



**LDB**  
EMPRESAS

## RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

IPMJ - FEVEREIRO 2024



## CENÁRIO MACROECONÔMICO

**MERCADOS INTERNACIONAIS:** No mês de fevereiro, continuando o movimento observado no mês anterior, houve uma alta de juros globais. Sendo este movimento originado pelas discussões sobre o início do ciclo de redução de juros norte-americanos e economia do país ainda aquecida. Nos EUA, a atividade segue em uma direção robusta, com o PIB forte e o mercado de trabalho ainda aquecido. Os dados recentes de inflação se mostraram mais pressionados que o esperado, sugerindo que a desinflação deve ocorrer de maneira mais lenta do que o previsto. Desta forma, houve uma diminuição da confiança no cenário de pouso suave da economia americana. A narrativa da diminuição de confiança no cenário de pouso suave ganhou força ao longo mês e impactou o discurso de alguns membros do FED, levando-os a uma postura mais conservadora. Assim, houve uma precificação na curva de juros americanos e conseqüentemente em novas discussão sobre a expectativa de quando se dará o início do movimento de redução do juros. Desta forma, diversos diretores de bancos centrais dos países desenvolvidos sinalizaram cautela para que haja o início de um ciclo de afrouxamento monetário, sendo necessária maior confiança na convergência da inflação para a meta. Já na China, ainda permanece um cenário de cautela. Onde, apesar dos estímulos do governo, o setor imobiliário residencial mostra elevado nível de fragilidade. Adicionalmente, a queda nos preços aos consumidores, produtores e imóveis residenciais sugerem a possibilidade de intensificação das pressões deflacionárias e pode ter repercussões globais importantes. Assim, no mês de fevereiro de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +4,17% e +5,17%, 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 +21,03% e +28,36%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +4,79% e +5,80%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +15,81% e +22,83% nos últimos 12 meses.

**BRASIL:** Localmente, as curvas de juros futuras aumentaram no mês, acompanhando, mesmo que em menor intensidade, o movimento observado dos juros globais. Com relação aos dados fiscais, as notícias foram marginalmente positivas, devido a uma arrecadação acima das expectativas. A inflação continuou seguindo uma tendência positiva, com desaceleração e de melhora da sua composição. Entretanto, os resultados de curto prazo trouxeram uma inflação de serviços mais pressionada que o esperado, sendo este fator algo a ser observado. Além disso, em linha com o esperado pelo mercado, o PIB do 4º trimestre de 2023 ficou em território estável. Assim, se consolidou a dinâmica de moderação do crescimento. Na parte fiscal, ainda que os desafios de médio prazo persistam, a melhora na arrecadação no primeiro bimestre do ano afasta a necessidade de um grande contingenciamento em março, conseqüentemente minimiza a possibilidade de mudança da meta para o resultado primário de 2024. Dessa forma, não havendo motivo para movimentos relevantes no curto prazo, o cenário ratifica as expectativas de que o Banco Central continue o movimento de redução de juros. Assim, as expectativas ainda são da continuidade ritmo de cortes de juros adotado até o momento. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo na direção dos índices globais. Apresentando um retorno positivo de +0,99% no mês. Entretanto, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -3,85% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +22,96%.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

67,99%

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%)	0,30	0,06	0,99	2,01	2.237.057,15	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,30	0,06	1,01	2,06	1.095.079,83	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,680000%)	2,87	0,07	1,00	2,04	20.850.793,69	2,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,41	0,06	0,94	1,91	2.267.701,34	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,41	0,06	0,95	1,91	2.264.103,27	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,41	0,06	0,95	1,92	2.263.417,31	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,42	0,06	0,97	1,96	2.254.139,68	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,42	0,06	0,98	1,98	2.255.785,31	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,42	0,06	0,98	1,98	2.255.025,58	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,670000%)	2,86	0,07	1,00	2,04	1.561.719,92	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,44	0,06	1,01	2,06	2.109.178,80	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,44	0,06	1,02	2,07	3.301.087,06	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,52	0,06	0,95	1,93	2.285.086,59	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,52	0,06	0,95	1,93	2.282.331,91	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,52	0,06	0,96	1,94	2.278.308,21	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,285000%)	0,53	0,06	0,97	1,98	2.266.268,90	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,54	0,06	0,98	1,99	2.265.534,01	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,54	0,06	0,98	1,99	2.264.130,84	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,56	0,06	1,01	2,06	5.330.677,46	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,56	0,06	1,02	2,07	2.202.378,12	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	0,56	0,06	1,02	2,07	2.118.767,67	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,56	0,06	1,02	2,08	6.473.972,98	0,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,56	0,06	1,02	2,08	2.112.699,15	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	0,57	0,06	1,04	2,11	4.750.580,50	0,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,58	0,06	1,04	2,13	3.745.127,46	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,280000%)	0,58	0,06	1,05	2,13	3.153.650,42	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	0,59	0,06	1,06	2,15	2.150.004,34	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,000000%)	0,60	0,06	0,95	1,93	2.292.817,74	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,60	0,06	0,96	1,94	2.287.724,35	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,60	0,06	0,96	1,94	2.282.657,87	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,62	0,06	0,98	1,98	2.271.468,14	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,62	0,06	0,98	1,99	2.272.595,25	0,32
TESOURO	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,62	0,06	0,98	2,00	2.270.577,13	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,520000%)	0,63	0,06	0,99	2,01	2.261.864,81	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,64	0,06	1,01	2,06	11.742.530,44	1,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,64	0,06	1,02	2,07	2.201.881,19	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	0,64	0,06	1,02	2,07	5.288.596,66	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,64	0,06	1,02	2,08	2.116.429,68	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,65	0,06	1,02	2,08	17.270.205,04	2,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	0,65	0,06	1,04	2,11	9.498.626,34	1,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,66	0,06	1,05	2,13	8.554.458,02	1,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,268000%)	0,66	0,06	1,05	2,13	7.358.380,48	1,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	0,66	0,06	1,06	2,15	5.379.953,51	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,29	0,06	0,98	1,99	2.201.301,78	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,450000%)	0,29	0,06	0,99	2,00	2.234.264,44	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,29	0,06	1,02	2,08	2.195.821,36	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,31	0,06	0,95	1,93	2.230.820,44	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,31	0,06	0,96	1,95	2.233.500,23	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,31	0,06	0,97	1,96	2.234.856,72	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,31	0,06	0,99	2,01	2.241.551,55	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,710000%)	0,31	0,06	1,01	2,04	3.284.255,87	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,32	0,06	0,94	1,91	2.245.648,10	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,32	0,06	0,96	1,95	2.239.870,72	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,33	0,06	0,97	1,97	2.243.305,11	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,33	0,06	0,97	1,98	2.240.766,46	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,33	0,06	1,01	2,06	3.293.577,78	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,36	0,06	0,94	1,91	2.256.053,39	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,36	0,06	0,95	1,92	2.251.365,09	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,36	0,06	0,97	1,96	2.245.660,96	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,36	0,06	0,97	1,98	2.248.254,39	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,300000%)	0,36	0,06	0,98	1,98	2.249.170,86	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,460000%)	0,37	0,06	0,99	2,01	3.540.257,53	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,37	0,06	0,99	2,01	2.247.855,47	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,835000%)	0,38	0,06	1,01	2,06	3.297.087,84	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,46	0,06	0,95	1,93	2.277.911,79	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,46	0,06	0,95	1,93	2.268.416,30	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,47	0,06	0,96	1,94	2.270.680,51	0,32
TESOURO	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,48	0,06	0,97	1,98	2.261.814,85	0,32

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%)	0,48	0,06	0,98	1,98	2.262.527,93	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,48	0,06	0,98	1,99	2.259.946,76	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,50	0,06	1,01	2,06	2.113.440,59	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,50	0,06	1,02	2,07	3.300.279,42	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,52	0,06	1,04	2,12	3.114.811,16	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,56	0,06	0,95	1,92	2.293.952,44	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,56	0,06	0,95	1,93	2.291.101,62	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,57	0,06	0,96	1,93	2.286.535,79	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,57	0,06	0,96	1,94	2.280.422,98	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,58	0,06	0,98	1,98	2.269.537,34	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,58	0,06	0,98	1,99	2.268.470,38	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,59	0,06	0,98	2,00	2.267.134,43	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,510000%)	0,59	0,06	0,99	2,01	2.259.828,83	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,61	0,06	1,01	2,06	8.535.446,67	1,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	0,61	0,06	1,02	2,07	3.170.374,96	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,61	0,06	1,02	2,08	2.115.637,97	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,61	0,06	1,02	2,08	11.532.596,43	1,64

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	0,62	0,06	1,04	2,11	6.856.950,77	0,98
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,63	0,06	1,05	2,13	5.710.924,25	0,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,278000%)	0,63	0,06	1,05	2,13	5.250.852,90	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	0,63	0,06	1,06	2,15	3.131.782,23	0,45
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,52</b>	<b>0,06</b>	<b>1,00</b>	<b>2,04</b>	<b>313.851.999,54</b>	<b>44,72</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	3,94	0,13	0,54	0,07	21.886.319,31	3,12	5.024.622.442,53	0,44
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,18	0,16	0,49	-1,03	21.668.570,37	3,09	1.569.481.605,43	1,38
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,22</b>	<b>0,15</b>	<b>0,51</b>	<b>-0,48</b>	<b>43.554.889,68</b>	<b>6,21</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	8,45	-0,03	0,34	1,68	5.206.174,50	0,74	232.869.554,09	2,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,80	1,78	11.521.844,10	1,64	17.003.081.830,78	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,05	0,82	1,83	22.088.076,25	3,15	5.956.708.638,04	0,37
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,04	0,86	1,91	37.500.114,33	5,34	2.774.133.845,40	1,35
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,49</b>	<b>0,04</b>	<b>0,80</b>	<b>1,83</b>	<b>76.316.209,18</b>	<b>10,87</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				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA	0,73	-0,20	0,81	2,11	5.389.063,63	0,77		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		6,70 % a.a								
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	0,66	0,05	1,06	2,20	5.402.048,18	0,77		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	0,62	0,04	1,05	2,17	5.394.316,56	0,77		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	9,23	0,22	1,25	2,17	5.759.574,00	0,82		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	0,72	-0,20	0,80	2,08	5.380.770,53	0,77		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 7,00% a.a	16,17	0,08	1,11	2,25	6.303.513,50	0,90		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>4,50</b>	<b>0,00</b>	<b>1,02</b>	<b>2,17</b>	<b>33.629.286,40</b>	<b>4,79</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 MULTISECTORIAL BVA MASTER III	354,42	0,00	19,63	20,92	37.815,88	0,01	1.308.125,24	2,89
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>354,42</b>	<b>0,00</b>	<b>19,63</b>	<b>20,92</b>	<b>37.815,88</b>	<b>0,01</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	0,06	0,05	0,83	1,83	3.584.163,22	0,51	15.350.519.848,35	0,02
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,21	0,05	0,95	2,08	6.230.847,33	0,89	5.258.089.412,65	0,12
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>0,23</b>	<b>0,05</b>	<b>0,90</b>	<b>1,99</b>	<b>9.815.010,55</b>	<b>1,40</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,63</b>	<b>0,06</b>	<b>0,93</b>	<b>1,78</b>	<b>477.205.211,23</b>	<b>67,99</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

13,10%

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	21,61	-0,70	2,80	-5,87	4.159.343,26	0,59	101.043.684,14	4,12
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	21,05	-0,14	0,31	-4,22	2.203.554,16	0,31	181.900.519,04	1,21
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	19,59	-0,15	0,63	-4,10	7.516.795,69	1,07	221.941.863,05	3,39
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,03	-1,06	2,43	-1,02	5.610.836,71	0,80	1.415.343.406,48	0,40
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	16,02	-0,45	1,43	-1,15	24.527.780,31	3,49	650.649.380,15	3,77
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	15,13	-0,97	1,15	-2,69	27.129.886,16	3,87	871.177.158,08	3,11
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	17,68	-0,83	2,90	1,37	6.826.078,67	0,97	516.851.657,29	1,32
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	20,49	-0,49	1,47	-4,07	3.890.044,24	0,55	358.684.421,84	1,08
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	18,40	0,35	2,24	-4,06	10.056.798,87	1,43	896.519.554,15	1,12
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,98	0,00	-0,72	-8,47	0,00	0,00	202.319.145,04	0,00
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>15,59</b>	<b>-0,56</b>	<b>1,41</b>	<b>-2,84</b>	<b>91.921.118,07</b>	<b>13,10</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>15,59</b>	<b>-0,56</b>	<b>1,41</b>	<b>-2,84</b>	<b>91.921.118,07</b>	<b>13,10</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,94%

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	16,49	0,23	3,34	5,80	18.118.841,83	2,58	240.074.387,26	7,55
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	28,44	-0,81	10,80	6,09	2.230.065,03	0,32	131.192.634,72	1,70
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,86	2,26	13,20	1,21	2.102.015,60	0,30	36.447.300,10	5,77
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,02	-0,41	3,51	3,42	2.577.232,26	0,37	62.362.068,38	4,13
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,50	1,52	8,42	12,80	3.340.346,26	0,48	763.217.450,44	0,44
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	14,65	0,32	2,92	5,80	5.871.862,83	0,84	329.505.382,91	1,78
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>12,21</b>	<b>0,38</b>	<b>4,78</b>	<b>5,98</b>	<b>34.240.363,81</b>	<b>4,88</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	13,37	0,50	4,54	7,40	21.480.519,66	3,06	697.423.955,25	3,08
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>13,37</b>	<b>0,50</b>	<b>4,54</b>	<b>7,40</b>	<b>21.480.519,66</b>	<b>3,06</b>		

Investimentos no Exterior

11,58 0,43 4,69 6,52 55.720.883,47 7,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,97%

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	12,99	0,71	-1,16	-1,59	7.693.453,19	1,10	51.619.838,30	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	12,34	0,61	5,65	7,40	21.642.429,67	3,08	935.362.029,08	2,31
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	12,36	0,61	5,74	7,56	36.120.990,46	5,15	608.566.481,77	5,94
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>10,85</b>	<b>0,62</b>	<b>4,85</b>	<b>6,35</b>	<b>65.456.873,32</b>	<b>9,33</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	29,50	3,04	3,04	2,87	11.567.180,55	1,65	368.993.009,51	3,13
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>29,50</b>	<b>3,04</b>	<b>3,04</b>	<b>2,87</b>	<b>11.567.180,55</b>	<b>1,65</b>		

<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>11,06</b>	<b>0,98</b>	<b>4,58</b>	<b>5,81</b>	<b>77.024.053,87</b>	<b>10,97</b>		
<b>Total</b>			<b>3,15</b>	<b>0,11</b>	<b>1,68</b>	<b>1,90</b>	<b>701.871.266,94</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	313.851.999,54	44,72	0,00	44,00	70,00	58,39	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	43.554.889,68	6,21	0,00	6,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	76.316.209,18	10,87	0,00	11,00	40,00	13,33	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	33.629.286,40	4,79	0,00	5,00	20,00	1,70	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	37.815,88	0,01	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	9.815.010,55	1,40	0,00	1,50	5,00	1,67	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>477.205.211,23</b>	<b>67,99</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	91.921.118,07	13,10	0,00	14,50	30,00	4,92	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>91.921.118,07</b>	<b>13,10</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	34.240.363,81	4,88	0,00	4,50	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	21.480.519,66	3,06	0,00	3,00	10,00	5,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>55.720.883,47</b>	<b>7,94</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	65.456.873,32	9,33	0,00	8,00	10,00	8,39	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	11.567.180,55	1,65	0,00	2,00	5,00	1,61	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>77.024.053,87</b>	<b>10,97</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>701.871.266,94</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	1,00 125,19	2,04 114,92	3,05 113,59	5,21 91,63	10,69 83,87	3.135.504,17	6.334.497,66
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,51 64,06	-0,48 <b>-27,07</b>	2,83 105,22	3,50 61,58	3,41 26,74	222.613,97	<b>-210.459,55</b>
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,80 99,18	1,83 103,13	2,78 103,21	5,59 98,27	12,81 100,53	522.831,68	1.214.843,79
Artigo 7º IV % do CDI	1,02 127,06	2,17 121,95	3,02 112,27	5,48 96,30	11,60 91,06	339.230,18	713.105,40
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	19,63 2.448,12	20,92 1.177,77	29,19 1.085,70	634,08 11.153,34	1.338,00 10.500,36	6.577,29	6.934,25
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,90 112,76	1,99 111,96	3,01 112,11	6,36 111,95	14,04 110,15	87.965,45	191.412,00
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,41 0,42	-2,84 1,01	2,57 1,24	9,36 <b>-2,12</b>	20,81 <b>-2,15</b>	1.376.431,92	<b>-2.872.962,52</b>
Artigo 9º II % do CDI	4,78 596,22	5,98 336,76	11,02 410,05	12,16 213,91	23,67 185,77	1.562.546,58	1.932.756,98
Artigo 9º III % do CDI	4,54 565,76	7,40 416,31	10,09 375,19	11,35 199,67	22,66 177,82	932.355,25	1.479.209,80
Artigo 10º I % do CDI	4,85 604,90	6,35 357,29	11,23 417,71	14,25 250,64	33,53 263,11	3.028.615,20	3.906.623,30
Artigo 10º II % do CDI	3,04 378,89	2,87 161,61	3,28 122,13	2,39 42,06	3,04 23,86	341.124,11	322.825,19
<b>JACAREÍ (Total)</b>						<b>11.555.795,80</b>	<b>13.018.786,30</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%)	2.215.149,68	0,00	0,00	0,00	2.237.057,15	21.907,47	44.049,69
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.084.100,66	0,00	0,00	0,00	1.095.079,83	10.979,17	22.109,03
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.643.689,41	0,00	0,00	0,00	20.850.793,69	207.104,28	416.818,88
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.246.492,60	0,00	0,00	0,00	2.267.701,34	21.208,74	42.521,05

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.242.895,19	0,00	0,00	0,00	2.264.103,27	21.208,08	42.523,18
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.242.168,06	0,00	0,00	0,00	2.263.417,31	21.249,25	42.613,96
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.232.520,21	0,00	0,00	0,00	2.254.139,68	21.619,47	43.418,30
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.233.999,30	0,00	0,00	0,00	2.255.785,31	21.786,01	43.769,90
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.233.199,30	0,00	0,00	0,00	2.255.025,58	21.826,28	43.859,21
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.546.217,10	0,00	0,00	0,00	1.561.719,92	15.502,82	31.198,16
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.087.993,29	0,00	0,00	0,00	2.109.178,80	21.185,51	42.669,92
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.267.884,52	0,00	0,00	0,00	3.301.087,06	33.202,54	66.872,21
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.263.536,22	0,00	0,00	0,00	2.285.086,59	21.550,37	43.229,79
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.260.791,60	0,00	0,00	0,00	2.282.331,91	21.540,31	43.210,86
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.256.724,18	0,00	0,00	0,00	2.278.308,21	21.584,03	43.308,77
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.244.387,24	0,00	0,00	0,00	2.266.268,90	21.881,66	43.958,23
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.243.573,77	0,00	0,00	0,00	2.265.534,01	21.960,24	44.131,22
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.242.119,89	0,00	0,00	0,00	2.264.130,84	22.010,95	44.242,26
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.277.151,01	0,00	0,00	0,00	5.330.677,46	53.526,45	107.796,33
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.180.219,69	0,00	0,00	0,00	2.202.378,12	22.158,43	44.630,37
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.097.393,65	0,00	0,00	0,00	2.118.767,67	21.374,02	43.054,88
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.408.587,75	0,00	0,00	0,00	6.473.972,98	65.385,23	131.728,28
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.091.350,14	0,00	0,00	0,00	2.112.699,15	21.349,01	43.011,58
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.701.849,63	0,00	0,00	0,00	4.750.580,50	48.730,87	98.269,73
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.706.400,22	0,00	0,00	0,00	3.745.127,46	38.727,24	78.125,25
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.120.988,07	0,00	0,00	0,00	3.153.650,42	32.662,35	65.897,98
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.127.558,18	0,00	0,00	0,00	2.150.004,34	22.446,16	45.312,24
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.271.144,97	0,00	0,00	0,00	2.292.817,74	21.672,77	43.481,41
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.266.051,32	0,00	0,00	0,00	2.287.724,35	21.673,03	43.488,64
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.260.984,37	0,00	0,00	0,00	2.282.657,87	21.673,50	43.496,28
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.249.487,97	0,00	0,00	0,00	2.271.468,14	21.980,17	44.162,39
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.250.516,66	0,00	0,00	0,00	2.272.595,25	22.078,59	44.372,96
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.248.436,54	0,00	0,00	0,00	2.270.577,13	22.140,59	44.505,50

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.239.651,41	0,00	0,00	0,00	2.261.864,81	22.213,40	44.676,00
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.624.614,68	0,00	0,00	0,00	11.742.530,44	117.915,76	237.458,39
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.179.727,27	0,00	0,00	0,00	2.201.881,19	22.153,92	44.622,18
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.235.246,91	0,00	0,00	0,00	5.288.596,66	53.349,75	107.470,33
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.095.034,56	0,00	0,00	0,00	2.116.429,68	21.395,12	43.103,86
NTN-B 150555 (5,950000%)	17.095.353,59	0,00	0,00	0,00	17.270.205,04	174.851,45	352.327,55
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.401.188,31	0,00	0,00	0,00	9.498.626,34	97.438,03	196.486,05
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.465.976,21	0,00	0,00	0,00	8.554.458,02	88.481,81	178.507,85
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.282.231,84	0,00	0,00	0,00	7.358.380,48	76.148,64	153.629,88
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.323.779,51	0,00	0,00	0,00	5.379.953,51	56.174,00	113.387,12
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.244.214,41	0,00	0,00	64.509,97	2.201.301,78	21.597,34	43.783,45
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.277.682,18	0,00	0,00	65.506,26	2.234.264,44	22.088,52	44.802,22
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.237.896,89	0,00	0,00	64.509,97	2.195.821,36	22.434,44	45.598,12
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.273.616,05	0,00	0,00	64.136,36	2.230.820,44	21.340,75	43.189,11
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.276.322,87	0,00	0,00	64.385,43	2.233.500,23	21.562,79	43.664,14
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.277.694,45	0,00	0,00	64.509,97	2.234.856,72	21.672,24	43.899,68
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.284.462,54	0,00	0,00	65.132,65	2.241.551,55	22.221,66	45.078,29
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.347.068,61	0,00	0,00	95.893,20	3.284.255,87	33.080,46	67.168,97
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.287.566,45	0,00	0,00	63.140,07	2.245.648,10	21.221,72	42.904,34
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.281.895,18	0,00	0,00	63.638,21	2.239.870,72	21.613,75	43.763,02
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.285.483,55	0,00	0,00	64.011,82	2.243.305,11	21.833,38	44.229,75
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.282.920,74	0,00	0,00	64.011,82	2.240.766,46	21.857,54	44.285,28
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.356.186,70	0,00	0,00	96.017,73	3.293.577,78	33.408,81	67.867,06
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.297.113,67	0,00	0,00	62.392,85	2.256.053,39	21.332,57	43.125,09
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.292.404,13	0,00	0,00	62.392,85	2.251.365,09	21.353,81	43.177,59
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.287.048,50	0,00	0,00	63.140,07	2.245.660,96	21.752,53	44.049,28
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.289.841,67	0,00	0,00	63.513,68	2.248.254,39	21.926,40	44.423,18
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.290.825,57	0,00	0,00	63.638,21	2.249.170,86	21.983,50	44.546,15
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.606.244,22	0,00	0,00	100.999,20	3.540.257,53	35.012,51	71.005,34



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.289.818,79	0,00	0,00	64.260,90	2.247.855,47	22.297,58	45.224,81
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.359.479,77	0,00	0,00	95.893,20	3.297.087,84	33.501,27	68.058,96
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.316.139,66	0,00	0,00	59.902,11	2.277.911,79	21.674,24	43.819,47
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.306.576,16	0,00	0,00	59.777,58	2.268.416,30	21.617,72	43.709,45
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.309.109,41	0,00	0,00	60.151,19	2.270.680,51	21.722,29	43.932,66
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.301.279,33	0,00	0,00	61.521,09	2.261.814,85	22.056,61	44.671,15
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.302.176,15	0,00	0,00	61.770,16	2.262.527,93	22.121,94	44.815,96
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.299.785,07	0,00	0,00	62.019,24	2.259.946,76	22.180,93	44.943,28
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.152.863,60	0,00	0,00	60.898,41	2.113.440,59	21.475,40	43.626,11
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.361.969,10	0,00	0,00	95.270,51	3.300.279,42	33.580,83	68.220,68
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.175.571,28	0,00	0,00	93.277,93	3.114.811,16	32.517,81	66.181,95
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.330.431,26	0,00	0,00	58.283,14	2.293.952,44	21.804,32	44.065,66
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.327.791,97	0,00	0,00	58.532,21	2.291.101,62	21.841,86	44.156,17
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.323.341,15	0,00	0,00	58.656,75	2.286.535,79	21.851,39	44.180,35
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.317.354,24	0,00	0,00	58.781,28	2.280.422,98	21.850,02	44.187,45
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.307.901,10	0,00	0,00	60.524,80	2.269.537,34	22.161,04	44.883,02
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.307.235,61	0,00	0,00	61.022,94	2.268.470,38	22.257,71	45.095,86
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.306.202,52	0,00	0,00	61.396,55	2.267.134,43	22.328,46	45.249,70
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.299.424,97	0,00	0,00	62.019,24	2.259.828,83	22.423,10	45.466,72
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.693.092,75	0,00	0,00	244.340,85	8.535.446,67	86.694,77	176.087,72
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.229.558,62	0,00	0,00	91.534,41	3.170.374,96	32.350,75	65.736,69
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.155.284,64	0,00	0,00	61.272,02	2.115.637,97	21.625,35	43.948,61
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.749.707,78	0,00	0,00	335.252,58	11.532.596,43	118.141,23	240.108,96
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.990.004,28	0,00	0,00	204.240,06	6.856.950,77	71.186,55	144.834,37
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.823.864,51	0,00	0,00	172.732,29	5.710.924,25	59.792,03	121.722,40
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.354.972,15	0,00	0,00	159.157,80	5.250.852,90	55.038,55	112.057,76
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.195.065,34	0,00	0,00	96.391,34	3.131.782,23	33.108,23	67.444,03
	314.650.856,27	0,00	0,00	3.934.360,90	313.851.999,54	3.135.504,17	

**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	21.563.149,39	0,00	0,00	0,00	21.668.570,37	105.420,98	-225.897,30
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.769.126,32	0,00	0,00	0,00	21.886.319,31	117.192,99	15.437,75
	43.332.275,71	0,00	0,00	0,00	43.554.889,68	222.613,97	

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	11.430.047,20	0,00	0,00	0,00	11.521.844,10	91.796,90	292.655,63
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	21.908.643,75	0,00	0,00	0,00	22.088.076,25	179.432,50	397.795,31
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5.188.355,50	0,00	0,00	0,00	5.206.174,50	17.819,00	85.936,50
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	26.095.331,05	13.519.000,00	-2.348.000,00	0,00	37.500.114,33	233.783,28	438.456,35
	64.622.377,50	13.519.000,00	-2.348.000,00	0,00	76.316.209,18	522.831,68	

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	5.338.262,40	0,00	0,00	0,00	5.394.316,56	56.054,16	114.765,37
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	5.345.291,93	0,00	0,00	0,00	5.402.048,18	56.756,25	116.446,15
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a	6.234.370,88	0,00	0,00	0,00	6.303.513,50	69.142,62	138.793,15
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	5.338.163,60	0,00	0,00	0,00	5.380.770,53	42.606,93	109.523,73
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	5.345.597,15	0,00	0,00	0,00	5.389.063,63	43.466,48	111.384,25
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.688.370,26	0,00	0,00	0,00	5.759.574,00	71.203,74	122.192,75
	33.290.056,22	0,00	0,00	0,00	33.629.286,40	339.230,18	

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	33.499,55	0,00	0,00	2.260,96	37.815,88	6.577,29	6.934,25
	33.499,55	0,00	0,00	2.260,96	37.815,88	6.577,29	

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	3.554.816,74	0,00	0,00	0,00	3.584.163,22	29.346,48	64.335,75
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	6.172.228,36	0,00	0,00	0,00	6.230.847,33	58.618,97	127.076,25
	9.727.045,10	0,00	0,00	0,00	9.815.010,55	87.965,45	

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	7.469.447,35	0,00	0,00	0,00	7.516.795,69	47.348,34	-321.685,85
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.477.733,12	0,00	0,00	0,00	5.610.836,71	133.103,59	-57.853,01
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	6.633.446,30	0,00	0,00	0,00	6.826.078,67	192.632,37	92.279,59
INDIE FIC FIA	3.833.778,34	0,00	0,00	0,00	3.890.044,24	56.265,90	-164.974,74
META VALOR FI DE AÇÕES	2.196.852,95	0,00	0,00	0,00	2.203.554,16	6.701,21	-97.001,18
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	24.181.749,30	0,00	0,00	0,00	24.527.780,31	346.031,01	-284.648,59
OCCAM FIC FIA	26.821.226,64	0,00	0,00	0,00	27.129.886,16	308.659,52	-748.745,15
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	4.046.040,89	0,00	0,00	0,00	4.159.343,26	113.302,37	-259.248,04
TARPON GT 30 FIC FIA	9.836.656,14	0,00	0,00	0,00	10.056.798,87	220.142,73	-425.219,41
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	6.591.816,24	0,00	-6.544.061,12	0,00	0,00	-47.755,12	-605.866,14
	97.088.747,27	0,00	-6.544.061,12	0,00	91.921.118,07	1.376.431,92	

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	17.532.413,72	0,00	0,00	0,00	18.118.841,83	586.428,11	993.707,40
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	2.012.627,83	0,00	0,00	0,00	2.230.065,03	217.437,20	128.036,46
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.856.942,25	0,00	0,00	0,00	2.102.015,60	245.073,35	25.092,01
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.489.720,26	0,00	0,00	0,00	2.577.232,26	87.512,00	85.106,33
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.080.954,16	0,00	0,00	0,00	3.340.346,26	259.392,10	379.057,53
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	5.705.159,01	0,00	0,00	0,00	5.871.862,83	166.703,82	321.757,25

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	32.677.817,23	0,00	0,00	0,00	34.240.363,81	1.562.546,58	

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	20.548.164,41	0,00	0,00	0,00	21.480.519,66	932.355,25	1.479.209,80
	20.548.164,41	0,00	0,00	0,00	21.480.519,66	932.355,25	

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	34.160.639,21	0,00	0,00	0,00	36.120.990,46	1.960.351,25	2.538.891,98
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	7.783.407,00	0,00	0,00	0,00	7.693.453,19	-89.953,81	-124.026,39
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	20.484.211,91	0,00	0,00	0,00	21.642.429,67	1.158.217,76	1.491.757,71
	62.428.258,12	0,00	0,00	0,00	65.456.873,32	3.028.615,20	

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	11.226.056,44	0,00	0,00	0,00	11.567.180,55	341.124,11	322.825,19
	11.226.056,44	0,00	0,00	0,00	11.567.180,55	341.124,11	

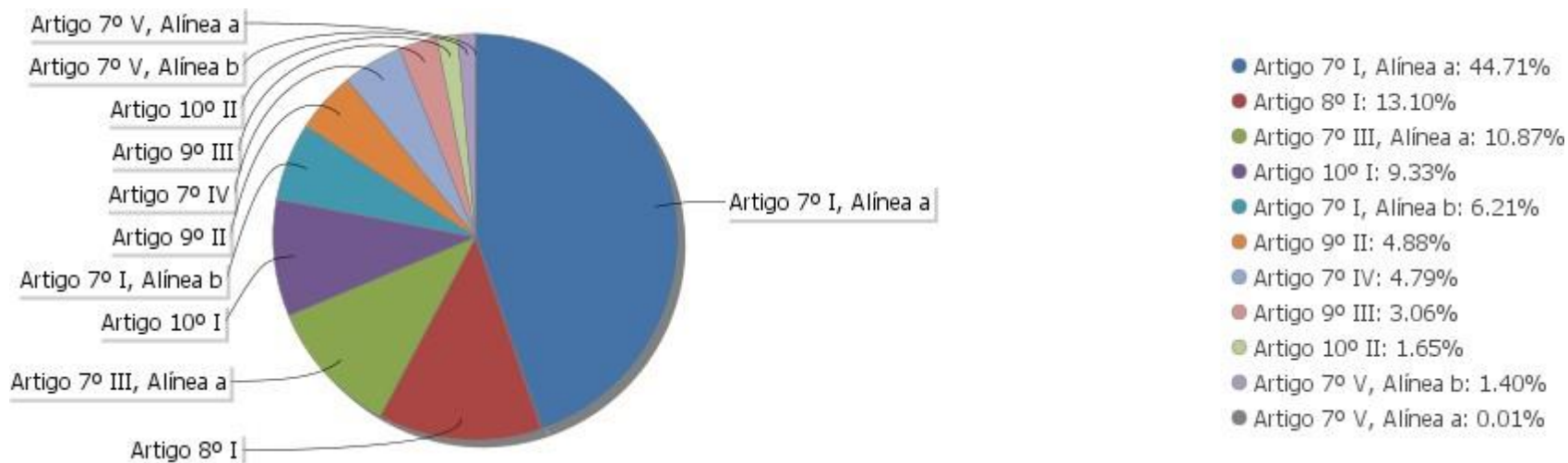
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

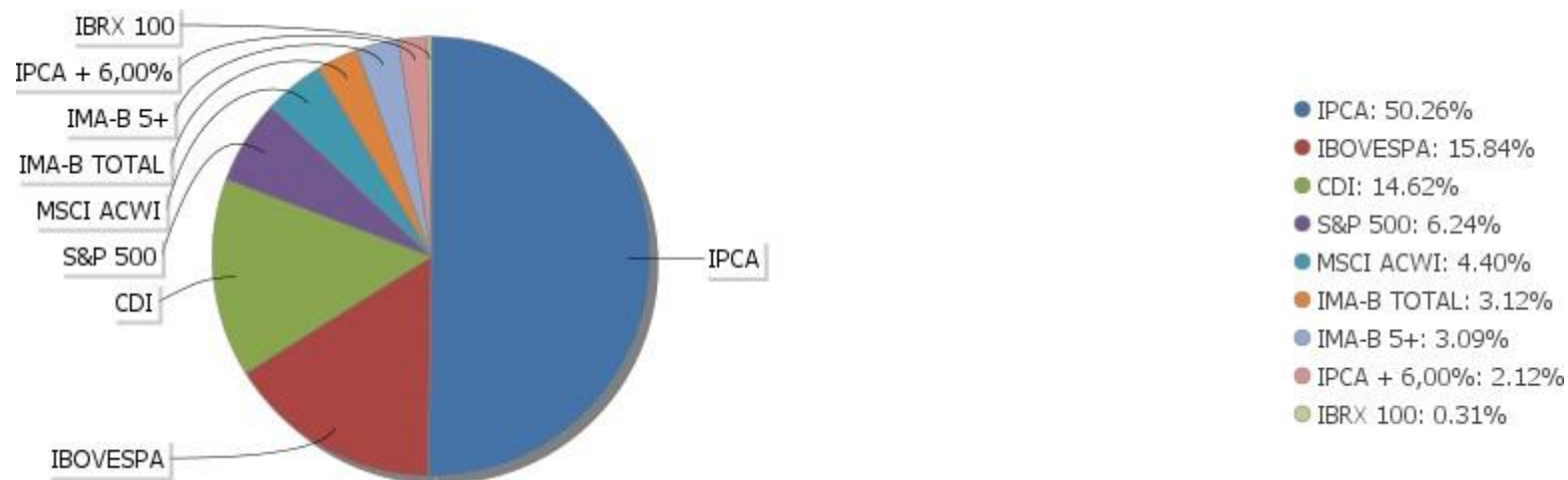
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	282.545.743,59	40,26		282.545.743,59	40,26	
de 31 dias a 365 dias	61.702.269,64	8,79		344.248.013,23	49,05	
acima de 365 dias	357.623.253,41	50,95		701.871.266,94	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

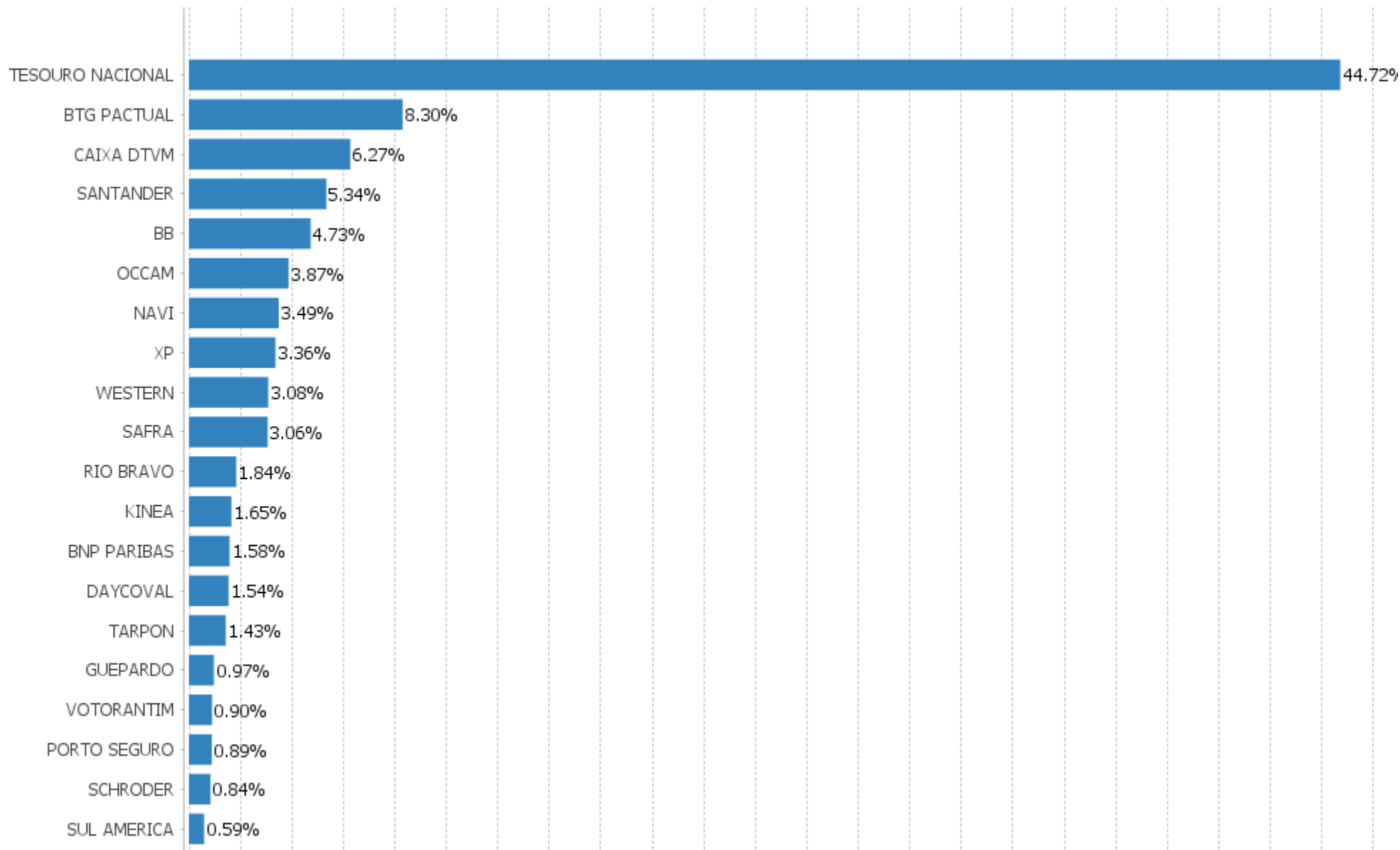


Alocação Por Estratégia

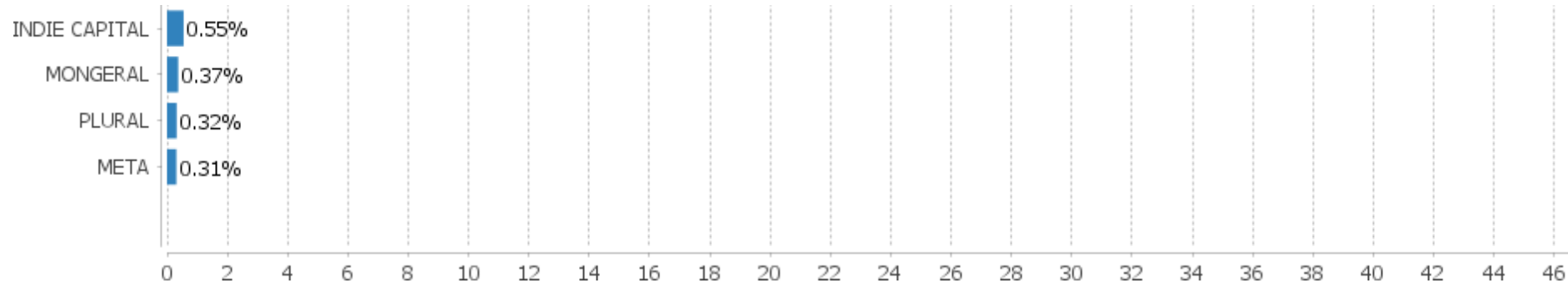


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS





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	1,68											1,90
IPCA + 5,11%	0,86	1,21											2,08
p.p. indexador	-0,65	0,47											-0,18
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	11	42,31	03 meses	4,22	3,06	1,17	2,68
Meses abaixo - Meta Atuarial	15	57,69	06 meses	7,02	5,12	1,90	3,22
			12 meses	14,87	9,79	5,07	3,15
			24 meses	20,85	21,57	-0,71	4,35
Maior rentabilidade da Carteira	3,32	2023-11	Desde 31/12/2021	20,66	24,38	-3,72	4,45
Menor rentabilidade da Carteira	-1,97	2022-06					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Evolução**

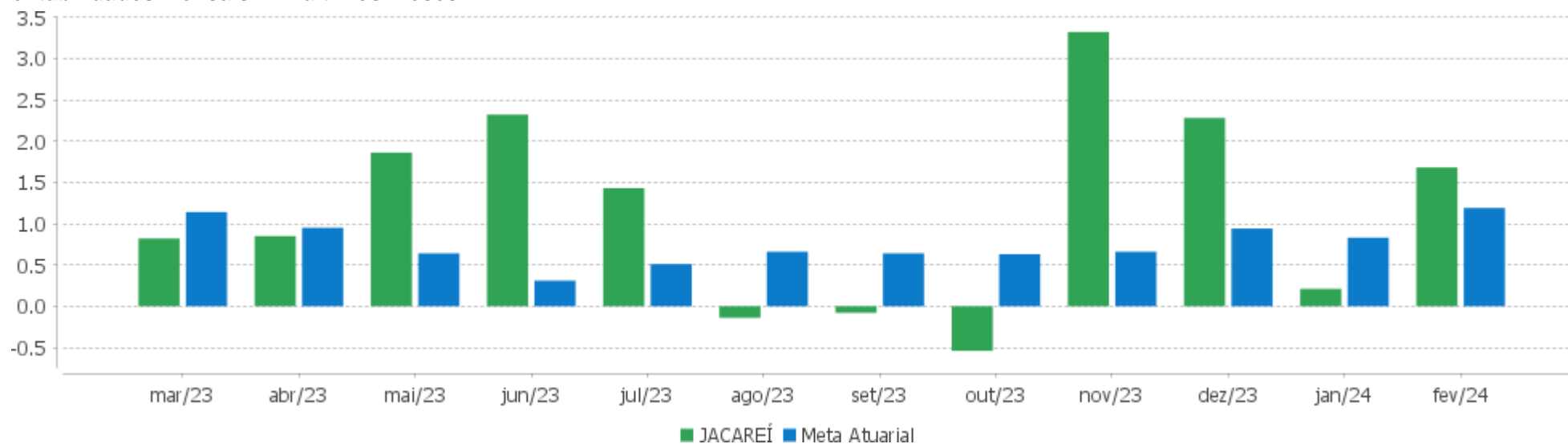


**Patrimônio Líquido**



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 - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a Var. IPCA p.p.	0,81 -0,02	2,11 0,86	2,93 1,11	5,38 2,76			
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a Var. IPCA p.p.	1,06 0,23	2,20 0,95	3,08 1,26	5,50 2,88			
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a Var. IPCA p.p.	1,05 0,22	2,17 0,92	3,06 1,24	5,44 2,82			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	1,25 0,42	2,17 0,91	2,95 1,13	5,56 2,94	11,85 7,35		
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a Var. IPCA p.p.	0,80 -0,03	2,08 0,82	2,89 1,06	5,28 2,66			
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	1,11 0,28	2,25 1,00	3,18 1,36	5,67 3,05	11,81 7,32		
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	0,95 118,42	2,08 117,20	3,16 117,37	6,66 117,07	14,82 116,33	29,19 106,56	39,00 112,73
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,83 102,93	1,83 102,89	2,77 103,01	5,86 103,10	13,11 102,89	28,54 104,17	37,21 107,56
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,21	2,11 0,86	3,22 1,40	5,48 2,87	11,22 6,72	21,05 10,70	
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,82	3,15 1,33	5,36 2,74	10,96 6,46	20,60 10,26	
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,13	1,95 0,70	2,80 0,98	4,81 2,19	9,97 5,47	22,11 11,77	
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,16	2,01 0,76	2,85 1,02	4,95 2,33	10,30 5,80	22,89 12,55	
NTN-B 150533 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,04 0,79	2,99 1,17	5,15 2,53	7,53 3,03	13,40 3,06	
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,83	3,17 1,35	5,39 2,77	11,01 6,52	24,24 13,89	
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,81	3,12 1,30	5,32 2,70	10,89 6,39	23,99 13,65	
NTN-B 150545 (5,915000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,82	3,13 1,31	5,34 2,73	10,95 6,45	24,12 13,78	
NTN-B 150850 (5,831200%)	1,01	2,06	3,14	5,33	10,89	23,95	

**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.	0,18	0,81	1,32	2,71	6,39	13,61	
NTN-B 150826 (5,190000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,14	1,96 0,71	2,79 0,97	4,82 2,21	10,02 5,52	22,24 11,90	
NTN-B 150830 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,14	1,98 0,72	2,86 1,04	4,91 2,30	10,15 5,66	22,48 12,14	
NTN-B 150840 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,06 0,81	3,08 1,26	5,27 2,65	10,83 6,33	23,90 13,56	
NTN-B 150545 (4,970000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,12	1,93 0,67	2,88 1,06	4,86 2,25	9,94 5,44	21,90 11,56	
NTN-B 150840 (4,950000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,12	1,93 0,67	2,85 1,03	4,82 2,20	9,89 5,39	21,82 11,47	
NTN-B 150850 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,12	1,93 0,68	2,91 1,09	4,89 2,28	9,98 5,48	21,95 11,61	
NTN-B 150850 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,99 0,74	3,01 1,19	5,09 2,47	10,38 5,89	22,85 12,50	
NTN-B 150555 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,83	3,18 1,36	5,39 2,78	11,01 6,51	24,20 13,86	
NTN-B 150545 (5,922000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,82	3,13 1,31	5,35 2,73	10,96 6,46	24,14 13,80	
NTN-B 150535 (4,910000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,12	1,92 0,67	2,81 0,99	4,77 2,15	9,81 5,32	21,69 11,35	
NTN-B 150840 (5,020000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,13	1,94 0,68	2,87 1,05	4,86 2,24	9,96 5,46	21,98 11,64	
NTN-B 150555 (5,370000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,99 0,74	3,03 1,21	5,11 2,49	10,41 5,92	22,89 12,55	
NTN-B 150850 (4,940000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,12	1,92 0,67	2,90 1,08	4,87 2,26	9,93 5,44	21,86 11,52	
NTN-B 150545 (6,280000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,22	2,13 0,88	3,23 1,41	5,53 2,91	11,34 6,84	17,70 7,35	
NTN-B 150840 (4,970000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,12	1,93 0,67	2,85 1,03	4,83 2,21	9,91 5,41	21,87 11,52	
NTN-B 150826 (5,490000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,16	2,01 0,76	2,87 1,05	4,97 2,35	10,33 5,83	22,94 12,59	
NTN-B 150830 (5,460000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,16	2,01 0,75	2,91 1,09	5,01 2,39	10,35 5,86	16,19 5,85	
NTN-B 150850 (6,261000%)	1,05	2,13	3,25	5,54	11,34	24,97	

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Variação da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. IPCA p.p.	0,22	0,88	1,43	2,93	6,85	14,63	
NTN-B 150535 (5,320000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,98 0,73	2,91 1,09	4,98 2,36	10,25 5,75	22,65 12,30	
NTN-B 150555 (5,000000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,12	1,93 0,68	2,94 1,12	4,92 2,31	10,02 5,52	22,02 11,68	
NTN-B 150535 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,04 0,78	3,00 1,18	5,15 2,54	7,54 3,04	13,43 3,08	
NTN-B 150850 (5,010000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,13	1,93 0,68	2,92 1,10	4,91 2,29	10,01 5,51	22,02 11,68	
NTN-B 150545 (6,256000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,21	2,13 0,88	3,22 1,40	5,52 2,90	11,31 6,82	24,93 14,58	
NTN-B 150555 (6,261000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,22	2,13 0,88	3,26 1,44	5,56 2,94	11,36 6,87	24,99 14,65	
NTN-B 150555 (5,520000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,16	2,01 0,76	3,07 1,25	5,19 2,57	10,57 6,08	23,24 12,90	
NTN-B 150555 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,81	3,16 1,34	5,36 2,74	10,94 6,44	24,04 13,70	
NTN-B 150545 (5,380000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,99 0,74	2,99 1,17	5,07 2,46	10,38 5,88	22,86 12,52	
NTN-B 150826 (5,009000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,12	1,93 0,68	2,75 0,93	4,73 2,12	9,83 5,33	21,82 11,48	
NTN-B 150545 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,23	2,15 0,90	3,26 1,44	5,59 2,97	11,47 6,97	17,87 7,52	
NTN-B 150535 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,81	3,05 1,23	5,25 2,63	10,81 6,32	23,90 13,56	
NTN-B 150555 (5,831200%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,06 0,81	3,15 1,33	5,34 2,73	10,91 6,41	23,98 13,63	
NTN-B 150828 (4,850000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,11	1,91 0,66	2,73 0,91	4,67 2,06	9,68 5,18	21,47 11,13	
NTN-B 150545 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,06 0,81	3,11 1,29	5,30 2,68	10,86 6,36	23,92 13,58	
NTN-B 150555 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,23	2,15 0,90	3,30 1,48	5,63 3,01	11,51 7,01	17,86 7,52	
NTN-B 150828 (5,240000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,14	1,97 0,72	2,82 1,00	4,87 2,25	10,09 5,59	22,38 12,03	
NTN-B 150545 (5,340000%)	0,98	1,99	2,98	5,05	10,34	22,77	

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Variação da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. IPCA p.p.	0,15	0,73	1,16	2,43	5,84	12,43	
NTN-B 150850 (5,921000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,82	3,16 1,34	5,37 2,76	10,98 6,49	24,17 13,82	
NTN-B 150535 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,11	1,91 0,66	2,80 0,97	4,74 2,13	9,76 5,26	21,57 11,23	
NTN-B 150555 (6,268000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,22	2,13 0,88	3,27 1,45	5,56 2,95	11,37 6,87	17,69 7,35	
NTN-B 150826 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,04 0,79	2,92 1,10	5,08 2,46	10,56 6,06	23,45 13,10	
NTN-B 150555 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,21	2,11 0,86	3,23 1,41	5,50 2,88	11,23 6,74	21,06 10,72	
NTN-B 150828 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,14	1,98 0,72	2,83 1,01	4,88 2,26	10,12 5,62	22,45 12,10	
NTN-B 150535 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,98 0,73	2,91 1,09	4,96 2,35	10,22 5,72	22,58 12,23	
NTN-B 150830 (5,835000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,06 0,81	3,00 1,18	5,19 2,58	10,75 6,25	23,80 13,46	
NTN-B 150535 (5,837000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,06 0,81	3,05 1,23	5,24 2,62	10,80 6,30	23,86 13,52	
NTN-B 150555 (5,315000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,98 0,73	3,02 1,20	5,08 2,47	10,35 5,86	22,76 12,42	
NTN-B 150830 (5,300000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,98 0,73	2,87 1,05	4,93 2,31	10,18 5,69	22,55 12,21	
NTN-B 150545 (5,285000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,14	1,98 0,72	2,97 1,15	5,02 2,41	10,28 5,78	22,64 12,30	
NTN-B 150830 (5,500000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,16	2,01 0,76	2,92 1,10	5,03 2,41	10,39 5,90	23,02 12,68	
NTN-B 150824 (5,450000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,16	2,00 0,75	2,82 1,00	4,91 2,29	10,25 5,75	22,80 12,45	
NTN-B 150830 (5,178300%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,14	1,96 0,71	2,84 1,02	4,87 2,25	10,06 5,56	22,27 11,93	
NTN-B 150545 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,82	3,13 1,31	5,33 2,72	10,93 6,43	20,57 10,22	
NTN-B 150545 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,13	1,94 0,68	2,90 1,08	4,89 2,28	10,00 5,51	22,04 11,70	
NTN-B 150850 (6,400000%)	1,06	2,15	3,28	5,61	11,49	21,52	

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Variação da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. IPCA p.p.	0,23	0,90	1,46	3,00	7,00	11,18	
NTN-B 150824 (5,912000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,82	2,93 1,11	5,13 2,52	10,72 6,23	23,87 13,52	
NTN-B 150850 (5,045000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,13	1,94 0,69	2,93 1,11	4,93 2,31	10,05 5,55	22,11 11,76	
NTN-B 150555 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,13	1,94 0,68	2,94 1,12	4,94 2,32	10,05 5,55	22,09 11,75	
NTN-B 150840 (5,274000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,14	1,98 0,72	2,93 1,11	4,99 2,37	10,23 5,74	22,58 12,23	
NTN-B 150826 (5,130000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,13	1,95 0,70	2,78 0,96	4,79 2,18	9,95 5,46	22,10 11,76	
NTN-B 150840 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,99 0,74	2,96 1,14	5,03 2,41	10,32 5,83	22,78 12,43	
NTN-B 150850 (5,410000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	2,00 0,74	3,03 1,20	5,11 2,50	10,44 5,94	22,96 12,62	
NTN-B 150840 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,81	3,08 1,26	5,28 2,66	10,85 6,35	23,94 13,60	
NTN-B 150545 (4,980000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,12	1,93 0,68	2,89 1,07	4,87 2,25	9,95 5,45	21,92 11,58	
NTN-B 150830 (4,860000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,11	1,91 0,66	2,76 0,94	4,71 2,09	9,72 5,22	21,53 11,19	
NTN-B 150840 (5,310000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,98 0,73	2,94 1,12	5,00 2,39	10,27 5,77	22,66 12,32	
NTN-B 150824 (5,345000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,99 0,73	2,79 0,97	4,86 2,24	10,14 5,64	22,55 12,21	
NTN-B 150830 (4,900000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,12	1,92 0,66	2,77 0,95	4,73 2,11	9,76 5,27	21,62 11,28	
NTN-B 150545 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,21	2,11 0,86	3,19 1,37	5,46 2,84	11,19 6,69	21,02 10,68	
NTN-B 150850 (5,295500%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,98 0,73	3,00 1,17	5,05 2,44	10,31 5,82	22,69 12,35	
NTN-B 150535 (4,880000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,12	1,91 0,66	2,80 0,98	4,75 2,14	9,78 5,28	21,62 11,28	
NTN-B 150555 (5,420000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	2,00 0,75	3,05 1,23	5,14 2,52	10,47 5,97	23,01 12,66	
NTN-B 150850 (5,510000%)	0,99	2,01	3,05	5,16	10,54	23,20	



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.	0,16	0,76	1,23	2,55	6,05	12,85	
NTN-B 150850 (6,278000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,22	2,13 0,88	3,25 1,43	5,55 2,94	11,36 6,87	17,70 7,36	
NTN-B 150555 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,82	3,17 1,35	5,38 2,76	10,98 6,48	20,63 10,28	
NTN-B 150840 (6,220000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,21	2,12 0,87	3,18 1,36	5,46 2,85	11,24 6,74	24,80 14,46	
NTN-B 150555 (5,060000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,13	1,94 0,69	2,95 1,13	4,95 2,34	10,08 5,59	22,16 11,82	
NTN-B 150828 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,06 0,81	2,96 1,14	5,15 2,53	10,69 6,19	23,71 13,36	
NTN-B 150555 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,83	3,18 1,36	5,40 2,79	11,03 6,54	24,26 13,91	
NTN-B 150525 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,06 0,81	2,92 1,10	5,11 2,49	10,64 6,15	23,66 13,31	
NTN-B 150535 (5,196100%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,14	1,96 0,71	2,88 1,06	4,91 2,30	10,12 5,62	22,36 12,01	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,54 -0,01	0,07 -0,03	2,80 -0,05	3,78 -0,09	14,54 -0,16	23,41 -0,40	24,22 -0,73
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,49 -0,02	-1,03 -0,07	2,86 -0,08	3,22 -0,15	17,79 -0,47	23,14 -0,87	17,57 -1,18
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III % do CDI	19,63 2.448,11	20,92 1.177,76	29,19 1.085,70	634,08 11.153,35	1.338,00 10.500,34	182,16 664,89	5.343,27 15.446,77
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 100,14	1,78 100,07	2,70 100,27	5,67 99,81	12,75 100,03	27,44 100,14	35,09 101,45
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,82 102,12	1,83 103,24	2,79 103,61	5,90 103,70	13,31 104,45	27,98 102,14	35,75 103,36
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	0,34 -0,49	1,68 0,42	2,58 0,76	1,88 -0,73			
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,86 107,46	1,91 107,60	2,87 106,82	5,96 104,88	13,39 105,10	28,29 103,26	36,50 105,52
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,43 1,44	-1,02 2,83	3,76 2,43	12,36 0,89	16,89 -6,07	6,29 -7,75	-23,05 -40,30
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,24 1,25	-4,06 -0,21	5,39 4,06	15,20 3,73	49,41 26,46	60,84 46,81	96,95 79,70
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	0,84	-7,04	-2,78	-7,08	3,96	15,37	45,76

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.	-0,16	-3,19	-4,10	-18,56	-18,99	1,34	28,51
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,43 0,44	-1,15 2,70	4,48 3,15	14,49 3,02	25,61 2,66	19,11 5,07	29,98 12,72
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,90 1,91	1,37 5,22	4,08 2,75	15,78 4,30	50,26 27,31	48,40 34,37	79,70 62,44
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,80 1,81	-5,87 -2,02	-2,09 -3,42	-4,22 -15,69	2,57 -20,39	-11,69 -25,72	-21,11 -38,36
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,47 0,48	-4,07 -0,22	1,23 -0,09	6,45 -5,03	27,72 4,76	1,31 -12,73	-19,81 -37,07
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	0,63 -0,36	-4,10 -0,25	2,15 0,82	1,86 -9,61	13,35 -9,60	-5,58 -19,62	-15,01 -32,27
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,15 0,16	-2,69 1,16	2,07 0,75	11,14 -0,33	17,16 -5,80	9,37 -4,66	9,73 -7,52
META VALOR FI DE AÇÕES Var. IBRX 100 p.p.	0,31 -0,66	-4,22 -0,63	2,99 1,29	4,53 -7,23	1,72 -20,51	-11,32 -23,49	-19,03 -34,41
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	4,54 3,55	7,40 11,24	10,09 8,76	11,35 -0,12	22,66 -0,30	7,22 -6,81	8,44 -8,82
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	13,20 8,41	1,21 -6,58	-1,89 -12,59	-13,30 -25,64	-26,84 -42,65	-33,00 -38,67	-49,82 -54,21
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	3,34 -1,45	5,80 -1,98	11,32 0,63	14,88 2,55	38,67 22,86	12,11 6,44	8,54 4,15
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	2,92 -1,87	5,80 -1,99	10,11 -0,58	11,66 -0,68	16,02 0,21	9,69 4,02	5,69 1,30
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	10,80 6,01	6,09 -1,70	18,45 7,76	18,79 6,46	28,29 12,48	-18,82 -24,50	-47,84 -52,23
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	3,51 -1,28	3,42 -4,37	9,23 -1,47	5,00 -7,33	1,76 -14,05	-24,58 -30,26	-39,29 -43,68
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	8,42 7,15	12,80 10,58	17,34 14,07	21,85 16,30	38,33 27,61	14,96 -8,94	-16,08 -61,29
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-1,16 -6,96	-1,59 -11,56	-1,05 -13,70	1,50 -12,97	10,87 -11,96		
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	5,65 705,01	7,40 416,73	12,95 481,76	15,96 280,70	36,61 287,33	35,48 129,49	62,47 180,58
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	5,74 -0,07	7,56 -2,42	13,19 0,54	16,33 1,87	37,65 14,82	42,69 29,99	72,42 51,93
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	3,04	2,87	3,28	3,82	4,61	-4,49	15,68

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.	1,76	0,65	0,02	-1,74	-6,10	-28,39	-29,53
<b>JACAREÍ</b>	<b>1,68</b>	<b>1,90</b>	<b>4,22</b>	<b>7,02</b>	<b>14,87</b>	<b>20,85</b>	
Var. IPCA + 4,83% p.p.	0,47	-0,18	1,17	1,90	5,07	-0,99	
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21

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 cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro	
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1	D+1	D+30	D+32	-	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,76	1,61	2,53	5,52	12,71	27,14	32,56	36,64	45,55
IRF-M 1+	0,34	0,94	2,69	5,87	17,85	28,53	26,35	29,91	48,38
IRF-M TOTAL	0,46	1,13	2,63	5,74	15,85	27,58	28,20	32,06	47,72
IMA-B 5	0,59	1,28	2,76	4,42	10,44	23,21	31,00	39,16	56,09
IMA-B 5+	0,51	-0,96	2,94	3,37	18,26	24,00	18,75	19,88	46,30
IMA-B TOTAL	0,55	0,10	2,85	3,87	14,70	23,81	24,95	28,90	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,64	1,11	2,75	5,15	14,09	26,08	29,72	34,01	49,13
IDKA 2	0,42	1,23	2,70	4,46	10,12	22,51	30,72	39,80	55,45
IDKA 20	0,22	-3,13	3,25	3,06	28,07	25,16	9,21	7,12	36,25
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59	37,78	45,48

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25	23,85	34,98
IBRX 100	0,96	-3,59	1,70	11,76	22,23	12,17	15,38	23,37	37,13
IBRX 50	0,91	-3,27	1,87	12,03	21,50	12,09	17,44	26,99	35,38
SMALL CAP	0,47	-6,11	0,51	1,70	19,40	-4,74	-17,42	-15,61	14,52
Índice Consumo - ICON	0,09	-8,26	-2,77	-1,10	5,65	-26,51	-42,10	-41,50	-21,16
Índice Dividendos - IDIV	0,91	-2,64	4,09	13,07	26,16	32,52	44,70	39,59	69,79

### 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	5,80	9,98	12,65	14,47	22,83	12,70	20,50	91,09	143,96

#### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,79	1,47	5,77	4,58	19,64	22,58	16,40	13,37	38,01

#### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,79	7,79	10,70	12,33	15,81	5,67	4,39	64,46	101,55

#### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,83	1,25	1,82	2,62	4,50	10,34	21,98	28,32	33,45
INPC	0,81	1,38	1,94	2,28	3,86	9,54	21,37	28,92	33,97
IGPM	-0,52	-0,45	0,29	1,76	-3,76	-1,97	13,83	46,78	56,79
SELIC	0,80	1,78	2,69	5,68	12,74	27,39	34,59	37,78	45,47

#### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,13	1,90	2,79	4,58	8,64	19,29	37,17	49,99	62,22
IPCA + 5,00%	1,20	2,06	3,03	5,07	9,68	21,58	41,15	55,82	70,13
IPCA + 5,50%	1,24	2,14	3,15	5,31	10,20	22,74	43,17	58,79	74,20
IPCA + 5,89%	1,27	2,20	3,24	5,50	10,60	23,64	44,76	61,14	77,43
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21	61,81	78,34
INPC + 4,00%	1,11	2,03	2,91	4,24	7,98	18,43	36,48	50,70	62,84
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49	62,57	79,03

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%)	2.237.057,15	5,480000	2.225.750,20	5,941600	-11.306,95
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.095.079,83	5,810000	1.093.502,03	5,941600	-1.577,80
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.850.793,69	5,680000	20.914.444,92	5,632700	63.651,23
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.267.701,34	4,860000	2.127.844,55	5,670000	-139.856,79
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.264.103,27	4,880000	2.127.844,55	5,670000	-136.258,72
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.263.417,31	4,910000	2.132.268,34	5,670000	-131.148,97
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.254.139,68	5,196100	2.172.082,48	5,670000	-82.057,20
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.255.785,31	5,290000	2.189.777,65	5,670000	-66.007,66
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.255.025,58	5,320000	2.194.201,45	5,670000	-60.824,13
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.561.719,92	5,670000	1.561.599,01	5,670000	-120,91
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.109.178,80	5,837000	2.136.692,13	5,670000	27.513,33
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.301.087,06	5,855000	3.348.811,48	5,670000	47.724,42
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.285.086,59	4,970000	2.085.547,70	5,743100	-199.538,89
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.282.331,91	4,980000	2.085.547,70	5,743100	-196.784,21
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.278.308,21	5,030000	2.094.441,29	5,743100	-183.866,92
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.266.268,90	5,285000	2.147.802,86	5,743100	-118.466,04
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.265.534,01	5,340000	2.161.143,25	5,743100	-104.390,76
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.264.130,84	5,380000	2.170.036,84	5,743100	-94.094,00
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.330.677,46	5,831000	5.385.070,93	5,743100	54.393,47
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.202.378,12	5,860000	2.232.292,00	5,743100	29.913,88
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.118.767,67	5,897000	2.156.696,45	5,743100	37.928,78
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.473.972,98	5,915000	6.603.493,25	5,743100	129.520,27
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.112.699,15	5,922000	2.156.696,45	5,743100	43.997,30
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.750.580,50	6,140000	4.971.518,83	5,743100	220.938,33
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.745.127,46	6,256000	3.970.989,55	5,743100	225.862,09
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.153.650,42	6,280000	3.352.884,79	5,743100	199.234,37
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.150.004,34	6,400000	2.316.781,13	5,743100	166.776,79
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.292.817,74	5,000000	2.064.065,42	5,739200	-228.752,32



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.287.724,35	5,030000	2.068.542,78	5,739200	-219.181,57
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.282.657,87	5,060000	2.073.020,15	5,739200	-209.637,72
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.271.468,14	5,315000	2.140.180,63	5,739200	-131.287,51
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.272.595,25	5,370000	2.158.090,09	5,739200	-114.505,16
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.270.577,13	5,420000	2.171.522,19	5,739200	-99.054,94
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.261.864,81	5,520000	2.193.909,01	5,739200	-67.955,80
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.742.530,44	5,831200	11.891.882,32	5,739200	149.351,88
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.201.881,19	5,860000	2.238.682,67	5,739200	36.801,48
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.288.596,66	5,897000	5.404.179,95	5,739200	115.583,29
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.116.429,68	5,927000	2.171.522,19	5,739200	55.092,51
NTN-B 150555 (5,950000%)	17.270.205,04	5,950000	17.775.140,36	5,739200	504.935,32
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.498.626,34	6,140000	10.029.298,34	5,739200	530.672,00
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.554.458,02	6,261000	9.178.598,93	5,739200	624.140,91
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.358.380,48	6,268000	7.902.549,81	5,739200	544.169,33
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.379.953,51	6,400000	5.878.780,68	5,739200	498.827,17
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.201.301,78	5,345000	2.182.619,74	7,296700	-18.682,04
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.234.264,44	5,450000	2.216.328,15	7,296700	-17.936,29
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.195.821,36	5,912000	2.182.619,74	7,296700	-13.201,62
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.230.820,44	5,009000	2.200.216,83	5,635400	-30.603,61
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.233.500,23	5,130000	2.208.761,36	5,635400	-24.738,87
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.234.856,72	5,190000	2.213.033,63	5,635400	-21.823,09
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.241.551,55	5,490000	2.234.394,96	5,635400	-7.156,59
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.284.255,87	5,710000	3.289.644,58	5,635400	5.388,71
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.245.648,10	4,850000	2.187.291,17	5,547200	-58.356,93
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.239.870,72	5,125600	2.204.547,91	5,547200	-35.322,81
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.243.305,11	5,240000	2.217.490,46	5,547200	-25.814,65
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.240.766,46	5,270000	2.217.490,46	5,547200	-23.276,00
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.293.577,78	5,810000	3.326.235,69	5,547200	32.657,91
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.256.053,39	4,860000	2.176.896,74	5,550000	-79.156,65
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.251.365,09	4,900000	2.176.896,74	5,550000	-74.468,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.245.660,96	5,178300	2.202.967,36	5,550000	-42.693,60
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.248.254,39	5,270000	2.216.002,67	5,550000	-32.251,72
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.249.170,86	5,300000	2.220.347,77	5,550000	-28.823,09
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.540.257,53	5,460000	3.523.878,76	5,550000	-16.378,77
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.247.855,47	5,500000	2.242.073,29	5,550000	-5.782,18
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.297.087,84	5,835000	3.345.729,52	5,550000	48.641,68
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.277.911,79	4,950000	2.111.058,32	5,685800	-166.853,47
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.268.416,30	4,970000	2.106.669,42	5,685800	-161.746,88
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.270.680,51	5,020000	2.119.836,10	5,685800	-150.844,41
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.261.814,85	5,274000	2.168.113,95	5,685800	-93.700,90
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.262.527,93	5,310000	2.176.891,73	5,685800	-85.636,20
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.259.946,76	5,360000	2.185.669,52	5,685800	-74.277,24
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.113.440,59	5,837000	2.146.169,47	5,685800	32.728,88
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.300.279,42	5,855000	3.357.504,39	5,685800	57.224,97
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.114.811,16	6,220000	3.287.282,07	5,685800	172.470,91
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.293.952,44	4,940000	2.058.971,91	5,745000	-234.980,53
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.291.101,62	4,980000	2.067.770,94	5,745000	-223.330,68
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.286.535,79	5,010000	2.072.170,45	5,745000	-214.365,34
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.280.422,98	5,045000	2.076.569,96	5,745000	-203.853,02
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.269.537,34	5,295500	2.138.163,14	5,745000	-131.374,20
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.268.470,38	5,360000	2.155.761,19	5,745000	-112.709,19
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.267.134,43	5,410000	2.168.959,73	5,745000	-98.174,70
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.259.828,83	5,510000	2.190.957,29	5,745000	-68.871,54
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.535.446,67	5,831200	8.631.843,79	5,745000	96.397,12
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.170.374,96	5,897000	3.233.641,79	5,745000	63.266,83
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.115.637,97	5,921000	2.164.560,22	5,745000	48.922,25
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.532.596,43	5,950000	11.843.488,01	5,745000	310.891,58
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.856.950,77	6,140000	7.215.200,72	5,745000	358.249,95
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.710.924,25	6,261000	6.102.124,02	5,745000	391.199,77
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.250.852,90	6,278000	5.622.577,14	5,745000	371.724,24

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.131.782,23	6,400000	3.405.222,78	5,745000	273.440,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
22	01/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.125.000,00	4.432,71679708	253,7946933000
23	01/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	13.000,00	51,22250521	253,7946933000
24	05/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	7.000,00	27,55773114	254,0122031000
25	07/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	473.000,00	0,00	1.860,46631713	254,2373359000
26	09/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	396.576,27	1.558,47021290	254,4650945000
27	09/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	473.423,73	1.860,46628883	254,4650945000
28	09/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	43.000,00	168,98191905	254,4650945000
29	14/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	48.000,00	188,52079955	254,6138151000
30	15/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	3.973.000,00	0,00	15.597,48046898	254,7206267000
31	20/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	25.000,00	98,01633410	255,0595289000
32	23/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	106.000,00	415,05611954	255,3871513000
33	26/02/2024	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	0,00	6.544.061,12	3.383.432,26660908	1,9341487000
34	28/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	6.860.000,00	0,00	26.824,30033231	255,7382640000
35	28/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	111.000,00	434,03751267	255,7382640000
36	29/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1.830.000,00	0,00	7.152,57521167	255,8519059000
37	29/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	383.000,00	0,00	1.496,95973009	255,8519059000
<b>Total</b>			<b>13.519.000,00</b>	<b>8.892.061,12</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise de Risco**

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

Value-At-Risk (R\$): 11.046.168,60

Value-At-Risk: 1,57%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,92	0,21		0,07	0,14	0,93	477.205.211,23	67,99
Artigo 8º	13,23	6,81		0,73	0,05	1,41	91.921.118,07	13,10
Artigo 9º	12,18	5,93		0,30	0,32	4,69	55.720.883,47	7,94
Artigo 10º	9,96	4,93		0,47	0,38	4,58	77.024.053,87	10,97
JACAREÍ		1,57		1,57			701.871.266,94	100,00

**Renda Fixa**

Value-At-Risk: 0,21%

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%)		0,10	-0,00	0,11			2.237.057,15	0,32
NTN-B 150525 (5,810000%)		0,10	-0,00	0,11			1.095.079,83	0,16
NTN-B 150533 (5,680000%)		0,14	-0,00	0,15			20.850.793,69	2,97
NTN-B 150535 (4,860000%)		0,11	-0,00	0,13			2.267.701,34	0,32
NTN-B 150535 (4,880000%)		0,11	-0,00	0,13			2.264.103,27	0,32
NTN-B 150535 (4,910000%)		0,11	-0,00	0,13			2.263.417,31	0,32
NTN-B 150535 (5,196100%)		0,11	-0,00	0,13			2.254.139,68	0,32
NTN-B 150535 (5,290000%)		0,11	-0,00	0,13			2.255.785,31	0,32
NTN-B 150535 (5,320000%)		0,11	-0,00	0,13			2.255.025,58	0,32
NTN-B 150535 (5,670000%)		0,12	-0,00	0,14			1.561.719,92	0,22
NTN-B 150535 (5,837000%)		0,11	-0,00	0,13			2.109.178,80	0,30
NTN-B 150535 (5,855000%)		0,11	-0,00	0,13			3.301.087,06	0,47
NTN-B 150545 (4,970000%)		0,11	-0,00	0,13			2.285.086,59	0,33
NTN-B 150545 (4,980000%)		0,11	-0,00	0,13			2.282.331,91	0,33
NTN-B 150545 (5,030000%)		0,11	-0,00	0,13			2.278.308,21	0,32
NTN-B 150545 (5,285000%)		0,11	-0,00	0,13			2.266.268,90	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 150545 (5,340000%)		0,11	-0,00	0,13			2.265.534,01	0,32
NTN-B 150545 (5,380000%)		0,11	-0,00	0,13			2.264.130,84	0,32
NTN-B 150545 (5,831000%)		0,11	-0,00	0,13			5.330.677,46	0,76
NTN-B 150545 (5,860000%)		0,11	-0,00	0,14			2.202.378,12	0,31
NTN-B 150545 (5,897000%)		0,11	-0,00	0,14			2.118.767,67	0,30
NTN-B 150545 (5,915000%)		0,11	-0,00	0,14			6.473.972,98	0,92
NTN-B 150545 (5,922000%)		0,11	-0,00	0,14			2.112.699,15	0,30
NTN-B 150545 (6,140000%)		0,11	-0,00	0,14			4.750.580,50	0,68
NTN-B 150545 (6,256000%)		0,11	-0,00	0,14			3.745.127,46	0,53
NTN-B 150545 (6,280000%)		0,11	-0,00	0,14			3.153.650,42	0,45
NTN-B 150545 (6,400000%)		0,11	-0,00	0,14			2.150.004,34	0,31
NTN-B 150555 (5,000000%)		0,11	-0,00	0,14			2.292.817,74	0,33
NTN-B 150555 (5,030000%)		0,11	-0,00	0,14			2.287.724,35	0,33
NTN-B 150555 (5,060000%)		0,11	-0,00	0,14			2.282.657,87	0,33
NTN-B 150555 (5,315000%)		0,11	-0,00	0,14			2.271.468,14	0,32
NTN-B 150555 (5,370000%)		0,11	-0,00	0,14			2.272.595,25	0,32
NTN-B 150555 (5,420000%)		0,11	-0,00	0,14			2.270.577,13	0,32
NTN-B 150555 (5,520000%)		0,11	-0,00	0,14			2.261.864,81	0,32
NTN-B 150555 (5,831200%)		0,11	-0,00	0,14			11.742.530,44	1,67
NTN-B 150555 (5,860000%)		0,11	-0,00	0,14			2.201.881,19	0,31
NTN-B 150555 (5,897000%)		0,11	-0,00	0,14			5.288.596,66	0,75
NTN-B 150555 (5,927000%)		0,11	-0,00	0,14			2.116.429,68	0,30
NTN-B 150555 (5,950000%)		0,11	-0,00	0,14			17.270.205,04	2,46
NTN-B 150555 (6,140000%)		0,11	-0,00	0,14			9.498.626,34	1,35
NTN-B 150555 (6,261000%)		0,11	-0,00	0,14			8.554.458,02	1,22
NTN-B 150555 (6,268000%)		0,11	-0,00	0,14			7.358.380,48	1,05
NTN-B 150555 (6,400000%)		0,11	-0,00	0,14			5.379.953,51	0,77
NTN-B 150824 (5,345000%)		0,07	-0,00	0,09			2.201.301,78	0,31
NTN-B 150824 (5,450000%)		0,07	-0,00	0,09			2.234.264,44	0,32
NTN-B 150824 (5,912000%)		0,07	-0,00	0,09			2.195.821,36	0,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,009000%)		0,10	-0,00	0,11			2.230.820,44	0,32
NTN-B 150826 (5,130000%)		0,10	-0,00	0,11			2.233.500,23	0,32
NTN-B 150826 (5,190000%)		0,10	-0,00	0,11			2.234.856,72	0,32
NTN-B 150826 (5,490000%)		0,10	-0,00	0,11			2.241.551,55	0,32
NTN-B 150826 (5,710000%)		0,10	-0,00	0,11			3.284.255,87	0,47
NTN-B 150828 (4,850000%)		0,10	-0,00	0,12			2.245.648,10	0,32
NTN-B 150828 (5,125600%)		0,10	-0,00	0,12			2.239.870,72	0,32
NTN-B 150828 (5,240000%)		0,10	-0,00	0,12			2.243.305,11	0,32
NTN-B 150828 (5,270000%)		0,10	-0,00	0,12			2.240.766,46	0,32
NTN-B 150828 (5,810000%)		0,10	-0,00	0,12			3.293.577,78	0,47
NTN-B 150830 (4,860000%)		0,11	-0,00	0,12			2.256.053,39	0,32
NTN-B 150830 (4,900000%)		0,11	-0,00	0,12			2.251.365,09	0,32
NTN-B 150830 (5,178300%)		0,11	-0,00	0,12			2.245.660,96	0,32
NTN-B 150830 (5,270000%)		0,11	-0,00	0,12			2.248.254,39	0,32
NTN-B 150830 (5,300000%)		0,11	-0,00	0,12			2.249.170,86	0,32
NTN-B 150830 (5,460000%)		0,11	-0,00	0,12			3.540.257,53	0,50
NTN-B 150830 (5,500000%)		0,11	-0,00	0,12			2.247.855,47	0,32
NTN-B 150830 (5,835000%)		0,11	-0,00	0,12			3.297.087,84	0,47
NTN-B 150840 (4,950000%)		0,11	-0,00	0,13			2.277.911,79	0,32
NTN-B 150840 (4,970000%)		0,11	-0,00	0,13			2.268.416,30	0,32
NTN-B 150840 (5,020000%)		0,11	-0,00	0,13			2.270.680,51	0,32
NTN-B 150840 (5,274000%)		0,11	-0,00	0,13			2.261.814,85	0,32
NTN-B 150840 (5,310000%)		0,11	-0,00	0,13			2.262.527,93	0,32
NTN-B 150840 (5,360000%)		0,11	-0,00	0,13			2.259.946,76	0,32
NTN-B 150840 (5,837000%)		0,11	-0,00	0,13			2.113.440,59	0,30
NTN-B 150840 (5,855000%)		0,11	-0,00	0,13			3.300.279,42	0,47
NTN-B 150840 (6,220000%)		0,11	-0,00	0,13			3.114.811,16	0,44
NTN-B 150850 (4,940000%)		0,11	-0,00	0,14			2.293.952,44	0,33
NTN-B 150850 (4,980000%)		0,11	-0,00	0,14			2.291.101,62	0,33
NTN-B 150850 (5,010000%)		0,11	-0,00	0,14			2.286.535,79	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,045000%)		0,11	-0,00	0,14			2.280.422,98	0,32
NTN-B 150850 (5,295500%)		0,11	-0,00	0,14			2.269.537,34	0,32
NTN-B 150850 (5,360000%)		0,11	-0,00	0,14			2.268.470,38	0,32
NTN-B 150850 (5,410000%)		0,11	-0,00	0,14			2.267.134,43	0,32
NTN-B 150850 (5,510000%)		0,11	-0,00	0,14			2.259.828,83	0,32
NTN-B 150850 (5,831200%)		0,11	-0,00	0,14			8.535.446,67	1,22
NTN-B 150850 (5,897000%)		0,11	-0,00	0,14			3.170.374,96	0,45
NTN-B 150850 (5,921000%)		0,11	-0,00	0,14			2.115.637,97	0,30
NTN-B 150850 (5,950000%)		0,11	-0,00	0,14			11.532.596,43	1,64
NTN-B 150850 (6,140000%)		0,11	-0,00	0,14			6.856.950,77	0,98
NTN-B 150850 (6,261000%)		0,11	-0,00	0,14			5.710.924,25	0,81
NTN-B 150850 (6,278000%)		0,11	-0,00	0,14			5.250.852,90	0,75
NTN-B 150850 (6,400000%)		0,11	-0,00	0,14			3.131.782,23	0,45
<b>Sub-total</b>	1,03	0,11	-0,00		0,20	1,00	313.851.999,54	44,72

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		1,81	0,03	0,01			21.886.319,31	3,12
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,60	0,04	0,07			21.668.570,37	3,09
<b>Sub-total</b>	2,15	2,20	0,07		-0,13	0,51	43.554.889,68	6,21

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		2,07	0,00	2,08			5.206.174,50	0,74
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,01			11.521.844,10	1,64
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			22.088.076,25	3,15
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,02	-0,00	0,02			37.500.114,33	5,34
<b>Sub-total</b>	0,12	0,14	0,00		-0,06	0,80	76.316.209,18	10,87

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 - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a		0,20	-0,00	0,23			5.389.063,63	0,77
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a		0,21	-0,00	0,22			5.402.048,18	0,77
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a		0,21	-0,00	0,22			5.394.316,56	0,77
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a		0,21	0,00	0,22			5.759.574,00	0,82
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a		0,20	-0,00	0,22			5.380.770,53	0,77
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a		0,22	-0,00	0,22			6.303.513,50	0,90
<b>Sub-total</b>	0,27	0,19	-0,00		0,80	1,02	33.629.286,40	4,79

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		3,83	-0,00	3,83			37.815,88	0,01
<b>Sub-total</b>	65,29	3,83	-0,00		0,29	19,63	37.815,88	0,01

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	0,01			3.584.163,22	0,51
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,10	0,00	0,10			6.230.847,33	0,89
<b>Sub-total</b>	0,11	0,06	0,00		0,95	0,90	9.815.010,55	1,40

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,81%

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		10,21	0,04	5,78			4.159.343,26	0,59
META VALOR FI DE AÇÕES		9,70	0,02	4,79			2.203.554,16	0,31
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES		9,26	0,08	5,36			7.516.795,69	1,07

**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		7,01	0,04	3,97			5.610.836,71	0,80
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		7,13	0,19	2,80			24.527.780,31	3,49
OCCAM FIC FIA		5,94	0,18	1,73			27.129.886,16	3,87
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		7,56	0,05	4,16			6.826.078,67	0,97
INDIE FIC FIA		9,89	0,04	5,40			3.890.044,24	0,55
TARPON GT 30 FIC FIA		8,20	0,08	5,75			10.056.798,87	1,43
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
<b>Sub-total</b>	13,23	6,81	0,73		0,05	1,41	91.921.118,07	13,10

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 4,93%

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		4,26	0,01	7,71			7.693.453,19	1,10
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		6,50	0,17	6,50			21.642.429,67	3,08
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		6,49	0,29	4,94			36.120.990,46	5,15
<b>Sub-total</b>	9,80	5,80	0,47		0,41	4,85	65.456.873,32	9,33

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		0,18	0,00	0,19			11.567.180,55	1,65
<b>Sub-total</b>	10,90	0,18	0,00		0,21	3,04	11.567.180,55	1,65

**Investimentos no Exterior**

Value-At-Risk: 5,93%

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		8,72	0,18	7,09			18.118.841,83	2,58
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		15,27	0,02	13,94			2.230.065,03	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
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,15	-0,00	9,87			2.102.015,60	0,30
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,33	0,00	10,08			2.577.232,26	0,37
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,22	0,01	10,21			3.340.346,26	0,48
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		6,20	0,01	6,65			5.871.862,83	0,84
<b>Sub-total</b>	11,80	6,75	0,22		0,34	4,78	34.240.363,81	4,88

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		5,77	0,08	9,22			21.480.519,66	3,06
<b>Sub-total</b>	12,78	5,77	0,08		0,29	4,54	21.480.519,66	3,06

(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

01 e 02 de fevereiro:

08h30 às 17h30: 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 Comitê de Investimentos, Conselheiros Fiscais e Deliberativos de forma presencial. Palestrante responsável Otoni Guimarães - Consultor Previdenciário.

09 de fevereiro:

09h00: Reunião com o representante da gestora BTG PACTUAL, senhor Bernardo Guimarães. O objetivo da reunião foi apresentar o cenário macroeconômico e visão dos gestores sobre ano de 2024. Também discorreu sobre os fundos BTG Absoluto e S&P 500 que o Instituto de Previdência do Município de Jacareí tem aplicado em sua carteira de investimentos. Participaram da reunião os senhores Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos.

21 de fevereiro:

09h00: Quingentésima primeira (401ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros (CAIF) do Instituto de Previdência do Município de Jacareí (IPMJ), ocorrida em 21 de fevereiro de 2024, tendo início às 9h10 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, Danielle de Paula, José Luis Machado de Almeida e Zilton Mendes da Silva. Ausência justificada de Clévio Vitor de Almeida. Pautas da reunião: 1) Análise do relatório de investimentos de janeiro de 2024; 2) Análise da carteira fechada de janeiro de 2024; 3) Análise parcial da carteira até 19/02/2024; 4) Assuntos diversos.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## ACOMPANHAMENTO DE FUNDOS ILÍQUIDOS

## I. FIDC MULTISSETORIAL MASTER III

Em fevereiro 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).

No dia 05/02/2024 foi realizado amortizações no montante de R\$ 1.765,87 (mil e setecentos e sessenta e cinco reais e oitenta e sete centavos), R\$ 356,72 (trezentos e cinquenta e seis reais e setenta e dois centavos) e R\$ 138,37 (cento e trinta e oito reais e trinta e sete centavos), totalizando R\$ 2.260,96 (dois mil e duzentos e sessenta reais e noventa e seis centavos) que foram aplicados no fundo SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI.

O total de amortizações já entregue é de R\$ 7.082.604,44 (sete milhões e oitenta e dois mil e seiscentos e quatro reais e quarenta e quatro centavos). O saldo em 29 de fevereiro de 2024 é de R\$ 37.815,88 (trinta e sete mil e oitocentos e quinze reais e oitenta e oito 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\$ 2.471.294,55 (dois milhões e quatrocentos e setenta e um mil e duzentos e noventa e quatro reais e cinquenta e cinco centavos).

No mês de fevereiro de 2024 a gestora Kinea Private Equity comunicou a remarcação de seus ativos do portfólio, com base da Marcação a Mercado realizada pela auditoria KPMG Brasil. Com essa reavaliação, o valor atualizado do retorno sobre o capital investido nas empresas é de 2,0 vezes, refletindo um impacto positivo na cota do Fundo Kinea IV Master de 3,7%.

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)

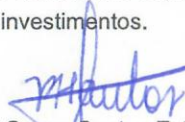
O saldo acumulado em 29 de fevereiro de 2024 é de R\$ 11.567.180,55 (onze milhões e quinhentos e sessenta e sete mil e cento e oitenta reais e cinquenta e cinco centavos) com um rendimento no mês de fevereiro de R\$ 341.124,11 (trezentos e quarenta e um mil e cento e vinte e quatro reais e onze centavos).

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS

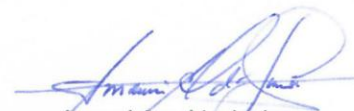
Em 17 de agosto de 2023 o IPMJ formalizou sua adesão ao Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios – “Pró Gestão RPPS”. Em atendimento ao Manual do Pró Gestão RPPS, apresenta-se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



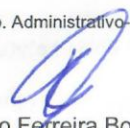
Renata de Souza Santos Esteves

Diretora do Dep. Administrativo-Financeiro – CPA 10



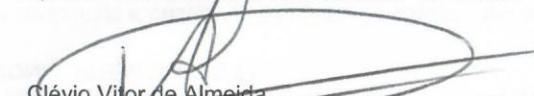
Amauri Arnaldo Junior

Supervisor da Unidade Gestão de Investimentos – CP CGINV I



Luis Gustavo Ferreira Bonacina

Assessor da Presidência – CPA 20



Clévio Vitor de Almeida

Membro do CAIF – CGRPPS



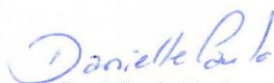
Zilton Mendes da Silva

Membro do CAIF



José Luis Machado de Almeida

Membro do CAIF – CODEL I



Danielle de Paula

Membro do CAIF

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 21 dias do mês de março 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 FEVEREIRO 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 fevereiro de 2024.

Jacareí, 21 de março de 2024

Clévio Vitor de Almeida

Representante do Conselho Fiscal – CGRPPS



Rafaela Carvalho dos Santos

Membro do Conselho Fiscal



José Edson Silva Souza

Membro do Conselho Fiscal