



**LDB**  
EMPRESAS

**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**  
IPMJ - JANEIRO 2024



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**CENÁRIO MACROECONÔMICO**

MERCADOS INTERNACIONAIS: O cenário internacional, embora em janeiro os índices de ações globais tenham apresentado retornos positivos, o mês foi marcado pela resiliência da economia norte-americana e pelas discussões sobre o início do ciclo de corte de juros nos EUA. O que resultou na alta dos juros futuros e, conseqüentemente, no ganho de força do dólar em relação às demais moedas. Em linhas gerais, a inflação seguiu surpreendendo para baixo na maioria das economias, com crescimento moderado da atividade e resiliência do mercado de trabalho. Desta forma, ao mesmo tempo que os Bancos Centrais dos países desenvolvidos mostram confiança no processo de desinflação, a perspectiva positiva para a economia justifica uma comunicação mais cautelosa quanto ao início e a extensão de um ciclo de afrouxamento monetário. Especificamente nos EUA, embora, a inflação caminha em uma direção positiva, os sinais de atividade econômica aquecida ainda estão presentes. Dessa forma, ainda há discussão sobre a expectativa de quando se dará o início do movimento de redução dos juros. Por sua vez, a comunicação do FED continuou na direção de suavização, com foco mais claro no processo de redução dos juros, discutindo o momento do seu início e as condições necessárias para tal. O principal ponto destacado é a necessidade de convicção suficiente na convergência da inflação para a meta. Já na China, a deterioração do setor imobiliário prossegue, limitando a efetividade dos estímulos adotados pelo governo. O quadro de excesso de oferta e pressões deflacionárias está se intensificando e pode ter repercussões globais importantes. Assim, no mês de janeiro de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +0,53% e +1,59%, 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 +12,72% e +18,86%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +2,86% e +3,94%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +9,50% e +15,47% nos últimos 12 meses.

BRASIL: Localmente, as curvas de juros futuras aumentaram no mês, acompanhando o movimento observado dos juros globais, além de terem sido impactadas negativamente com o anúncio do plano Nova Indústria Brasil, que fez ressuscitar fantasmas do passado, quando o BNDES foi extensivamente usado para subsidiar projetos duvidosos com alto custo fiscal. A inflação continuou seguindo uma tendência positiva, com desaceleração das medidas de núcleo. Além disso, os números de atividade sugerem que o PIB ficou de lado ou recuou marginalmente no último trimestre ano, de forma compatível com a desaceleração econômica esperada. O estágio mais lento do processo de desinflação, o desconforto com a desancoragem das expectativas de mercado e o fato de suas projeções para 2024 e 2025 estarem acima da meta contribuem para uma atuação mais conservadora adotada autoridade monetária. O Banco Central confirmou as expectativas do mercado, dando continuidade no movimento de redução de juros. Assim, reduzindo a taxa Selic em 0,5%, para 11,25%, enquanto em seu comunicado indicou a continuidade deste ritmo de cortes de juros. O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo na direção oposta dos índices globais e sendo impactada pela curva de juros. Apresentando um retorno negativo de -4,79% no mês. Entretanto, o Ibovespa possui um comportamento positivo de +12,63% no acumulado nos últimos 12 meses.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

67,52%

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%)	0,29	0,06	1,01	1,01	2.215.149,68	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,29	0,06	1,04	1,04	1.084.100,66	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,680000%)	2,87	0,17	1,03	1,03	20.643.689,41	2,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,36	0,15	0,96	0,96	2.246.492,60	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,37	0,15	0,96	0,96	2.242.895,19	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,37	0,15	0,96	0,96	2.242.168,06	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,37	0,16	0,99	0,99	2.232.520,21	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,37	0,16	0,99	0,99	2.233.999,30	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,38	0,16	1,00	1,00	2.233.199,30	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,670000%)	2,86	0,18	1,03	1,03	1.546.217,10	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,39	0,17	1,04	1,04	2.087.993,29	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,39	0,18	1,04	1,04	3.267.884,52	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,44	0,21	0,97	0,97	2.263.536,22	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,44	0,21	0,97	0,97	2.260.791,60	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,44	0,21	0,97	0,97	2.256.724,18	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,285000%)	0,45	0,22	0,99	0,99	2.244.387,24	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,45	0,22	1,00	1,00	2.243.573,77	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,45	0,23	1,00	1,00	2.242.119,89	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,47	0,24	1,04	1,04	5.277.151,01	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,47	0,24	1,04	1,04	2.180.219,69	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	0,47	0,24	1,04	1,04	2.097.393,65	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,47	0,24	1,05	1,05	6.408.587,75	0,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,47	0,24	1,05	1,05	2.091.350,14	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	0,48	0,25	1,06	1,06	4.701.849,63	0,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,48	0,25	1,07	1,07	3.706.400,22	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,280000%)	0,49	0,25	1,08	1,08	3.120.988,07	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	0,49	0,25	1,09	1,09	2.127.558,18	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,000000%)	0,50	0,26	0,97	0,97	2.271.144,97	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,50	0,26	0,97	0,97	2.266.051,32	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,50	0,26	0,97	0,97	2.260.984,37	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,51	0,27	1,00	1,00	2.249.487,97	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,51	0,27	1,00	1,00	2.250.516,66	0,33
TESOURO	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,51	0,27	1,00	1,00	2.248.436,54	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,520000%)	0,52	0,27	1,01	1,01	2.239.651,41	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,53	0,28	1,04	1,04	11.624.614,68	1,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,53	0,28	1,04	1,04	2.179.727,27	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	0,53	0,28	1,04	1,04	5.235.246,91	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,53	0,28	1,05	1,05	2.095.034,56	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,53	0,28	1,05	1,05	17.095.353,59	2,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	0,54	0,29	1,06	1,06	9.401.188,31	1,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,54	0,29	1,07	1,07	8.465.976,21	1,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,268000%)	0,54	0,29	1,08	1,08	7.282.231,84	1,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	0,55	0,29	1,09	1,09	5.323.779,51	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,29	0,04	1,00	1,00	2.244.214,41	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,450000%)	0,29	0,04	1,01	1,01	2.277.682,18	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,29	0,04	1,05	1,05	2.237.896,89	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,30	0,07	0,97	0,97	2.273.616,05	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,30	0,07	0,98	0,98	2.276.322,87	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,30	0,07	0,99	0,99	2.277.694,45	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,30	0,08	1,01	1,01	2.284.462,54	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%)	0,30	0,08	1,03	1,03	3.347.068,61	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,31	0,09	0,96	0,96	2.287.566,45	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,31	0,09	0,98	0,98	2.281.895,18	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,31	0,09	0,99	0,99	2.285.483,55	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,31	0,09	0,99	0,99	2.282.920,74	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,31	0,10	1,04	1,04	3.356.186,70	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,33	0,12	0,96	0,96	2.297.113,67	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,33	0,12	0,96	0,96	2.292.404,13	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,33	0,12	0,98	0,98	2.287.048,50	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,33	0,12	0,99	0,99	2.289.841,67	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,300000%)	0,34	0,12	0,99	0,99	2.290.825,57	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,460000%)	2,85	0,13	1,01	1,01	3.606.244,22	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,34	0,13	1,01	1,01	2.289.818,79	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,835000%)	0,34	0,13	1,04	1,04	3.359.479,77	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,40	0,18	0,97	0,97	2.316.139,66	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,40	0,18	0,97	0,97	2.306.576,16	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,40	0,18	0,97	0,97	2.309.109,41	0,33
TESOURO	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,41	0,19	0,99	0,99	2.301.279,33	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,310000%)	0,41	0,19	1,00	1,00	2.302.176,15	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,41	0,19	1,00	1,00	2.299.785,07	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,43	0,21	1,04	1,04	2.152.863,60	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,43	0,21	1,04	1,04	3.361.969,10	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,44	0,22	1,07	1,07	3.175.571,28	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,47	0,24	0,96	0,96	2.330.431,26	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,47	0,24	0,97	0,97	2.327.791,97	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,47	0,24	0,97	0,97	2.323.341,15	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,48	0,24	0,97	0,97	2.317.354,24	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,48	0,25	0,99	0,99	2.307.901,10	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,49	0,25	1,00	1,00	2.307.235,61	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,49	0,25	1,00	1,00	2.306.202,52	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,510000%)	0,49	0,25	1,01	1,01	2.299.424,97	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,50	0,26	1,04	1,04	8.693.092,75	1,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	0,51	0,26	1,04	1,04	3.229.558,62	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,51	0,26	1,05	1,05	2.155.284,64	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,51	0,27	1,05	1,05	11.749.707,78	1,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	0,51	0,27	1,06	1,06	6.990.004,28	1,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,52	0,27	1,07	1,07	5.823.864,51	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,278000%)	3,07	0,27	1,08	1,08	5.354.972,15	0,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	0,52	0,28	1,09	1,09	3.195.065,34	0,46
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,44</b>	<b>0,22</b>	<b>1,03</b>	<b>1,03</b>	<b>314.650.856,27</b>	<b>45,63</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	4,15	0,20	-0,47	-0,47	21.769.126,32	3,16	5.008.664.499,36	0,43
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,51	0,28	-1,51	-1,51	21.563.149,39	3,13	1.616.605.994,98	1,33
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,18</b>	<b>0,24</b>	<b>-0,99</b>	<b>-0,99</b>	<b>43.332.275,71</b>	<b>6,28</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	8,88	0,23	1,33	1,33	5.188.355,50	0,75	232.072.505,38	2,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,04	0,97	0,97	11.430.047,20	1,66	16.400.080.186,89	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,05	1,01	1,01	21.908.643,75	3,18	5.587.152.012,51	0,39
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,05	1,04	1,04	26.095.331,05	3,78	2.799.993.446,09	0,93
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,49</b>	<b>0,06</b>	<b>1,03</b>	<b>1,03</b>	<b>64.622.377,50</b>	<b>9,37</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	0,69	0,06	1,13	1,13	5.345.291,93	0,78		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	0,71	0,22	1,29	1,29	5.345.597,15	0,78		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	0,64	0,05	1,11	1,11	5.338.262,40	0,77		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	9,25	-0,18	0,90	0,90	5.688.370,26	0,82		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	0,70	0,22	1,27	1,27	5.338.163,60	0,77		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 7,00% a.a	16,21	0,04	1,13	1,13	6.234.370,88	0,90		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>4,51</b>	<b>0,06</b>	<b>1,14</b>	<b>1,14</b>	<b>33.290.056,22</b>	<b>4,83</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	355,50	1,08	1,08	1,08	33.499,55	0,00	1.158.815,12	2,89
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>355,50</b>	<b>1,08</b>	<b>1,08</b>	<b>1,08</b>	<b>33.499,55</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	0,05	0,04	0,99	0,99	3.554.816,74	0,52	14.755.770.781,21	0,02
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,24	0,05	1,12	1,12	6.172.228,36	0,90	4.611.599.592,77	0,13
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>0,28</b>	<b>0,05</b>	<b>1,07</b>	<b>1,07</b>	<b>9.727.045,10</b>	<b>1,41</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,61</b>	<b>0,18</b>	<b>0,85</b>	<b>0,85</b>	<b>465.656.110,35</b>	<b>67,52</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

14,08%

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	21,88	0,92	-8,43	-8,43	4.046.040,89	0,59	170.127.295,80	2,38
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	21,20	1,04	-4,51	-4,51	2.196.852,95	0,32	181.775.436,47	1,21
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	19,84	1,45	-4,71	-4,71	7.469.447,35	1,08	223.008.224,56	3,35
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,33	0,43	-3,37	-3,37	5.477.733,12	0,79	1.385.702.652,77	0,40
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	16,37	0,80	-2,54	-2,54	24.181.749,30	3,51	656.392.735,97	3,68
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	15,37	0,38	-3,79	-3,79	26.821.226,64	3,89	860.013.686,86	3,12
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	18,45	0,56	-1,49	-1,49	6.633.446,30	0,96	483.893.890,15	1,37
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	20,95	0,85	-5,46	-5,46	3.833.778,34	0,56	360.366.393,04	1,06
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	18,96	3,30	-6,16	-6,16	9.836.656,14	1,43	876.894.794,02	1,12
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,50	0,34	-7,81	-7,81	6.591.816,24	0,96	249.514.908,26	2,64
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>15,87</b>	<b>0,92</b>	<b>-4,19</b>	<b>-4,19</b>	<b>97.088.747,27</b>	<b>14,08</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>15,87</b>	<b>0,92</b>	<b>-4,19</b>	<b>-4,19</b>	<b>97.088.747,27</b>	<b>14,08</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,72%

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	17,26	-1,79	2,38	2,38	17.532.413,72	2,54	244.319.238,90	7,18
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	30,11	-2,80	-4,25	-4,25	2.012.627,83	0,29	118.429.248,26	1,70
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,36	-1,16	-10,59	-10,59	1.856.942,25	0,27	33.506.997,97	5,54
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,11	-0,72	-0,10	-0,10	2.489.720,26	0,36	60.247.495,39	4,13
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,20	-1,16	4,04	4,04	3.080.954,16	0,45	709.646.976,36	0,43
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	15,12	-0,01	2,79	2,79	5.705.159,01	0,83	321.725.294,33	1,77
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>12,71</b>	<b>-1,37</b>	<b>1,15</b>	<b>1,15</b>	<b>32.677.817,23</b>	<b>4,74</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	13,44	-1,88	2,73	2,73	20.548.164,41	2,98	670.212.192,72	3,07
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>13,44</b>	<b>-1,88</b>	<b>2,73</b>	<b>2,73</b>	<b>20.548.164,41</b>	<b>2,98</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>11,82</b>	<b>-1,57</b>	<b>1,75</b>	<b>1,75</b>	<b>53.225.981,64</b>	<b>7,72</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,68%

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	13,99	0,86	-0,44	-0,44	7.783.407,00	1,13	52.223.389,94	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	12,73	-1,61	1,66	1,66	20.484.211,91	2,97	847.909.436,42	2,42
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	12,76	-1,62	1,72	1,72	34.160.639,21	4,95	542.323.947,05	6,30
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>11,18</b>	<b>-1,32</b>	<b>1,43</b>	<b>1,43</b>	<b>62.428.258,12</b>	<b>9,05</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	29,42	-0,16	-0,16	-0,16	11.226.056,44	1,63	358.111.151,88	3,13
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>29,42</b>	<b>-0,16</b>	<b>-0,16</b>	<b>-0,16</b>	<b>11.226.056,44</b>	<b>1,63</b>		

<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>11,25</b>	<b>-1,14</b>	<b>1,18</b>	<b>1,18</b>	<b>73.654.314,56</b>	<b>10,68</b>		
<b>Total</b>			<b>3,19</b>	<b>0,01</b>	<b>0,21</b>	<b>0,21</b>	<b>689.625.153,80</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	314.650.856,27	45,63	0,00	44,00	70,00	58,39	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	43.332.275,71	6,28	0,00	6,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	64.622.377,50	9,37	0,00	11,00	40,00	13,33	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	33.290.056,22	4,83	0,00	5,00	20,00	1,70	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	33.499,55	0,00	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	9.727.045,10	1,41	0,00	1,50	5,00	1,67	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>465.656.110,35</b>	<b>67,52</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	97.088.747,27	14,08	0,00	14,50	30,00	4,92	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>97.088.747,27</b>	<b>14,08</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	32.677.817,23	4,74	0,00	4,50	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	20.548.164,41	2,98	0,00	3,00	10,00	5,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>53.225.981,64</b>	<b>7,72</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	62.428.258,12	9,05	0,00	8,00	10,00	8,39	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	11.226.056,44	1,63	0,00	2,00	5,00	1,61	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>73.654.314,56</b>	<b>10,68</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>689.625.153,80</b>	<b>100,00</b>					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	1,03 106,25	1,03 106,25	2,73 97,13	4,92 81,55	10,62 82,53	3.198.993,49	3.198.993,49
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,99 -102,36	-0,99 -102,36	5,36 191,03	2,12 35,05	2,88 22,36	-433.073,52	-433.073,52
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,03 106,40	1,03 106,40	2,79 99,56	6,03 99,86	12,78 99,32	692.012,11	692.012,11
Artigo 7º IV % do CDI	1,14 117,50	1,14 117,50	2,76 98,26	5,16 85,50	11,74 91,24	373.875,22	373.875,22
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	1,08 111,41	1,08 111,41	-0,48 -17,06	614,01 10.167,89	861,32 6.691,27	356,96	356,96
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,07 111,20	1,07 111,20	3,20 113,86	6,94 114,97	13,77 106,98	103.446,55	103.446,55
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,19 0,60	-4,19 0,60	11,39 -1,52	3,01 -1,76	11,41 -1,21	-4.249.394,44	-4.249.394,44
Artigo 9º II % do CDI	1,15 118,54	1,15 118,54	17,13 610,40	6,57 108,79	16,63 129,16	370.210,40	370.210,40
Artigo 9º III % do CDI	2,73 282,83	2,73 282,83	11,88 423,23	10,53 174,36	17,61 136,77	546.854,55	546.854,55
Artigo 10º I % do CDI	1,43 147,56	1,43 147,56	15,01 534,98	8,35 138,20	25,58 198,70	878.008,10	878.008,10
Artigo 10º II % do CDI	-0,16 -16,83	-0,16 -16,83	1,24 44,05	0,01 0,19	0,65 5,02	-18.298,92	-18.298,92
<b>JACAREÍ (Total)</b>						<b>1.462.990,50</b>	<b>1.462.990,50</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%)	2.193.007,46	0,00	0,00	0,00	2.215.149,68	22.142,22	22.142,22
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.072.970,80	0,00	0,00	0,00	1.084.100,66	11.129,86	11.129,86
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.433.974,81	0,00	0,00	0,00	20.643.689,41	209.714,60	209.714,60
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.225.180,29	0,00	0,00	0,00	2.246.492,60	21.312,31	21.312,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.221.580,09	0,00	0,00	0,00	2.242.895,19	21.315,10	21.315,10
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.220.803,35	0,00	0,00	0,00	2.242.168,06	21.364,71	21.364,71
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.210.721,38	0,00	0,00	0,00	2.232.520,21	21.798,83	21.798,83
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.212.015,41	0,00	0,00	0,00	2.233.999,30	21.983,89	21.983,89
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.211.166,37	0,00	0,00	0,00	2.233.199,30	22.032,93	22.032,93
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.530.521,76	0,00	0,00	0,00	1.546.217,10	15.695,34	15.695,34
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.066.508,88	0,00	0,00	0,00	2.087.993,29	21.484,41	21.484,41
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.234.214,85	0,00	0,00	0,00	3.267.884,52	33.669,67	33.669,67
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.241.856,80	0,00	0,00	0,00	2.263.536,22	21.679,42	21.679,42
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.239.121,05	0,00	0,00	0,00	2.260.791,60	21.670,55	21.670,55
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.234.999,44	0,00	0,00	0,00	2.256.724,18	21.724,74	21.724,74
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.222.310,67	0,00	0,00	0,00	2.244.387,24	22.076,57	22.076,57
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.221.402,79	0,00	0,00	0,00	2.243.573,77	22.170,98	22.170,98
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.219.888,58	0,00	0,00	0,00	2.242.119,89	22.231,31	22.231,31
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.222.881,13	0,00	0,00	0,00	5.277.151,01	54.269,88	54.269,88
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.157.747,75	0,00	0,00	0,00	2.180.219,69	22.471,94	22.471,94
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.075.712,79	0,00	0,00	0,00	2.097.393,65	21.680,86	21.680,86
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.342.244,70	0,00	0,00	0,00	6.408.587,75	66.343,05	66.343,05
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.069.687,57	0,00	0,00	0,00	2.091.350,14	21.662,57	21.662,57
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.652.310,77	0,00	0,00	0,00	4.701.849,63	49.538,86	49.538,86
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.667.002,21	0,00	0,00	0,00	3.706.400,22	39.398,01	39.398,01
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.087.752,44	0,00	0,00	0,00	3.120.988,07	33.235,63	33.235,63
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.104.692,10	0,00	0,00	0,00	2.127.558,18	22.866,08	22.866,08
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.249.336,33	0,00	0,00	0,00	2.271.144,97	21.808,64	21.808,64
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.244.235,71	0,00	0,00	0,00	2.266.051,32	21.815,61	21.815,61
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.239.161,59	0,00	0,00	0,00	2.260.984,37	21.822,78	21.822,78
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.227.305,75	0,00	0,00	0,00	2.249.487,97	22.182,22	22.182,22
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.228.222,29	0,00	0,00	0,00	2.250.516,66	22.294,37	22.294,37
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.226.071,63	0,00	0,00	0,00	2.248.436,54	22.364,91	22.364,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.217.188,81	0,00	0,00	0,00	2.239.651,41	22.462,60	22.462,60
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.505.072,05	0,00	0,00	0,00	11.624.614,68	119.542,63	119.542,63
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.157.259,01	0,00	0,00	0,00	2.179.727,27	22.468,26	22.468,26
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.181.126,33	0,00	0,00	0,00	5.235.246,91	54.120,58	54.120,58
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.073.325,82	0,00	0,00	0,00	2.095.034,56	21.708,74	21.708,74
NTN-B 150555 (5,950000%)	16.917.877,49	0,00	0,00	0,00	17.095.353,59	177.476,10	177.476,10
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.302.140,29	0,00	0,00	0,00	9.401.188,31	99.048,02	99.048,02
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.375.950,17	0,00	0,00	0,00	8.465.976,21	90.026,04	90.026,04
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.204.750,60	0,00	0,00	0,00	7.282.231,84	77.481,24	77.481,24
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.266.566,39	0,00	0,00	0,00	5.323.779,51	57.213,12	57.213,12
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.222.028,30	0,00	0,00	0,00	2.244.214,41	22.186,11	22.186,11
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.254.968,48	0,00	0,00	0,00	2.277.682,18	22.713,70	22.713,70
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.214.733,21	0,00	0,00	0,00	2.237.896,89	23.163,68	23.163,68
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.251.767,69	0,00	0,00	0,00	2.273.616,05	21.848,36	21.848,36
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.254.221,52	0,00	0,00	0,00	2.276.322,87	22.101,35	22.101,35
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.255.467,01	0,00	0,00	0,00	2.277.694,45	22.227,44	22.227,44
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.261.605,91	0,00	0,00	0,00	2.284.462,54	22.856,63	22.856,63
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.312.980,10	0,00	0,00	0,00	3.347.068,61	34.088,51	34.088,51
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.265.883,83	0,00	0,00	0,00	2.287.566,45	21.682,62	21.682,62
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.259.745,91	0,00	0,00	0,00	2.281.895,18	22.149,27	22.149,27
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.263.087,18	0,00	0,00	0,00	2.285.483,55	22.396,37	22.396,37
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.260.493,00	0,00	0,00	0,00	2.282.920,74	22.427,74	22.427,74
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.321.728,45	0,00	0,00	0,00	3.356.186,70	34.458,25	34.458,25
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.275.321,15	0,00	0,00	0,00	2.297.113,67	21.792,52	21.792,52
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.270.580,35	0,00	0,00	0,00	2.292.404,13	21.823,78	21.823,78
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.264.751,75	0,00	0,00	0,00	2.287.048,50	22.296,75	22.296,75
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.267.344,89	0,00	0,00	0,00	2.289.841,67	22.496,78	22.496,78
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.268.262,92	0,00	0,00	0,00	2.290.825,57	22.562,65	22.562,65
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.570.251,39	0,00	0,00	0,00	3.606.244,22	35.992,83	35.992,83



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.266.891,56	0,00	0,00	0,00	2.289.818,79	22.927,23	22.927,23
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.324.922,08	0,00	0,00	0,00	3.359.479,77	34.557,69	34.557,69
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.293.994,43	0,00	0,00	0,00	2.316.139,66	22.145,23	22.145,23
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.284.484,43	0,00	0,00	0,00	2.306.576,16	22.091,73	22.091,73
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.286.899,04	0,00	0,00	0,00	2.309.109,41	22.210,37	22.210,37
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.278.664,79	0,00	0,00	0,00	2.301.279,33	22.614,54	22.614,54
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.279.482,13	0,00	0,00	0,00	2.302.176,15	22.694,02	22.694,02
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.277.022,72	0,00	0,00	0,00	2.299.785,07	22.762,35	22.762,35
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.130.712,89	0,00	0,00	0,00	2.152.863,60	22.150,71	22.150,71
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.327.329,25	0,00	0,00	0,00	3.361.969,10	34.639,85	34.639,85
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.141.907,14	0,00	0,00	0,00	3.175.571,28	33.664,14	33.664,14
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.308.169,92	0,00	0,00	0,00	2.330.431,26	22.261,34	22.261,34
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.305.477,66	0,00	0,00	0,00	2.327.791,97	22.314,31	22.314,31
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.301.012,19	0,00	0,00	0,00	2.323.341,15	22.328,96	22.328,96
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.295.016,81	0,00	0,00	0,00	2.317.354,24	22.337,43	22.337,43
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.285.179,12	0,00	0,00	0,00	2.307.901,10	22.721,98	22.721,98
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.284.397,46	0,00	0,00	0,00	2.307.235,61	22.838,15	22.838,15
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.283.281,28	0,00	0,00	0,00	2.306.202,52	22.921,24	22.921,24
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.276.381,35	0,00	0,00	0,00	2.299.424,97	23.043,62	23.043,62
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.603.699,80	0,00	0,00	0,00	8.693.092,75	89.392,95	89.392,95
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.196.172,68	0,00	0,00	0,00	3.229.558,62	33.385,94	33.385,94
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.132.961,38	0,00	0,00	0,00	2.155.284,64	22.323,26	22.323,26
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.627.740,05	0,00	0,00	0,00	11.749.707,78	121.967,73	121.967,73
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.916.356,46	0,00	0,00	0,00	6.990.004,28	73.647,82	73.647,82
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.761.934,14	0,00	0,00	0,00	5.823.864,51	61.930,37	61.930,37
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.297.952,94	0,00	0,00	0,00	5.354.972,15	57.019,21	57.019,21
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.160.729,54	0,00	0,00	0,00	3.195.065,34	34.335,80	34.335,80
	311.451.862,78	0,00	0,00	0,00	314.650.856,27	3.198.993,49	

**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	21.894.467,67	0,00	0,00	0,00	21.563.149,39	-331.318,28	-331.318,28
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.870.881,56	0,00	0,00	0,00	21.769.126,32	-101.755,24	-101.755,24
	43.765.349,23	0,00	0,00	0,00	43.332.275,71	-433.073,52	

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	21.229.188,47	0,00	-10.000.000,00	0,00	11.430.047,20	200.858,73	200.858,73
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	21.690.280,94	0,00	0,00	0,00	21.908.643,75	218.362,81	218.362,81
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5.120.238,00	0,00	0,00	0,00	5.188.355,50	68.117,50	68.117,50
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	19.675.157,99	15.371.500,00	-9.156.000,01	0,00	26.095.331,05	204.673,07	204.673,07
	67.714.865,40	15.371.500,00	-19.156.000,01	0,00	64.622.377,50	692.012,11	

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	5.279.551,19	0,00	0,00	0,00	5.338.262,40	58.711,21	58.711,21
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	5.285.602,03	0,00	0,00	0,00	5.345.291,93	59.689,90	59.689,90
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a	6.164.720,35	0,00	0,00	0,00	6.234.370,88	69.650,53	69.650,53
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	5.271.246,80	0,00	0,00	0,00	5.338.163,60	66.916,80	66.916,80
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	5.277.679,38	0,00	0,00	0,00	5.345.597,15	67.917,77	67.917,77
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.637.381,25	0,00	0,00	0,00	5.688.370,26	50.989,01	50.989,01
	32.916.181,00	0,00	0,00	0,00	33.290.056,22	373.875,22	

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	33.142,59	0,00	0,00	0,00	33.499,55	356,96	356,96
	33.142,59	0,00	0,00	0,00	33.499,55	356,96	

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	3.519.827,47	0,00	0,00	0,00	3.554.816,74	34.989,27	34.989,27
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	6.103.771,08	0,00	0,00	0,00	6.172.228,36	68.457,28	68.457,28
	9.623.598,55	0,00	0,00	0,00	9.727.045,10	103.446,55	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	7.838.481,54	0,00	0,00	0,00	7.469.447,35	-369.034,19	-369.034,19
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.668.689,72	0,00	0,00	0,00	5.477.733,12	-190.956,60	-190.956,60
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	6.733.799,08	0,00	0,00	0,00	6.633.446,30	-100.352,78	-100.352,78
INDIE FIC FIA	4.055.018,98	0,00	0,00	0,00	3.833.778,34	-221.240,64	-221.240,64
META VALOR FI DE AÇÕES	2.300.555,34	0,00	0,00	0,00	2.196.852,95	-103.702,39	-103.702,39
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	24.812.428,90	0,00	0,00	0,00	24.181.749,30	-630.679,60	-630.679,60
OCCAM FIC FIA	27.878.631,31	0,00	0,00	0,00	26.821.226,64	-1.057.404,67	-1.057.404,67
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	4.418.591,30	0,00	0,00	0,00	4.046.040,89	-372.550,41	-372.550,41
TARPON GT 30 FIC FIA	10.482.018,28	0,00	0,00	0,00	9.836.656,14	-645.362,14	-645.362,14
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	7.149.927,26	0,00	0,00	0,00	6.591.816,24	-558.111,02	-558.111,02
	101.338.141,71	0,00	0,00	0,00	97.088.747,27	-4.249.394,44	

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	17.125.134,43	0,00	0,00	0,00	17.532.413,72	407.279,29	407.279,29
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	2.102.028,57	0,00	0,00	0,00	2.012.627,83	-89.400,74	-89.400,74
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.076.923,59	0,00	0,00	0,00	1.856.942,25	-219.981,34	-219.981,34
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.492.125,93	0,00	0,00	0,00	2.489.720,26	-2.405,67	-2.405,67
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.961.288,73	0,00	0,00	0,00	3.080.954,16	119.665,43	119.665,43
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	5.550.105,58	0,00	0,00	0,00	5.705.159,01	155.053,43	155.053,43

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	32.307.606,83	0,00	0,00	0,00	32.677.817,23	370.210,40	

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	20.001.309,86	0,00	0,00	0,00	20.548.164,41	546.854,55	546.854,55
	20.001.309,86	0,00	0,00	0,00	20.548.164,41	546.854,55	

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	33.582.098,48	0,00	0,00	0,00	34.160.639,21	578.540,73	578.540,73
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	7.817.479,58	0,00	0,00	0,00	7.783.407,00	-34.072,58	-34.072,58
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	20.150.671,96	0,00	0,00	0,00	20.484.211,91	333.539,95	333.539,95
	61.550.250,02	0,00	0,00	0,00	62.428.258,12	878.008,10	

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	11.244.355,36	0,00	0,00	0,00	11.226.056,44	-18.298,92	-18.298,92
	11.244.355,36	0,00	0,00	0,00	11.226.056,44	-18.298,92	

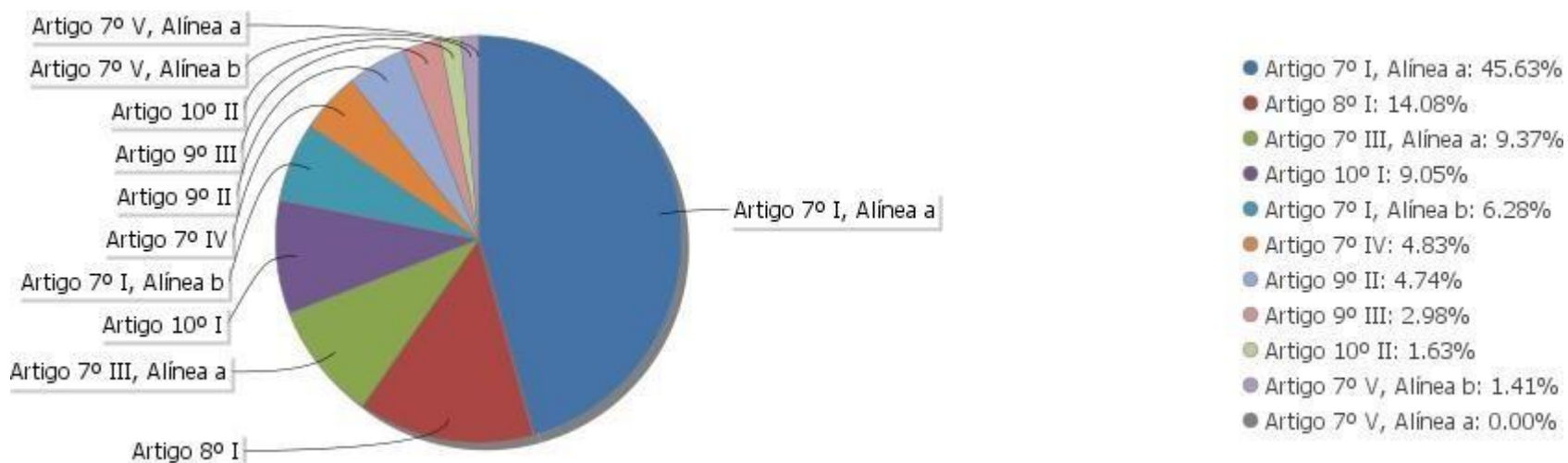
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

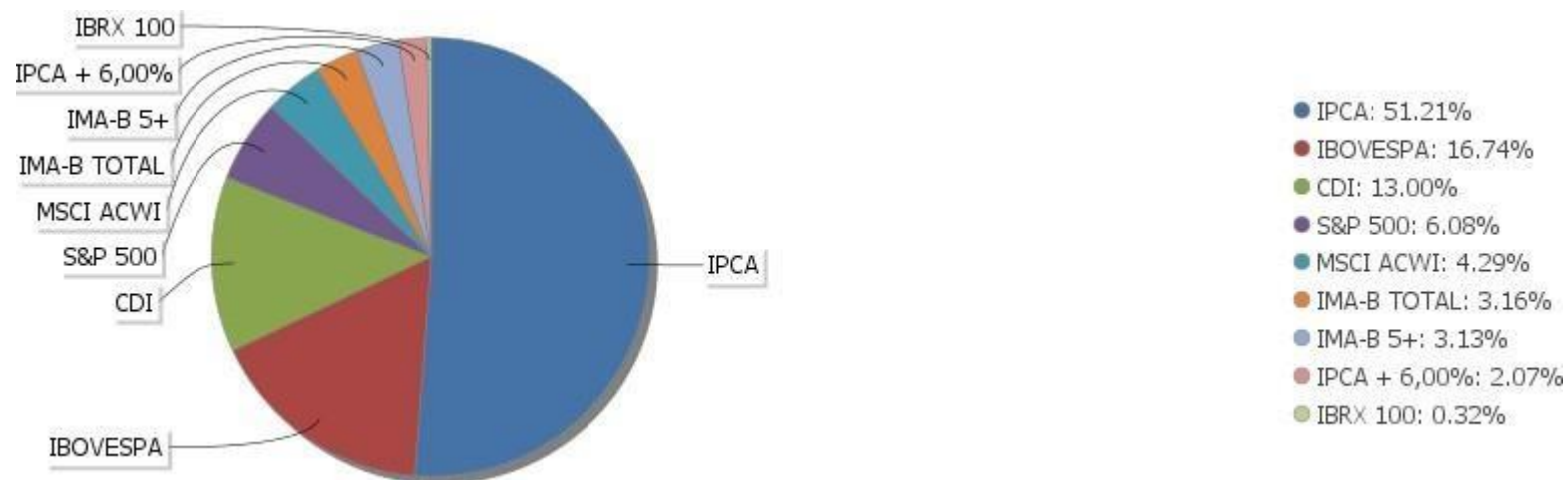
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	264.668.609,06	38,38		264.668.609,06	38,38	
de 31 dias a 365 dias	67.361.013,81	9,77		332.029.622,87	48,15	
acima de 365 dias	357.595.530,95	51,85		689.625.153,80	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

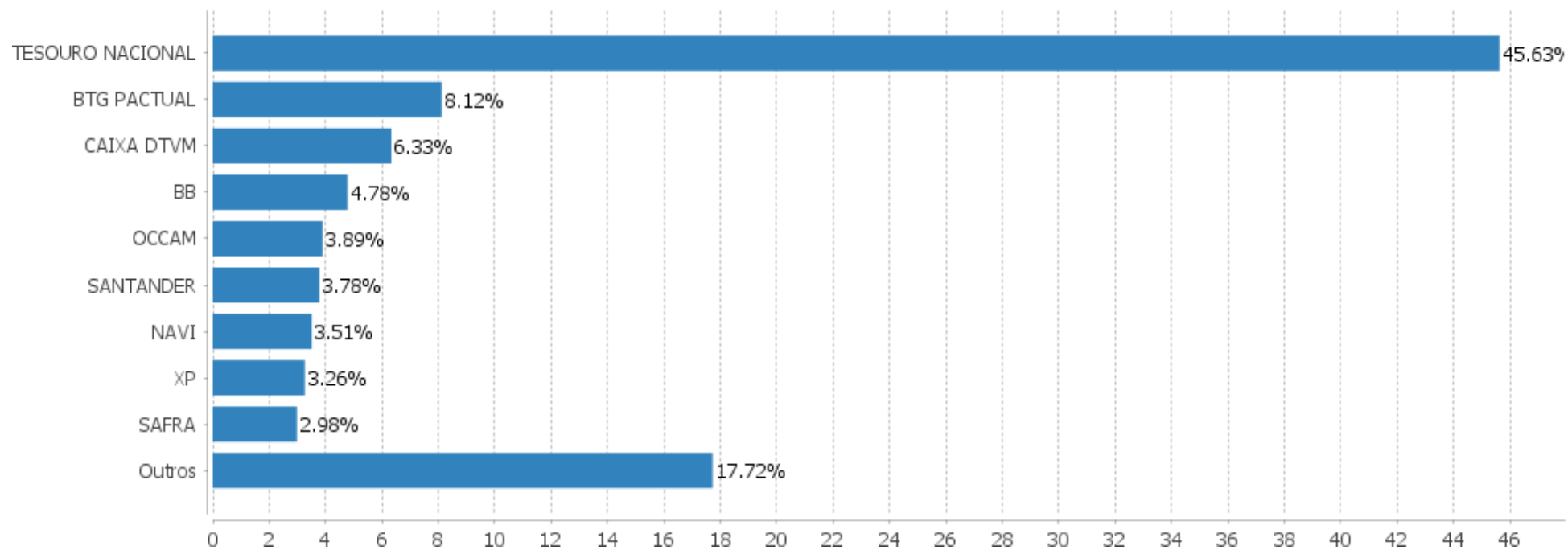


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,21												0,21
IPCA + 5,11%	0,86												0,86
p.p. indexador	-0,65												-0,65
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	40,00	03 meses	5,90	2,51	3,39	3,18
Meses abaixo - Meta Atuarial	15	60,00	06 meses	5,10	4,58	0,52	3,24
			12 meses	12,43	9,78	2,65	3,19
			24 meses	19,11	21,76	-2,65	4,45
Maior rentabilidade da Carteira	3,32	2023-11	Desde 31/12/2021	18,67	22,90	-4,23	4,51
Menor rentabilidade da Carteira	-1,97	2022-06					



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Evolução

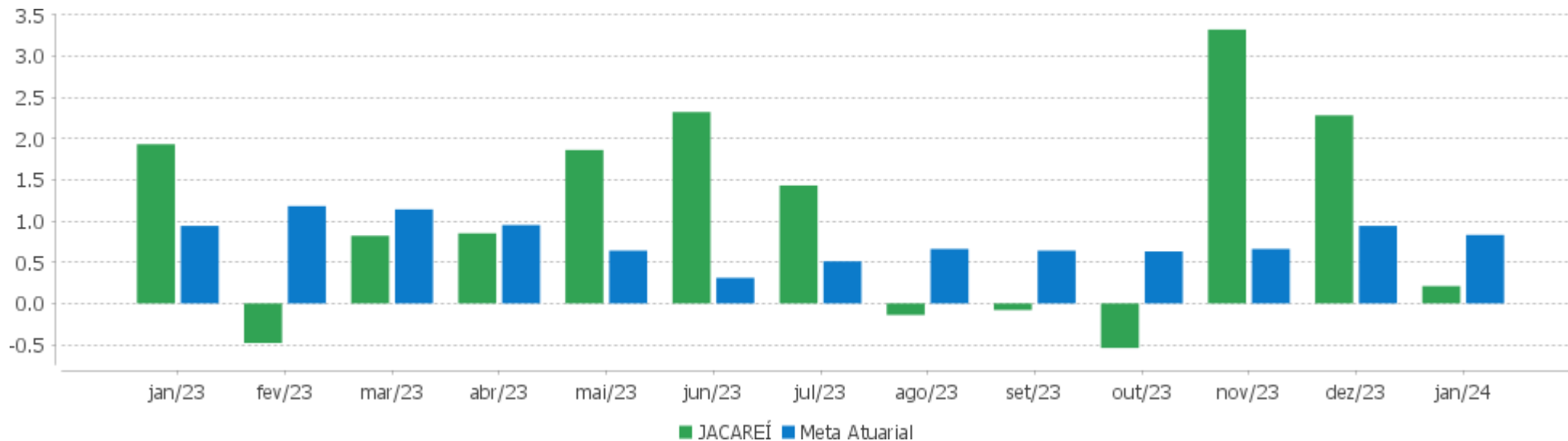


## Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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.	1,13 0,71	1,13 0,71	2,78 1,51	5,22 3,22			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a Var. IPCA p.p.	1,29 0,87	1,29 0,87	2,86 1,59	5,37 3,36			
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a Var. IPCA p.p.	1,11 0,69	1,11 0,69	2,75 1,48	5,18 3,17			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,90 0,48	0,90 0,48	2,51 1,24	4,58 2,57	11,82 7,31		
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a Var. IPCA p.p.	1,27 0,85	1,27 0,85	2,81 1,54	5,27 3,26			
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	1,13 0,71	1,13 0,71	2,85 1,59	5,37 3,37	11,78 7,27		
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,12 116,02	1,12 116,02	3,37 120,17	7,36 121,80	14,44 112,15	29,03 106,21	38,13 113,13
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,99 102,83	0,99 102,83	2,89 102,95	6,23 103,23	13,20 102,53	28,50 104,28	36,18 107,37
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,64	1,06 0,64	2,89 1,62	5,20 3,20	11,15 6,64	17,65 7,11	
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,83 1,56	5,08 3,07	10,89 6,39	17,32 6,78	
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,56	0,98 0,56	2,47 1,20	4,52 2,51	9,91 5,40	22,25 11,71	
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,59	1,01 0,59	2,52 1,25	4,66 2,65	10,24 5,73	23,03 12,49	
NTN-B 150533 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,67 1,40	4,86 2,86	7,47 2,96	13,53 2,99	
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,84 1,57	5,11 3,10	10,95 6,44	24,37 13,83	
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,79 1,53	5,03 3,03	10,83 6,32	24,13 13,59	
NTN-B 150545 (5,915000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,81 1,54	5,06 3,06	10,89 6,38	24,26 13,72	
NTN-B 150850 (5,831200%)	1,04	1,04	2,81	5,04	10,82	24,09	

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.	0,62	0,62	1,54	3,04	6,32	13,55	
NTN-B 150826 (5,190000%)	0,99	0,99	2,46	4,53	9,96	22,38	
Var. IPCA p.p.	0,57	0,57	1,20	2,53	5,45	11,84	
NTN-B 150840 (5,837000%)	1,04	1,04	2,75	4,99	10,77	24,04	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,49	2,98	6,26	13,50	
NTN-B 150830 (5,270000%)	0,99	0,99	2,53	4,62	10,09	22,62	
Var. IPCA p.p.	0,57	0,57	1,27	2,62	5,59	12,08	
NTN-B 150545 (4,970000%)	0,97	0,97	2,55	4,57	9,88	22,04	
Var. IPCA p.p.	0,55	0,55	1,29	2,56	5,38	11,50	
NTN-B 150840 (4,950000%)	0,97	0,97	2,52	4,53	9,83	21,95	
Var. IPCA p.p.	0,55	0,55	1,25	2,52	5,32	11,41	
NTN-B 150850 (4,980000%)	0,97	0,97	2,58	4,60	9,92	22,09	
Var. IPCA p.p.	0,55	0,55	1,32	2,59	5,41	11,55	
NTN-B 150850 (5,360000%)	1,00	1,00	2,68	4,80	10,32	22,98	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,42	2,79	5,82	12,44	
NTN-B 150555 (5,927000%)	1,05	1,05	2,85	5,11	10,94	24,34	
Var. IPCA p.p.	0,63	0,63	1,59	3,11	6,44	13,80	
NTN-B 150545 (5,922000%)	1,05	1,05	2,81	5,07	10,89	24,28	
Var. IPCA p.p.	0,63	0,63	1,54	3,06	6,39	13,74	
NTN-B 150535 (4,910000%)	0,96	0,96	2,48	4,47	9,75	21,83	
Var. IPCA p.p.	0,54	0,54	1,21	2,47	5,25	11,28	
NTN-B 150555 (5,370000%)	1,00	1,00	2,70	4,82	10,35	23,03	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,44	2,82	5,85	12,49	
NTN-B 150840 (5,020000%)	0,97	0,97	2,54	4,56	9,90	22,12	
Var. IPCA p.p.	0,55	0,55	1,27	2,56	5,40	11,58	
NTN-B 150850 (4,940000%)	0,96	0,96	2,57	4,58	9,88	22,00	
Var. IPCA p.p.	0,54	0,54	1,31	2,57	5,37	11,46	
NTN-B 150826 (5,490000%)	1,01	1,01	2,54	4,68	10,27	23,07	
Var. IPCA p.p.	0,59	0,59	1,27	2,68	5,76	12,53	
NTN-B 150545 (6,280000%)	1,08	1,08	2,90	5,25	11,27	17,83	
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,64	3,25	6,77	7,29	
NTN-B 150840 (4,970000%)	0,97	0,97	2,52	4,54	9,85	22,00	
Var. IPCA p.p.	0,55	0,55	1,26	2,53	5,34	11,46	
NTN-B 150830 (5,460000%)	1,01	1,01	2,58	4,72	7,22	13,10	
Var. IPCA p.p.	0,59	0,59	1,32	2,71	2,72	2,56	
NTN-B 150850 (6,261000%)	1,07	1,07	2,92	5,27	11,28	25,11	

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.	0,65	0,65	1,66	3,26	6,77	14,57	
NTN-B 150535 (5,670000%)	1,03	1,03	2,68	4,87	7,48	13,56	
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,41	2,86	2,97	3,01	
NTN-B 150555 (5,000000%)	0,97	0,97	2,61	4,63	9,96	22,16	
Var. IPCA p.p.	0,55	0,55	1,34	2,62	5,45	11,62	
NTN-B 150535 (5,320000%)	1,00	1,00	2,59	4,69	10,19	22,78	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,32	2,68	5,68	12,24	
NTN-B 150850 (5,010000%)	0,97	0,97	2,59	4,61	9,95	22,16	
Var. IPCA p.p.	0,55	0,55	1,32	2,61	5,44	11,62	
NTN-B 150545 (6,256000%)	1,07	1,07	2,90	5,24	11,25	25,07	
Var. IPCA p.p.	0,65	0,65	1,63	3,23	6,74	14,53	
NTN-B 150555 (6,261000%)	1,07	1,07	2,94	5,28	11,30	25,13	
Var. IPCA p.p.	0,65	0,65	1,67	3,28	6,79	14,59	
NTN-B 150555 (5,520000%)	1,01	1,01	2,74	4,90	10,51	23,38	
Var. IPCA p.p.	0,59	0,59	1,48	2,89	6,01	12,84	
NTN-B 150555 (5,860000%)	1,04	1,04	2,83	5,08	10,87	24,18	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,57	3,07	6,37	13,64	
NTN-B 150545 (5,380000%)	1,00	1,00	2,66	4,78	10,32	23,00	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,40	2,78	5,81	12,46	
NTN-B 150826 (5,009000%)	0,97	0,97	2,42	4,44	9,77	21,96	
Var. IPCA p.p.	0,55	0,55	1,16	2,43	5,26	11,42	
NTN-B 150545 (6,400000%)	1,09	1,09	2,93	5,32	11,40	18,00	
Var. IPCA p.p.	0,67	0,67	1,67	3,31	6,89	7,46	
NTN-B 150555 (5,831200%)	1,04	1,04	2,83	5,06	10,84	24,11	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,56	3,06	6,34	13,57	
NTN-B 150535 (5,855000%)	1,04	1,04	2,72	4,96	10,75	24,04	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,46	2,96	6,24	13,50	
NTN-B 150828 (4,850000%)	0,96	0,96	2,40	4,38	9,62	21,61	
Var. IPCA p.p.	0,54	0,54	1,13	2,37	5,11	11,07	
NTN-B 150545 (5,831000%)	1,04	1,04	2,78	5,02	10,80	24,06	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,52	3,01	6,29	13,52	
NTN-B 150555 (6,400000%)	1,09	1,09	2,97	5,36	11,44	17,99	
Var. IPCA p.p.	0,67	0,67	1,71	3,35	6,94	7,45	
NTN-B 150828 (5,240000%)	0,99	0,99	2,49	4,58	10,03	22,51	
Var. IPCA p.p.	0,57	0,57	1,23	2,57	5,52	11,97	
NTN-B 150545 (5,340000%)	1,00	1,00	2,65	4,76	10,28	22,91	

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.	0,58	0,58	1,39	2,76	5,77	12,36	
NTN-B 150850 (5,921000%)	1,05	1,05	2,83	5,09	10,92	24,31	
Var. IPCA p.p.	0,63	0,63	1,57	3,08	6,41	13,76	
NTN-B 150555 (6,268000%)	1,08	1,08	2,94	5,29	11,30	17,83	
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,67	3,28	6,80	7,28	
NTN-B 150535 (4,860000%)	0,96	0,96	2,46	4,45	9,70	21,71	
Var. IPCA p.p.	0,54	0,54	1,20	2,44	5,19	11,17	
NTN-B 150826 (5,710000%)	1,03	1,03	2,59	4,79	10,50	23,59	
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,33	2,79	5,99	13,05	
NTN-B 150828 (5,270000%)	0,99	0,99	2,50	4,59	10,06	22,58	
Var. IPCA p.p.	0,57	0,57	1,24	2,58	5,55	12,04	
NTN-B 150555 (6,140000%)	1,06	1,06	2,91	5,22	11,17	21,20	
Var. IPCA p.p.	0,64	0,64	1,64	3,22	6,66	10,66	
NTN-B 150535 (5,290000%)	0,99	0,99	2,58	4,67	10,15	22,71	
Var. IPCA p.p.	0,57	0,57	1,31	2,67	5,65	12,17	
NTN-B 150830 (5,835000%)	1,04	1,04	2,68	4,91	10,68	23,94	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,41	2,91	6,18	13,40	
NTN-B 150535 (5,837000%)	1,04	1,04	2,72	4,96	10,73	24,00	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,45	2,95	6,23	13,46	
NTN-B 150555 (5,315000%)	1,00	1,00	2,69	4,79	10,29	22,90	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,42	2,79	5,79	12,36	
NTN-B 150830 (5,300000%)	0,99	0,99	2,54	4,64	10,12	22,69	
Var. IPCA p.p.	0,57	0,57	1,28	2,63	5,62	12,15	
NTN-B 150545 (5,285000%)	0,99	0,99	2,64	4,73	10,22	22,78	
Var. IPCA p.p.	0,57	0,57	1,37	2,73	5,71	12,24	
NTN-B 150830 (5,500000%)	1,01	1,01	2,59	4,74	10,33	23,16	
Var. IPCA p.p.	0,59	0,59	1,33	2,73	5,83	12,62	
NTN-B 150824 (5,450000%)	1,01	1,01	2,49	4,62	10,18	22,93	
Var. IPCA p.p.	0,59	0,59	1,22	2,62	5,68	12,39	
NTN-B 150830 (5,178300%)	0,98	0,98	2,51	4,57	10,00	22,41	
Var. IPCA p.p.	0,56	0,56	1,24	2,57	5,49	11,86	
NTN-B 150545 (5,897000%)	1,04	1,04	2,80	5,05	10,87	20,70	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,54	3,05	6,36	10,16	
NTN-B 150545 (5,030000%)	0,97	0,97	2,57	4,60	9,95	22,18	
Var. IPCA p.p.	0,55	0,55	1,31	2,59	5,44	11,64	
NTN-B 150850 (6,400000%)	1,09	1,09	2,96	5,34	11,43	17,99	

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.	0,67	0,67	1,69	3,33	6,92	7,45	
NTN-B 150824 (5,912000%)	1,05	1,05	2,60	4,85	10,66	24,01	
Var. IPCA p.p.	0,63	0,63	1,33	2,85	6,15	13,47	
NTN-B 150850 (5,045000%)	0,97	0,97	2,60	4,63	9,99	22,24	
Var. IPCA p.p.	0,55	0,55	1,33	2,63	5,48	11,70	
NTN-B 150555 (5,030000%)	0,97	0,97	2,61	4,64	9,99	22,23	
Var. IPCA p.p.	0,55	0,55	1,35	2,64	5,48	11,69	
NTN-B 150840 (5,274000%)	0,99	0,99	2,60	4,70	10,17	22,71	
Var. IPCA p.p.	0,57	0,57	1,34	2,69	5,66	12,17	
NTN-B 150826 (5,130000%)	0,98	0,98	2,45	4,50	9,89	22,24	
Var. IPCA p.p.	0,56	0,56	1,18	2,50	5,39	11,70	
NTN-B 150840 (5,360000%)	1,00	1,00	2,63	4,74	10,26	22,92	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,36	2,73	5,76	12,37	
NTN-B 150840 (5,855000%)	1,04	1,04	2,76	5,00	10,79	24,08	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,49	2,99	6,28	13,54	
NTN-B 150850 (5,410000%)	1,00	1,00	2,70	4,82	10,38	23,10	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,43	2,82	5,87	12,56	
NTN-B 150545 (4,980000%)	0,97	0,97	2,56	4,57	9,89	22,06	
Var. IPCA p.p.	0,55	0,55	1,29	2,57	5,39	11,52	
NTN-B 150830 (4,860000%)	0,96	0,96	2,43	4,41	9,66	21,66	
Var. IPCA p.p.	0,54	0,54	1,16	2,41	5,15	11,12	
NTN-B 150840 (5,310000%)	1,00	1,00	2,61	4,71	10,21	22,80	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,35	2,71	5,70	12,26	
NTN-B 150824 (5,345000%)	1,00	1,00	2,46	4,57	10,08	22,69	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,20	2,56	5,57	12,15	
NTN-B 150545 (6,140000%)	1,06	1,06	2,86	5,18	11,12	21,16	
Var. IPCA p.p.	0,64	0,64	1,60	3,17	6,62	10,62	
NTN-B 150830 (4,900000%)	0,96	0,96	2,44	4,43	9,70	21,76	
Var. IPCA p.p.	0,54	0,54	1,17	2,43	5,20	11,22	
NTN-B 150850 (5,295500%)	0,99	0,99	2,67	4,76	10,25	22,83	
Var. IPCA p.p.	0,57	0,57	1,40	2,76	5,75	12,29	
NTN-B 150535 (4,880000%)	0,96	0,96	2,47	4,46	9,72	21,76	
Var. IPCA p.p.	0,54	0,54	1,20	2,45	5,21	11,21	
NTN-B 150555 (5,420000%)	1,00	1,00	2,72	4,85	10,41	23,15	
Var. IPCA p.p.	0,58	0,58	1,45	2,84	5,90	12,60	
NTN-B 150850 (5,510000%)	1,01	1,01	2,72	4,88	10,48	23,34	

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.	0,59	0,59	1,46	2,87	5,98	12,79	
NTN-B 150555 (5,897000%)	1,04	1,04	2,84	5,10	10,91	20,76	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,58	3,09	6,41	10,22	
NTN-B 150850 (6,278000%)	1,08	1,08	2,93	5,28	8,00	14,34	
Var. IPCA p.p.	0,66	0,66	1,66	3,27	3,49	3,80	
NTN-B 150840 (6,220000%)	1,07	1,07	2,85	5,19	11,17	24,94	
Var. IPCA p.p.	0,65	0,65	1,59	3,18	6,67	14,40	
NTN-B 150555 (5,060000%)	0,97	0,97	2,62	4,66	10,02	22,30	
Var. IPCA p.p.	0,55	0,55	1,36	2,65	5,52	11,76	
NTN-B 150555 (5,950000%)	1,05	1,05	2,86	5,12	10,97	24,39	
Var. IPCA p.p.	0,63	0,63	1,59	3,12	6,46	13,85	
NTN-B 150828 (5,810000%)	1,04	1,04	2,64	4,86	10,62	23,84	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,37	2,86	6,12	13,30	
NTN-B 150525 (5,810000%)	1,04	1,04	2,60	4,82	10,58	23,80	
Var. IPCA p.p.	0,62	0,62	1,33	2,82	6,07	13,25	
NTN-B 150535 (5,196100%)	0,99	0,99	2,55	4,62	10,06	22,49	
Var. IPCA p.p.	0,57	0,57	1,29	2,62	5,55	11,95	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,47	-0,47	4,92	2,84	15,36	23,40	21,65
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,02	-0,06	-0,07	-0,18	-0,40	-0,73
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-1,51	-1,51	5,82	1,40	18,57	22,51	14,29
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,05	-0,05	-0,08	-0,14	-0,46	-0,87	-1,11
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	1,08	1,08	-0,48	614,01	861,32	140,48	6.584,52
% do CDI	111,41	111,41	-17,06	10.167,89	6.691,26	514,01	19.538,45
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,80	27,43	34,15
% do CDI	100,00	100,00	100,09	100,08	99,46	100,36	101,32
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1,01	1,01	2,96	6,31	13,28	28,05	34,74
% do CDI	104,14	104,14	105,32	104,56	103,17	102,63	103,08
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	1,33	1,33	1,07	2,36			
Var. IPCA p.p.	0,91	0,91	-0,20	0,36			
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1,04	1,04	2,95	6,45	13,33	28,24	35,48
% do CDI	107,65	107,65	105,27	106,83	103,56	103,32	105,28
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-3,37	-3,37	13,39	1,81	6,94	1,60	-26,78
Var. IBOVESPA p.p.	1,43	1,43	0,48	-2,95	-5,69	-12,32	-37,80
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	-7,81	-7,81	-3,19	-5,63	-1,03	11,28	50,51
Var. IBOVESPA p.p.	-3,01	-3,01	-16,10	-10,39	-13,65	-2,64	39,49
TARPON GT 30 FIC FIA	-6,16	-6,16	11,40	10,28	42,45	65,15	101,97



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.	-1,36	-1,36	-1,51	5,51	29,82	51,24	90,94
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	-2,54	-2,54	14,64	8,05	14,81	16,95	24,00
Var. IBOVESPA p.p.	2,25	2,25	1,73	3,28	2,19	3,03	12,98
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	-8,43	-8,43	5,22	-12,06	-8,80	-20,42	-20,92
Var. IBOVESPA p.p.	-3,64	-3,64	-7,69	-16,82	-21,42	-34,34	-31,94
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	-1,49	-1,49	14,31	8,75	40,63	37,57	63,46
Var. IBOVESPA p.p.	3,30	3,30	1,40	3,99	28,01	23,65	52,44
INDIE FIC FIA	-5,46	-5,46	13,63	-2,02	15,52	-5,11	-24,38
Var. IBOVESPA p.p.	-0,66	-0,66	0,71	-6,78	2,89	-19,03	-35,40
OCCAM FIC FIA	-3,79	-3,79	11,66	3,54	8,37	9,26	4,83
Var. IBOVESPA p.p.	1,00	1,00	-1,25	-1,22	-4,26	-4,66	-6,19
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-4,71	-4,71	12,72	-3,42	3,51	-9,22	-16,59
Var. IBOVESPA p.p.	0,09	0,09	-0,19	-8,18	-9,11	-23,13	-27,61
META VALOR FI DE AÇÕES	-4,51	-4,51	15,75	-5,42	-7,83	-13,46	-23,03
Var. IBRX 100 p.p.	0,00	0,00	2,56	-10,58	-19,71	-26,18	-33,37
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	2,73	2,73	11,88	10,53	17,61	-4,90	8,37
Var. IBOVESPA p.p.	7,53	7,53	-1,03	5,76	4,98	-18,81	-2,66
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-10,59	-10,59	-16,83	-24,93	-35,74	-43,29	-56,77
Var. MSCI ACWI p.p.	-13,45	-13,45	-29,26	-32,90	-45,24	-37,49	-59,60
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	2,79	2,79	16,40	9,90	13,12	0,70	8,18
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,06	-0,06	3,97	1,92	3,62	6,50	5,35
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	2,38	2,38	21,15	10,68	30,11	2,91	7,50
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,48	-0,48	8,72	2,71	20,61	8,72	4,67
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	-4,25	-4,25	22,56	1,86	16,60	-32,59	-52,16
Var. MSCI ACWI p.p.	-7,11	-7,11	10,13	-6,11	7,11	-26,79	-54,99
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4,04	4,04	21,71	13,90	29,36	-4,31	-19,18
Var. IPCA + 6,00% p.p.	3,11	3,11	18,98	8,88	18,66	-28,43	-64,40
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-0,10	-0,10	17,48	0,49	-0,55	-28,36	-40,26
Var. MSCI ACWI p.p.	-2,95	-2,95	5,05	-7,49	-10,05	-22,56	-43,09
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	-0,44	-0,44	2,88	4,51	13,18		
Var. S&P 500 p.p.	-4,38	-4,38	-10,29	-5,81	-2,28		
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,66	1,66	16,87	8,71	26,98	25,55	57,87
% do CDI	171,23	171,23	600,98	144,26	209,61	93,47	171,73
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	1,72	1,72	17,05	9,04	27,92	32,08	67,61
Var. S&P 500 p.p.	-2,22	-2,22	3,88	-1,28	12,45	32,86	49,60
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	-0,16	-0,16	1,24	1,40	2,18	15,06	47,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,09	-1,09	-1,49	-3,62	-8,52	-9,06	2,35
JACAREÍ	0,21	0,21	5,90	5,10	12,43	19,11	
Var. IPCA + 4,83% p.p.	-0,65	-0,65	3,39	0,52	2,65	-2,94	
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,83	0,83	2,77	5,92	12,95	27,12	31,60	36,12	45,12
IRF-M 1+	0,60	0,60	5,55	6,14	18,37	28,70	23,39	30,51	48,22
IRF-M TOTAL	0,67	0,67	4,68	6,05	16,31	27,74	26,10	32,31	47,48
IMA-B 5	0,68	0,68	3,99	4,44	11,33	23,79	29,45	39,23	56,02
IMA-B 5+	-1,47	-1,47	5,89	1,54	19,03	23,38	15,40	19,65	46,36
IMA-B TOTAL	-0,45	-0,45	4,97	2,91	15,53	23,80	22,38	28,77	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,47	0,47	3,98	5,14	14,53	26,21	28,00	33,76	48,90
IDKA 2	0,81	0,81	4,15	4,81	11,43	23,53	29,55	40,17	55,62
IDKA 20	-3,34	-3,34	7,85	-0,30	28,79	24,16	6,04	6,79	36,82
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02	12,30	31,17
IBRX 100	-4,51	-4,51	13,20	5,15	11,88	12,72	10,34	12,15	33,43
IBRX 50	-4,15	-4,15	13,07	5,74	11,32	13,01	11,95	14,94	31,89
SMALL CAP	-6,55	-6,55	12,50	-6,30	6,34	-10,11	-19,32	-22,95	11,91
Índice Consumo - ICON	-8,33	-8,33	13,01	-11,48	-4,76	-28,41	-45,21	-47,39	-24,62
Índice Dividendos - IDIV	-3,51	-3,51	14,18	8,88	15,58	28,28	35,93	29,79	64,85

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Investimentos Estruturados**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,94	3,94	13,17	10,31	15,47	-0,78	18,02	74,30	143,07

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,67	0,67	5,63	4,26	18,16	20,04	15,77	8,33	38,34

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,86	2,86	12,43	7,98	9,50	-5,80	2,83	51,79	101,82

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,42	0,42	1,27	2,01	4,51	10,54	22,01	27,58	32,93
INPC	0,57	0,57	1,22	1,66	3,82	9,75	21,38	28,10	33,61
IGPM	0,07	0,07	1,41	2,15	-3,32	0,35	17,32	47,48	59,00
SELIC	0,97	0,97	2,80	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,76	0,76	2,25	4,03	8,64	19,51	37,19	49,11	61,60
IPCA + 5,00%	0,85	0,85	2,49	4,53	9,67	21,80	41,17	54,89	69,49
IPCA + 5,50%	0,89	0,89	2,61	4,77	10,18	22,96	43,18	57,84	73,54
IPCA + 5,89%	0,92	0,92	2,70	4,97	10,59	23,86	44,77	60,18	76,76
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22	60,84	77,68
INPC + 4,00%	0,91	0,91	2,21	3,67	7,92	18,65	36,48	49,72	62,43
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47	61,50	78,60

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%)	2.215.149,68	5,480000	2.212.556,70	5,580000	-2.592,98
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.084.100,66	5,810000	1.087.020,12	5,580000	2.919,46
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.643.689,41	5,680000	20.777.976,92	5,582700	134.287,51
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.246.492,60	4,860000	2.115.010,08	5,620000	-131.482,52
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.242.895,19	4,880000	2.115.010,08	5,620000	-127.885,11
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.242.168,06	4,910000	2.119.407,19	5,620000	-122.760,87
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.232.520,21	5,196100	2.158.981,18	5,620000	-73.539,03
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.233.999,30	5,290000	2.176.569,62	5,620000	-57.429,68
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.233.199,30	5,320000	2.180.966,73	5,620000	-52.232,57
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.546.217,10	5,670000	1.552.179,95	5,620000	5.962,85
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.087.993,29	5,837000	2.123.804,30	5,620000	35.811,01
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.267.884,52	5,855000	3.328.612,53	5,620000	60.728,01
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.263.536,22	4,970000	2.075.502,50	5,698500	-188.033,72
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.260.791,60	4,980000	2.075.502,50	5,698500	-185.289,10
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.256.724,18	5,030000	2.084.353,26	5,698500	-172.370,92
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.244.387,24	5,285000	2.137.457,80	5,698500	-106.929,44
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.243.573,77	5,340000	2.150.733,94	5,698500	-92.839,83
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.242.119,89	5,380000	2.159.584,70	5,698500	-82.535,19
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.277.151,01	5,831000	5.359.133,33	5,698500	81.982,32
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.180.219,69	5,860000	2.221.539,99	5,698500	41.320,30
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.097.393,65	5,897000	2.146.308,56	5,698500	48.914,91
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.408.587,75	5,915000	6.571.687,04	5,698500	163.099,29
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.091.350,14	5,922000	2.146.308,56	5,698500	54.958,42
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.701.849,63	6,140000	4.947.573,14	5,698500	245.723,51
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.706.400,22	6,256000	3.951.862,98	5,698500	245.462,76
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.120.988,07	6,280000	3.336.735,37	5,698500	215.747,30
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.127.558,18	6,400000	2.305.622,19	5,698500	178.064,01
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.271.144,97	5,000000	2.057.257,24	5,690800	-213.887,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.266.051,32	5,030000	2.061.719,84	5,690800	-204.331,48
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.260.984,37	5,060000	2.066.182,44	5,690800	-194.801,93
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.249.487,97	5,315000	2.133.121,39	5,690800	-116.366,58
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.250.516,66	5,370000	2.150.971,78	5,690800	-99.544,88
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.248.436,54	5,420000	2.164.359,57	5,690800	-84.076,97
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.239.651,41	5,520000	2.186.672,56	5,690800	-52.978,85
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.624.614,68	5,831200	11.852.657,77	5,690800	228.043,09
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.179.727,27	5,860000	2.231.298,53	5,690800	51.571,26
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.235.246,91	5,897000	5.386.354,64	5,690800	151.107,73
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.095.034,56	5,927000	2.164.359,57	5,690800	69.325,01
NTN-B 150555 (5,950000%)	17.095.353,59	5,950000	17.716.510,30	5,690800	621.156,71
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.401.188,31	6,140000	9.996.217,40	5,690800	595.029,09
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.465.976,21	6,261000	9.148.323,96	5,690800	682.347,75
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.282.231,84	6,268000	7.876.483,80	5,690800	594.251,96
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.323.779,51	6,400000	5.859.389,93	5,690800	535.610,42
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.244.214,41	5,345000	2.230.584,16	6,574000	-13.630,25
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.277.682,18	5,450000	2.265.033,33	6,574000	-12.648,85
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.237.896,89	5,912000	2.230.584,16	6,574000	-7.312,73
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.273.616,05	5,009000	2.255.987,86	5,360100	-17.628,19
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.276.322,87	5,130000	2.264.748,98	5,360100	-11.573,89
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.277.694,45	5,190000	2.269.129,54	5,360100	-8.564,91
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.284.462,54	5,490000	2.291.032,33	5,360100	6.569,79
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.347.068,61	5,710000	3.373.030,39	5,360100	25.961,78
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.287.566,45	4,850000	2.235.895,58	5,460200	-51.670,87
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.281.895,18	5,125600	2.253.535,78	5,460200	-28.359,40
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.285.483,55	5,240000	2.266.765,94	5,460200	-18.717,61
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.282.920,74	5,270000	2.266.765,94	5,460200	-16.154,80
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.356.186,70	5,810000	3.400.148,90	5,460200	43.962,20
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.297.113,67	4,860000	2.225.705,95	5,478300	-71.407,72
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.292.404,13	4,900000	2.225.705,95	5,478300	-66.698,18



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.287.048,50	5,178300	2.252.361,11	5,478300	-34.687,39
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.289.841,67	5,270000	2.265.688,69	5,478300	-24.152,98
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.290.825,57	5,300000	2.270.131,22	5,478300	-20.694,35
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.606.244,22	5,460000	3.602.889,28	5,478300	-3.354,94
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.289.818,79	5,500000	2.292.343,86	5,478300	2.525,07
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.359.479,77	5,835000	3.420.745,68	5,478300	61.265,91
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.316.139,66	4,950000	2.158.498,54	5,645100	-157.641,12
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.306.576,16	4,970000	2.154.011,02	5,645100	-152.565,14
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.309.109,41	5,020000	2.167.473,58	5,645100	-141.635,83
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.301.279,33	5,274000	2.216.836,34	5,645100	-84.442,99
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.302.176,15	5,310000	2.225.811,38	5,645100	-76.364,77
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.299.785,07	5,360000	2.234.786,43	5,645100	-64.998,64
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.152.863,60	5,837000	2.194.398,72	5,645100	41.535,12
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.361.969,10	5,855000	3.432.955,06	5,645100	70.985,96
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.175.571,28	6,220000	3.361.154,69	5,645100	185.583,41
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.330.431,26	4,940000	2.107.902,86	5,702500	-222.528,40
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.327.791,97	4,980000	2.116.910,99	5,702500	-210.880,98
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.323.341,15	5,010000	2.121.415,06	5,702500	-201.926,09
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.317.354,24	5,045000	2.125.919,12	5,702500	-191.435,12
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.307.901,10	5,295500	2.188.976,05	5,702500	-118.925,05
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.307.235,61	5,360000	2.206.992,31	5,702500	-100.243,30
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.306.202,52	5,410000	2.220.504,51	5,702500	-85.698,01
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.299.424,97	5,510000	2.243.024,84	5,702500	-56.400,13
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.693.092,75	5,831200	8.836.977,37	5,702500	143.884,62
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.229.558,62	5,897000	3.310.488,47	5,702500	80.929,85
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.155.284,64	5,921000	2.216.000,44	5,702500	60.715,80
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.749.707,78	5,950000	12.124.945,51	5,702500	375.237,73
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.990.004,28	6,140000	7.386.668,14	5,702500	396.663,86
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.823.864,51	6,261000	6.247.139,46	5,702500	423.274,95
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.354.972,15	6,278000	5.756.196,27	5,702500	401.224,12

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.195.065,34	6,400000	3.486.147,04	5,702500	291.081,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	08/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	393.500,00	0,00	1.563,91662255	251,6118790000
2	10/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	938.150,25	3.725,24994224	251,8355183000
3	10/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	393.849,75	1.563,91660977	251,8355183000
4	10/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	42.000,00	166,77552191	251,8355183000
5	12/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	9.000,00	35,70566438	252,0608468000
6	12/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	36.000,00	142,82265753	252,0608468000
7	15/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	4.000,00	15,85826850	252,2343471000
8	15/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	26.000,00	103,07874522	252,2343471000
9	15/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	3.000,00	11,89370137	252,2343471000
10	16/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	4.000,00	15,85086747	252,3521194000
11	19/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	14.000,00	55,40258920	252,6957711000
12	25/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	105.000,00	414,76204430	253,1572053000
13	26/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	17.000,00	67,11961658	253,2791584000
14	29/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	321.000,00	0,00	1.266,71719984	253,4109429000
15	29/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	32.928,13	129,93965305	253,4109429000
16	29/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	59.071,87	233,10702105	253,4109429000
17	30/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000.000,00	3.234.723,95949400	3,0914539000
18	30/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	14.219.000,00	0,00	56.082,77191425	253,5359704000
19	30/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	47.000,00	185,37803502	253,5359704000
20	31/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	7.425.000,01	29.270,79556185	253,6658080000
21	31/01/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	438.000,00	0,00	1.726,68127192	253,6658080000
<b>Total</b>			<b>15.371.500,00</b>	<b>19.156.000,01</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 11.809.695,81

Value-At-Risk: 1,71%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,96	0,26		0,10	-0,12	0,85	465.656.110,35	67,52
Artigo 8º	14,15	6,93		0,86	-0,36	-4,19	97.088.747,27	14,08
Artigo 9º	13,68	5,92		0,30	0,06	1,76	53.225.981,64	7,72
Artigo 10º	7,92	4,87		0,45	0,03	1,18	73.654.314,56	10,68
JACAREÍ		1,71		1,71			689.625.153,80	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,26%

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%)		0,09	-0,00	0,09			2.215.149,68	0,32
NTN-B 150525 (5,810000%)		0,09	-0,00	0,09			1.084.100,66	0,16
NTN-B 150533 (5,680000%)		0,10	0,00	0,10			20.643.689,41	2,99
NTN-B 150535 (4,860000%)		0,09	0,00	0,10			2.246.492,60	0,33
NTN-B 150535 (4,880000%)		0,09	0,00	0,10			2.242.895,19	0,33
NTN-B 150535 (4,910000%)		0,09	0,00	0,10			2.242.168,06	0,33
NTN-B 150535 (5,196100%)		0,09	0,00	0,10			2.232.520,21	0,32
NTN-B 150535 (5,290000%)		0,09	0,00	0,10			2.233.999,30	0,32
NTN-B 150535 (5,320000%)		0,09	0,00	0,10			2.233.199,30	0,32
NTN-B 150535 (5,670000%)		0,10	0,00	0,10			1.546.217,10	0,22
NTN-B 150535 (5,837000%)		0,10	0,00	0,10			2.087.993,29	0,30
NTN-B 150535 (5,855000%)		0,10	0,00	0,10			3.267.884,52	0,47
NTN-B 150545 (4,970000%)		0,10	0,00	0,10			2.263.536,22	0,33
NTN-B 150545 (4,980000%)		0,10	0,00	0,10			2.260.791,60	0,33
NTN-B 150545 (5,030000%)		0,10	0,00	0,10			2.256.724,18	0,33
NTN-B 150545 (5,285000%)		0,10	0,00	0,10			2.244.387,24	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 150545 (5,340000%)		0,10	0,00	0,10			2.243.573,77	0,33
NTN-B 150545 (5,380000%)		0,10	0,00	0,10			2.242.119,89	0,33
NTN-B 150545 (5,831000%)		0,10	0,00	0,10			5.277.151,01	0,77
NTN-B 150545 (5,860000%)		0,10	0,00	0,10			2.180.219,69	0,32
NTN-B 150545 (5,897000%)		0,10	0,00	0,10			2.097.393,65	0,30
NTN-B 150545 (5,915000%)		0,10	0,00	0,10			6.408.587,75	0,93
NTN-B 150545 (5,922000%)		0,10	0,00	0,10			2.091.350,14	0,30
NTN-B 150545 (6,140000%)		0,10	0,00	0,10			4.701.849,63	0,68
NTN-B 150545 (6,256000%)		0,10	0,00	0,10			3.706.400,22	0,54
NTN-B 150545 (6,280000%)		0,10	0,00	0,10			3.120.988,07	0,45
NTN-B 150545 (6,400000%)		0,10	0,00	0,10			2.127.558,18	0,31
NTN-B 150555 (5,000000%)		0,10	0,00	0,10			2.271.144,97	0,33
NTN-B 150555 (5,030000%)		0,10	0,00	0,10			2.266.051,32	0,33
NTN-B 150555 (5,060000%)		0,10	0,00	0,10			2.260.984,37	0,33
NTN-B 150555 (5,315000%)		0,10	0,00	0,10			2.249.487,97	0,33
NTN-B 150555 (5,370000%)		0,10	0,00	0,10			2.250.516,66	0,33
NTN-B 150555 (5,420000%)		0,10	0,00	0,10			2.248.436,54	0,33
NTN-B 150555 (5,520000%)		0,10	0,00	0,10			2.239.651,41	0,32
NTN-B 150555 (5,831200%)		0,10	0,00	0,10			11.624.614,68	1,69
NTN-B 150555 (5,860000%)		0,10	0,00	0,10			2.179.727,27	0,32
NTN-B 150555 (5,897000%)		0,10	0,00	0,10			5.235.246,91	0,76
NTN-B 150555 (5,927000%)		0,10	0,00	0,10			2.095.034,56	0,30
NTN-B 150555 (5,950000%)		0,10	0,00	0,10			17.095.353,59	2,48
NTN-B 150555 (6,140000%)		0,10	0,00	0,10			9.401.188,31	1,36
NTN-B 150555 (6,261000%)		0,10	0,00	0,10			8.465.976,21	1,23
NTN-B 150555 (6,268000%)		0,10	0,00	0,10			7.282.231,84	1,06
NTN-B 150555 (6,400000%)		0,10	0,00	0,10			5.323.779,51	0,77
NTN-B 150824 (5,345000%)		0,09	-0,00	0,09			2.244.214,41	0,33
NTN-B 150824 (5,450000%)		0,09	-0,00	0,09			2.277.682,18	0,33
NTN-B 150824 (5,912000%)		0,09	-0,00	0,09			2.237.896,89	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,009000%)		0,09	-0,00	0,09			2.273.616,05	0,33
NTN-B 150826 (5,130000%)		0,09	-0,00	0,09			2.276.322,87	0,33
NTN-B 150826 (5,190000%)		0,09	-0,00	0,09			2.277.694,45	0,33
NTN-B 150826 (5,490000%)		0,09	-0,00	0,09			2.284.462,54	0,33
NTN-B 150826 (5,710000%)		0,09	-0,00	0,09			3.347.068,61	0,49
NTN-B 150828 (4,850000%)		0,09	-0,00	0,09			2.287.566,45	0,33
NTN-B 150828 (5,125600%)		0,09	-0,00	0,09			2.281.895,18	0,33
NTN-B 150828 (5,240000%)		0,09	-0,00	0,09			2.285.483,55	0,33
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,09	-0,00	0,09			2.282.920,74	0,33
NTN-B 150828 (5,810000%)		0,09	-0,00	0,09			3.356.186,70	0,49
NTN-B 150830 (4,860000%)		0,09	0,00	0,09			2.297.113,67	0,33
NTN-B 150830 (4,900000%)		0,09	0,00	0,09			2.292.404,13	0,33
NTN-B 150830 (5,178300%)		0,09	0,00	0,09			2.287.048,50	0,33
NTN-B 150830 (5,270000%)		0,09	0,00	0,09			2.289.841,67	0,33
NTN-B 150830 (5,300000%)		0,09	0,00	0,09			2.290.825,57	0,33
NTN-B 150830 (5,460000%)		0,09	0,00	0,10			3.606.244,22	0,52
NTN-B 150830 (5,500000%)		0,09	0,00	0,10			2.289.818,79	0,33
NTN-B 150830 (5,835000%)		0,09	0,00	0,10			3.359.479,77	0,49
NTN-B 150840 (4,950000%)		0,10	0,00	0,10			2.316.139,66	0,34
NTN-B 150840 (4,970000%)		0,10	0,00	0,10			2.306.576,16	0,33
NTN-B 150840 (5,020000%)		0,10	0,00	0,10			2.309.109,41	0,33
NTN-B 150840 (5,274000%)		0,10	0,00	0,10			2.301.279,33	0,33
NTN-B 150840 (5,310000%)		0,10	0,00	0,10			2.302.176,15	0,33
NTN-B 150840 (5,360000%)		0,10	0,00	0,10			2.299.785,07	0,33
NTN-B 150840 (5,837000%)		0,10	0,00	0,10			2.152.863,60	0,31
NTN-B 150840 (5,855000%)		0,10	0,00	0,10			3.361.969,10	0,49
NTN-B 150840 (6,220000%)		0,10	0,00	0,10			3.175.571,28	0,46
NTN-B 150850 (4,940000%)		0,10	0,00	0,10			2.330.431,26	0,34
NTN-B 150850 (4,980000%)		0,10	0,00	0,10			2.327.791,97	0,34
NTN-B 150850 (5,010000%)		0,10	0,00	0,10			2.323.341,15	0,34

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 (5,045000%)		0,10	0,00	0,10			2.317.354,24	0,34
NTN-B 150850 (5,295500%)		0,10	0,00	0,10			2.307.901,10	0,33
NTN-B 150850 (5,360000%)		0,10	0,00	0,10			2.307.235,61	0,33
NTN-B 150850 (5,410000%)		0,10	0,00	0,10			2.306.202,52	0,33
NTN-B 150850 (5,510000%)		0,10	0,00	0,10			2.299.424,97	0,33
NTN-B 150850 (5,831200%)		0,10	0,00	0,10			8.693.092,75	1,26
NTN-B 150850 (5,897000%)		0,10	0,00	0,10			3.229.558,62	0,47
NTN-B 150850 (5,921000%)		0,10	0,00	0,10			2.155.284,64	0,31
NTN-B 150850 (5,950000%)		0,10	0,00	0,10			11.749.707,78	1,70
NTN-B 150850 (6,140000%)		0,10	0,00	0,10			6.990.004,28	1,01
NTN-B 150850 (6,261000%)		0,10	0,00	0,10			5.823.864,51	0,84
NTN-B 150850 (6,278000%)		0,10	0,00	0,10			5.354.972,15	0,78
NTN-B 150850 (6,400000%)		0,10	0,00	0,10			3.195.065,34	0,46
<b>Sub-total</b>	0,87	0,09	0,00		0,07	1,03	314.650.856,27	45,63

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		2,16	0,04	0,03			21.769.126,32	3,16
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,15	0,06	0,05			21.563.149,39	3,13
<b>Sub-total</b>	3,49	2,65	0,10		-0,56	-0,99	43.332.275,71	6,28

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		2,41	0,00	2,41			5.188.355,50	0,75
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			11.430.047,20	1,66
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,03	0,00	0,03			21.908.643,75	3,18
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,02	-0,00	0,02			26.095.331,05	3,78
<b>Sub-total</b>	0,17	0,20	0,00		0,36	1,03	64.622.377,50	9,37

Artigo 7º IV

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 - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a		0,19	0,00	0,19			5.345.291,93	0,78
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a		0,20	-0,00	0,20			5.345.597,15	0,78
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a		0,19	0,00	0,19			5.338.262,40	0,77
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a		0,19	-0,00	0,19			5.688.370,26	0,82
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a		0,19	-0,00	0,20			5.338.163,60	0,77
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a		0,20	-0,00	0,20			6.234.370,88	0,90
<b>Sub-total</b>	0,22	0,14	-0,00		0,75	1,14	33.290.056,22	4,83

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		8,31	-0,00	8,31			33.499,55	0,00
<b>Sub-total</b>	3,63	8,31	-0,00		0,03	1,08	33.499,55	0,00

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV		0,02	-0,00	0,02			3.554.816,74	0,52
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,08	0,00	0,08			6.172.228,36	0,90
<b>Sub-total</b>	0,07	0,05	0,00		1,55	1,07	9.727.045,10	1,41

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,93%

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		8,88	0,04	4,77			4.046.040,89	0,59
META VALOR FI DE AÇÕES		10,13	0,03	5,03			2.196.852,95	0,32
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		9,22	0,08	5,10			7.469.447,35	1,08



**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
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,54	0,05	3,43			5.477.733,12	0,79
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		7,28	0,21	2,85			24.181.749,30	3,51
OCCAM FIC FIA		6,09	0,20	1,18			26.821.226,64	3,89
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		7,95	0,06	4,11			6.633.446,30	0,96
INDIE FIC FIA		10,14	0,05	5,60			3.833.778,34	0,56
TARPON GT 30 FIC FIA		8,39	0,09	5,49			9.836.656,14	1,43
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA		8,69	0,05	6,81			6.591.816,24	0,96
<b>Sub-total</b>	14,15	6,93	0,86		-0,36	-4,19	97.088.747,27	14,08

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 4,87%

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		4,22	0,01	7,95			7.783.407,00	1,13
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		6,44	0,17	6,44			20.484.211,91	2,97
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		6,48	0,28	5,36			34.160.639,21	4,95
<b>Sub-total</b>	9,25	5,74	0,45		0,05	1,43	62.428.258,12	9,05

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		0,03	0,00	0,06			11.226.056,44	1,63
<b>Sub-total</b>	0,55	0,03	0,00		-2,05	-0,16	11.226.056,44	1,63

**Investimentos no Exterior**

Value-At-Risk: 5,92%

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		9,39	0,19	7,79			17.532.413,72	2,54
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		14,05	0,02	13,11			2.012.627,83	0,29

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
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,24	-0,00	9,88			1.856.942,25	0,27
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,81	0,00	8,87			2.489.720,26	0,36
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,96	0,01	8,95			3.080.954,16	0,45
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		6,44	0,01	7,14			5.705.159,01	0,83
<b>Sub-total</b>	13,95	6,78	0,23		0,01	1,15	32.677.817,23	4,74

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		5,99	0,07	8,37			20.548.164,41	2,98
<b>Sub-total</b>	13,25	5,99	0,07		0,13	2,73	20.548.164,41	2,98

(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

**AGENDA REALIZADA**

08 de janeiro:

11h00: Reunião com os representantes da BRAM (Bradesco Asset Management). O objetivo da reunião foi a apresentação do cenário econômico, política monetária e apresentação de fundos elegíveis em renda fixa, renda variável e exterior da instituição e uma visão geral do mercado para o ano de 2024. Participou da reunião o senhor Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos.

09 de janeiro:

10h30: Reunião com os representantes da 4UM INVESTIMENTOS. O objetivo da reunião foi a apresentação institucional da empresa, visão do cenário macroeconômico e apresentação de fundos elegíveis de crédito privado, dividendos, ações livres e small caps, bem como as premiações recebidas pela gestora nos últimos anos. Participou da reunião o senhor Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos de forma on-line.

11 de janeiro:

15h30: Reunião com o representante da WESTERN ASSET MANAGEMENT. A reunião foi conduzida por Elder Andrade que apresentou opções de fundos em renda fixa, variável e exterior. Discorreu sobre o fundo S&P500 que o IPMJ já possui na carteira de investimentos. Participaram da reunião o senhor Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e Rossana Vasques – Presidente do Instituto de Previdência do Município de Jacareí.

18 de janeiro:

09h00: Tricentésima nonagésima nona (399ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros (CAIF) do Instituto de Previdência do Município de Jacareí (IPMJ), ocorrida em 18 de janeiro de 2024, tendo início às 9h15 na sala de reuniões do IPMJ, com as seguintes presenças: Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Clévio Vitor de Almeida, José Ricardo Vinhas e Rafaela Carvalho dos Santos. Pautas da reunião: 1) Análise do relatório de investimentos de dezembro de 2023; 2) Análise da carteira fechada de dezembro de 2023; 3) Apresentação relatório de gestão do FIDC Master III 4º trimestre; 4) Reunião com os gestores da Meta Asset Management, incluído na ordem do dia; 5) Assuntos diversos.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

24 de janeiro:

09h30: Live ABIPEM sobre o tema: “O Resgate de Investimentos com rentabilidade negativa”. A ABIPEM reuniu um time de especialistas que desmistificaram o assunto, debateram soluções e tiraram dúvidas. No evento estiveram presentes João Figueiredo - Presidente da ABIPEM, Alexandre Sarquis - Professor de Dir. Constitucional da Fipecafi, Daniel Maeda - Diretor da CVM, Gustavo Neves - Auditor-fiscal da Receita Federal em exercício no MPS, Otoni Guimarães - Consultor Previdenciário. Participou da Live o senhor Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos.

24 de janeiro:

15h00: Reunião com o representante da VINCI PARTNERS. Eduardo Reichert realizou uma apresentação institucional da empresa e opções de fundos em renda fixa, variável e exterior. Participaram da reunião o senhor Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e Rossana Vasques – Presidente do Instituto de Previdência do Município de Jacareí.

25 de janeiro:

09h00: Quadringentésima (400ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, ocorrida em 25 de janeiro de 2024, tendo início às 9h30, com as seguintes presenças dos membros do CAIF na sala de reuniões do IPMJ: Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos e Clévio Vitor de Almeida. Ausências justificadas de José Ricardo Vinhas e Rafaela Carvalho dos Santos. Pautas da reunião: 1) Análise parcial da carteira até 23/01/2024; 2) Reunião com gestores do fundo OCCAM FIC FIA; 3) Assuntos Diversos.

29 de janeiro:

10h00: Reunião com os representantes do Banco do Brasil. O objetivo da reunião foi apresentar o cenário macroeconômico e visão dos gestores sobre ano de 2024. Participou da reunião o senhor Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos de forma on-line.

31 de janeiro:

08h00 às 17h00: Curso Preparatório para Certificação dos Membros do Conselho Fiscal e Deliberativo do RPPS realizado em parceria pela EMPIRE CAPITAL ASSESSORIA EM INVESTIMENTOS realizado na sede do SAAE Jacareí. Participaram vários membros do CAIF, Conselheiros Fiscais e Deliberativos de forma presencial. Palestrante responsável Otoni Guimarães - Consultor Previdenciário

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**ACOMPANHAMENTO DE FUNDOS ILÍQUIDOS****I. FIDC MULSTISETORIAL MASTER III**

Em janeiro de 2024, 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).

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 31 de janeiro de 2024 é de R\$ 33.499,55 (trinta e três mil e quatrocentos e noventa e nove reais e cinquenta e cinco centavos).

**ACOMPANHAMENTO DE FUNDOS ESTRUTURADOS****I. 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\$ 2.130.170,44 (dois milhões e cento e trinta mil e cento e setenta reais e quarenta e quatro centavos).

O total de amortizações já entregue desde o início do fundo é de: (agosto de 2020 R\$ 997.681,60 / fevereiro de 2022 R\$ 2.117.806,90 / julho de 2023 R\$ 19.310,74 / setembro de 2023 R\$ 154.865,00) totalizando R\$ 3.289.664,24 (três milhões e duzentos e oitenta e nove mil e seiscentos e sessenta e quatro reais e vinte e quatro centavos)

O saldo acumulado em 31 de janeiro de 2024 é de R\$ 11.226.056,44 (onze milhões e duzentos e vinte e seis mil e cinquenta e seis reais e quarenta e quatro centavos) com um rendimento negativo no mês de janeiro de R\$ -18.298,92 (dezoito mil e duzentos e noventa e oito reais e noventa e dois centavos negativos).

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS

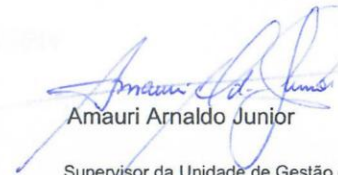
Em 17 de agosto de 2023 o IPMJ formalizou sua adesão ao Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios – “Pró Gestão RPPS”. Em atendimento ao Manual do Pró Gestão RPPS, apresenta-se o presente relatório, referente ao mês de Janeiro de 2024, 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 Júnior

Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos – CP RPPS CGINV I – CPA 10

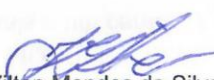


Luis Gustavo Ferreira Bonacina

Assessor da Presidência – CPA 20

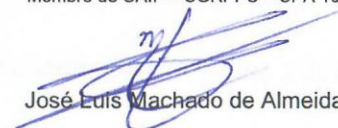
**AUSÊNCIA  
JUSTIFICADA**  
Clévio Vitor de Almeida

Membro do CAIF – CGRPPS – CPA 10



Zilton Mendes da Silva

Membro do CAIF



José Luis Machado de Almeida

Membro do CAIF – CP RPPS CODEL I



Danielle de Paula

Membro do CAIF

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 22 dias do mês de fevereiro 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 Janeiro de 2024, 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 janeiro de 2024.


Jacareí, 22 de fevereiro de 2024

**AUSÊNCIA  
JUSTIFICADA**  
Clévio Vitor de Almeida

Representante do Conselho Fiscal



Rafaela Carvalho dos Santos  
Membro do Conselho Fiscal



José Edson Silva Souza  
Membro do Conselho Fiscal