15	21.870.881,56	3,16	5.157.397.073,53	0,42
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,98	0,09	3,93	3,67	21.894.467,67	3,16	1.649.727.443,32	1,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,05	0,09	3,33	3,91	43.765.349,23	6,32		

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	9,46	-0,01	0,89	2,40	5.120.238,00	0,74	229.025.651,82	2,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	0,90	6,15	21.229.188,47	3,07	16.475.113.370,57	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,04	0,93	13,39	21.690.280,94	3,13	5.463.046.966,63	0,40
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,04	0,94	13,34	19.675.157,99	2,84	2.799.591.858,55	0,70
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,49	0,04	0,93	12,77	67.714.865,40	9,79		

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	0,72	0,06	0,85	5,71	5.285.602,03	0,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	0,71	0,02	0,81	5,55	5.277.679,38	0,76		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	0,68	0,08	0,87	5,59	5.279.551,19	0,76		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	9,26	-0,04	0,77	11,78	5.637.381,25	0,81		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	0,70	0,02	0,79	5,42	5.271.246,80	0,76		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 7,00% a.a	16,21	0,10	0,91	11,96	6.164.720,35	0,89		
Sub-total Artigo 7º IV			4,51	0,04	0,83	11,70	32.916.181,00	4,76		

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	355,52	-1,08	6,84	896,78	33.142,59	0,00	1.146.467,50	2,89
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			355,52	-1,08	6,84	896,78	33.142,59	0,00		

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	0,05	0,05	0,92	13,37	3.519.827,47	0,51	13.909.965.101,92	0,03
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,50	0,05	1,05	13,61	6.103.771,08	0,88	4.181.766.121,63	0,15
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,43	0,05	1,01	13,15	9.623.598,55	1,39		
Renda Fixa			0,58	0,20	1,19	11,19	465.504.999,55	67,27		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

14,65%

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	22,92	-0,01	4,01	7,90	4.418.591,30	0,64	185.980.198,92	2,38
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	22,08	-0,01	7,52	1,25	2.300.555,34	0,33	190.592.652,26	1,21
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	20,30	-0,01	6,52	14,44	7.838.481,54	1,13	235.540.317,99	3,33
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,45	-0,01	4,83	15,82	5.668.689,72	0,82	1.435.426.948,17	0,39
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	16,90	-0,00	5,69	20,10	24.812.428,90	3,59	709.599.426,12	3,50
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	15,73	-0,01	4,89	15,74	27.878.631,31	4,03	808.496.565,25	3,45
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	18,84	-0,00	2,67	41,44	6.733.799,08	0,97	474.190.468,78	1,42
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	21,98	-0,01	5,53	26,46	4.055.018,98	0,59	423.361.344,50	0,96
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	18,67	-0,00	9,85	55,36	10.482.018,28	1,51	934.426.001,03	1,12
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	19,39	-0,01	4,58	10,97	7.149.927,26	1,03	270.640.641,64	2,64
Sub-total Artigo 8º I			16,23	-0,01	5,57	19,83	101.338.141,71	14,65		
Renda Variável			16,23	-0,01	5,57	19,83	101.338.141,71	14,65		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,56%

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	17,58	-0,59	5,22	42,31	17.125.134,43	2,47	243.950.699,07	7,02
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	32,07	0,29	11,65	35,65	2.102.028,57	0,30	123.682.585,44	1,70
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,51	0,62	-3,06	-26,37	2.076.923,59	0,30	39.118.246,56	5,31
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,87	-0,13	5,62	1,99	2.492.125,93	0,36	60.409.928,43	4,13
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,09	0,13	4,02	38,02	2.961.288,73	0,43	687.792.180,37	0,43
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,10	0,06	4,08	11,96	5.550.105,58	0,80	313.084.759,07	1,77
Sub-total Artigo 9º II			13,14	-0,24	4,76	24,50	32.307.606,83	4,67		

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	13,81	0,01	2,51	17,40	20.001.309,86	2,89	658.947.271,35	3,04
Sub-total Artigo 9º III			13,81	0,01	2,51	17,40	20.001.309,86	2,89		

Investimentos no Exterior

12,24 -0,15 3,89 21,68 52.308.916,69 7,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,52%

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	14,20	0,02	0,55	15,86	7.817.479,58	1,13	52.452.003,29	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13,19	0,04	5,17	33,02	20.150.671,96	2,91	811.288.336,53	2,48
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,21	0,04	5,23	33,78	33.582.098,48	4,85	525.320.065,94	6,39
Sub-total Artigo 10º I			11,58	0,04	4,59	30,96	61.550.250,02	8,90		

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	30,16	0,40	0,40	-5,51	11.244.355,36	1,63	358.694.887,42	3,13
Sub-total Artigo 10º II			30,16	0,40	0,40	-5,63	11.244.355,36	1,63		

Investimentos Estruturados			11,45	0,10	3,92	24,00	72.794.605,38	10,52		
Total			3,20	0,13	2,28	14,36	691.946.663,33	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	311.451.862,78	45,01	0,00	43,00	70,00	58,39	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	43.765.349,23	6,32	0,00	5,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	67.714.865,40	9,79	0,00	12,50	40,00	13,33	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	32.916.181,00	4,76	0,00	2,50	20,00	1,70	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	33.142,59	0,00	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	9.623.598,55	1,39	0,00	2,00	5,00	1,67	5,00
	Total Renda Fixa	465.504.999,55	67,27					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	101.338.141,71	14,65	0,00	14,50	30,00	4,92	30,00
	Total Renda Variável	101.338.141,71	14,65					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	32.307.606,83	4,67	0,00	4,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	20.001.309,86	2,89	0,00	6,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	52.308.916,69	7,56					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	61.550.250,02	8,90	0,00	8,00	10,00	8,39	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	11.244.355,36	1,63	0,00	2,00	5,00	1,61	5,00
	Total Investimentos Estruturados	72.794.605,38	10,52					15,00
Total		691.946.663,33	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	0,99 110,72	10,78 82,62	2,40 84,51	4,34 70,59	10,78 82,62	3.060.616,26	31.694.254,08
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	3,33 371,06	3,91 29,94	5,54 195,08	3,91 63,53	3,91 29,94	1.408.730,87	1.639.885,23
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 103,31	12,77 97,87	2,71 95,47	6,15 100,03	12,77 97,87	666.596,05	11.355.585,93
Artigo 7º IV % do CDI	0,83 93,06	11,70 89,65	2,44 85,86	4,52 73,44	11,70 89,65	272.299,51	2.366.900,32
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	6,84 762,89	896,78 6.873,20	-62,17 -2.190,49	1.223,04 19.889,19	896,78 6.873,20	2.319,91	197.232,80
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,01 112,16	13,15 100,80	3,17 111,73	7,16 116,48	13,15 100,80	95.786,95	1.237.917,20
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,57 0,19	19,83 -2,45	11,29 -3,83	11,41 -2,23	19,83 -2,45	5.348.802,88	17.412.491,05
Artigo 9º II % do CDI	4,76 530,83	24,50 187,77	11,00 387,72	10,03 163,12	24,50 187,77	1.467.363,47	6.357.431,65
Artigo 9º III % do CDI	2,51 279,66	17,40 133,34	6,67 234,85	9,25 150,44	17,40 133,34	489.109,76	2.964.071,20
Artigo 10º I % do CDI	4,59 512,36	30,96 237,30	11,81 416,22	10,15 164,98	30,96 237,30	2.702.524,42	14.551.756,77
Artigo 10º II % do CDI	0,40 44,75	-5,63 -43,14	1,05 36,87	0,21 3,44	-5,63 -43,14	44.917,64	-471.116,43
JACAREÍ (Total)						15.559.067,74	89.461.075,76

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150525 (5,480000%)	2.175.170,92	0,00	0,00	0,00	2.193.007,46	17.836,54	214.905,37
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.063.967,21	0,00	0,00	0,00	1.072.970,80	9.003,59	108.280,36
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.244.659,51	0,00	0,00	0,00	20.433.974,81	189.315,30	1.019.415,86
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.206.037,44	0,00	0,00	0,00	2.225.180,29	19.142,85	207.084,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.202.426,60	0,00	0,00	0,00	2.221.580,09	19.153,49	207.163,08
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.201.592,00	0,00	0,00	0,00	2.220.803,35	19.211,35	207.711,21
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.190.993,59	0,00	0,00	0,00	2.210.721,38	19.727,79	212.655,04
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.192.077,83	0,00	0,00	0,00	2.212.015,41	19.937,58	214.707,53
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.191.173,20	0,00	0,00	0,00	2.211.166,37	19.993,17	215.240,98
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.516.175,58	0,00	0,00	0,00	1.530.521,76	14.346,18	76.438,96
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.046.811,43	0,00	0,00	0,00	2.066.508,88	19.697,45	211.035,79
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.203.332,03	0,00	0,00	0,00	3.234.214,85	30.882,82	330.822,21
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.221.019,56	0,00	0,00	0,00	2.241.856,80	20.837,24	211.830,95
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.218.286,19	0,00	0,00	0,00	2.239.121,05	20.834,86	211.784,78
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.214.089,39	0,00	0,00	0,00	2.234.999,44	20.910,05	212.453,44
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.200.946,20	0,00	0,00	0,00	2.222.310,67	21.364,47	216.607,50
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.199.926,02	0,00	0,00	0,00	2.221.402,79	21.476,77	217.672,06
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.198.336,70	0,00	0,00	0,00	2.219.888,58	21.551,88	218.361,72
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.169.838,50	0,00	0,00	0,00	5.222.881,13	53.042,63	535.927,81
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.135.772,40	0,00	0,00	0,00	2.157.747,75	21.975,35	221.997,79
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.054.496,85	0,00	0,00	0,00	2.075.712,79	21.215,94	214.278,46
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.277.309,29	0,00	0,00	0,00	6.342.244,70	64.935,41	655.788,95
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.048.483,97	0,00	0,00	0,00	2.069.687,57	21.203,60	214.141,29
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.603.656,30	0,00	0,00	0,00	4.652.310,77	48.654,47	490.858,99
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.628.240,35	0,00	0,00	0,00	3.667.002,21	38.761,86	390.881,97
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.055.043,03	0,00	0,00	0,00	3.087.752,44	32.709,41	272.289,69
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.082.152,55	0,00	0,00	0,00	2.104.692,10	22.539,55	227.180,48
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.227.430,12	0,00	0,00	0,00	2.249.336,33	21.906,21	213.855,26
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.222.311,48	0,00	0,00	0,00	2.244.235,71	21.924,23	214.010,80
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.217.219,17	0,00	0,00	0,00	2.239.161,59	21.942,42	214.168,15
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.204.909,15	0,00	0,00	0,00	2.227.305,75	22.396,60	218.439,37
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.205.696,27	0,00	0,00	0,00	2.228.222,29	22.526,02	219.692,11
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.203.454,98	0,00	0,00	0,00	2.226.071,63	22.616,65	220.538,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.194.445,35	0,00	0,00	0,00	2.217.188,81	22.743,46	221.761,41
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.383.571,70	0,00	0,00	0,00	11.505.072,05	121.500,35	1.184.611,56
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.134.418,26	0,00	0,00	0,00	2.157.259,01	22.840,75	222.707,76
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.126.087,49	0,00	0,00	0,00	5.181.126,33	55.038,84	536.690,67
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.051.239,87	0,00	0,00	0,00	2.073.325,82	22.085,95	215.354,59
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.737.307,19	0,00	0,00	0,00	16.917.877,49	180.570,30	1.760.919,25
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.201.163,87	0,00	0,00	0,00	9.302.140,29	100.976,42	984.886,65
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.284.075,38	0,00	0,00	0,00	8.375.950,17	91.874,79	896.368,80
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.125.681,10	0,00	0,00	0,00	7.204.750,60	79.069,50	637.367,05
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.208.120,12	0,00	0,00	0,00	5.266.566,39	58.446,27	570.489,21
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.204.619,52	0,00	0,00	0,00	2.222.028,30	17.408,78	211.313,04
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.237.125,06	0,00	0,00	0,00	2.254.968,48	17.843,42	216.506,03
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.196.447,44	0,00	0,00	0,00	2.214.733,21	18.285,77	221.502,13
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.233.895,51	0,00	0,00	0,00	2.251.767,69	17.872,18	208.176,91
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.236.109,53	0,00	0,00	0,00	2.254.221,52	18.111,99	210.814,73
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.237.234,49	0,00	0,00	0,00	2.255.467,01	18.232,52	212.129,24
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.242.769,77	0,00	0,00	0,00	2.261.605,91	18.836,14	218.681,11
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.284.793,99	0,00	0,00	0,00	3.312.980,10	28.186,11	326.735,85
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.247.838,12	0,00	0,00	0,00	2.265.883,83	18.045,71	206.526,18
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.241.221,55	0,00	0,00	0,00	2.259.745,91	18.524,36	211.520,79
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.244.315,46	0,00	0,00	0,00	2.263.087,18	18.771,72	214.135,15
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.241.685,98	0,00	0,00	0,00	2.260.493,00	18.807,02	214.490,66
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.292.580,20	0,00	0,00	0,00	3.321.728,45	29.148,25	331.036,34
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.256.554,57	0,00	0,00	0,00	2.275.321,15	18.766,58	208.086,45
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.251.770,91	0,00	0,00	0,00	2.270.580,35	18.809,44	208.471,58
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.245.423,99	0,00	0,00	0,00	2.264.751,75	19.327,76	213.598,25
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.247.807,05	0,00	0,00	0,00	2.267.344,89	19.537,84	215.704,29
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.248.657,35	0,00	0,00	0,00	2.268.262,92	19.605,57	216.399,25
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.538.881,36	0,00	0,00	0,00	3.570.251,39	31.370,03	170.501,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.246.891,75	0,00	0,00	0,00	2.266.891,56	19.999,81	220.315,58
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.294.593,62	0,00	0,00	0,00	3.324.922,08	30.328,46	333.047,48
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.273.390,92	0,00	0,00	0,00	2.293.994,43	20.603,51	212.778,88
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.263.923,42	0,00	0,00	0,00	2.284.484,43	20.561,01	212.313,20
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.266.201,41	0,00	0,00	0,00	2.286.899,04	20.697,63	213.585,28
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.257.469,43	0,00	0,00	0,00	2.278.664,79	21.195,36	218.103,83
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.258.199,22	0,00	0,00	0,00	2.279.482,13	21.282,91	218.927,83
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.255.649,69	0,00	0,00	0,00	2.277.022,72	21.373,03	219.730,42
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.109.722,70	0,00	0,00	0,00	2.130.712,89	20.990,19	214.829,06
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.294.495,06	0,00	0,00	0,00	3.327.329,25	32.834,19	336.017,51
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.109.798,07	0,00	0,00	0,00	3.141.907,14	32.109,07	327.629,99
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.286.240,76	0,00	0,00	0,00	2.308.169,92	21.929,16	214.859,02
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.283.480,02	0,00	0,00	0,00	2.305.477,66	21.997,64	215.460,62
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.278.986,96	0,00	0,00	0,00	2.301.012,19	22.025,23	215.678,42
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.272.965,70	0,00	0,00	0,00	2.295.016,81	22.051,11	215.858,38
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.262.642,74	0,00	0,00	0,00	2.285.179,12	22.536,38	220.199,20
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.261.722,04	0,00	0,00	0,00	2.284.397,46	22.675,42	221.475,43
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.260.502,76	0,00	0,00	0,00	2.283.281,28	22.778,52	222.414,43
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.253.446,45	0,00	0,00	0,00	2.276.381,35	22.934,90	223.826,31
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.514.283,72	0,00	0,00	0,00	8.603.699,80	89.416,08	871.188,54
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.162.751,65	0,00	0,00	0,00	3.196.172,68	33.421,03	325.551,62
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.110.609,94	0,00	0,00	0,00	2.132.961,38	22.351,44	217.719,66
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.505.557,92	0,00	0,00	0,00	11.627.740,05	122.182,13	1.189.960,27
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.842.415,48	0,00	0,00	0,00	6.916.356,46	73.940,98	719.732,54
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.699.662,15	0,00	0,00	0,00	5.761.934,14	62.271,99	605.911,10
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.240.611,00	0,00	0,00	0,00	5.297.952,94	57.341,94	459.544,16
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.126.153,95	0,00	0,00	0,00	3.160.729,54	34.575,59	336.345,42
	308.391.246,52	0,00	0,00	0,00	311.451.862,78	3.060.616,26	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	21.066.238,17	0,00	0,00	0,00	21.894.467,67	828.229,50	769.003,67
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.290.380,19	0,00	0,00	0,00	21.870.881,56	580.501,37	870.881,56
	42.356.618,36	0,00	0,00	0,00	43.765.349,23	1.408.730,87	

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	21.039.375,57	0,00	0,00	0,00	21.229.188,47	189.812,90	1.229.188,47
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	21.489.405,49	0,00	0,00	0,00	21.690.280,94	200.875,45	4.576.364,19
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5.075.060,50	0,00	0,00	0,00	5.120.238,00	45.177,50	120.238,00
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	27.981.927,79	7.761.500,00	-16.299.000,00	0,00	19.675.157,99	230.730,20	3.570.570,54
	75.585.769,35	7.761.500,00	-16.299.000,00	0,00	67.714.865,40	666.596,05	

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	5.234.263,74	0,00	0,00	0,00	5.279.551,19	45.287,45	279.551,19
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	5.240.815,33	0,00	0,00	0,00	5.285.602,03	44.786,70	285.602,03
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a	6.109.212,75	0,00	0,00	0,00	6.164.720,35	55.507,60	658.497,25
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	5.229.880,54	0,00	0,00	0,00	5.271.246,80	41.366,26	271.246,80
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	5.235.443,99	0,00	0,00	0,00	5.277.679,38	42.235,39	277.679,38
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.594.265,14	0,00	0,00	0,00	5.637.381,25	43.116,11	594.323,67
	32.643.881,49	0,00	0,00	0,00	32.916.181,00	272.299,51	

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	33.504,03	0,00	0,00	2.681,35	33.142,59	2.319,91	197.232,80
	33.504,03	0,00	0,00	2.681,35	33.142,59	2.319,91	

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	3.487.572,98	0,00	0,00	0,00	3.519.827,47	32.254,49	415.206,94
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	6.040.238,62	0,00	0,00	0,00	6.103.771,08	63.532,46	731.006,37
	9.527.811,60	0,00	0,00	0,00	9.623.598,55	95.786,95	

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	7.358.650,29	0,00	0,00	0,00	7.838.481,54	479.831,25	989.037,33
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.407.449,71	0,00	0,00	0,00	5.668.689,72	261.240,01	774.235,61
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	6.558.688,18	0,00	0,00	0,00	6.733.799,08	175.110,90	1.569.699,87
INDIE FIC FIA	3.842.620,96	0,00	0,00	0,00	4.055.018,98	212.398,02	848.552,16
META VALOR FI DE AÇÕES	2.139.579,83	0,00	0,00	0,00	2.300.555,34	160.975,51	28.423,00
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	23.476.331,19	0,00	0,00	0,00	24.812.428,90	1.336.097,71	4.439.815,06
OCCAM FIC FIA	26.578.825,96	0,00	0,00	0,00	27.878.631,31	1.299.805,35	3.997.653,77
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	4.248.238,34	0,00	0,00	0,00	4.418.591,30	170.352,96	323.392,27
TARPON GT 30 FIC FIA	9.542.367,11	0,00	0,00	0,00	10.482.018,28	939.651,17	3.734.986,51
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	6.836.587,26	0,00	0,00	0,00	7.149.927,26	313.340,00	706.695,47
	95.989.338,83	0,00	0,00	0,00	101.338.141,71	5.348.802,88	

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	16.276.006,20	0,00	0,00	0,00	17.125.134,43	849.128,23	5.091.511,05
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.882.679,74	0,00	0,00	0,00	2.102.028,57	219.348,83	552.387,45
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.142.591,57	0,00	0,00	0,00	2.076.923,59	-65.667,98	-743.753,96
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.359.561,40	0,00	0,00	0,00	2.492.125,93	132.564,53	48.520,56
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.846.840,95	0,00	0,00	0,00	2.961.288,73	114.447,78	815.698,32
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	5.332.563,50	0,00	0,00	0,00	5.550.105,58	217.542,08	593.068,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	30.840.243,36	0,00	0,00	0,00	32.307.606,83	1.467.363,47	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	19.512.200,10	0,00	0,00	0,00	20.001.309,86	489.109,76	2.964.071,20
	19.512.200,10	0,00	0,00	0,00	20.001.309,86	489.109,76	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	31.912.199,31	0,00	0,00	0,00	33.582.098,48	1.669.899,17	8.479.048,88
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	7.774.991,92	0,00	0,00	0,00	7.817.479,58	42.487,66	1.070.138,57
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	19.160.534,37	0,00	0,00	0,00	20.150.671,96	990.137,59	5.002.569,32
	58.847.725,60	0,00	0,00	0,00	61.550.250,02	2.702.524,42	

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	11.199.437,72	0,00	0,00	0,00	11.244.355,36	44.917,64	-456.040,20
	11.199.437,72	0,00	0,00	0,00	11.244.355,36	44.917,64	

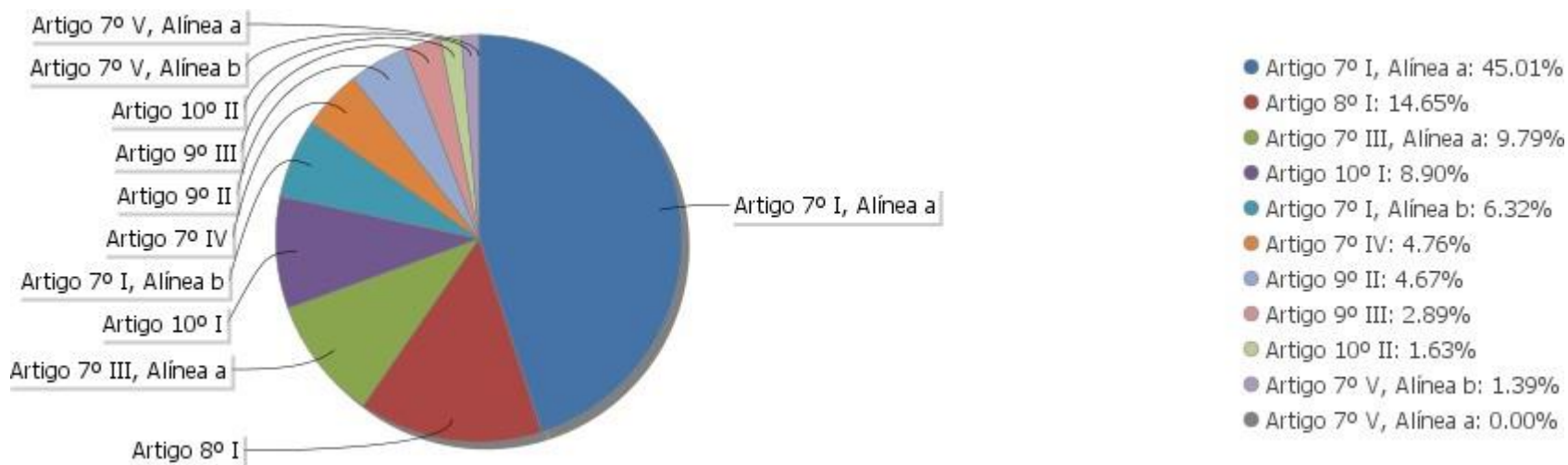
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

6. Análise de Liquidez

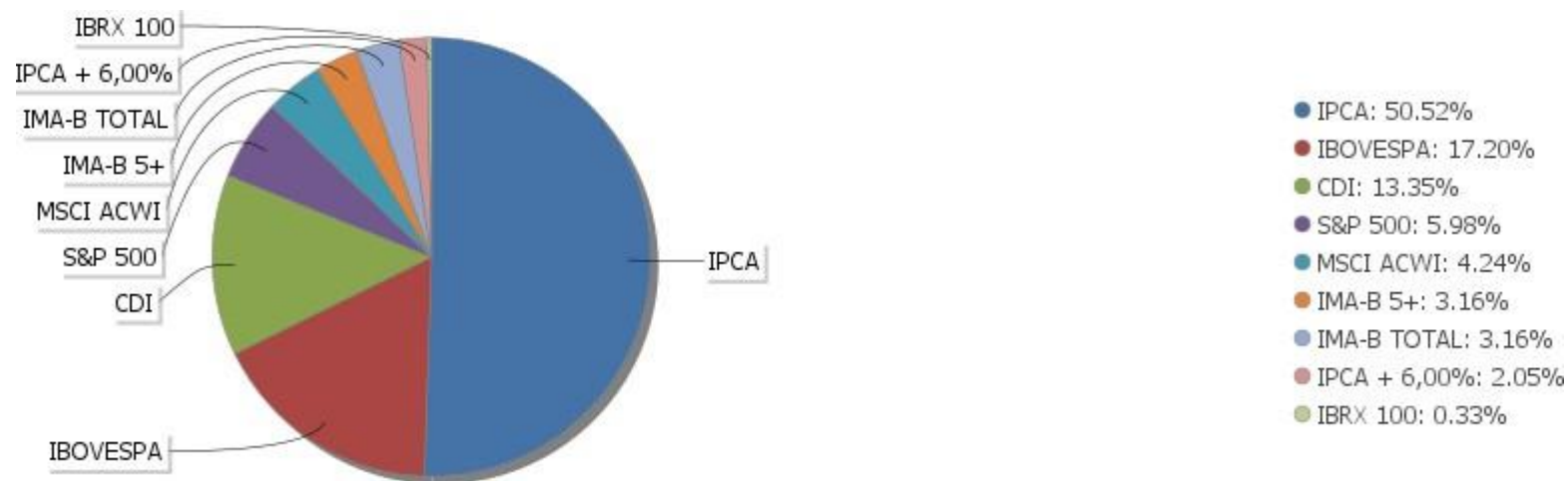
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	267.893.552,67	38,72	267.893.552,67	38,72	15,00
de 31 dias a 365 dias	70.012.203,51	10,12	337.905.756,18	48,83	20,00
acima de 365 dias	354.040.907,15	51,17	691.946.663,33	100,00	25,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

7. Alocação por Artigo

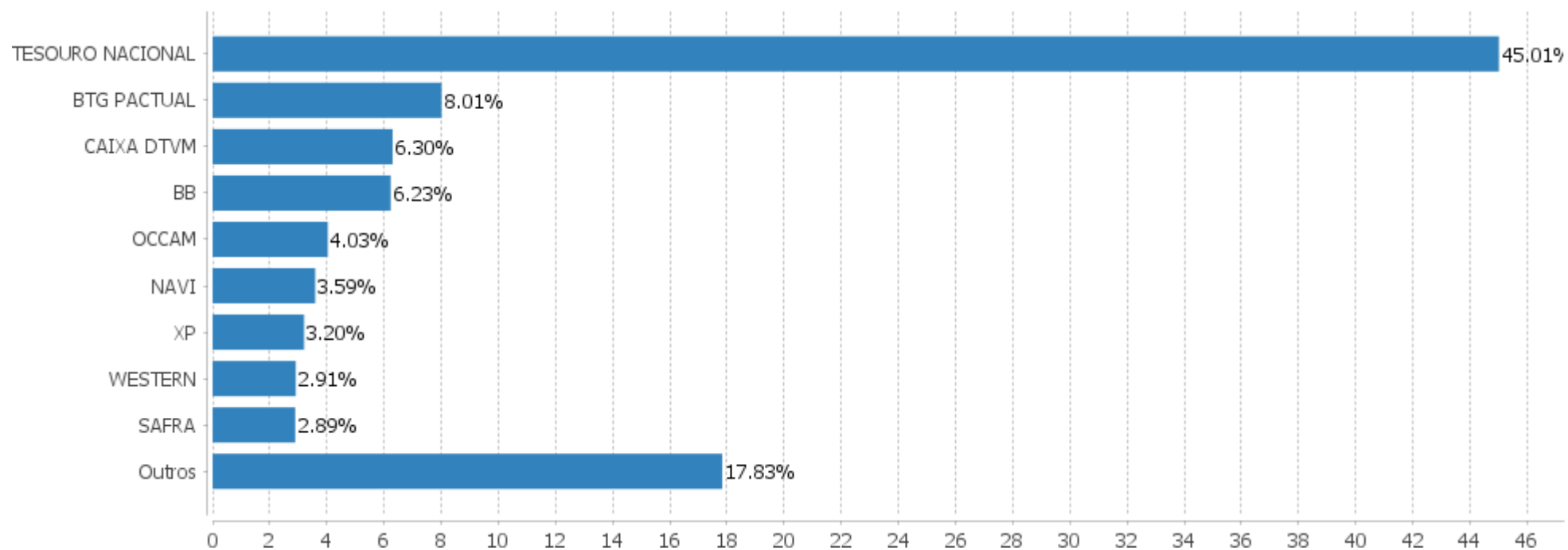


8. Alocação Por Estratégia



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	2,28	14,36
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	0,96	9,90
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	1,32	4,46
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

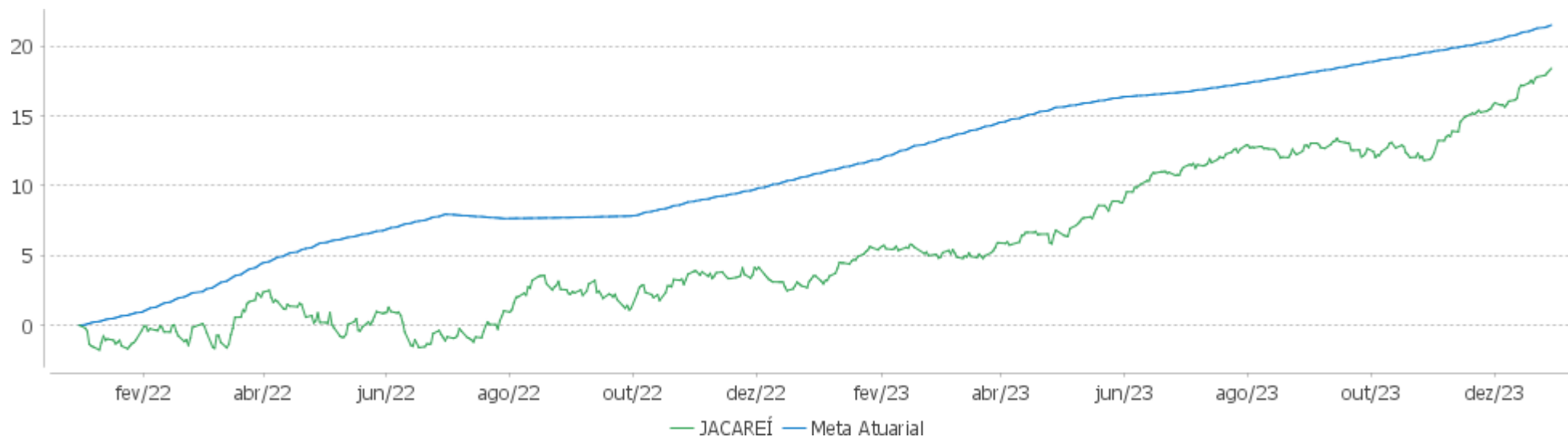
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	41,67	03 meses	5,11	2,31	2,80	3,51
Meses abaixo - Meta Atuarial	14	58,33	06 meses	6,38	4,25	2,13	3,22
			12 meses	14,36	9,90	4,46	3,20
			24 meses	18,42	21,85	-3,44	4,57
Maior rentabilidade da Carteira	3,32	2023-11	Desde 31/12/2021	18,42	21,85	-3,44	4,57
Menor rentabilidade da Carteira	-1,97	2022-06					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

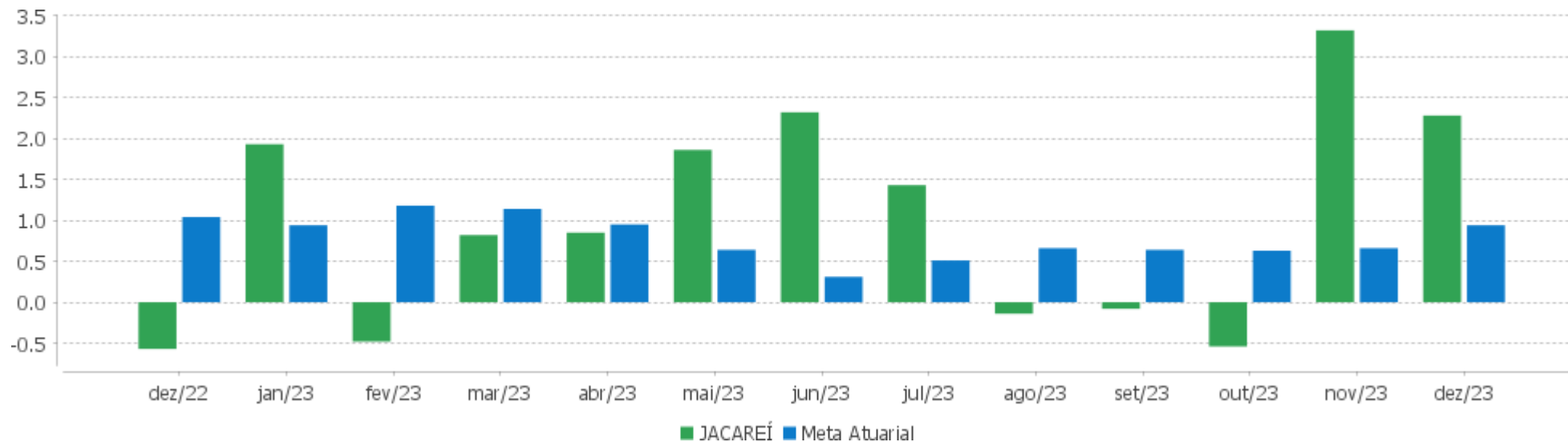


Patrimônio Líquido



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.	0,85 0,29	5,71 3,99	2,44 1,35	4,60 2,90			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a Var. IPCA p.p.	0,81 0,25	5,55 3,83	2,39 1,30	4,52 2,82			
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a Var. IPCA p.p.	0,87 0,31	5,59 3,86	2,42 1,33	4,58 2,88			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,77 0,21	11,78 7,16	2,49 1,40	4,18 2,48	11,78 7,16		
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a Var. IPCA p.p.	0,79 0,23	5,42 3,70	2,34 1,25	4,41 2,71			
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,91 0,35	11,96 7,34	2,54 1,45	4,79 3,08	11,96 7,34		
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,05 117,35	13,61 104,28	3,32 116,88	7,60 123,63	13,61 104,28	28,61 105,84	36,98 113,37
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,92 103,18	13,37 102,50	2,92 102,83	6,38 103,77	13,37 102,50	28,26 104,52	34,89 106,97
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,52	11,31 6,69	2,56 1,48	4,62 2,92	11,31 6,69	17,77 7,10	
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,50	11,05 6,43	2,50 1,41	4,49 2,79	11,05 6,43	17,45 6,77	
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,26	10,40 5,78	2,19 1,11	4,08 2,38	10,40 5,78	23,16 12,48	
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,27	10,07 5,45	2,14 1,06	3,94 2,24	10,07 5,45	22,38 11,71	
NTN-B 150533 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,38	7,62 3,00	2,34 1,26	4,28 2,58	7,62 3,00	13,65 2,97	
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,50	11,11 6,49	2,51 1,43	4,52 2,82	11,11 6,49	24,50 13,83	
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	10,99 6,37	2,46 1,38	4,45 2,75	10,99 6,37	24,26 13,59	
NTN-B 150545 (5,915000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	11,05 6,42	2,48 1,39	4,48 2,78	11,05 6,42	24,39 13,72	
NTN-B 150850 (5,831200%)	1,05	10,98	2,48	4,46	10,98	24,22	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,49	6,36	1,40	2,76	6,36	13,55	
NTN-B 150826 (5,190000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,25	10,11 5,49	2,14 1,06	3,95 2,25	10,11 5,49	22,51 11,83	
NTN-B 150830 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,31	10,25 5,63	2,21 1,12	4,04 2,34	10,25 5,63	22,75 12,08	
NTN-B 150840 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,43	10,93 6,31	2,42 1,34	4,40 2,70	10,93 6,31	24,17 13,49	
NTN-B 150545 (4,970000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,38	10,04 5,42	2,23 1,15	3,99 2,29	10,04 5,42	22,17 11,50	
NTN-B 150840 (4,950000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,35	9,99 5,37	2,19 1,11	3,95 2,25	9,99 5,37	22,09 11,41	
NTN-B 150850 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,40	10,08 5,46	2,26 1,17	4,02 2,32	10,08 5,46	22,22 11,55	
NTN-B 150555 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,52	11,10 6,48	2,52 1,44	4,53 2,82	11,10 6,48	24,47 13,80	
NTN-B 150850 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,44	10,48 5,86	2,36 1,27	4,22 2,51	10,48 5,86	23,11 12,44	
NTN-B 150545 (5,922000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,48	11,05 6,43	2,48 1,39	4,48 2,78	11,05 6,43	24,41 13,73	
NTN-B 150535 (4,910000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,31	9,91 5,29	2,15 1,07	3,90 2,20	9,91 5,29	21,96 11,28	
NTN-B 150840 (5,020000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,35	10,06 5,44	2,21 1,13	3,98 2,28	10,06 5,44	22,25 11,58	
NTN-B 150555 (5,370000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,46	10,51 5,89	2,38 1,29	4,24 2,54	10,51 5,89	23,16 12,49	
NTN-B 150850 (4,940000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,40	10,03 5,41	2,25 1,16	4,00 2,30	10,03 5,41	22,13 11,45	
NTN-B 150545 (6,280000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,51	11,43 6,81	2,57 1,49	4,67 2,96	11,43 6,81	17,95 7,28	
NTN-B 150840 (4,970000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,35	10,01 5,39	2,20 1,12	3,96 2,26	10,01 5,39	22,13 11,46	
NTN-B 150826 (5,490000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,28	10,43 5,81	2,21 1,13	4,10 2,40	10,43 5,81	23,20 12,53	
NTN-B 150830 (5,460000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,33	7,38 2,76	2,25 1,17	4,14 2,44	7,38 2,76	13,22 2,54	
NTN-B 150850 (6,261000%)	1,09	11,44	2,59	4,68	11,44	25,24	

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.	0,53	6,82	1,51	2,98	6,82	14,56	
NTN-B 150555 (5,000000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,42	10,12 5,50	2,28 1,20	4,05 2,35	10,12 5,50	22,29 11,62	
NTN-B 150535 (5,320000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,35	10,35 5,72	2,26 1,18	4,11 2,41	10,35 5,72	22,91 12,24	
NTN-B 150535 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,39	7,63 3,01	2,35 1,26	4,29 2,58	7,63 3,01	13,68 3,00	
NTN-B 150850 (5,010000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,41	10,11 5,49	2,26 1,18	4,03 2,33	10,11 5,49	22,29 11,62	
NTN-B 150555 (6,261000%) Var. IPCA p.p.	1,11 0,55	11,46 6,84	2,61 1,52	4,70 3,00	11,46 6,84	25,26 14,59	
NTN-B 150545 (6,256000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,51	11,41 6,79	2,56 1,48	4,65 2,95	11,41 6,79	25,20 14,52	
NTN-B 150555 (5,520000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,48	10,67 6,05	2,42 1,33	4,32 2,62	10,67 6,05	23,51 12,84	
NTN-B 150555 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,51	11,03 6,41	2,50 1,42	4,49 2,79	11,03 6,41	24,31 13,64	
NTN-B 150545 (5,380000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,42	10,48 5,86	2,34 1,25	4,20 2,50	10,48 5,86	23,13 12,46	
NTN-B 150826 (5,009000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,24	9,93 5,31	2,10 1,01	3,86 2,16	9,93 5,31	22,09 11,41	
NTN-B 150545 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,52	11,56 6,94	2,60 1,52	4,73 3,03	11,56 6,94	18,12 7,44	
NTN-B 150555 (5,831200%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,51	11,00 6,38	2,50 1,41	4,48 2,78	11,00 6,38	24,24 13,57	
NTN-B 150535 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,40	10,91 6,29	2,40 1,31	4,38 2,68	10,91 6,29	24,17 13,50	
NTN-B 150828 (4,850000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,24	9,78 5,16	2,07 0,99	3,80 2,10	9,78 5,16	21,74 11,07	
NTN-B 150555 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	1,12 0,56	11,60 6,98	2,64 1,56	4,77 3,07	11,60 6,98	18,11 7,44	
NTN-B 150545 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	10,96 6,34	2,45 1,37	4,43 2,73	10,96 6,34	24,19 13,52	
NTN-B 150828 (5,240000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,28	10,19 5,57	2,17 1,09	4,00 2,29	10,19 5,57	22,64 11,97	
NTN-B 150545 (5,340000%)	0,98	10,43	2,33	4,18	10,43	23,04	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,42	5,81	1,24	2,48	5,81	12,36	
NTN-B 150850 (5,921000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,50	11,08 6,46	2,50 1,42	4,51 2,80	11,08 6,46	24,43 13,76	
NTN-B 150555 (6,268000%) Var. IPCA p.p.	1,11 0,55	11,46 6,84	2,61 1,52	4,70 3,00	11,46 6,84	17,95 7,27	
NTN-B 150535 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,31	9,86 5,24	2,14 1,06	3,87 2,17	9,86 5,24	21,84 11,17	
NTN-B 150826 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,30	10,66 6,04	2,27 1,18	4,21 2,51	10,66 6,04	23,72 13,04	
NTN-B 150828 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,28	10,22 5,60	2,18 1,09	4,01 2,31	10,22 5,60	22,71 12,04	
NTN-B 150555 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,54	11,33 6,71	2,58 1,49	4,64 2,93	11,33 6,71	21,32 10,65	
NTN-B 150535 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,35	10,31 5,69	2,25 1,17	4,09 2,39	10,31 5,69	22,84 12,17	
NTN-B 150830 (5,835000%) Var. IPCA p.p.	0,92 0,36	10,84 6,22	2,35 1,26	4,33 2,63	10,84 6,22	24,07 13,40	
NTN-B 150830 (5,300000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,31	10,28 5,66	2,21 1,13	4,06 2,36	10,28 5,66	22,82 12,15	
NTN-B 150535 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,40	10,89 6,27	2,39 1,31	4,37 2,67	10,89 6,27	24,13 13,45	
NTN-B 150555 (5,315000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,46	10,45 5,83	2,36 1,28	4,21 2,51	10,45 5,83	23,03 12,36	
NTN-B 150545 (5,285000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,41	10,38 5,75	2,31 1,23	4,15 2,45	10,38 5,75	22,91 12,23	
NTN-B 150830 (5,500000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,33	10,49 5,87	2,26 1,18	4,16 2,46	10,49 5,87	23,29 12,61	
NTN-B 150824 (5,450000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,24	10,34 5,72	2,16 1,08	4,04 2,34	10,34 5,72	23,06 12,39	
NTN-B 150830 (5,178300%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,30	10,15 5,53	2,18 1,10	4,00 2,29	10,15 5,53	22,54 11,86	
NTN-B 150545 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,38	10,10 5,48	2,25 1,16	4,02 2,32	10,10 5,48	22,31 11,64	
NTN-B 150545 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	11,03 6,41	2,47 1,39	4,47 2,77	11,03 6,41	20,83 10,16	
NTN-B 150850 (6,400000%)	1,11	11,59	2,63	4,75	11,59	18,11	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,55	6,97	1,54	3,05	6,97	7,44	
NTN-B 150824 (5,912000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,27	10,82 6,20	2,27 1,19	4,27 2,57	10,82 6,20	24,14 13,46	
NTN-B 150850 (5,045000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,41	10,15 5,53	2,27 1,19	4,05 2,35	10,15 5,53	22,37 11,70	
NTN-B 150555 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,43	10,15 5,53	2,29 1,20	4,06 2,36	10,15 5,53	22,36 11,69	
NTN-B 150840 (5,274000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,38	10,33 5,71	2,28 1,20	4,12 2,41	10,33 5,71	22,84 12,17	
NTN-B 150826 (5,130000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,25	10,05 5,43	2,13 1,04	3,92 2,22	10,05 5,43	22,37 11,70	
NTN-B 150840 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,39	10,42 5,80	2,30 1,22	4,16 2,46	10,42 5,80	23,05 12,37	
NTN-B 150850 (5,410000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,45	10,53 5,91	2,37 1,29	4,24 2,54	10,53 5,91	23,23 12,56	
NTN-B 150840 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,44	10,95 6,33	2,43 1,35	4,41 2,71	10,95 6,33	24,21 13,54	
NTN-B 150545 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,38	10,05 5,43	2,23 1,15	3,99 2,29	10,05 5,43	22,19 11,52	
NTN-B 150830 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,27	9,82 5,20	2,10 1,02	3,83 2,13	9,82 5,20	21,80 11,12	
NTN-B 150824 (5,345000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,23	10,23 5,61	2,14 1,05	3,99 2,29	10,23 5,61	22,82 12,15	
NTN-B 150840 (5,310000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,38	10,37 5,75	2,29 1,20	4,13 2,43	10,37 5,75	22,93 12,26	
NTN-B 150830 (4,900000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,28	9,86 5,24	2,11 1,03	3,85 2,15	9,86 5,24	21,89 11,22	
NTN-B 150545 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,50	11,28 6,66	2,53 1,45	4,59 2,89	11,28 6,66	21,28 10,61	
NTN-B 150850 (5,295500%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,44	10,41 5,79	2,34 1,26	4,18 2,48	10,41 5,79	22,96 12,29	
NTN-B 150535 (4,880000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,31	9,88 5,26	2,15 1,06	3,88 2,18	9,88 5,26	21,89 11,21	
NTN-B 150555 (5,420000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	10,56 5,94	2,39 1,31	4,27 2,56	10,56 5,94	23,28 12,60	
NTN-B 150850 (5,510000%)	1,02	10,64	2,40	4,29	10,64	23,47	

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	6,02	1,31	2,59	6,02	12,79	
NTN-B 150555 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,51	11,07 6,45	2,51 1,43	4,51 2,81	11,07 6,45	20,89 10,21	
NTN-B 150850 (6,278000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,53	8,15 3,53	2,59 1,51	4,69 2,99	8,15 3,53	14,46 3,78	
NTN-B 150840 (6,220000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	11,33 6,71	2,52 1,44	4,60 2,90	11,33 6,71	25,07 14,40	
NTN-B 150828 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,33	10,78 6,16	2,31 1,23	4,28 2,58	10,78 6,16	23,97 13,30	
NTN-B 150555 (5,060000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,43	10,18 5,56	2,30 1,21	4,08 2,38	10,18 5,56	22,43 11,76	
NTN-B 150555 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,52	11,13 6,51	2,53 1,44	4,54 2,84	11,13 6,51	24,52 13,85	
NTN-B 150525 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,29	10,74 6,12	2,27 1,19	4,24 2,54	10,74 6,12	23,92 13,25	
NTN-B 150535 (5,196100%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,34	10,21 5,59	2,23 1,14	4,04 2,34	10,21 5,59	22,62 11,95	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,73 -0,02	15,86 -0,20	4,71 -0,05	4,15 -0,06	15,86 -0,20	23,03 -0,41	21,15 -0,73
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	3,93 -0,01	18,87 -0,41	6,38 -0,04	3,67 -0,14	18,87 -0,41	22,37 -0,84	14,08 -1,06
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III % do CDI	6,84 762,89	896,78 6.873,20	-62,17 -2.190,49	1.223,04 19.889,19	896,78 6.873,20	142,85 528,38	10.227,56 31.355,39
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,90 100,65	12,98 99,47	2,83 99,76	6,15 99,95	12,98 99,47	27,20 100,61	33,08 101,42
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,93 104,29	13,39 102,59	2,94 103,59	6,46 105,08	13,39 102,59	27,85 103,01	33,62 103,08
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	0,89 0,33	2,40 0,69	-0,01 -1,09	2,54 0,84			
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,94 105,16	13,34 102,25	2,93 103,08	6,55 106,52	13,34 102,25	27,93 103,31	34,33 105,25
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,83 -0,55	15,82 -6,46	12,81 -2,30	8,59 -5,04	15,82 -6,46	10,40 -17,61	-24,69 -37,43
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,58 -0,80	10,97 -11,31	-2,98 -18,10	4,93 -8,70	10,97 -11,31	16,93 -11,08	66,39 53,65
TARPON GT 30 FIC FIA	9,85	55,36	11,54	24,45	55,36	78,35	107,80

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.	4,46	33,08	-3,58	10,82	33,08	50,34	95,06
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,69 0,31	20,10 -2,19	14,14 -0,98	14,67 1,04	20,10 -2,19	27,83 -0,18	21,83 9,08
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,01 -1,37	7,90 -14,38	6,47 -8,65	3,99 -9,64	7,90 -14,38	-9,54 -37,56	-12,53 -25,27
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,67 -2,71	41,44 19,16	12,52 -2,59	16,24 2,61	41,44 19,16	47,88 19,87	62,60 49,86
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,53 0,14	26,46 4,18	9,86 -5,26	7,52 -6,11	26,46 4,18	4,34 -23,68	-20,11 -32,86
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	6,52 1,14	14,44 -7,84	9,65 -5,47	3,21 -10,42	14,44 -7,84	0,59 -27,42	-14,50 -27,25
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,89 -0,49	15,74 -6,54	13,32 -1,80	10,70 -2,93	15,74 -6,54	20,98 -7,04	5,56 -7,19
META VALOR FI DE AÇÕES Var. IBRX 100 p.p.	7,52 2,04	1,25 -20,02	13,31 -1,64	3,50 -10,27	1,25 -20,02	-0,54 -26,69	-24,34 -36,39
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	2,51 -2,88	17,40 -4,88	6,67 -8,45	9,25 -4,38	17,40 -4,88	-18,28 -46,29	9,44 -3,31
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-3,06 -5,76	-26,37 -37,79	-12,40 -19,41	-13,95 -20,91	-26,37 -37,79	-45,86 -29,42	-47,16 -51,96
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	4,08 1,38	11,96 0,54	8,76 1,75	8,85 1,90	11,96 0,54	-12,95 3,49	11,83 7,04
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	5,22 2,52	42,31 30,88	15,17 8,16	14,73 7,77	42,31 30,88	-8,64 7,81	4,81 0,01
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	11,65 8,95	35,65 24,22	15,48 8,47	12,22 5,27	35,65 24,22	-49,40 -32,95	-46,72 -51,52
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	4,02 2,99	38,02 27,20	12,26 9,74	13,39 8,70	38,02 27,20	-24,45 -48,69	-18,98 -63,88
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	5,62 2,92	1,99 -9,44	8,23 1,22	2,21 -4,74	1,99 -9,44	-43,29 -26,85	-32,89 -37,68
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	0,55 -1,88	15,86 0,59	3,91 -3,63	4,57 -3,10	15,86 0,59		
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	5,17 576,54	33,02 253,11	12,97 456,93	10,80 175,65	33,02 253,11	17,07 63,14	55,06 168,79
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	5,23 2,80	33,78 18,51	13,12 5,58	11,13 3,46	33,78 18,51	23,09 36,27	64,64 46,33
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,40	-4,20	1,05	1,75	-4,20	19,99	47,28

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.	-0,63	-15,02	-1,47	-2,94	-15,02	-4,25	2,37
JACAREÍ	2,28	14,36	5,11	6,38	14,36	18,42	
Var. IPCA + 4,83% p.p.	1,32	4,46	2,80	2,13	4,46	-3,76	
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

12. Cotização e Taxas

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

13. Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,91	13,25	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	18,52	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	16,51	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	12,13	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	19,28	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	14,80	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	12,13	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	27,13	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	21,27	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	20,06	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	17,12	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	6,98	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	26,84	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

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	2,43	15,27	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	15,50	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	11,43	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	4,62	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	3,71	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	-3,18	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	8,75	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	9,79	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	10,30	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	10,71	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	7,80	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

14. Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150525 (5,480000%)	2.193.007,46	5,480000	2.192.888,56	5,484300	-118,90
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.072.970,80	5,810000	1.077.357,24	5,484300	4.386,44
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.433.974,81	5,680000	20.930.183,63	5,330500	496.208,82
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.225.180,29	4,860000	2.140.388,49	5,342800	-84.791,80
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.221.580,09	4,880000	2.140.388,49	5,342800	-81.191,60
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.220.803,35	4,910000	2.144.838,37	5,342800	-75.964,98
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.210.721,38	5,196100	2.184.887,22	5,342800	-25.834,16
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.212.015,41	5,290000	2.202.686,70	5,342800	-9.328,71
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.211.166,37	5,320000	2.207.136,58	5,342800	-4.029,79
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.530.521,76	5,670000	1.570.804,86	5,342800	40.283,10
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.066.508,88	5,837000	2.149.288,24	5,342800	82.779,36
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.234.214,85	5,855000	3.368.553,20	5,342800	134.338,35
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.241.856,80	4,970000	2.108.917,18	5,477000	-132.939,62
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.239.121,05	4,980000	2.108.917,18	5,477000	-130.203,87
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.234.999,44	5,030000	2.117.910,43	5,477000	-117.089,01
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.222.310,67	5,285000	2.171.869,93	5,477000	-50.440,74
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.221.402,79	5,340000	2.185.359,81	5,477000	-36.042,98
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.219.888,58	5,380000	2.194.353,06	5,477000	-25.535,52
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.222.881,13	5,831000	5.445.413,02	5,477000	222.531,89
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.157.747,75	5,860000	2.257.305,81	5,477000	99.558,06
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.075.712,79	5,897000	2.180.863,18	5,477000	105.150,39
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.342.244,70	5,915000	6.677.488,30	5,477000	335.243,60
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.069.687,57	5,922000	2.180.863,18	5,477000	111.175,61
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.652.310,77	6,140000	5.027.226,89	5,477000	374.916,12
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.667.002,21	6,256000	4.015.486,23	5,477000	348.484,02
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.087.752,44	6,280000	3.390.455,34	5,477000	302.702,90
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.104.692,10	6,400000	2.342.741,69	5,477000	238.049,59
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.249.336,33	5,000000	2.100.137,63	5,472400	-149.198,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.244.235,71	5,030000	2.104.693,25	5,472400	-139.542,46
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.239.161,59	5,060000	2.109.248,86	5,472400	-129.912,73
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.227.305,75	5,315000	2.177.583,06	5,472400	-49.722,69
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.228.222,29	5,370000	2.195.805,51	5,472400	-32.416,78
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.226.071,63	5,420000	2.209.472,35	5,472400	-16.599,28
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.217.188,81	5,520000	2.232.250,41	5,472400	15.061,60
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.505.072,05	5,831200	12.099.708,36	5,472400	594.636,31
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.157.259,01	5,860000	2.277.806,54	5,472400	120.547,53
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.181.126,33	5,897000	5.498.625,00	5,472400	317.498,67
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.073.325,82	5,927000	2.209.472,35	5,472400	136.146,53
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.917.877,49	5,950000	18.085.783,96	5,472400	1.167.906,47
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.302.140,29	6,140000	10.204.573,32	5,472400	902.433,03
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.375.950,17	6,261000	9.339.006,83	5,472400	963.056,66
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.204.750,60	6,268000	8.040.657,10	5,472400	835.906,50
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.266.566,39	6,400000	5.981.519,99	5,472400	714.953,60
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.222.028,30	5,345000	2.205.739,97	6,618000	-16.288,33
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.254.968,48	5,450000	2.239.805,46	6,618000	-15.163,02
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.214.733,21	5,912000	2.205.739,97	6,618000	-8.993,24
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.251.767,69	5,009000	2.241.889,78	5,200000	-9.877,91
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.254.221,52	5,130000	2.250.596,15	5,200000	-3.625,37
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.255.467,01	5,190000	2.254.949,34	5,200000	-517,67
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.261.605,91	5,490000	2.276.715,26	5,200000	15.109,35
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.312.980,10	5,710000	3.351.951,72	5,200000	38.971,62
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.265.883,83	4,850000	2.233.914,17	5,220700	-31.969,66
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.259.745,91	5,125600	2.251.538,73	5,220700	-8.207,18
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.263.087,18	5,240000	2.264.757,16	5,220700	1.669,98
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.260.493,00	5,270000	2.264.757,16	5,220700	4.264,16
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.321.728,45	5,810000	3.397.135,74	5,220700	75.407,29
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.275.321,15	4,860000	2.233.112,79	5,220000	-42.208,36
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.270.580,35	4,900000	2.233.112,79	5,220000	-37.467,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.264.751,75	5,178300	2.259.856,66	5,220000	-4.895,09
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.267.344,89	5,270000	2.273.228,59	5,220000	5.883,70
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.268.262,92	5,300000	2.277.685,90	5,220000	9.422,98
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.570.251,39	5,460000	3.614.879,19	5,220000	44.627,80
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.266.891,56	5,500000	2.299.972,46	5,220000	33.080,90
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.324.922,08	5,835000	3.432.129,44	5,220000	107.207,36
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.293.994,43	4,950000	2.194.387,50	5,381900	-99.606,93
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.284.484,43	4,970000	2.189.825,37	5,381900	-94.659,06
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.286.899,04	5,020000	2.203.511,77	5,381900	-83.387,27
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.278.664,79	5,274000	2.253.695,27	5,381900	-24.969,52
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.279.482,13	5,310000	2.262.819,54	5,381900	-16.662,59
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.277.022,72	5,360000	2.271.943,82	5,381900	-5.078,90
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.130.712,89	5,837000	2.230.884,59	5,381900	100.171,70
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.327.329,25	5,855000	3.490.034,18	5,381900	162.704,93
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.141.907,14	6,220000	3.417.040,00	5,381900	275.132,86
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.308.169,92	4,940000	2.149.973,90	5,471800	-158.196,02
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.305.477,66	4,980000	2.159.161,83	5,471800	-146.315,83
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.301.012,19	5,010000	2.163.755,79	5,471800	-137.256,40
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.295.016,81	5,045000	2.168.349,75	5,471800	-126.667,06
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.285.179,12	5,295500	2.232.665,21	5,471800	-52.513,91
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.284.397,46	5,360000	2.251.041,05	5,471800	-33.356,41
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.283.281,28	5,410000	2.264.822,94	5,471800	-18.458,34
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.276.381,35	5,510000	2.287.792,74	5,471800	11.411,39
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.603.699,80	5,831200	9.013.352,13	5,471800	409.652,33
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.196.172,68	5,897000	3.376.561,58	5,471800	180.388,90
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.132.961,38	5,921000	2.260.228,97	5,471800	127.267,59
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.627.740,05	5,950000	12.366.943,90	5,471800	739.203,85
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.916.356,46	6,140000	7.534.096,58	5,471800	617.740,12
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.761.934,14	6,261000	6.371.824,37	5,471800	609.890,23
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.297.952,94	6,278000	5.871.082,58	5,471800	573.129,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.160.729,54	6,400000	3.555.726,07	5,471800	394.996,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

15. Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
364	01/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.056.000,00	4.243,81902869	248,8324768000
381	01/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	7.000,00	28,13137614	248,8324768000
365	07/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	930.000,00	3.730,21638078	249,3152957000
366	07/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	940.000,00	0,00	3.770,32623434	249,3152957000
382	07/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	63.000,00	252,69207741	249,3152957000
383	11/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	12,02132000	249,5566211000
367	14/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	236.082,27	944,62491725	249,9217051000
368	14/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.522.878,29	6.093,42149531	249,9217051000
369	14/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	490.787,88	1.963,76653162	249,9217051000
370	14/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	971.202,66	3.886,02766459	249,9217051000
371	14/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	586.762,54	2.347,78543850	249,9217051000
372	14/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	942.286,36	3.770,32622926	249,9217051000
384	14/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	80.000,00	320,10024887	249,9217051000
373	15/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1.228.000,00	0,00	4.911,31180931	250,0350309000
385	15/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	46.000,00	183,97422087	250,0350309000
386	15/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	7,99887917	250,0350309000
374	20/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	66.000,00	263,60875336	250,3710486000
387	20/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	113.000,00	451,33013834	250,3710486000
388	20/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	7,98814404	250,3710486000
389	27/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	32.085,91	127,91735225	250,8331312000
390	27/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	51.823,37	206,60496383	250,8331312000
391	27/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.090,72	8,33510306	250,8331312000
375	27/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	788.706,11	3.144,34582954	250,8331312000
376	27/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	55.104,46	219,68573185	250,8331312000
377	27/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	6.846.470,73	27.294,92191580	250,8331312000
378	27/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	238.920,79	952,50890047	250,8331312000
379	27/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.165.797,91	4.647,70305431	250,8331312000
392	28/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	274.000,00	0,00	1.091,88317068	250,9425984000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
380	28/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	5.319.500,00	0,00	21.198,07491401	250,9425984000
	Total		7.761.500,00	16.299.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

16. Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 12.021.349,90

Value-At-Risk: 1,74%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
JACAREÍ		1,74		1,74			691.946.663,33	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,27%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,480000%)		0,07	-0,00	0,08			2.193.007,46	0,32
NTN-B 150525 (5,810000%)		0,07	-0,00	0,08			1.072.970,80	0,16
NTN-B 150533 (5,680000%)		0,08	-0,00	0,09			20.433.974,81	2,95
NTN-B 150535 (4,860000%)		0,08	-0,00	0,08			2.225.180,29	0,32
NTN-B 150535 (4,880000%)		0,08	-0,00	0,08			2.221.580,09	0,32
NTN-B 150535 (4,910000%)		0,08	-0,00	0,08			2.220.803,35	0,32
NTN-B 150535 (5,196100%)		0,08	-0,00	0,08			2.210.721,38	0,32
NTN-B 150535 (5,290000%)		0,08	-0,00	0,08			2.212.015,41	0,32
NTN-B 150535 (5,320000%)		0,08	-0,00	0,08			2.211.166,37	0,32
NTN-B 150535 (5,670000%)		0,08	-0,00	0,08			1.530.521,76	0,22
NTN-B 150535 (5,837000%)		0,08	-0,00	0,08			2.066.508,88	0,30
NTN-B 150535 (5,855000%)		0,08	-0,00	0,08			3.234.214,85	0,47
NTN-B 150545 (4,970000%)		0,08	-0,00	0,09			2.241.856,80	0,32
NTN-B 150545 (4,980000%)		0,08	-0,00	0,09			2.239.121,05	0,32
NTN-B 150545 (5,030000%)		0,08	-0,00	0,09			2.234.999,44	0,32
NTN-B 150545 (5,285000%)		0,08	-0,00	0,09			2.222.310,67	0,32
NTN-B 150545 (5,340000%)		0,08	-0,00	0,09			2.221.402,79	0,32
NTN-B 150545 (5,380000%)		0,08	-0,00	0,09			2.219.888,58	0,32
NTN-B 150545 (5,831000%)		0,08	-0,00	0,09			5.222.881,13	0,75
NTN-B 150545 (5,860000%)		0,08	-0,00	0,09			2.157.747,75	0,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (5,897000%)		0,08	-0,00	0,09			2.075.712,79	0,30
NTN-B 150545 (5,915000%)		0,08	-0,00	0,09			6.342.244,70	0,92
NTN-B 150545 (5,922000%)		0,08	-0,00	0,09			2.069.687,57	0,30
NTN-B 150545 (6,140000%)		0,08	-0,00	0,09			4.652.310,77	0,67
NTN-B 150545 (6,256000%)		0,08	-0,00	0,09			3.667.002,21	0,53
NTN-B 150545 (6,280000%)		0,08	-0,00	0,09			3.087.752,44	0,45
NTN-B 150545 (6,400000%)		0,08	-0,00	0,09			2.104.692,10	0,30
NTN-B 150555 (5,000000%)		0,08	-0,00	0,09			2.249.336,33	0,33
NTN-B 150555 (5,030000%)		0,08	-0,00	0,09			2.244.235,71	0,32
NTN-B 150555 (5,060000%)		0,08	-0,00	0,09			2.239.161,59	0,32
NTN-B 150555 (5,315000%)		0,08	-0,00	0,09			2.227.305,75	0,32
NTN-B 150555 (5,370000%)		0,08	-0,00	0,09			2.228.222,29	0,32
NTN-B 150555 (5,420000%)		0,08	-0,00	0,09			2.226.071,63	0,32
NTN-B 150555 (5,520000%)		0,08	-0,00	0,09			2.217.188,81	0,32
NTN-B 150555 (5,831200%)		0,08	-0,00	0,09			11.505.072,05	1,66
NTN-B 150555 (5,860000%)		0,08	-0,00	0,09			2.157.259,01	0,31
NTN-B 150555 (5,897000%)		0,08	-0,00	0,09			5.181.126,33	0,75
NTN-B 150555 (5,927000%)		0,08	-0,00	0,09			2.073.325,82	0,30
NTN-B 150555 (5,950000%)		0,08	-0,00	0,09			16.917.877,49	2,44
NTN-B 150555 (6,140000%)		0,08	-0,00	0,09			9.302.140,29	1,34
NTN-B 150555 (6,261000%)		0,08	-0,00	0,09			8.375.950,17	1,21
NTN-B 150555 (6,268000%)		0,08	-0,00	0,09			7.204.750,60	1,04
NTN-B 150555 (6,400000%)		0,08	-0,00	0,09			5.266.566,39	0,76
NTN-B 150824 (5,345000%)		0,07	-0,00	0,08			2.222.028,30	0,32
NTN-B 150824 (5,450000%)		0,07	-0,00	0,08			2.254.968,48	0,33
NTN-B 150824 (5,912000%)		0,07	-0,00	0,08			2.214.733,21	0,32
NTN-B 150826 (5,009000%)		0,07	-0,00	0,08			2.251.767,69	0,33
NTN-B 150826 (5,130000%)		0,07	-0,00	0,08			2.254.221,52	0,33
NTN-B 150826 (5,190000%)		0,07	-0,00	0,08			2.255.467,01	0,33
NTN-B 150826 (5,490000%)		0,07	-0,00	0,08			2.261.605,91	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,710000%)		0,07	-0,00	0,08			3.312.980,10	0,48
NTN-B 150828 (4,850000%)		0,07	-0,00	0,08			2.265.883,83	0,33
NTN-B 150828 (5,125600%)		0,07	-0,00	0,08			2.259.745,91	0,33
NTN-B 150828 (5,240000%)		0,07	-0,00	0,08			2.263.087,18	0,33
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,07	-0,00	0,08			2.260.493,00	0,33
NTN-B 150828 (5,810000%)		0,07	-0,00	0,08			3.321.728,45	0,48
NTN-B 150830 (4,860000%)		0,07	-0,00	0,08			2.275.321,15	0,33
NTN-B 150830 (4,900000%)		0,07	-0,00	0,08			2.270.580,35	0,33
NTN-B 150830 (5,178300%)		0,07	-0,00	0,08			2.264.751,75	0,33
NTN-B 150830 (5,270000%)		0,07	-0,00	0,08			2.267.344,89	0,33
NTN-B 150830 (5,300000%)		0,07	-0,00	0,08			2.268.262,92	0,33
NTN-B 150830 (5,460000%)		0,07	-0,00	0,08			3.570.251,39	0,52
NTN-B 150830 (5,500000%)		0,08	-0,00	0,08			2.266.891,56	0,33
NTN-B 150830 (5,835000%)		0,08	-0,00	0,08			3.324.922,08	0,48
NTN-B 150840 (4,950000%)		0,08	-0,00	0,08			2.293.994,43	0,33
NTN-B 150840 (4,970000%)		0,08	-0,00	0,08			2.284.484,43	0,33
NTN-B 150840 (5,020000%)		0,08	-0,00	0,08			2.286.899,04	0,33
NTN-B 150840 (5,274000%)		0,08	-0,00	0,08			2.278.664,79	0,33
NTN-B 150840 (5,310000%)		0,08	-0,00	0,08			2.279.482,13	0,33
NTN-B 150840 (5,360000%)		0,08	-0,00	0,09			2.277.022,72	0,33
NTN-B 150840 (5,837000%)		0,08	-0,00	0,09			2.130.712,89	0,31
NTN-B 150840 (5,855000%)		0,08	-0,00	0,09			3.327.329,25	0,48
NTN-B 150840 (6,220000%)		0,08	-0,00	0,09			3.141.907,14	0,45
NTN-B 150850 (4,940000%)		0,08	-0,00	0,09			2.308.169,92	0,33
NTN-B 150850 (4,980000%)		0,08	-0,00	0,09			2.305.477,66	0,33
NTN-B 150850 (5,010000%)		0,08	-0,00	0,09			2.301.012,19	0,33
NTN-B 150850 (5,045000%)		0,08	-0,00	0,09			2.295.016,81	0,33
NTN-B 150850 (5,295500%)		0,08	-0,00	0,09			2.285.179,12	0,33
NTN-B 150850 (5,360000%)		0,08	-0,00	0,09			2.284.397,46	0,33
NTN-B 150850 (5,410000%)		0,08	-0,00	0,09			2.283.281,28	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,510000%)		0,08	-0,00	0,09			2.276.381,35	0,33
NTN-B 150850 (5,831200%)		0,08	-0,00	0,09			8.603.699,80	1,24
NTN-B 150850 (5,897000%)		0,08	-0,00	0,09			3.196.172,68	0,46
NTN-B 150850 (5,921000%)		0,08	-0,00	0,09			2.132.961,38	0,31
NTN-B 150850 (5,950000%)		0,08	-0,00	0,09			11.627.740,05	1,68
NTN-B 150850 (6,140000%)		0,08	-0,00	0,09			6.916.356,46	1,00
NTN-B 150850 (6,261000%)		0,08	-0,00	0,09			5.761.934,14	0,83
NTN-B 150850 (6,278000%)		0,08	-0,00	0,09			5.297.952,94	0,77
NTN-B 150850 (6,400000%)		0,08	-0,00	0,09			3.160.729,54	0,46
Sub-total	0,85	0,08	-0,00		0,11	0,99	311.451.862,78	45,01

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		2,20	0,04	0,03			21.870.881,56	3,16
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,34	0,06	0,04			21.894.467,67	3,16
Sub-total	4,01	2,76	0,11		0,61	3,33	43.765.349,23	6,32

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		2,37	0,00	2,37			5.120.238,00	0,74
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	-0,00	0,01			21.229.188,47	3,07
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,03	0,00	0,03			21.690.280,94	3,13
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,03	-0,00	0,03			19.675.157,99	2,84
Sub-total	0,11	0,18	0,00		0,28	0,93	67.714.865,40	9,79

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		0,18	0,00	0,18			5.285.602,03	0,76
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a		0,18	0,00	0,18			5.277.679,38	0,76
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a		0,18	0,00	0,18			5.279.551,19	0,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a		0,16	-0,00	0,17			5.637.381,25	0,81
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a		0,17	0,00	0,18			5.271.246,80	0,76
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a		0,18	-0,00	0,19			6.164.720,35	0,89
Sub-total	0,08	0,13	0,00		-0,75	0,83	32.916.181,00	4,76

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8,96	-0,00	8,96			33.142,59	0,00
Sub-total	27,80	8,96	-0,00		0,21	6,84	33.142,59	0,00

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	0,01			3.519.827,47	0,51
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,10	-0,00	0,09			6.103.771,08	0,88
Sub-total	0,10	0,06	-0,00		1,10	1,01	9.623.598,55	1,39

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,25%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA		8,64	0,04	4,79			4.418.591,30	0,64
META VALOR FI DE AÇÕES		10,44	0,03	4,85			2.300.555,34	0,33
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		10,41	0,10	5,49			7.838.481,54	1,13
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,35	0,06	3,61			5.668.689,72	0,82
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		6,98	0,20	2,89			24.812.428,90	3,59
OCCAM FIC FIA		6,76	0,24	1,40			27.878.631,31	4,03
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		8,01	0,06	3,93			6.733.799,08	0,97
INDIE FIC FIA		10,16	0,05	5,25			4.055.018,98	0,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TARPON GT 30 FIC FIA		8,64	0,10	5,07			10.482.018,28	1,51
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA		8,98	0,06	6,83			7.149.927,26	1,03
Sub-total	12,45	7,25	0,95		0,38	5,57	101.338.141,71	14,65

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,72%

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		3,86	0,01	8,22			7.817.479,58	1,13
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		6,33	0,16	6,33			20.150.671,96	2,91
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		6,29	0,26	5,47			33.582.098,48	4,85
Sub-total	7,73	5,58	0,43		0,48	4,59	61.550.250,02	8,90

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		0,07	-0,00	0,09			11.244.355,36	1,63
Sub-total	1,42	0,07	-0,00		-0,35	0,40	11.244.355,36	1,63

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,49%

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		8,34	0,16	6,94			17.125.134,43	2,47
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		14,15	0,02	13,24			2.102.028,57	0,30
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,36	-0,01	9,03			2.076.923,59	0,30
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,66	-0,00	8,85			2.492.125,93	0,36
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,36	0,01	9,35			2.961.288,73	0,43

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		6,66	0,00	7,29			5.550.105,58	0,80
Sub-total	7,23	6,09	0,18		0,53	4,76	32.307.606,83	4,67

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		6,00	0,06	9,02			20.001.309,86	2,89
Sub-total	11,76	6,00	0,06		0,14	2,51	20.001.309,86	2,89

(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 (%)

17. RELATÓRIO CENÁRIO MACROECONÔMICO

No mês de dezembro, no cenário internacional foi mais um mês com sinais positivos, refletindo a evolução positiva do cenário nos EUA, com indicações por parte do FED que o movimento de redução dos juros pode começar antes do previsto. Com isso, os índices de ações globais apresentaram retornos positivos, enquanto o dólar perdeu força em comparação às demais moedas. Diversos países, com destaque para os desenvolvidos, divulgaram quedas de inflação mais fortes do que o esperado por seus bancos centrais. Dessa forma, o cenário externo segue em direção construtiva, com a atividade econômica desacelerando, ainda que não haja indícios de algo mais acentuado, enquanto o mercado de trabalho ainda se mostra aquecido. Sinalizando que o controle inflacionário está evoluindo, mas ainda deverá ocorrer de maneira gradual. Nos EUA, os diretores do FED surpreenderam os mercados, ao revisar de forma relevante as suas projeções para a taxa básica de juros no curto/médio prazo, indicando três cortes na taxa básica ao longo de 2024 e reforçou a perspectiva de um cenário positivo para a economia americana. Já na China, os dados seguem na direção de estabilização do crescimento econômico, enquanto o governo se mostra mais ativo nas medidas de estímulos, mas ainda de forma equilibrada e não muito intensa. Isso aponta para uma trajetória mais construtiva para a economia chinesa. No entanto, ainda permanece um cenário de cautela com a trajetória econômica, por conta da fragilidade do setor imobiliário e da incerteza sobre a efetividade desses estímulos. 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 +4,70% e +4,42%, 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 +20,09% e +24,23%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +2,70% e +2,43%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +11,43% e +15,27% nos últimos 12 meses.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

No Brasil, as curvas de juros futuras cederam no mês, acompanhando o movimento de queda dos juros globais e a evolução positiva do cenário econômico nacional. A agenda legislativa apresentou uma evolução importante no último mês, com a aprovação da parte constitucional da reforma tributária e com a aprovação da MP 1185, peça importante no ajuste fiscal proposto pelo governo. Por fim, a atenção em torno da política fiscal prosseguirá. A inflação segue em um nível mais comportado, apresentando desaceleração das medidas de núcleo. Já, a atividade econômica começou a apresentar uma trajetória de desaceleração mais clara. Com isso, economia deverá continuar mais fraca, mas a ociosidade será menor do que a prevista. O Banco Central confirmou as expectativas na sua última reunião de 2023. Reduzindo a taxa Selic em 0,5%, para 11,75%, enquanto em seu comunicado indicou a continuidade deste ritmo de cortes nas primeiras reuniões de 2024, assim mantendo o processo de flexibilização monetária. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo o movimento dos índices globais. Apresentando um retorno positivo de +5,38% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo de +22,28% no acumulado nos últimos 12 meses.

18. AGENDA REALIZADA

9h00: Tricentésima nonagésima oitava (398ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros (CAIF) do Instituto de Previdência do Município de Jacareí (IPMJ), ocorrida em 14 de dezembro de 2023, tendo início às 9h30 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. Ausência justificada de José Ricardo Vinhas e ausência de Rafaela Carvalho dos Santos. Pautas da reunião: 1) Análise do relatório de investimentos de novembro de 2023; 2) Análise da carteira fechada de novembro de 2023; 3) Carteira Parcial 13/12/2023; 4) Credenciamentos; 5) Assuntos diversos.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Em dezembro 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 05/12/2023 foi realizado amortizações no montante de R\$ 2.094,21 (dois mil e noventa e quatro reais e vinte e um centavos), R\$ 423,05 (quatrocentos e vinte e três reais e cinco centavos) e R\$ 164,09 (cento e sessenta e quatro reais e nove centavos), totalizando R\$ 2.681,35 (dois mil e seiscentos e oitenta e um reais e trinta e cinco centavos) que foram aplicados no fundo SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI.

O total de amortizações já entregue é de R\$ 7.080.343,48 (sete milhões e oitenta mil e trezentos e quarenta e três reais e quarenta e oito centavos). O saldo em 29 de dezembro de 2023 é de R\$ 33.142,59 (trinta e três mil e cento e quarenta e dois reais e cinquenta e nove centavos).

20. Acompanhamento fundos estruturados**(FIP) KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA**

O Fundo KINEA PRIVATE EQUITY apresenta um valor total aplicado de R\$ 9.095.886,00 (nove milhões e noventa e cinco mil e oitocentos e oitenta e seis reais), e um rendimento acumulado de R\$ 2.148.469,36 (dois milhões e cento e quarenta e oito mil e quatrocentos e sessenta e nove reais e trinta e seis centavos).

O saldo acumulado em 29 de dezembro de 2023 é de R\$ 11.244.355,36 (onze milhões e duzentos e quarenta e quatro mil e trezentos e cinquenta e cinco reais e trinta e seis centavos) com um rendimento no mês de dezembro de R\$ 44.917,64 (quarenta e quatro mil e novecentos e dezessete reais e sessenta e quatro centavos).