



LDB
EMPRESAS

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS
IPMJ - MARÇO 2024



CENÁRIO MACROECONÔMICO

MERCADOS INTERNACIONAIS: Em março, o cenário internacional foi marcado pelas discussões sobre a velocidade da redução da inflação nas economias desenvolvidas e a manutenção da taxa de juros básica nos EUA. Além disso, houve continuidade do avanço dos ativos de risco nos mercados globais. Esse movimento ocorreu à medida que as curvas de juros mantiveram-se relativamente estáveis, apesar das declarações dos principais banqueiros centrais indicando que o início dos ciclos de redução de juros poderá ocorrer um pouco mais tarde. Nos EUA, as leituras de inflação seguem mais pressionadas do que o esperado e o mercado de trabalho continua em expansão. Desta forma, é fortalecida a hipótese que a trajetória do processo de desinflação ocorra de maneira gradual, num contexto de mercado de trabalho aquecido. Assim, é importante reconhecer que esses dados trazem um risco maior de que a inflação possa se mostrar mais resistente e, eventualmente, afete os próximos passos do FED. Na Zona do Euro, a situação econômica contrasta com a dos Estados Unidos, sendo marcada pela estagnação e a necessidade de políticas monetárias mais flexíveis. Onde, apesar da resiliência do mercado de trabalho, os indicadores dos setores de manufatura e serviços da região revelaram um desempenho modesto. Este contexto tem contribuído para a manutenção da tendência de queda nas taxas de inflação, colocando a Zona do Euro em uma posição favorável no que diz respeito ao controle inflacionário. Já na China, o setor industrial tem avançado mais fortemente desde o início do ano, sendo este um sinal positivo para a demanda global por bens industriais e para o comércio internacional. Entretanto, ainda permanece um cenário de cautela. Onde, o setor imobiliário ainda apresenta certa fragilidade e, além disso, a inflação encontra-se em patamares baixos, podendo estar associada a uma demanda interna mais fraca. Assim, no mês de março de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +2,88% e +3,10%, 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 +21,09% e +27,86%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +3,14% e +3,37%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +19,08% e +25,75% nos últimos 12 meses.

BRASIL: Localmente, as curvas de juros futuras aumentaram no mês, refletindo o aumento da incerteza sobre a condução da política econômica. Assim, o Ibovespa ficou em território negativo e o Real perdeu espaço frente ao dólar. Os dados de atividade econômica continuam fortes. As pesquisas sobre comércio e serviços superaram as expectativas, porém, mais uma vez, o mercado de trabalho se destacou. A taxa de desemprego continuou a diminuir e houve uma significativa criação de empregos formais, resultando em um contínuo crescimento substancial do salário real. A sustentação da demanda, em função deste aumento da renda e da expansão das concessões de crédito para pessoas físicas, tem se refletido em aumento gradual das previsões para o PIB deste ano. No entanto, a ausência de ociosidade no mercado de trabalho em conjunto com a elevação dos núcleos de inflação e da inflação subjacente de serviços exige cautela na condução da política monetária. Dito isso, números de inflação e de atividade acima das expectativas fizeram com que o Banco Central apresentasse uma mensagem mais conservadora em sua última reunião do Copom, sinalizando apenas mais um corte de 0,5% na Selic e deixando os próximos passos em aberto, a depender dos dados. O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo na direção oposta dos índices globais. Apresentando um retorno positivo de -0,71% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -4,53% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +25,74%.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

67,93%

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%)	0,28	0,03	0,98	3,01	2.258.949,94	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,810000%)	0,28	0,03	1,00	3,08	1.106.070,76	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,680000%)	2,89	0,05	0,99	3,05	21.057.992,86	2,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,860000%)	0,40	0,03	0,93	2,86	2.288.822,55	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,880000%)	0,40	0,03	0,93	2,86	2.285.225,07	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,910000%)	0,40	0,03	0,94	2,87	2.284.584,00	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,196100%)	0,41	0,03	0,96	2,94	2.275.713,56	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,290000%)	0,41	0,03	0,96	2,96	2.277.535,27	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,41	0,03	0,97	2,97	2.276.819,66	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,670000%)	2,88	0,04	0,99	3,05	1.577.228,00	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,837000%)	0,43	0,03	1,01	3,09	2.130.391,10	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,855000%)	0,43	0,03	1,01	3,10	3.334.333,18	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,970000%)	0,51	0,03	0,94	2,89	2.306.561,73	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,980000%)	0,51	0,03	0,94	2,89	2.303.799,82	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,030000%)	0,51	0,03	0,94	2,90	2.299.823,77	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	0,03	0,96	2,96	2.288.110,07	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,340000%)	0,53	0,03	0,97	2,97	2.287.464,22	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,380000%)	0,53	0,03	0,97	2,98	2.286.116,98	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,831000%)	0,55	0,03	1,01	3,09	5.384.266,15	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,860000%)	0,56	0,03	1,01	3,10	2.224.566,71	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897000%)	0,56	0,03	1,01	3,11	2.140.171,51	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,915000%)	0,56	0,03	1,01	3,11	6.539.466,13	0,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,922000%)	0,56	0,03	1,01	3,11	2.134.081,87	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,140000%)	0,57	0,04	1,03	3,16	4.799.448,96	0,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,256000%)	0,57	0,04	1,04	3,19	3.783.979,54	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,280000%)	0,58	0,04	1,04	3,20	3.186.423,93	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	0,58	0,04	1,05	3,22	2.172.542,71	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,000000%)	0,59	0,03	0,94	2,89	2.314.417,64	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,030000%)	0,60	0,03	0,94	2,90	2.309.329,29	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,060000%)	0,60	0,03	0,95	2,91	2.304.266,08	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,315000%)	0,61	0,03	0,97	2,97	2.293.412,13	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,370000%)	0,61	0,03	0,97	2,98	2.294.646,72	0,32
TESOURO	NTN-B 150555 (5,420000%)	0,62	0,03	0,97	2,99	2.292.693,13	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%)	0,62	0,03	0,98	3,02	2.284.069,01	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,831200%)	0,64	0,03	1,01	3,09	11.860.570,80	1,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,860000%)	0,64	0,03	1,01	3,10	2.224.063,20	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,897000%)	0,64	0,03	1,01	3,11	5.342.022,08	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,927000%)	0,64	0,03	1,01	3,11	2.137.857,74	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,950000%)	0,64	0,03	1,01	3,12	17.445.375,46	2,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,140000%)	0,65	0,04	1,03	3,16	9.596.335,04	1,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,261000%)	0,66	0,04	1,04	3,19	8.643.236,57	1,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,268000%)	0,66	0,04	1,04	3,19	7.434.779,12	1,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,400000%)	0,66	0,04	1,05	3,22	5.436.346,40	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,345000%)	0,27	0,03	0,97	2,98	2.222.617,02	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,450000%)	0,27	0,03	0,98	3,00	2.256.077,61	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,912000%)	0,27	0,03	1,01	3,11	2.218.029,20	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,009000%)	0,29	0,03	0,94	2,90	2.251.853,57	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,130000%)	0,29	0,03	0,95	2,92	2.254.764,47	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,29	0,03	0,96	2,94	2.256.236,03	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,490000%)	0,29	0,03	0,98	3,01	2.263.506,54	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%)	0,30	0,03	1,00	3,06	3.316.969,76	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (4,850000%)	0,31	0,03	0,93	2,86	2.266.547,86	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,125600%)	0,31	0,03	0,95	2,92	2.261.185,92	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,240000%)	0,31	0,03	0,96	2,95	2.264.849,17	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,31	0,03	0,96	2,96	2.262.338,04	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,810000%)	0,32	0,03	1,00	3,08	3.326.634,16	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,860000%)	0,34	0,03	0,93	2,86	2.277.065,45	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,900000%)	0,34	0,03	0,93	2,87	2.272.402,40	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,178300%)	0,35	0,03	0,96	2,94	2.267.121,29	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,35	0,03	0,96	2,96	2.269.897,60	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,300000%)	0,35	0,03	0,96	2,96	2.270.874,17	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,460000%)	0,36	0,03	0,98	3,00	3.574.850,77	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,500000%)	0,36	0,03	0,98	3,01	2.269.888,14	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,835000%)	0,36	0,03	1,01	3,09	3.330.242,52	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,950000%)	0,45	0,03	0,94	2,88	2.299.285,70	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,970000%)	0,45	0,03	0,94	2,89	2.289.735,83	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020000%)	0,46	0,03	0,94	2,90	2.292.106,54	0,32
TESOURO	NTN-B 150840 (5,274000%)	0,47	0,03	0,96	2,96	2.283.596,11	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%)	0,47	0,03	0,97	2,97	2.284.378,18	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,47	0,03	0,97	2,98	2.281.856,51	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,837000%)	0,49	0,03	1,01	3,09	2.134.695,50	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,855000%)	0,49	0,03	1,01	3,10	3.333.513,98	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,220000%)	0,51	0,04	1,03	3,18	3.147.039,09	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,940000%)	0,56	0,03	0,94	2,88	2.315.457,62	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (4,980000%)	0,56	0,03	0,94	2,89	2.312.650,84	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,010000%)	0,56	0,03	0,94	2,90	2.308.092,77	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,045000%)	0,56	0,03	0,95	2,90	2.301.985,25	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,295500%)	0,58	0,03	0,96	2,96	2.291.429,72	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,360000%)	0,58	0,03	0,97	2,98	2.290.463,12	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,410000%)	0,58	0,03	0,97	2,99	2.289.200,83	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,510000%)	0,59	0,03	0,98	3,01	2.281.994,14	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,831200%)	0,60	0,03	1,01	3,09	8.621.251,74	1,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,897000%)	0,61	0,03	1,01	3,11	3.202.403,55	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,921000%)	0,61	0,03	1,01	3,11	2.137.051,70	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,950000%)	0,61	0,03	1,01	3,12	11.649.569,88	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	0,04	1,03	3,16	6.927.482,66	0,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,261000%)	0,62	0,04	1,04	3,19	5.770.194,54	0,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,278000%)	0,62	0,04	1,04	3,20	5.305.413,99	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,400000%)	0,63	0,04	1,05	3,22	3.164.612,26	0,44
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,51	0,03	0,99	3,06	316.973.324,20	44,56

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	3,88	-0,00	0,06	0,13	21.898.712,51	3,08	5.029.824.301,86	0,44
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,11	-0,08	-0,59	-1,61	21.541.524,79	3,03	1.570.682.197,15	1,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,32	-0,04	-0,26	-0,74	43.440.237,30	6,11		

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	8,06	0,11	1,42	3,13	5.280.310,50	0,74	236.185.618,53	2,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,85	2,65	11.620.102,92	1,63	16.860.564.075,44	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,04	0,85	2,70	22.275.576,40	3,13	6.030.179.613,18	0,37
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,04	0,86	2,79	39.656.964,09	5,57	2.837.635.942,66	1,40
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,49	0,04	0,90	2,75	78.832.953,91	11,08		

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	0,64	0,12	1,16	3,39	5.464.618,45	0,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	0,84	0,46	1,50	3,64	5.469.874,70	0,77		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	0,60	0,10	1,13	3,33	5.455.170,31	0,77		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	9,28	-0,18	0,87	3,06	5.809.752,00	0,82		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	0,83	0,46	1,48	3,59	5.460.603,18	0,77		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 7,00% a.a	16,27	0,05	1,10	3,38	6.372.930,36	0,90		
Sub-total Artigo 7º IV			4,52	0,16	1,20	3,39	34.032.949,00	4,78		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLURAL	GENIAL	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	354,12	0,50	2,14	23,51	38.003,55	0,01	1.314.617,64	2,89
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			354,12	0,50	2,14	23,51	38.003,55	0,01		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,06	0,04	0,86	2,71	3.615.127,07	0,51	15.754.636.811,81	0,02
PORTO SEGURO	INTRAG	PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,20	0,04	1,00	3,10	6.293.234,45	0,88	6.224.377.589,59	0,10
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,20	0,04	0,95	2,96	9.908.361,52	1,39		
Renda Fixa			0,64	0,04	0,88	2,68	483.225.829,50	67,93		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

13,01%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SUL AMERICA	BEM	SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	20,31	1,27	4,14	-1,97	4.331.366,92	0,61	93.534.066,36	4,63
META	DAYCOVAL	META VALOR FI DE AÇÕES	20,38	0,16	1,02	-3,24	2.226.078,65	0,31	180.439.188,82	1,23
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	18,94	0,05	2,97	-1,25	7.740.181,53	1,09	227.891.719,09	3,40
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	16,21	0,24	0,22	-0,80	5.623.142,47	0,79	1.424.304.935,88	0,39
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	15,28	0,44	-0,95	-2,09	24.294.476,09	3,42	641.082.628,90	3,79
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	14,77	0,32	-1,50	-4,14	26.723.801,66	3,76	883.741.463,99	3,02
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	16,82	0,38	1,49	2,88	6.927.646,66	0,97	575.583.312,97	1,20
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	19,02	0,92	1,84	-2,30	3.961.790,08	0,56	357.933.959,90	1,11
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	17,20	0,34	6,72	2,39	10.732.945,47	1,51	956.795.060,83	1,12
Sub-total Artigo 8º I			14,90	0,39	0,70	-2,17	92.561.429,53	13,01		
Renda Variável			14,90	0,39	0,70	-2,17	92.561.429,53	13,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,96%

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	15,66	0,03	-0,65	5,12	18.001.471,42	2,53	235.599.510,69	7,64
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	27,49	0,88	2,58	8,83	2.287.553,69	0,32	134.712.820,08	1,70
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,02	1,53	1,05	2,27	2.124.060,73	0,30	34.079.830,36	6,23
MONGERAL	BEM	MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17,85	0,93	3,25	6,77	2.660.943,98	0,37	64.387.669,20	4,13
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,82	1,35	2,16	15,24	3.412.602,08	0,48	769.263.355,99	0,44
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	14,32	0,92	3,31	9,30	6.065.996,33	0,85	340.339.443,53	1,78
Sub-total Artigo 9º II			11,76	0,53	0,91	6,95	34.552.628,23	4,86		

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	12,80	0,71	2,71	10,30	22.061.850,71	3,10	710.413.926,44	3,11
Sub-total Artigo 9º III			12,80	0,71	2,71	10,30	22.061.850,71	3,10		

Investimentos no Exterior

11,09 0,60 1,60 8,23 56.614.478,93 7,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

11,10%

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	10,88	0,79	-0,60	-2,18	7.647.413,19	1,08	51.310.928,89	14,90
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	11,46	0,13	3,41	11,07	22.381.509,44	3,15	1.009.848.189,26	2,22
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	11,50	0,14	3,44	11,26	37.362.281,41	5,25	648.677.226,01	5,76
Sub-total Artigo 10º I			10,11	0,21	2,96	9,49	67.391.204,04	9,47		

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	29,68	0,11	0,11	2,98	11.579.346,84	1,63	369.381.113,95	3,13
Sub-total Artigo 10º II			29,68	0,11	0,11	2,98	11.579.346,84	1,63		

Investimentos Estruturados

10,61 0,19 2,53 8,48 78.970.550,88 11,10

Total

3,09 0,15 1,09 3,01 711.372.288,82 100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	316.973.324,20	44,56	0,00	44,00	70,00	58,39	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	43.440.237,30	6,11	0,00	6,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	78.832.953,91	11,08	0,00	11,00	40,00	13,33	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	34.032.949,00	4,78	0,00	5,00	20,00	1,70	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	38.003,55	0,01	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	9.908.361,52	1,39	0,00	1,50	5,00	1,67	5,00
	Total Renda Fixa	483.225.829,50	67,93					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	92.561.429,53	13,01	0,00	14,50	30,00	4,92	30,00
	Total Renda Variável	92.561.429,53	13,01					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	34.552.628,23	4,86	0,00	4,50	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	22.061.850,71	3,10	0,00	3,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	56.614.478,93	7,96					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	67.391.204,04	9,47	0,00	8,00	10,00	8,39	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	11.579.346,84	1,63	0,00	2,00	5,00	1,61	5,00
	Total Investimentos Estruturados	78.970.550,88	11,10					15,00
Total		711.372.288,82	100,00					

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	0,99 119,32	3,06 116,44	3,06 116,44	5,53 99,83	10,17 82,28	3.121.324,66	9.455.822,32
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,26 -31,58	-0,74 -28,30	-0,74 -28,30	4,75 85,83	3,13 25,36	-114.652,38	-325.111,93
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,90 107,60	2,75 104,60	2,75 104,60	5,53 99,86	12,54 101,42	671.244,73	1.886.088,52
Artigo 7º IV % do CDI	1,20 144,01	3,39 129,26	3,39 129,26	5,91 106,77	11,46 92,68	403.662,60	1.116.768,00
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	2,14 256,41	23,51 895,58	23,51 895,58	-53,27 -962,10	2.092,95 16.930,14	805,11	7.739,36
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,95 114,11	2,96 112,74	2,96 112,74	6,22 112,40	13,91 112,55	93.350,97	284.762,97
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,70 1,40	-2,17 2,36	-2,17 2,36	8,88 -1,03	26,95 1,21	640.311,46	-2.232.651,06
Artigo 9º II % do CDI	0,91 109,42	6,95 264,75	6,95 264,75	18,72 338,02	22,09 178,69	312.264,42	2.245.021,40
Artigo 9º III % do CDI	2,71 324,70	10,30 392,50	10,30 392,50	17,65 318,82	23,43 189,52	581.331,04	2.060.540,84
Artigo 10º I % do CDI	2,96 354,55	9,49 361,55	9,49 361,55	22,42 404,95	32,39 261,98	1.934.330,72	5.840.954,02
Artigo 10º II % do CDI	0,11 12,62	2,98 113,50	2,98 113,50	4,06 73,26	3,66 29,58	12.166,29	334.991,48
JACAREÍ (Total)						7.656.139,62	20.674.925,92

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%)	2.237.057,15	0,00	0,00	0,00	2.258.949,94	21.892,79	65.942,48
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.095.079,83	0,00	0,00	0,00	1.106.070,76	10.990,93	33.099,96
NTN-B 150533 (5,680000%)	20.850.793,69	0,00	0,00	0,00	21.057.992,86	207.199,17	624.018,05
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.267.701,34	0,00	0,00	0,00	2.288.822,55	21.121,21	63.642,26

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.264.103,27	0,00	0,00	0,00	2.285.225,07	21.121,80	63.644,98
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.263.417,31	0,00	0,00	0,00	2.284.584,00	21.166,69	63.780,65
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.254.139,68	0,00	0,00	0,00	2.275.713,56	21.573,88	64.992,18
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.255.785,31	0,00	0,00	0,00	2.277.535,27	21.749,96	65.519,86
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.255.025,58	0,00	0,00	0,00	2.276.819,66	21.794,08	65.653,29
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.561.719,92	0,00	0,00	0,00	1.577.228,00	15.508,08	46.706,24
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.109.178,80	0,00	0,00	0,00	2.130.391,10	21.212,30	63.882,22
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.301.087,06	0,00	0,00	0,00	3.334.333,18	33.246,12	100.118,33
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.285.086,59	0,00	0,00	0,00	2.306.561,73	21.475,14	64.704,93
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.282.331,91	0,00	0,00	0,00	2.303.799,82	21.467,91	64.678,77
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.278.308,21	0,00	0,00	0,00	2.299.823,77	21.515,56	64.824,33
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.266.268,90	0,00	0,00	0,00	2.288.110,07	21.841,17	65.799,40
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.265.534,01	0,00	0,00	0,00	2.287.464,22	21.930,21	66.061,43
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.264.130,84	0,00	0,00	0,00	2.286.116,98	21.986,14	66.228,40
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.330.677,46	0,00	0,00	0,00	5.384.266,15	53.588,69	161.385,02
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.202.378,12	0,00	0,00	0,00	2.224.566,71	22.188,59	66.818,96
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.118.767,67	0,00	0,00	0,00	2.140.171,51	21.403,84	64.458,72
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.473.972,98	0,00	0,00	0,00	6.539.466,13	65.493,15	197.221,43
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.112.699,15	0,00	0,00	0,00	2.134.081,87	21.382,72	64.394,30
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.750.580,50	0,00	0,00	0,00	4.799.448,96	48.868,46	147.138,19
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.745.127,46	0,00	0,00	0,00	3.783.979,54	38.852,08	116.977,33
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.153.650,42	0,00	0,00	0,00	3.186.423,93	32.773,51	98.671,49
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.150.004,34	0,00	0,00	0,00	2.172.542,71	22.538,37	67.850,61
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.292.817,74	0,00	0,00	0,00	2.314.417,64	21.599,90	65.081,31
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.287.724,35	0,00	0,00	0,00	2.309.329,29	21.604,94	65.093,58
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.282.657,87	0,00	0,00	0,00	2.304.266,08	21.608,21	65.104,49
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.271.468,14	0,00	0,00	0,00	2.293.412,13	21.943,99	66.106,38
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.272.595,25	0,00	0,00	0,00	2.294.646,72	22.051,47	66.424,43
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.270.577,13	0,00	0,00	0,00	2.292.693,13	22.116,00	66.621,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.261.864,81	0,00	0,00	0,00	2.284.069,01	22.204,20	66.880,20
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.742.530,44	0,00	0,00	0,00	11.860.570,80	118.040,36	355.498,75
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.201.881,19	0,00	0,00	0,00	2.224.063,20	22.182,01	66.804,19
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.288.596,66	0,00	0,00	0,00	5.342.022,08	53.425,42	160.895,75
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.116.429,68	0,00	0,00	0,00	2.137.857,74	21.428,06	64.531,92
NTN-B 150555 (5,950000%)	17.270.205,04	0,00	0,00	0,00	17.445.375,46	175.170,42	527.497,97
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.498.626,34	0,00	0,00	0,00	9.596.335,04	97.708,70	294.194,75
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.554.458,02	0,00	0,00	0,00	8.643.236,57	88.778,55	267.286,40
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.358.380,48	0,00	0,00	0,00	7.434.779,12	76.398,64	230.028,52
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.379.953,51	0,00	0,00	0,00	5.436.346,40	56.392,89	169.780,01
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.201.301,78	0,00	0,00	0,00	2.222.617,02	21.315,24	65.098,69
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.234.264,44	0,00	0,00	0,00	2.256.077,61	21.813,17	66.615,39
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.195.821,36	0,00	0,00	0,00	2.218.029,20	22.207,84	67.805,96
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.230.820,44	0,00	0,00	0,00	2.251.853,57	21.033,13	64.222,24
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.233.500,23	0,00	0,00	0,00	2.254.764,47	21.264,24	64.928,38
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.234.856,72	0,00	0,00	0,00	2.256.236,03	21.379,31	65.278,99
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.241.551,55	0,00	0,00	0,00	2.263.506,54	21.954,99	67.033,28
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.284.255,87	0,00	0,00	0,00	3.316.969,76	32.713,89	99.882,86
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.245.648,10	0,00	0,00	0,00	2.266.547,86	20.899,76	63.804,10
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.239.870,72	0,00	0,00	0,00	2.261.185,92	21.315,20	65.078,22
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.243.305,11	0,00	0,00	0,00	2.264.849,17	21.544,06	65.773,81
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.240.766,46	0,00	0,00	0,00	2.262.338,04	21.571,58	65.856,86
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.293.577,78	0,00	0,00	0,00	3.326.634,16	33.056,38	100.923,44
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.256.053,39	0,00	0,00	0,00	2.277.065,45	21.012,06	64.137,15
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.251.365,09	0,00	0,00	0,00	2.272.402,40	21.037,31	64.214,90
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.245.660,96	0,00	0,00	0,00	2.267.121,29	21.460,33	65.509,61
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.248.254,39	0,00	0,00	0,00	2.269.897,60	21.643,21	66.066,39
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.249.170,86	0,00	0,00	0,00	2.270.874,17	21.703,31	66.249,46
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.540.257,53	0,00	0,00	0,00	3.574.850,77	34.593,24	105.598,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.247.855,47	0,00	0,00	0,00	2.269.888,14	22.032,67	67.257,48
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.297.087,84	0,00	0,00	0,00	3.330.242,52	33.154,68	101.213,64
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.277.911,79	0,00	0,00	0,00	2.299.285,70	21.373,91	65.193,38
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.268.416,30	0,00	0,00	0,00	2.289.735,83	21.319,53	65.028,98
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.270.680,51	0,00	0,00	0,00	2.292.106,54	21.426,03	65.358,69
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.261.814,85	0,00	0,00	0,00	2.283.596,11	21.781,26	66.452,41
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.262.527,93	0,00	0,00	0,00	2.284.378,18	21.850,25	66.666,21
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.259.946,76	0,00	0,00	0,00	2.281.856,51	21.909,75	66.853,03
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.113.440,59	0,00	0,00	0,00	2.134.695,50	21.254,91	64.881,02
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.300.279,42	0,00	0,00	0,00	3.333.513,98	33.234,56	101.455,24
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.114.811,16	0,00	0,00	0,00	3.147.039,09	32.227,93	98.409,88
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.293.952,44	0,00	0,00	0,00	2.315.457,62	21.505,18	65.570,84
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.291.101,62	0,00	0,00	0,00	2.312.650,84	21.549,22	65.705,39
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.286.535,79	0,00	0,00	0,00	2.308.092,77	21.556,98	65.737,33
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.280.422,98	0,00	0,00	0,00	2.301.985,25	21.562,27	65.749,72
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.269.537,34	0,00	0,00	0,00	2.291.429,72	21.892,38	66.775,40
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.268.470,38	0,00	0,00	0,00	2.290.463,12	21.992,74	67.088,60
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.267.134,43	0,00	0,00	0,00	2.289.200,83	22.066,40	67.316,10
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.259.828,83	0,00	0,00	0,00	2.281.994,14	22.165,31	67.632,03
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.535.446,67	0,00	0,00	0,00	8.621.251,74	85.805,07	261.892,79
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.170.374,96	0,00	0,00	0,00	3.202.403,55	32.028,59	97.765,28
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.115.637,97	0,00	0,00	0,00	2.137.051,70	21.413,73	65.362,34
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.532.596,43	0,00	0,00	0,00	11.649.569,88	116.973,45	357.082,41
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.856.950,77	0,00	0,00	0,00	6.927.482,66	70.531,89	215.366,26
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.710.924,25	0,00	0,00	0,00	5.770.194,54	59.270,29	180.992,69
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.250.852,90	0,00	0,00	0,00	5.305.413,99	54.561,09	166.618,85
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.131.782,23	0,00	0,00	0,00	3.164.612,26	32.830,03	100.274,06
	313.851.999,54	0,00	0,00	0,00	316.973.324,20	3.121.324,66	

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	21.668.570,37	0,00	0,00	0,00	21.541.524,79	-127.045,58	-352.942,88
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.886.319,31	0,00	0,00	0,00	21.898.712,51	12.393,20	27.830,95
	43.554.889,68	0,00	0,00	0,00	43.440.237,30	-114.652,38	

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	11.521.844,10	0,00	0,00	0,00	11.620.102,92	98.258,82	390.914,45
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	22.088.076,25	0,00	0,00	0,00	22.275.576,40	187.500,15	585.295,46
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5.206.174,50	0,00	0,00	0,00	5.280.310,50	74.136,00	160.072,50
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	37.500.114,33	4.760.000,00	-2.914.500,00	0,00	39.656.964,09	311.349,76	749.806,11
	76.316.209,18	4.760.000,00	-2.914.500,00	0,00	78.832.953,91	671.244,73	

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	5.394.316,56	0,00	0,00	0,00	5.455.170,31	60.853,75	175.619,12
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	5.402.048,18	0,00	0,00	0,00	5.464.618,45	62.570,27	179.016,42
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a	6.303.513,50	0,00	0,00	0,00	6.372.930,36	69.416,86	208.210,01
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	5.380.770,53	0,00	0,00	0,00	5.460.603,18	79.832,65	189.356,38
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	5.389.063,63	0,00	0,00	0,00	5.469.874,70	80.811,07	192.195,32
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	5.759.574,00	0,00	0,00	0,00	5.809.752,00	50.178,00	172.370,75
	33.629.286,40	0,00	0,00	0,00	34.032.949,00	403.662,60	

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	37.815,88	0,00	0,00	617,42	38.003,55	805,11	7.739,36
	37.815,88	0,00	0,00	617,42	38.003,55	805,11	

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	3.584.163,22	0,00	0,00	0,00	3.615.127,07	30.963,85	95.299,60
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	6.230.847,33	0,00	0,00	0,00	6.293.234,45	62.387,12	189.463,37
	9.815.010,55	0,00	0,00	0,00	9.908.361,52	93.350,97	

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	7.516.795,69	0,00	0,00	0,00	7.740.181,53	223.385,84	-98.300,01
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.610.836,71	0,00	0,00	0,00	5.623.142,47	12.305,76	-45.547,25
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	6.826.078,67	0,00	0,00	0,00	6.927.646,66	101.567,99	193.847,58
INDIE FIC FIA	3.890.044,24	0,00	0,00	0,00	3.961.790,08	71.745,84	-93.228,90
META VALOR FI DE AÇÕES	2.203.554,16	0,00	0,00	0,00	2.226.078,65	22.524,49	-74.476,69
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	24.527.780,31	0,00	0,00	0,00	24.294.476,09	-233.304,22	-517.952,81
OCCAM FIC FIA	27.129.886,16	0,00	0,00	0,00	26.723.801,66	-406.084,50	-1.154.829,65
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	4.159.343,26	0,00	0,00	0,00	4.331.366,92	172.023,66	-87.224,38
TARPON GT 30 FIC FIA	10.056.798,87	0,00	0,00	0,00	10.732.945,47	676.146,60	250.927,19
	91.921.118,07	0,00	0,00	0,00	92.561.429,53	640.311,46	

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	18.118.841,83	0,00	0,00	0,00	18.001.471,42	-117.370,41	876.336,99
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	2.230.065,03	0,00	0,00	0,00	2.287.553,69	57.488,66	185.525,12
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.102.015,60	0,00	0,00	0,00	2.124.060,73	22.045,13	47.137,14
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.577.232,26	0,00	0,00	0,00	2.660.943,98	83.711,72	168.818,05
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.340.346,26	0,00	0,00	0,00	3.412.602,08	72.255,82	451.313,35
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	5.871.862,83	0,00	0,00	0,00	6.065.996,33	194.133,50	515.890,75
	34.240.363,81	0,00	0,00	0,00	34.552.628,23	312.264,42	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	21.480.519,66	0,00	0,00	0,00	22.061.850,71	581.331,04	2.060.540,84
	21.480.519,66	0,00	0,00	0,00	22.061.850,71	581.331,04	

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	36.120.990,46	0,00	0,00	0,00	37.362.281,41	1.241.290,95	3.780.182,93
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	7.693.453,19	0,00	0,00	0,00	7.647.413,19	-46.040,00	-170.066,39
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	21.642.429,67	0,00	0,00	0,00	22.381.509,44	739.079,77	2.230.837,48
	65.456.873,32	0,00	0,00	0,00	67.391.204,04	1.934.330,72	

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	11.567.180,55	0,00	0,00	0,00	11.579.346,84	12.166,29	334.991,48
	11.567.180,55	0,00	0,00	0,00	11.579.346,84	12.166,29	

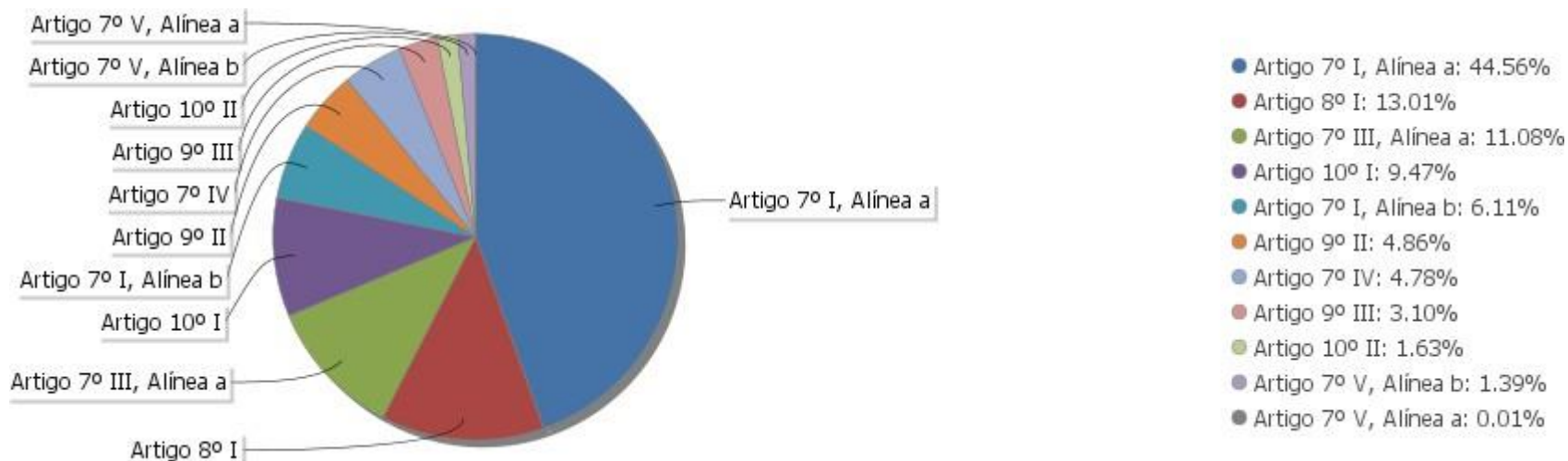
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

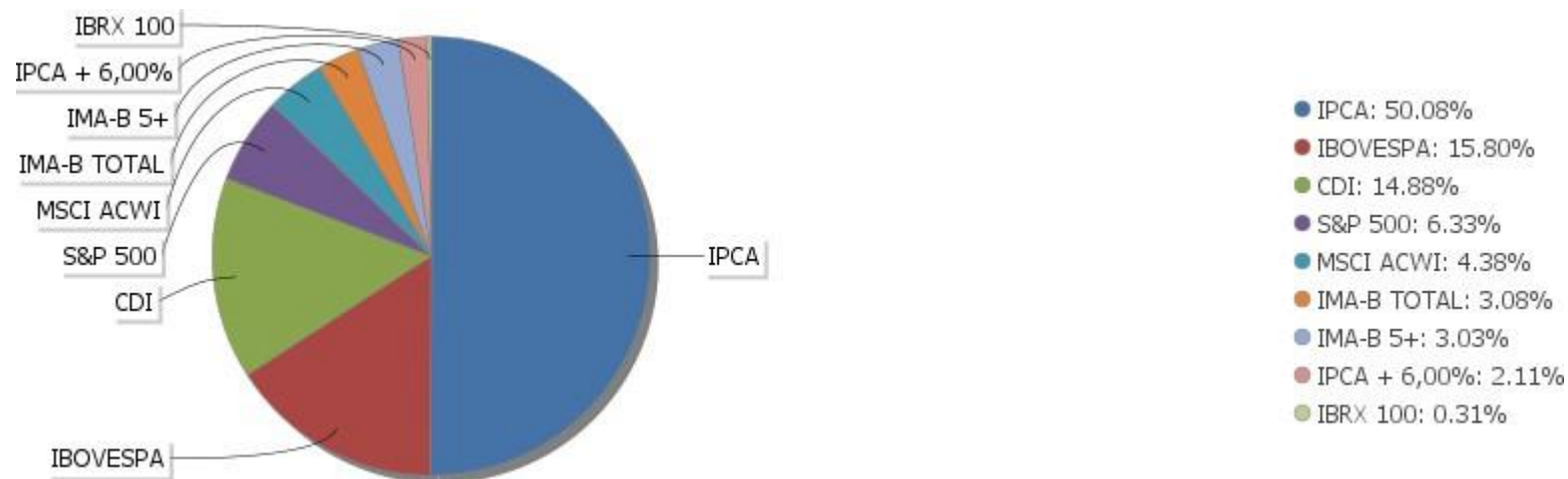
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	287.634.990,61	40,43		287.634.990,61	40,43	
de 31 dias a 365 dias	62.568.091,52	8,80		350.203.082,13	49,23	
acima de 365 dias	361.169.206,71	50,77		711.372.288,82	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

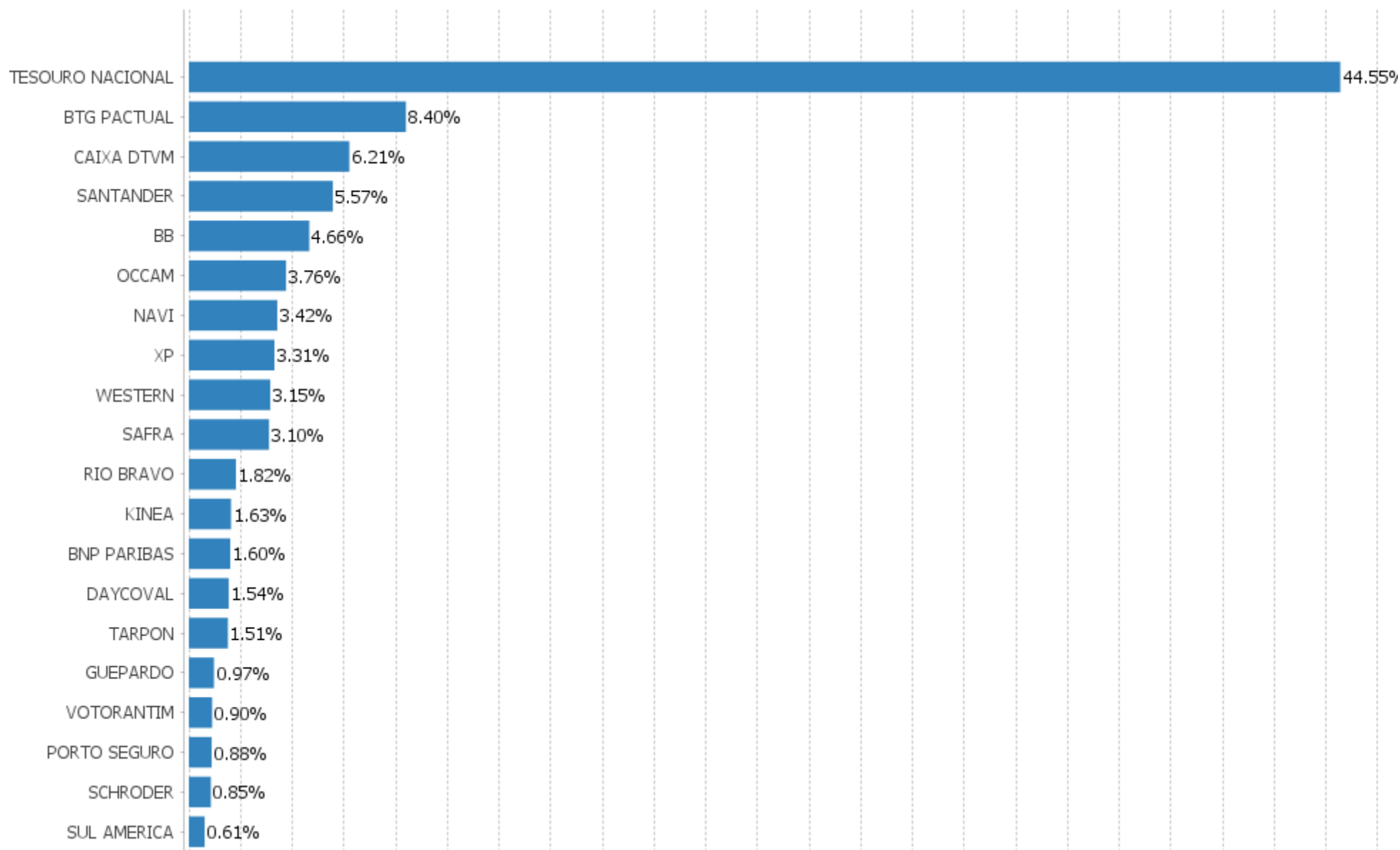


Alocação Por Estratégia

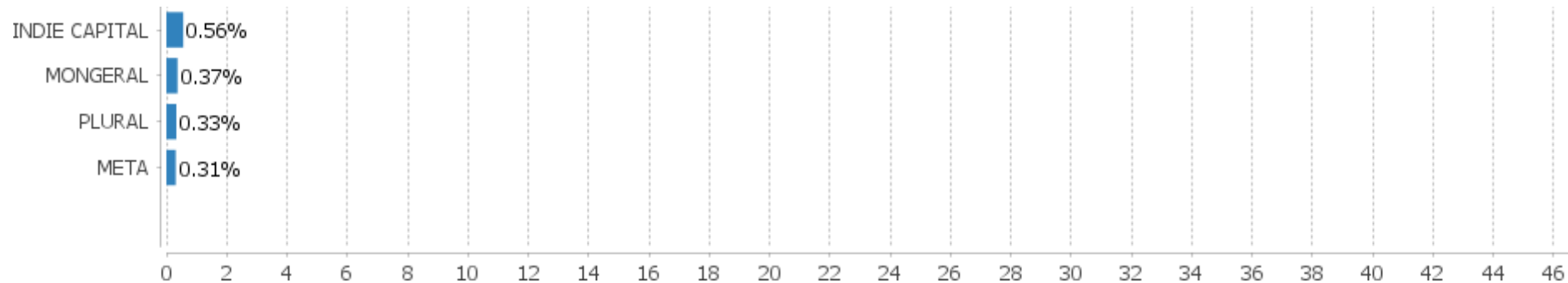


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	1,09										3,01
IPCA + 5,11%	0,86	1,21	0,56										2,65
p.p. indexador	-0,65	0,47	0,54										0,36
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

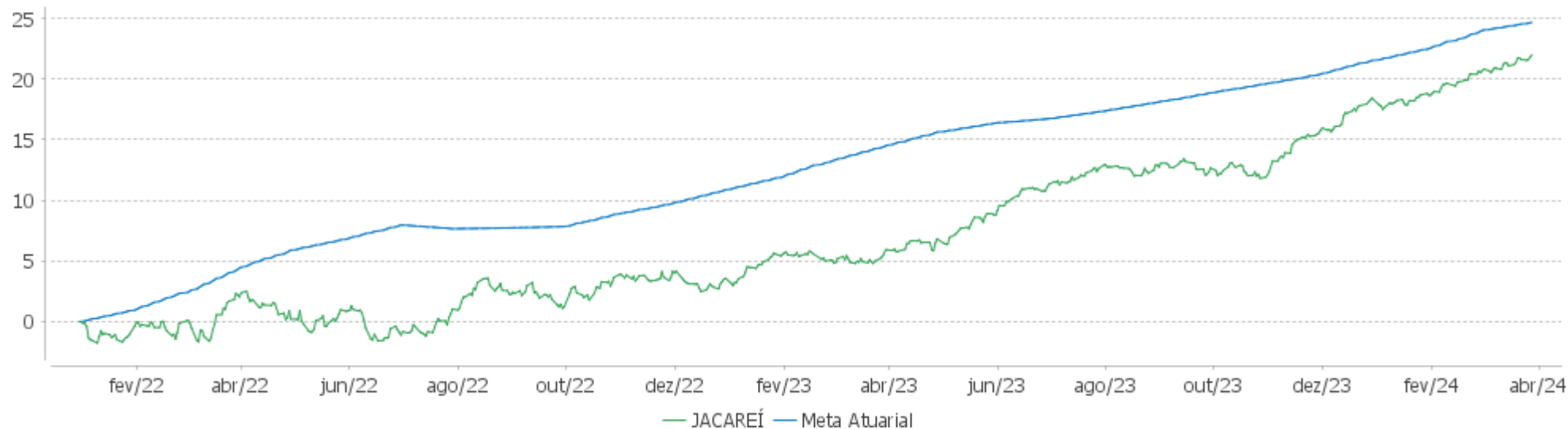
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	12	44,44	03 meses	3,01	2,65	0,36	2,53
Meses abaixo - Meta Atuarial	15	55,56	06 meses	8,27	5,02	3,25	3,06
			12 meses	15,18	9,13	6,05	3,09
			24 meses	19,56	19,80	-0,24	4,10
Maior rentabilidade da Carteira	3,32	2023-11	Desde 31/12/2021	21,98	25,08	-3,10	4,39
Menor rentabilidade da Carteira	-1,97	2022-06					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

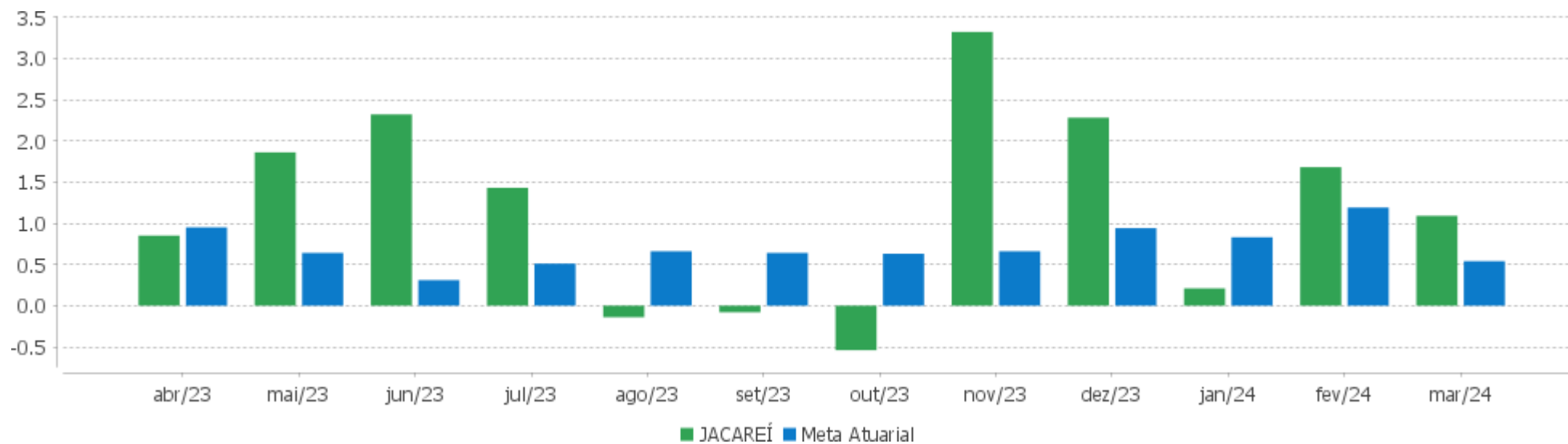


Patrimônio Líquido



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.	1,16 1,00	3,39 1,97	3,39 1,97	5,91 3,39			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a Var. IPCA p.p.	1,50 1,34	3,64 2,23	3,64 2,23	6,11 3,60			
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a Var. IPCA p.p.	1,13 0,97	3,33 1,91	3,33 1,91	5,82 3,31			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,87 0,71	3,06 1,64	3,06 1,64	5,62 3,11	11,54 7,62		
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a Var. IPCA p.p.	1,48 1,32	3,59 2,18	3,59 2,18	6,01 3,50			
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	1,10 0,94	3,38 1,96	3,38 1,96	6,00 3,49	11,37 7,45		
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,00 120,13	3,10 118,26	3,10 118,26	6,52 117,82	14,79 119,66	29,17 106,92	39,78 112,22
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,86 103,65	2,71 103,15	2,71 103,15	5,70 103,03	12,76 103,20	28,36 103,93	38,17 107,69
NTN-B 150850 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,87	3,16 1,75	3,16 1,75	5,80 3,29	10,69 6,77	20,14 11,39	
NTN-B 150850 (5,897000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,69	3,11 1,69	5,68 3,16	10,44 6,51	19,70 10,94	
NTN-B 150525 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,82	3,01 1,59	3,01 1,59	5,26 2,75	9,79 5,86	21,98 13,22	
NTN-B 150828 (5,125600%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,79	2,92 1,51	2,92 1,51	5,13 2,61	9,46 5,54	21,21 12,45	
NTN-B 150533 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,05 1,64	3,05 1,64	5,46 2,95	7,03 3,10	12,56 3,80	
NTN-B 150850 (5,950000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,12 1,70	3,12 1,70	5,71 3,19	10,49 6,57	23,31 14,55	
NTN-B 150545 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,10 1,68	3,10 1,68	5,64 3,12	10,37 6,45	23,07 14,31	
NTN-B 150545 (5,915000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,69	3,11 1,69	5,66 3,15	10,43 6,50	23,20 14,44	
NTN-B 150850 (5,831200%)	1,01	3,09	3,09	5,65	10,37	23,03	

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.	0,85	1,67	1,67	3,13	6,44	14,27	
NTN-B 150826 (5,190000%)	0,96	2,94	2,94	5,14	9,51	21,34	
Var. IPCA p.p.	0,80	1,52	1,52	2,63	5,58	12,58	
NTN-B 150840 (5,837000%)	1,01	3,09	3,09	5,59	10,31	22,98	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,68	1,68	3,08	6,39	14,22	
NTN-B 150830 (5,270000%)	0,96	2,96	2,96	5,23	9,64	21,58	
Var. IPCA p.p.	0,80	1,54	1,54	2,72	5,72	12,82	
NTN-B 150545 (4,970000%)	0,94	2,89	2,89	5,18	9,44	21,00	
Var. IPCA p.p.	0,78	1,47	1,47	2,67	5,51	12,24	
NTN-B 150840 (4,950000%)	0,94	2,88	2,88	5,14	9,38	20,92	
Var. IPCA p.p.	0,78	1,47	1,47	2,62	5,46	12,16	
NTN-B 150850 (4,980000%)	0,94	2,89	2,89	5,21	9,47	21,05	
Var. IPCA p.p.	0,78	1,47	1,47	2,70	5,55	12,30	
NTN-B 150850 (5,360000%)	0,97	2,98	2,98	5,41	9,87	21,94	
Var. IPCA p.p.	0,81	1,56	1,56	2,89	5,95	13,18	
NTN-B 150555 (5,927000%)	1,01	3,11	3,11	5,71	10,49	23,28	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,70	1,70	3,20	6,56	14,52	
NTN-B 150545 (5,922000%)	1,01	3,11	3,11	5,67	10,44	23,21	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,70	1,70	3,15	6,51	14,46	
NTN-B 150535 (4,910000%)	0,94	2,87	2,87	5,09	9,31	20,79	
Var. IPCA p.p.	0,78	1,46	1,46	2,57	5,38	12,03	
NTN-B 150555 (5,370000%)	0,97	2,98	2,98	5,43	9,90	21,98	
Var. IPCA p.p.	0,81	1,57	1,57	2,91	5,98	13,22	
NTN-B 150840 (5,020000%)	0,94	2,90	2,90	5,17	9,46	21,08	
Var. IPCA p.p.	0,78	1,48	1,48	2,66	5,53	12,32	
NTN-B 150850 (4,940000%)	0,94	2,88	2,88	5,19	9,43	20,96	
Var. IPCA p.p.	0,78	1,46	1,46	2,68	5,51	12,20	
NTN-B 150545 (6,280000%)	1,04	3,20	3,20	5,85	10,81	16,82	
Var. IPCA p.p.	0,88	1,78	1,78	3,33	6,89	8,06	
NTN-B 150840 (4,970000%)	0,94	2,89	2,89	5,15	9,41	20,97	
Var. IPCA p.p.	0,78	1,47	1,47	2,63	5,48	12,21	
NTN-B 150826 (5,490000%)	0,98	3,01	3,01	5,29	9,82	22,02	
Var. IPCA p.p.	0,82	1,59	1,59	2,77	5,89	13,27	
NTN-B 150830 (5,460000%)	0,98	3,00	3,00	5,32	9,84	15,33	
Var. IPCA p.p.	0,82	1,59	1,59	2,81	5,92	6,57	
NTN-B 150850 (6,261000%)	1,04	3,19	3,19	5,86	10,82	24,04	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,88	1,78	1,78	3,35	6,89	15,28	
NTN-B 150535 (5,670000%)	0,99	3,05	3,05	5,47	7,04	12,59	
Var. IPCA p.p.	0,83	1,64	1,64	2,96	3,11	3,83	
NTN-B 150555 (5,000000%)	0,94	2,89	2,89	5,24	9,51	21,12	
Var. IPCA p.p.	0,78	1,48	1,48	2,73	5,59	12,36	
NTN-B 150535 (5,320000%)	0,97	2,97	2,97	5,30	9,74	21,74	
Var. IPCA p.p.	0,81	1,55	1,55	2,78	5,81	12,98	
NTN-B 150850 (5,010000%)	0,94	2,90	2,90	5,23	9,51	21,12	
Var. IPCA p.p.	0,78	1,48	1,48	2,71	5,58	12,36	
NTN-B 150545 (6,256000%)	1,04	3,19	3,19	5,84	10,79	23,99	
Var. IPCA p.p.	0,88	1,77	1,77	3,32	6,86	15,24	
NTN-B 150555 (6,261000%)	1,04	3,19	3,19	5,88	10,84	24,06	
Var. IPCA p.p.	0,88	1,78	1,78	3,37	6,91	15,30	
NTN-B 150555 (5,520000%)	0,98	3,02	3,02	5,51	10,06	22,33	
Var. IPCA p.p.	0,82	1,60	1,60	2,99	6,14	13,57	
NTN-B 150555 (5,860000%)	1,01	3,10	3,10	5,68	10,42	23,12	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,68	1,68	3,16	6,49	14,36	
NTN-B 150545 (5,380000%)	0,97	2,98	2,98	5,39	9,87	21,95	
Var. IPCA p.p.	0,81	1,57	1,57	2,88	5,94	13,19	
NTN-B 150826 (5,009000%)	0,94	2,90	2,90	5,05	9,32	20,92	
Var. IPCA p.p.	0,78	1,48	1,48	2,54	5,40	12,16	
NTN-B 150545 (6,400000%)	1,05	3,22	3,22	5,91	10,94	16,98	
Var. IPCA p.p.	0,89	1,81	1,81	3,39	7,01	8,22	
NTN-B 150555 (5,831200%)	1,01	3,09	3,09	5,66	10,39	23,05	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,67	1,67	3,15	6,46	14,29	
NTN-B 150535 (5,855000%)	1,01	3,10	3,10	5,57	10,30	22,98	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,68	1,68	3,05	6,37	14,22	
NTN-B 150828 (4,850000%)	0,93	2,86	2,86	4,99	9,18	20,58	
Var. IPCA p.p.	0,77	1,44	1,44	2,48	5,25	11,82	
NTN-B 150555 (6,400000%)	1,05	3,22	3,22	5,95	10,98	16,98	
Var. IPCA p.p.	0,89	1,81	1,81	3,44	7,06	8,22	
NTN-B 150545 (5,831000%)	1,01	3,09	3,09	5,62	10,34	23,00	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,67	1,67	3,11	6,42	14,24	
NTN-B 150828 (5,240000%)	0,96	2,95	2,95	5,18	9,58	21,47	
Var. IPCA p.p.	0,80	1,53	1,53	2,67	5,65	12,71	
NTN-B 150545 (5,340000%)	0,97	2,97	2,97	5,37	9,83	21,86	

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.	0,81	1,56	1,56	2,86	5,90	13,10	
NTN-B 150850 (5,921000%)	1,01	3,11	3,11	5,69	10,46	23,24	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,70	1,70	3,18	6,54	14,48	
NTN-B 150555 (6,268000%)	1,04	3,19	3,19	5,88	10,84	16,81	
Var. IPCA p.p.	0,88	1,78	1,78	3,37	6,92	8,06	
NTN-B 150535 (4,860000%)	0,93	2,86	2,86	5,06	9,26	20,68	
Var. IPCA p.p.	0,77	1,44	1,44	2,55	5,33	11,92	
NTN-B 150826 (5,710000%)	1,00	3,06	3,06	5,40	10,04	22,53	
Var. IPCA p.p.	0,84	1,65	1,65	2,88	6,12	13,77	
NTN-B 150828 (5,270000%)	0,96	2,96	2,96	5,20	9,61	21,54	
Var. IPCA p.p.	0,80	1,54	1,54	2,68	5,69	12,78	
NTN-B 150555 (6,140000%)	1,03	3,16	3,16	5,82	10,71	20,16	
Var. IPCA p.p.	0,87	1,75	1,75	3,31	6,78	11,40	
NTN-B 150535 (5,290000%)	0,96	2,96	2,96	5,28	9,71	21,67	
Var. IPCA p.p.	0,80	1,55	1,55	2,77	5,78	12,91	
NTN-B 150830 (5,835000%)	1,01	3,09	3,09	5,51	10,23	22,88	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,68	1,68	3,00	6,30	14,12	
NTN-B 150555 (5,315000%)	0,97	2,97	2,97	5,40	9,85	21,85	
Var. IPCA p.p.	0,81	1,55	1,55	2,89	5,92	13,09	
NTN-B 150830 (5,300000%)	0,96	2,96	2,96	5,24	9,68	21,65	
Var. IPCA p.p.	0,80	1,55	1,55	2,73	5,75	12,89	
NTN-B 150535 (5,837000%)	1,01	3,09	3,09	5,56	10,28	22,94	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,68	1,68	3,04	6,35	14,18	
NTN-B 150545 (5,285000%)	0,96	2,96	2,96	5,34	9,77	21,73	
Var. IPCA p.p.	0,80	1,55	1,55	2,83	5,84	12,97	
NTN-B 150830 (5,500000%)	0,98	3,01	3,01	5,34	9,88	22,11	
Var. IPCA p.p.	0,82	1,60	1,60	2,83	5,96	13,35	
NTN-B 150830 (5,178300%)	0,96	2,94	2,94	5,18	9,55	21,37	
Var. IPCA p.p.	0,80	1,52	1,52	2,67	5,62	12,61	
NTN-B 150824 (5,450000%)	0,98	3,00	3,00	5,23	9,74	21,89	
Var. IPCA p.p.	0,82	1,58	1,58	2,71	5,81	13,13	
NTN-B 150545 (5,030000%)	0,94	2,90	2,90	5,21	9,50	21,14	
Var. IPCA p.p.	0,78	1,48	1,48	2,70	5,58	12,38	
NTN-B 150545 (5,897000%)	1,01	3,11	3,11	5,65	10,41	19,67	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,69	1,69	3,14	6,49	10,91	
NTN-B 150850 (6,400000%)	1,05	3,22	3,22	5,93	10,96	20,61	

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.	0,89	1,81	1,81	3,42	7,04	11,86	
NTN-B 150824 (5,912000%)	1,01	3,11	3,11	5,45	10,21	22,95	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,69	1,69	2,94	6,28	14,19	
NTN-B 150850 (5,045000%)	0,95	2,90	2,90	5,24	9,54	21,20	
Var. IPCA p.p.	0,79	1,49	1,49	2,73	5,62	12,45	
NTN-B 150555 (5,030000%)	0,94	2,90	2,90	5,26	9,55	21,19	
Var. IPCA p.p.	0,78	1,48	1,48	2,74	5,62	12,43	
NTN-B 150840 (5,274000%)	0,96	2,96	2,96	5,30	9,72	21,67	
Var. IPCA p.p.	0,80	1,54	1,54	2,79	5,80	12,91	
NTN-B 150826 (5,130000%)	0,95	2,92	2,92	5,11	9,45	21,20	
Var. IPCA p.p.	0,79	1,51	1,51	2,60	5,52	12,44	
NTN-B 150840 (5,360000%)	0,97	2,98	2,98	5,35	9,81	21,87	
Var. IPCA p.p.	0,81	1,56	1,56	2,83	5,89	13,11	
NTN-B 150840 (5,855000%)	1,01	3,10	3,10	5,60	10,33	23,02	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,68	1,68	3,09	6,41	14,26	
NTN-B 150850 (5,410000%)	0,97	2,99	2,99	5,43	9,93	22,05	
Var. IPCA p.p.	0,81	1,57	1,57	2,92	6,00	13,29	
NTN-B 150545 (4,980000%)	0,94	2,89	2,89	5,19	9,45	21,03	
Var. IPCA p.p.	0,78	1,47	1,47	2,67	5,52	12,27	
NTN-B 150830 (4,860000%)	0,93	2,86	2,86	5,02	9,22	20,63	
Var. IPCA p.p.	0,77	1,44	1,44	2,51	5,29	11,87	
NTN-B 150840 (5,310000%)	0,97	2,97	2,97	5,32	9,76	21,75	
Var. IPCA p.p.	0,81	1,55	1,55	2,81	5,84	12,99	
NTN-B 150824 (5,345000%)	0,97	2,98	2,98	5,18	9,63	21,65	
Var. IPCA p.p.	0,81	1,56	1,56	2,66	5,70	12,89	
NTN-B 150830 (4,900000%)	0,93	2,87	2,87	5,04	9,26	20,73	
Var. IPCA p.p.	0,77	1,45	1,45	2,53	5,33	11,97	
NTN-B 150545 (6,140000%)	1,03	3,16	3,16	5,78	10,67	20,12	
Var. IPCA p.p.	0,87	1,75	1,75	3,26	6,74	11,36	
NTN-B 150850 (5,295500%)	0,96	2,96	2,96	5,37	9,81	21,79	
Var. IPCA p.p.	0,80	1,55	1,55	2,86	5,88	13,03	
NTN-B 150535 (4,880000%)	0,93	2,86	2,86	5,07	9,28	20,72	
Var. IPCA p.p.	0,77	1,45	1,45	2,56	5,35	11,96	
NTN-B 150555 (5,420000%)	0,97	2,99	2,99	5,45	9,96	22,10	
Var. IPCA p.p.	0,81	1,58	1,58	2,94	6,03	13,34	
NTN-B 150850 (5,510000%)	0,98	3,01	3,01	5,48	10,03	22,28	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,82	1,60	1,60	2,97	6,11	13,53	
NTN-B 150850 (6,278000%)	1,04	3,20	3,20	5,87	10,84	16,82	
Var. IPCA p.p.	0,88	1,78	1,78	3,36	6,91	8,07	
NTN-B 150555 (5,897000%)	1,01	3,11	3,11	5,70	10,46	19,73	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,69	1,69	3,18	6,53	10,97	
NTN-B 150840 (6,220000%)	1,03	3,18	3,18	5,78	10,71	23,87	
Var. IPCA p.p.	0,87	1,77	1,77	3,27	6,79	15,11	
NTN-B 150555 (5,060000%)	0,95	2,91	2,91	5,27	9,58	21,26	
Var. IPCA p.p.	0,79	1,49	1,49	2,76	5,65	12,50	
NTN-B 150555 (5,950000%)	1,01	3,12	3,12	5,72	10,51	23,33	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,70	1,70	3,21	6,59	14,57	
NTN-B 150828 (5,810000%)	1,00	3,08	3,08	5,46	10,17	22,78	
Var. IPCA p.p.	0,84	1,67	1,67	2,95	6,24	14,03	
NTN-B 150525 (5,810000%)	1,00	3,08	3,08	5,42	10,13	22,74	
Var. IPCA p.p.	0,84	1,67	1,67	2,91	6,20	13,98	
NTN-B 150535 (5,196100%)	0,96	2,94	2,94	5,23	9,61	21,45	
Var. IPCA p.p.	0,80	1,52	1,52	2,72	5,68	12,69	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,06	0,13	0,13	4,84	11,64	19,81	24,88
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,05	-0,05	-0,10	-0,17	-0,40	-0,74
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,59	-1,61	-1,61	4,66	13,00	18,25	18,29
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,03	-0,10	-0,10	-0,15	-0,39	-0,83	-1,20
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	2,13	23,50	23,50	-53,28	2.092,77	198,48	3.391,80
% do CDI	255,44	895,21	895,21	-962,17	16.928,72	727,48	9.569,21
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,85	2,65	2,65	5,55	12,40	27,30	35,92
% do CDI	102,32	100,79	100,79	100,26	100,31	100,05	101,34
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,85	2,70	2,70	5,72	12,96	27,89	36,73
% do CDI	101,85	102,81	102,81	103,26	104,85	102,21	103,63
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	1,42	3,13	3,13	3,12			
Var. IPCA p.p.	1,26	1,71	1,71	0,60			
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,86	2,79	2,79	5,80	13,09	28,17	37,34
% do CDI	103,63	106,36	106,36	104,72	105,91	103,25	105,36
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	0,22	-0,80	-0,80	11,91	23,98	-0,33	-24,19
Var. IBOVESPA p.p.	0,93	3,73	3,73	2,01	-1,76	-7,09	-34,03
TARPON GT 30 FIC FIA	6,72	2,39	2,39	14,21	66,23	58,97	103,98
Var. IBOVESPA p.p.	7,43	6,92	6,92	4,31	40,49	52,21	94,15
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	-0,95	-2,09	-2,09	11,76	30,94	15,74	21,99

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.	-0,24	2,44	2,44	1,86	5,21	8,99	12,15
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	1,49	2,88	2,88	15,76	54,11	41,79	68,81
Var. IBOVESPA p.p.	2,20	7,41	7,41	5,86	28,37	35,04	58,98
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	4,14	-1,97	-1,97	4,36	15,06	-14,51	-19,21
Var. IBOVESPA p.p.	4,84	2,56	2,56	-5,54	-10,67	-21,26	-29,05
INDIE FIC FIA	1,84	-2,30	-2,30	7,33	35,51	2,36	-20,13
Var. IBOVESPA p.p.	2,55	2,23	2,23	-2,57	9,77	-4,39	-29,96
META VALOR FI DE AÇÕES	1,02	-3,24	-3,24	9,65	9,99	-16,62	-23,11
Var. IBRX 100 p.p.	1,75	1,05	1,05	-0,37	-15,19	-21,71	-31,14
OCCAM FIC FIA	-1,50	-4,14	-4,14	8,63	18,73	3,74	3,99
Var. IBOVESPA p.p.	-0,79	0,39	0,39	-1,27	-7,01	-3,02	-5,84
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	2,97	-1,25	-1,25	8,28	20,20	-9,44	-15,21
Var. IBOVESPA p.p.	3,68	3,28	3,28	-1,63	-5,54	-16,20	-25,05
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	2,71	10,30	10,30	17,65	23,43	15,35	8,10
Var. IBOVESPA p.p.	3,41	14,83	14,83	7,75	-2,31	8,59	-1,74
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,05	2,27	2,27	-10,41	-23,38	-18,53	-46,76
Var. MSCI ACWI p.p.	-2,09	-8,90	-8,90	-29,38	-42,46	-34,59	-48,77
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-0,65	5,12	5,12	21,06	30,93	10,02	10,36
Var. MSCI ACWI p.p.	-3,79	-6,06	-6,06	2,09	11,85	-6,04	8,35
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	3,31	9,30	9,30	18,87	18,82	19,35	7,11
Var. MSCI ACWI p.p.	0,16	-1,88	-1,88	-0,10	-0,27	3,28	5,11
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	2,58	8,83	8,83	25,67	33,27	-11,94	-44,32
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,56	-2,35	-2,35	6,70	14,19	-28,01	-46,33
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,25	6,77	6,77	15,56	7,08	-19,51	-32,00
Var. MSCI ACWI p.p.	0,11	-4,40	-4,40	-3,40	-12,00	-35,57	-34,01
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2,16	15,24	15,24	29,37	37,99	27,89	-12,39
Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,54	12,38	12,38	23,92	27,96	5,83	-56,39
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	-0,60	-2,18	-2,18	1,65	7,70		
Var. S&P 500 p.p.	-3,97	-15,86	-15,86	-20,60	-18,05		
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,41	11,07	11,07	25,47	35,83	33,97	61,51
% do CDI	409,72	421,79	421,79	460,05	289,85	124,50	173,54
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	3,44	11,26	11,26	25,85	36,73	41,02	71,15
Var. S&P 500 p.p.	0,07	-2,43	-2,43	3,60	10,98	18,71	55,17
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,11	2,98	2,98	4,06	5,24	-4,93	15,54
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,52	0,12	0,12	-1,39	-4,79	-26,99	-28,46
JACAREÍ	1,09	3,01	3,01	8,27	15,18	19,56	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 4,83% p.p.	0,54	0,36	0,36	3,25	6,05	-0,48	
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

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	
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	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

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	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

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%)	2.258.949,94	5,480000	2.247.888,34	5,960000	-11.061,60
NTN-B 150525 (5,810000%)	1.106.070,76	5,810000	1.104.378,41	5,960000	-1.692,35
NTN-B 150533 (5,680000%)	21.057.992,86	5,680000	20.856.623,35	5,822700	-201.369,51
NTN-B 150535 (4,860000%)	2.288.822,55	4,860000	2.119.927,32	5,847100	-168.895,23
NTN-B 150535 (4,880000%)	2.285.225,07	4,880000	2.119.927,32	5,847100	-165.297,75
NTN-B 150535 (4,910000%)	2.284.584,00	4,910000	2.124.334,66	5,847100	-160.249,34
NTN-B 150535 (5,196100%)	2.275.713,56	5,196100	2.164.000,66	5,847100	-111.712,90
NTN-B 150535 (5,290000%)	2.277.535,27	5,290000	2.181.629,99	5,847100	-95.905,28
NTN-B 150535 (5,320000%)	2.276.819,66	5,320000	2.186.037,32	5,847100	-90.782,34
NTN-B 150535 (5,670000%)	1.577.228,00	5,670000	1.555.788,66	5,847100	-21.439,34
NTN-B 150535 (5,837000%)	2.130.391,10	5,837000	2.128.741,99	5,847100	-1.649,11
NTN-B 150535 (5,855000%)	3.334.333,18	5,855000	3.336.351,32	5,847100	2.018,14
NTN-B 150545 (4,970000%)	2.306.561,73	4,970000	2.070.961,83	5,891100	-235.599,90
NTN-B 150545 (4,980000%)	2.303.799,82	4,980000	2.070.961,83	5,891100	-232.837,99
NTN-B 150545 (5,030000%)	2.299.823,77	5,030000	2.079.793,23	5,891100	-220.030,54
NTN-B 150545 (5,285000%)	2.288.110,07	5,285000	2.132.781,59	5,891100	-155.328,48
NTN-B 150545 (5,340000%)	2.287.464,22	5,340000	2.146.028,68	5,891100	-141.435,54
NTN-B 150545 (5,380000%)	2.286.116,98	5,380000	2.154.860,07	5,891100	-131.256,91
NTN-B 150545 (5,831000%)	5.384.266,15	5,831000	5.347.408,91	5,891100	-36.857,24
NTN-B 150545 (5,860000%)	2.224.566,71	5,860000	2.216.679,83	5,891100	-7.886,88
NTN-B 150545 (5,897000%)	2.140.171,51	5,897000	2.141.612,98	5,891100	1.441,47
NTN-B 150545 (5,915000%)	6.539.466,13	5,915000	6.557.309,86	5,891100	17.843,73
NTN-B 150545 (5,922000%)	2.134.081,87	5,922000	2.141.612,98	5,891100	7.531,11
NTN-B 150545 (6,140000%)	4.799.448,96	6,140000	4.936.749,11	5,891100	137.300,15
NTN-B 150545 (6,256000%)	3.783.979,54	6,256000	3.943.217,31	5,891100	159.237,77
NTN-B 150545 (6,280000%)	3.186.423,93	6,280000	3.329.435,44	5,891100	143.011,51
NTN-B 150545 (6,400000%)	2.172.542,71	6,400000	2.300.578,07	5,891100	128.035,36
NTN-B 150555 (5,000000%)	2.314.417,64	5,000000	2.046.499,37	5,874700	-267.918,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150555 (5,030000%)	2.309.329,29	5,030000	2.050.938,63	5,874700	-258.390,66
NTN-B 150555 (5,060000%)	2.304.266,08	5,060000	2.055.377,90	5,874700	-248.888,18
NTN-B 150555 (5,315000%)	2.293.412,13	5,315000	2.121.966,81	5,874700	-171.445,32
NTN-B 150555 (5,370000%)	2.294.646,72	5,370000	2.139.723,86	5,874700	-154.922,86
NTN-B 150555 (5,420000%)	2.292.693,13	5,420000	2.153.041,64	5,874700	-139.651,49
NTN-B 150555 (5,520000%)	2.284.069,01	5,520000	2.175.237,95	5,874700	-108.831,06
NTN-B 150555 (5,831200%)	11.860.570,80	5,831200	11.790.677,52	5,874700	-69.893,28
NTN-B 150555 (5,860000%)	2.224.063,20	5,860000	2.219.630,56	5,874700	-4.432,64
NTN-B 150555 (5,897000%)	5.342.022,08	5,897000	5.358.188,16	5,874700	16.166,08
NTN-B 150555 (5,927000%)	2.137.857,74	5,927000	2.153.041,64	5,874700	15.183,90
NTN-B 150555 (5,950000%)	17.445.375,46	5,950000	17.623.866,62	5,874700	178.491,16
NTN-B 150555 (6,140000%)	9.596.335,04	6,140000	9.943.944,89	5,874700	347.609,85
NTN-B 150555 (6,261000%)	8.643.236,57	6,261000	9.100.485,28	5,874700	457.248,71
NTN-B 150555 (6,268000%)	7.434.779,12	6,268000	7.835.295,86	5,874700	400.516,74
NTN-B 150555 (6,400000%)	5.436.346,40	6,400000	5.828.749,84	5,874700	392.403,44
NTN-B 150824 (5,345000%)	2.222.617,02	5,345000	2.203.025,74	7,796100	-19.591,28
NTN-B 150824 (5,450000%)	2.256.077,61	5,450000	2.237.049,31	7,796100	-19.028,30
NTN-B 150824 (5,912000%)	2.218.029,20	5,912000	2.203.025,74	7,796100	-15.003,46
NTN-B 150826 (5,009000%)	2.251.853,57	5,009000	2.219.905,15	5,680000	-31.948,42
NTN-B 150826 (5,130000%)	2.254.764,47	5,130000	2.228.526,14	5,680000	-26.238,33
NTN-B 150826 (5,190000%)	2.256.236,03	5,190000	2.232.836,63	5,680000	-23.399,40
NTN-B 150826 (5,490000%)	2.263.506,54	5,490000	2.254.389,11	5,680000	-9.117,43
NTN-B 150826 (5,710000%)	3.316.969,76	5,710000	3.319.081,48	5,680000	2.111,72
NTN-B 150828 (4,850000%)	2.266.547,86	4,850000	2.194.317,89	5,726000	-72.229,97
NTN-B 150828 (5,125600%)	2.261.185,92	5,125600	2.211.630,06	5,726000	-49.555,86
NTN-B 150828 (5,240000%)	2.264.849,17	5,240000	2.224.614,19	5,726000	-40.234,98
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.262.338,04	5,270000	2.224.614,19	5,726000	-37.723,85
NTN-B 150828 (5,810000%)	3.326.634,16	5,810000	3.336.921,29	5,726000	10.287,13
NTN-B 150830 (4,860000%)	2.277.065,45	4,860000	2.177.264,61	5,739900	-99.800,84
NTN-B 150830 (4,900000%)	2.272.402,40	4,900000	2.177.264,61	5,739900	-95.137,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150830 (5,178300%)	2.267.121,29	5,178300	2.203.339,63	5,739900	-63.781,66
NTN-B 150830 (5,270000%)	2.269.897,60	5,270000	2.216.377,14	5,739900	-53.520,46
NTN-B 150830 (5,300000%)	2.270.874,17	5,300000	2.220.722,98	5,739900	-50.151,19
NTN-B 150830 (5,460000%)	3.574.850,77	5,460000	3.524.474,24	5,739900	-50.376,53
NTN-B 150830 (5,500000%)	2.269.888,14	5,500000	2.242.452,17	5,739900	-27.435,97
NTN-B 150830 (5,835000%)	3.330.242,52	5,835000	3.346.294,90	5,739900	16.052,38
NTN-B 150840 (4,950000%)	2.299.285,70	4,950000	2.095.448,54	5,857500	-203.837,16
NTN-B 150840 (4,970000%)	2.289.735,83	4,970000	2.091.092,10	5,857500	-198.643,73
NTN-B 150840 (5,020000%)	2.292.106,54	5,020000	2.104.161,42	5,857500	-187.945,12
NTN-B 150840 (5,274000%)	2.283.596,11	5,274000	2.152.082,28	5,857500	-131.513,83
NTN-B 150840 (5,310000%)	2.284.378,18	5,310000	2.160.795,17	5,857500	-123.583,01
NTN-B 150840 (5,360000%)	2.281.856,51	5,360000	2.169.508,05	5,857500	-112.348,46
NTN-B 150840 (5,837000%)	2.134.695,50	5,837000	2.130.300,07	5,857500	-4.395,43
NTN-B 150840 (5,855000%)	3.333.513,98	5,855000	3.332.678,03	5,857500	-835,95
NTN-B 150840 (6,220000%)	3.147.039,09	6,220000	3.262.974,96	5,857500	115.935,87
NTN-B 150850 (4,940000%)	2.315.457,62	4,940000	2.042.520,00	5,883900	-272.937,62
NTN-B 150850 (4,980000%)	2.312.650,84	4,980000	2.051.248,72	5,883900	-261.402,12
NTN-B 150850 (5,010000%)	2.308.092,77	5,010000	2.055.613,08	5,883900	-252.479,69
NTN-B 150850 (5,045000%)	2.301.985,25	5,045000	2.059.977,44	5,883900	-242.007,81
NTN-B 150850 (5,295500%)	2.291.429,72	5,295500	2.121.078,46	5,883900	-170.351,26
NTN-B 150850 (5,360000%)	2.290.463,12	5,360000	2.138.535,90	5,883900	-151.927,22
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.289.200,83	5,410000	2.151.628,98	5,883900	-137.571,85
NTN-B 150850 (5,510000%)	2.281.994,14	5,510000	2.173.450,77	5,883900	-108.543,37
NTN-B 150850 (5,831200%)	8.621.251,74	5,831200	8.562.872,31	5,883900	-58.379,43
NTN-B 150850 (5,897000%)	3.202.403,55	5,897000	3.207.803,85	5,883900	5.400,30
NTN-B 150850 (5,921000%)	2.137.051,70	5,921000	2.147.264,62	5,883900	10.212,92
NTN-B 150850 (5,950000%)	11.649.569,88	5,950000	11.748.854,37	5,883900	99.284,49
NTN-B 150850 (6,140000%)	6.927.482,66	6,140000	7.157.548,72	5,883900	230.066,06
NTN-B 150850 (6,261000%)	5.770.194,54	6,261000	6.053.365,90	5,883900	283.171,36
NTN-B 150850 (6,278000%)	5.305.413,99	6,278000	5.577.650,77	5,883900	272.236,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (6,400000%)	3.164.612,26	6,400000	3.378.013,85	5,883900	213.401,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
38	01/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.157.000,00	4.520,08893186	255,9684151000
39	01/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.500,00	5,86009801	255,9684151000
49	01/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	5.000,00	19,53366003	255,9684151000
40	07/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	492.000,00	0,00	1.918,63298616	256,4325765000
50	07/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	49.000,00	191,08336651	256,4325765000
41	08/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	587.774,42	2.291,07022692	256,5501542000
42	08/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	492.225,58	1.918,63295321	256,5501542000
43	08/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	260.000,00	0,00	1.013,44706188	256,5501542000
51	12/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	2.000,00	7,78906004	256,7703919000
44	13/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	5.000,00	19,46432607	256,8802014000
52	14/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	245.000,00	953,34932145	256,9886971000
45	19/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	10.000,00	38,86254558	257,3171636000
53	19/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	17.000,00	66,06632749	257,3171636000
54	22/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	40.785,01	158,29632585	257,6497577000
55	22/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	88.448,15	343,28831042	257,6497577000
56	22/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	66.766,84	259,13798870	257,6497577000
46	25/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	45.000,00	174,58526659	257,7537090000
47	25/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	425.000,00	0,00	1.648,86085112	257,7537090000
57	27/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	30.580,66	118,54676787	257,9628323000
58	27/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	71.419,34	276,85903184	257,9628323000
48	28/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	3.200.000,00	0,00	12.400,12654717	258,0618825000
59	28/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	383.000,00	0,00	1.484,14014611	258,0618825000
Total			4.760.000,00	2.914.500,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.400.083,19

Value-At-Risk: 1,32%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,48	0,18		0,06	0,10	0,88	483.225.829,50	67,93
Artigo 8º	9,57	5,96		0,65	-0,01	0,70	92.561.429,53	13,01
Artigo 9º	10,36	5,08		0,25	0,08	1,61	56.614.478,93	7,96
Artigo 10º	7,00	3,86		0,37	0,24	2,54	78.970.550,88	11,10
JACAREÍ		1,32		1,32			711.372.288,82	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,480000%)	0,26	0,08	-0,00	0,12	0,57	0,98	2.258.949,94	0,32
NTN-B 150525 (5,810000%)	0,26	0,08	-0,00	0,12	0,67	1,00	1.106.070,76	0,16
NTN-B 150533 (5,680000%)	0,25	0,15	-0,00	0,17	0,65	0,99	21.057.992,86	2,96
NTN-B 150535 (4,860000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,38	0,93	2.288.822,55	0,32
NTN-B 150535 (4,880000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,39	0,93	2.285.225,07	0,32
NTN-B 150535 (4,910000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,40	0,94	2.284.584,00	0,32
NTN-B 150535 (5,196100%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,48	0,96	2.275.713,56	0,32
NTN-B 150535 (5,290000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,51	0,96	2.277.535,27	0,32
NTN-B 150535 (5,320000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,52	0,97	2.276.819,66	0,32
NTN-B 150535 (5,670000%)	0,25	0,15	-0,00	0,17	0,64	0,99	1.577.228,00	0,22
NTN-B 150535 (5,837000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,67	1,01	2.130.391,10	0,30
NTN-B 150535 (5,855000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,68	1,01	3.334.333,18	0,47
NTN-B 150545 (4,970000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,42	0,94	2.306.561,73	0,32
NTN-B 150545 (4,980000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,42	0,94	2.303.799,82	0,32
NTN-B 150545 (5,030000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,43	0,94	2.299.823,77	0,32
NTN-B 150545 (5,285000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,51	0,96	2.288.110,07	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (5,340000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,53	0,97	2.287.464,22	0,32
NTN-B 150545 (5,380000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,54	0,97	2.286.116,98	0,32
NTN-B 150545 (5,831000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,67	1,01	5.384.266,15	0,76
NTN-B 150545 (5,860000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,68	1,01	2.224.566,71	0,31
NTN-B 150545 (5,897000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,69	1,01	2.140.171,51	0,30
NTN-B 150545 (5,915000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,70	1,01	6.539.466,13	0,92
NTN-B 150545 (5,922000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,70	1,01	2.134.081,87	0,30
NTN-B 150545 (6,140000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,76	1,03	4.799.448,96	0,67
NTN-B 150545 (6,256000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,80	1,04	3.783.979,54	0,53
NTN-B 150545 (6,280000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,81	1,04	3.186.423,93	0,45
NTN-B 150545 (6,400000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,84	1,05	2.172.542,71	0,31
NTN-B 150555 (5,000000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,43	0,94	2.314.417,64	0,33
NTN-B 150555 (5,030000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,43	0,94	2.309.329,29	0,32
NTN-B 150555 (5,060000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,44	0,95	2.304.266,08	0,32
NTN-B 150555 (5,315000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,52	0,97	2.293.412,13	0,32
NTN-B 150555 (5,370000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,54	0,97	2.294.646,72	0,32
NTN-B 150555 (5,420000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,55	0,97	2.292.693,13	0,32
NTN-B 150555 (5,520000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,58	0,98	2.284.069,01	0,32
NTN-B 150555 (5,831200%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,67	1,01	11.860.570,80	1,67
NTN-B 150555 (5,860000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,68	1,01	2.224.063,20	0,31
NTN-B 150555 (5,897000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,69	1,01	5.342.022,08	0,75
NTN-B 150555 (5,927000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,70	1,01	2.137.857,74	0,30
NTN-B 150555 (5,950000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,71	1,01	17.445.375,46	2,45
NTN-B 150555 (6,140000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,76	1,03	9.596.335,04	1,35
NTN-B 150555 (6,261000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,80	1,04	8.643.236,57	1,22
NTN-B 150555 (6,268000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,80	1,04	7.434.779,12	1,05
NTN-B 150555 (6,400000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,84	1,05	5.436.346,40	0,76
NTN-B 150824 (5,345000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,53	0,97	2.222.617,02	0,31
NTN-B 150824 (5,450000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,56	0,98	2.256.077,61	0,32
NTN-B 150824 (5,912000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,70	1,01	2.218.029,20	0,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,009000%)	0,26	0,14	-0,00	0,16	0,43	0,94	2.251.853,57	0,32
NTN-B 150826 (5,130000%)	0,26	0,14	-0,00	0,16	0,46	0,95	2.254.764,47	0,32
NTN-B 150826 (5,190000%)	0,26	0,15	-0,00	0,16	0,48	0,96	2.256.236,03	0,32
NTN-B 150826 (5,490000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,57	0,98	2.263.506,54	0,32
NTN-B 150826 (5,710000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,64	1,00	3.316.969,76	0,47
NTN-B 150828 (4,850000%)	0,26	0,16	-0,00	0,17	0,38	0,93	2.266.547,86	0,32
NTN-B 150828 (5,125600%)	0,26	0,16	-0,00	0,17	0,46	0,95	2.261.185,92	0,32
NTN-B 150828 (5,240000%)	0,26	0,16	-0,00	0,17	0,50	0,96	2.264.849,17	0,32
NTN-B 150828 (5,270000%)	0,26	0,16	-0,00	0,17	0,51	0,96	2.262.338,04	0,32
NTN-B 150828 (5,810000%)	0,26	0,16	-0,00	0,17	0,67	1,00	3.326.634,16	0,47
NTN-B 150830 (4,860000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,38	0,93	2.277.065,45	0,32
NTN-B 150830 (4,900000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,40	0,93	2.272.402,40	0,32
NTN-B 150830 (5,178300%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,48	0,96	2.267.121,29	0,32
NTN-B 150830 (5,270000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,51	0,96	2.269.897,60	0,32
NTN-B 150830 (5,300000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,52	0,96	2.270.874,17	0,32
NTN-B 150830 (5,460000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,56	0,98	3.574.850,77	0,50
NTN-B 150830 (5,500000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,57	0,98	2.269.888,14	0,32
NTN-B 150830 (5,835000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,67	1,01	3.330.242,52	0,47
NTN-B 150840 (4,950000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,41	0,94	2.299.285,70	0,32
NTN-B 150840 (4,970000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,42	0,94	2.289.735,83	0,32
NTN-B 150840 (5,020000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,43	0,94	2.292.106,54	0,32
NTN-B 150840 (5,274000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,51	0,96	2.283.596,11	0,32
NTN-B 150840 (5,310000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,52	0,97	2.284.378,18	0,32
NTN-B 150840 (5,360000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,53	0,97	2.281.856,51	0,32
NTN-B 150840 (5,837000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,67	1,01	2.134.695,50	0,30
NTN-B 150840 (5,855000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,68	1,01	3.333.513,98	0,47
NTN-B 150840 (6,220000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,79	1,03	3.147.039,09	0,44
NTN-B 150850 (4,940000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,41	0,94	2.315.457,62	0,33
NTN-B 150850 (4,980000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,42	0,94	2.312.650,84	0,33
NTN-B 150850 (5,010000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,43	0,94	2.308.092,77	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,045000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,44	0,95	2.301.985,25	0,32
NTN-B 150850 (5,295500%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,51	0,96	2.291.429,72	0,32
NTN-B 150850 (5,360000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,53	0,97	2.290.463,12	0,32
NTN-B 150850 (5,410000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,55	0,97	2.289.200,83	0,32
NTN-B 150850 (5,510000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,58	0,98	2.281.994,14	0,32
NTN-B 150850 (5,831200%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,67	1,01	8.621.251,74	1,21
NTN-B 150850 (5,897000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,69	1,01	3.202.403,55	0,45
NTN-B 150850 (5,921000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,70	1,01	2.137.051,70	0,30
NTN-B 150850 (5,950000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,71	1,01	11.649.569,88	1,64
NTN-B 150850 (6,140000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,76	1,03	6.927.482,66	0,97
NTN-B 150850 (6,261000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,80	1,04	5.770.194,54	0,81
NTN-B 150850 (6,278000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,81	1,04	5.305.413,99	0,75
NTN-B 150850 (6,400000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,84	1,05	3.164.612,26	0,44
Sub-total	0,25	0,14	-0,00		0,63	0,99	316.973.324,20	44,56

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,28	1,22	0,02	0,01	-0,34	0,06	21.898.712,51	3,08
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,59	2,22	0,04	0,03	-0,40	-0,59	21.541.524,79	3,03
Sub-total	2,93	1,71	0,06		-0,37	-0,26	43.440.237,30	6,11

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	1,20	1,52	-0,00	1,52	0,49	1,42	5.280.310,50	0,74
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,03	0,01	0,00	0,01	0,64	0,85	11.620.102,92	1,63
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,11	0,05	0,00	0,04	0,14	0,85	22.275.576,40	3,13
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,04	0,02	0,00	0,02	0,75	0,86	39.656.964,09	5,57
Sub-total	0,09	0,10	0,00		0,70	0,90	78.832.953,91	11,08

Artigo 7º IV

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,76% a.a	0,34	0,08	-0,00	0,12	0,96	1,16	5.464.618,45	0,77
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70 % a.a	1,46	0,13	-0,00	0,17	0,46	1,50	5.469.874,70	0,77
LETRA FINANCEIRA - BCO DAYCOVAL SA 6,61% a.a	0,30	0,14	-0,00	0,16	0,99	1,13	5.455.170,31	0,77
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	0,88	0,13	-0,00	0,15	0,04	0,87	5.809.752,00	0,82
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,49% a.a	1,46	0,13	-0,00	0,17	0,44	1,48	5.460.603,18	0,77
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 7,00% a.a	0,25	0,12	-0,00	0,14	1,07	1,10	6.372.930,36	0,90
Sub-total	0,45	0,08	-0,00		0,81	1,20	34.032.949,00	4,78

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III	7,48	0,90	-0,00	0,90	0,17	2,13	38.003,55	0,01
Sub-total	5,92	0,90	-0,00		0,22	2,14	38.003,55	0,01

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,03	0,01	0,00	0,01	1,18	0,86	3.615.127,07	0,51
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,13	0,09	0,00	0,08	1,31	1,00	6.293.234,45	0,88
Sub-total	0,08	0,06	0,00		1,43	0,95	9.908.361,52	1,39

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,96%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	15,78	9,90	0,04	6,40	0,21	4,14	4.331.366,92	0,61
META VALOR FI DE AÇÕES	15,53	8,38	0,02	4,49	0,01	1,02	2.226.078,65	0,31
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	12,47	8,12	0,07	4,90	0,17	2,97	7.740.181,53	1,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10,69	6,93	0,05	3,77	-0,06	0,22	5.623.142,47	0,79
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	10,67	5,74	0,15	1,72	-0,17	-0,95	24.294.476,09	3,42
OCCAM FIC FIA	10,96	5,80	0,17	1,11	-0,21	-1,50	26.723.801,66	3,76
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	11,51	6,52	0,05	3,62	0,06	1,49	6.927.646,66	0,97
INDIE FIC FIA	12,70	8,43	0,04	4,73	0,08	1,84	3.961.790,08	0,56
TARPON GT 30 FIC FIA	9,37	6,16	0,06	4,72	0,63	6,72	10.732.945,47	1,51
Sub-total	9,57	5,96	0,65		-0,01	0,70	92.561.429,53	13,01

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,86%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	10,53	4,70	0,00	7,42	-0,14	-0,60	7.647.413,19	1,08
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	9,68	5,10	0,14	5,10	0,27	3,41	22.381.509,44	3,15
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9,64	5,05	0,23	4,20	0,27	3,44	37.362.281,41	5,25
Sub-total	8,14	4,52	0,37		0,26	2,96	67.391.204,04	9,47

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,37	0,20	0,00	0,21	-1,95	0,11	11.579.346,84	1,63
Sub-total	0,37	0,20	0,00		-1,95	0,11	11.579.346,84	1,63

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,08%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	12,64	6,61	0,13	5,68	-0,12	-0,65	18.001.471,42	2,53
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	29,54	15,92	0,01	15,23	0,06	2,58	2.287.553,69	0,32
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA	17,73	8,66	-0,00	9,04	0,01	1,05	2.124.060,73	0,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INVESTIMENTO NO EXTERIOR								
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FC DE FI MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15,10	9,71	-0,00	9,49	0,16	3,25	2.660.943,98	0,37
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,55	10,03	0,02	10,02	0,07	2,16	3.412.602,08	0,48
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	14,02	6,41	0,01	6,36	0,18	3,31	6.065.996,33	0,85
Sub-total	10,11	5,66	0,17		0,01	0,91	34.552.628,23	4,86

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	10,75	5,41	0,08	7,63	0,17	2,71	22.061.850,71	3,10
Sub-total	10,75	5,41	0,08		0,17	2,71	22.061.850,71	3,10

(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**

06 e 08 de março:

6º Congresso Brasileiro de Investimentos dos RPPS realizado pela ABIPEM na cidade de Florianópolis. Participaram a presidente Rossana Vasques, gestor de recursos Luís Gustavo Ferreira Bonacina e o Supervisor de Investimentos Amauri Arnaldo Junior. Foram abordados os seguintes temas: ASPECTOS RELEVANTES DOS INVESTIMENTOS DOS RPPS, SELEÇÃO DE FUNDOS LÍQUIDOS, A ATUAÇÃO DO CONTROLE EXTERNO NA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DOS RPPS, AVALIAÇÃO E MONITORAMENTO DOS RISCOS, SELEÇÃO DE FUNDOS ESTRUTURADOS, EXECUÇÃO E FISCALIZAÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS, FUNDOS NO EXTERIOR, TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADOS, CREDENCIAMENTOS, FUNDOS DE RENDA FIXA, ASPECTOS RELEVANTES DO EMPRÉSTIMO CONSIGNADO, ALM COMO FERRAMENTA DE GESTÃO, FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL, PROCESSO DE INVESTIMENTOS E DESINVESTIMENTOS, PRÓ-GESTÃO E CERTIFICAÇÃO PROFISSIONAL, FUNDOS ESTRUTURADOS, O BRASIL DE 2024 E OS INVESTIMENTOS DOS RPPS.

11 e 12 de março:

Reunião com os Auditores da empresa TOTUM. O objetivo da reunião foi a auditoria “*in loco*” do processo de certificação do nível I do Pró-Gestão. Participaram da reunião os senhores Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos, Rossana Vasques, Presidente do IPMJ, Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Fabíola Melo - Assessora da Presidência e Sandra Pereira Rossi – Diretora de Benefícios.

14 de março:

09h00: Quadringentésima segunda (402ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros (CAIF) do Instituto de Previdência do Município de Jacareí (IPMJ), ocorrida em 14 de março de 2024, tendo início às 9h05 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, Danielle de Paula, José Luis Machado de Almeida e Zilton Mendes da Silva. Pautas da reunião: 1) Reunião Trimestral do Kinea Private Equity IV – 4º Trimestre 2023; 2) Apresentação do Relatório Anual de Investimentos 2023; 3) Análise do relatório de investimentos de fevereiro de 2024; 4) Análise da carteira fechada de fevereiro de 2024; 5) Assuntos diversos.

19 de março:

Reunião com os representantes da CAIXA ASSET na cidade de São Paulo. A reunião denominada CAIXA EXPERIENCE RPPS abordou os seguintes temas: Tour pela Caixa Asset, Apresentação do Head de Renda Fixa, encontro com o Economista chefe da CAIXA ASSET, reunião com PIMCO INVESTIMENTOS onde foi apresentada a tese de renda fixa Global. Participaram da reunião o senhor Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e Rossana Vasques – Presidente do Instituto de Previdência do Município de Jacareí.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

21 de março:

10h00: Reunião com os representantes da HMC INVESTIMENTOS (Vinicius Bueno Lima). O objetivo da reunião foi a apresentação institucional da empresa, visão do cenário macroeconômico e apresentação de fundos elegíveis de investimentos no 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.

21 de março:

15h00: Reunião com a representante da plataforma de investimentos QUANTUM. O objetivo da reunião foi a apresentação institucional da empresa, elaboração de estudos e demais ferramentas da plataforma. Participaram da reunião o senhor Luís Gustavo Ferreira Bonacina – Gestor dos Recursos e Amauri Arnaldo Junior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos.

25 de março:

Reunião com os representantes da BNP ASSET na cidade de São Paulo. O objetivo da reunião foi a apresentação institucional da empresa, visão do cenário macroeconômico e apresentação de fundos elegíveis de investimentos nas estratégias de 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.

27 de março:

09h00: Quadringentésima terceira (403ª) reunião ordinária do Comitê de Acompanhamento de Investimentos Financeiros do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, ocorrida em 27 de março 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, Clévio Vitor de Almeida, Danielle de Paula, José Luís Machado de Almeida e Zilton Mendes da Silva. Ausência justificada de Amauri Arnaldo Junior. Pautas da reunião: 1) Análise parcial da carteira até 25/03/2024; 2) Reunião com gestores da VINCI PARTNERS; 3) Assuntos Diversos.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

ACOMPANHAMENTO DE FUNDOS ILÍQUIDOS

I. FIDC MULTISETORIAL MASTER III

Em março 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 05/03/2024 foi realizado amortizações no montante de R\$ 482,23 (quatrocentos e oitenta e dois reais e vinte e três centavos), R\$ 97,41 (noventa e sete reais e quarenta e um centavos) e R\$ 37,78 (trinta e sete reais e setenta e oito centavos), totalizando R\$ 617,42 (seiscentos e dezessete reais e quarenta e dois centavos) que foram aplicados no fundo SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI.

O total de amortizações já entregue é de R\$ 7.083.221,86 (sete milhões e oitenta e três mil e duzentos e vinte e um reais e oitenta e seis centavos). O saldo em 29 de março de 2024 é de R\$ 38.003,55 (trinta e oito mil e três 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\$ 2.483.460,84 (dois milhões e quatrocentos e oitenta e três mil e quatrocentos e sessenta reais e oitenta 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 29 de março de 2024 é de R\$ 11.579.346,84 (onze milhões e quinhentos e setenta e nove mil e trezentos e quarenta e seis reais e oitenta e quatro centavos) com um rendimento no mês de março de R\$ 12.166,29 (doze mil e cento e sessenta e seis reais e vinte e nove 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” (Certificação emitida em 01/04/2024). Em atendimento ao Manual do Pró Gestão RPPS, apresenta-se o presente relatório, referente ao mês de MARÇO 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, atendendo 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



Clóvio 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 24 dias do mês de abril 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 MARÇO de 2024, considerando as explicações dos investimentos, rentabilidade e pormenores constantes no presente documento, pela Diretoria Administrativa – Financeira deste Instituto, APROVAMOS o Relatório de Investimentos referente ao mês de março de 2024.

Jacareí, 24 de abril 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

