

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS DEZEMBRO - 2023



Carteira Consolidada

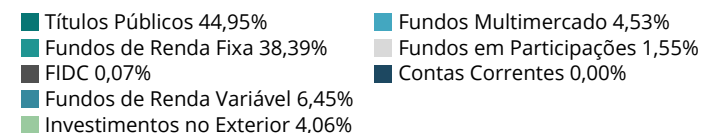
Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos do Município de Joinville - SC



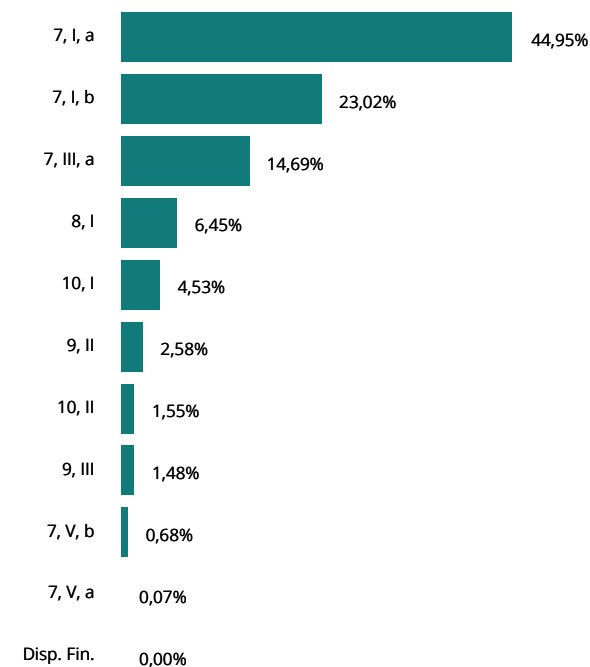
Distribuição da Carteira	3
Retorno da Carteira por Ativo	11
Rentabilidade da Carteira (em %)	19
Rentabilidade e Risco dos Ativos	20
Análise do Risco da Carteira	28
Liquidez e Custos das Aplicações	30
Movimentações	33
Enquadramento da Carteira	35
Comentários do Mês	40

ATIVOS	%	DEZEMBRO	NOVEMBRO
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	13,9%	520.019.427,66	515.744.499,83
LFT 01/03/2024 (Compra em 17/02/2023)	0,0%	1.027.410,67	1.018.277,54
LFT 01/03/2024 (Compra em 21/11/2022)	0,0%	998.871,48	989.992,05
LFT 01/03/2025 (Compra em 06/03/2023)	0,0%	1.198.572,66	1.187.876,42
LFT 01/03/2025 (Compra em 18/05/2020)	0,0%	799.048,44	791.917,61
LFT 01/03/2026 (Compra em 17/05/2023)	0,2%	6.486.470,66	6.428.513,38
LFT 01/09/2024 (Compra em 06/12/2018)	0,0%	57.078,48	56.570,47
LFT 01/09/2024 (Compra em 18/11/2019)	0,0%	713.481,06	707.130,81
LFT 01/09/2025 (Compra em 16/05/2023)	0,2%	5.720.086,74	5.669.034,08
LTN 01/01/2024 (Compra em 13/12/2021)	0,0%	999,55	990,61
LTN 01/01/2026 (Compra em 25/07/2023) 000075647	0,1%	4.362.563,85	12.483.071,83
LTN 01/01/2026 (Compra em 28/07/2023) 00007565E	0,2%	6.647.716,34	6.548.496,70
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 14/06/2023) 005D3D3	0,4%	15.426.568,06	15.226.792,22
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 17/05/2021) 312733	0,2%	6.362.345,91	6.279.952,80
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 02/09/2022) 00565EE	0,6%	21.535.793,15	21.173.526,97
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 05/10/2022) 00575E2	0,1%	2.153.579,32	2.117.352,70
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 09/09/2022) 00569CA	0,6%	21.535.793,15	21.173.526,97
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 17/08/2022) 352262	0,3%	10.337.180,71	10.163.292,94
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 19/08/2022) 00560B1	0,1%	3.876.442,77	3.811.234,85
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 26/09/2022) 0056FDF	0,1%	4.307.158,63	4.234.705,39
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 02/01/2019)	0,0%	311.491,05	301.795,04
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 03/06/2020)	0,1%	4.449.872,13	4.311.357,75
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 07/07/2023) 005DD3D	0,4%	13.349.616,39	12.934.073,26
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 10/05/2019)	0,1%	4.627.867,01	4.483.812,06
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 11/01/2019)	0,0%	1.232.614,58	1.194.246,10
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 13/05/2022) 343941	0,1%	2.892.416,88	2.802.382,54
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 16/08/2019)	0,0%	1.041.270,08	1.008.857,71
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 17/08/2022) 352264	0,1%	3.782.391,31	3.664.654,09
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 18/02/2020)	0,0%	1.201.465,47	1.164.066,59
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 21/11/2018)	0,1%	4.449.872,13	4.311.357,75
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 25/07/2023) 005E442	0,8%	29.814.143,26	28.886.096,94
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/10/2017)	0,3%	9.785.268,82	9.480.675,71
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 04/10/2022) 0057548	0,5%	20.234.813,04	19.474.202,49
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/07/2022) 349638	0,0%	674.493,77	649.140,08

POR SEGMENTO

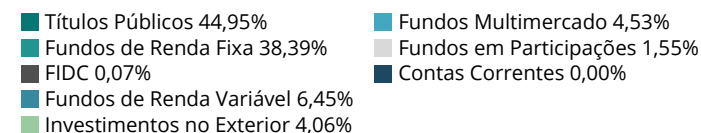


POR TIPO DE ATIVO

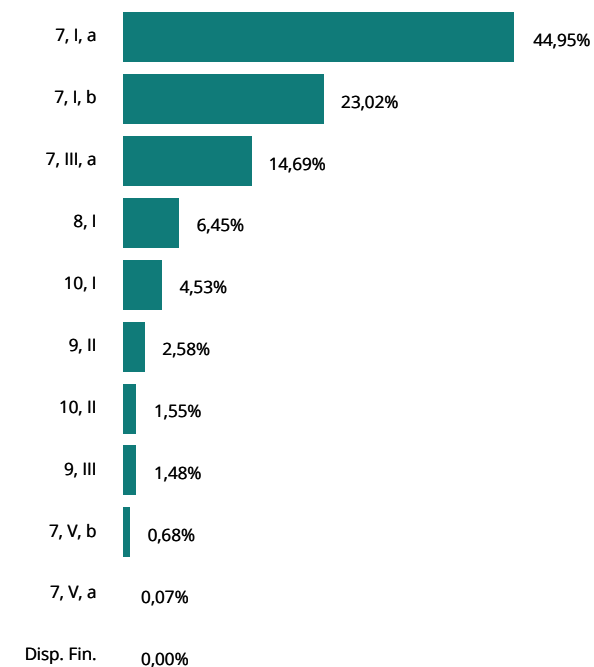


ATIVOS	%	DEZEMBRO	NOVEMBRO
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	13,9%	520.019.427,66	515.744.499,83
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/11/2022) 00587CF	0,1%	3.372.468,84	3.245.700,41
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/05/2022) 344518	0,0%	1.573.818,79	1.514.660,19
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/08/2022) 00560AF	0,1%	4.046.962,61	3.894.840,50
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 28/03/2022) 339279	0,1%	3.822.131,35	3.678.460,47
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 16/08/2021)	0,0%	774.454,24	736.834,43
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 17/12/2019)	0,0%	428.227,62	407.426,09
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 01/02/2022) 334348	0,4%	14.903.648,47	14.764.794,04
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 04/01/2022)	0,0%	1.311.521,07	1.299.301,88
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/05/2019)	0,0%	621.695,05	615.902,84
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 20/01/2022) 333549	0,1%	4.684.003,81	4.640.363,84
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 22/02/2022)	0,0%	906.993,46	898.543,18
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 03/07/2018)	0,0%	352.607,92	347.237,87
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 07/03/2022) 336701	0,1%	3.700.206,44	3.643.854,22
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 09/08/2017) 244294	0,1%	4.353.184,05	4.286.887,32
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 10/03/2022) 337480	0,1%	3.787.270,12	3.729.591,97
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 13/07/2022) 349261	0,1%	3.264.888,04	3.215.165,49
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/07/2022) 349480	0,1%	3.264.888,04	3.215.165,49
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/12/2022) 00593A4	0,1%	3.700.206,44	3.643.854,22
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/05/2023)	0,2%	6.159.755,42	6.065.945,56
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/09/2021) 321107	0,2%	8.706.368,09	8.573.774,64
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2021) 318118	0,1%	4.353.184,05	4.286.887,32
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2023) 005ECDD	0,1%	3.177.824,35	3.129.427,74
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/02/2018)	0,0%	783.573,12	771.639,72
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/03/2018)	0,0%	191.540,10	188.623,04
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 22/11/2022) 0058918	0,1%	4.353.184,05	4.286.887,32
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2021) 325234	0,0%	435.318,40	428.688,73
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 29/06/2021)	0,0%	478.850,25	471.557,61
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 30/11/2022) 0058C49	0,1%	4.353.184,05	4.286.887,32
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/09/2021) 320543	0,1%	5.287.370,81	5.183.652,43
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323671	0,1%	1.982.764,05	1.943.869,66
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323677	0,2%	8.812.284,68	8.639.420,72
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/02/2019)	0,0%	1.260.156,72	1.235.437,16
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2022)	0,0%	942.914,46	924.418,02

POR SEGMENTO

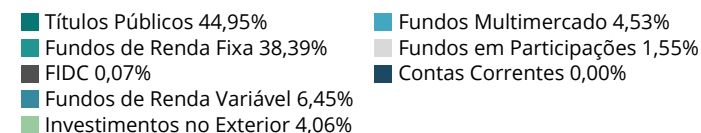


POR TIPO DE ATIVO

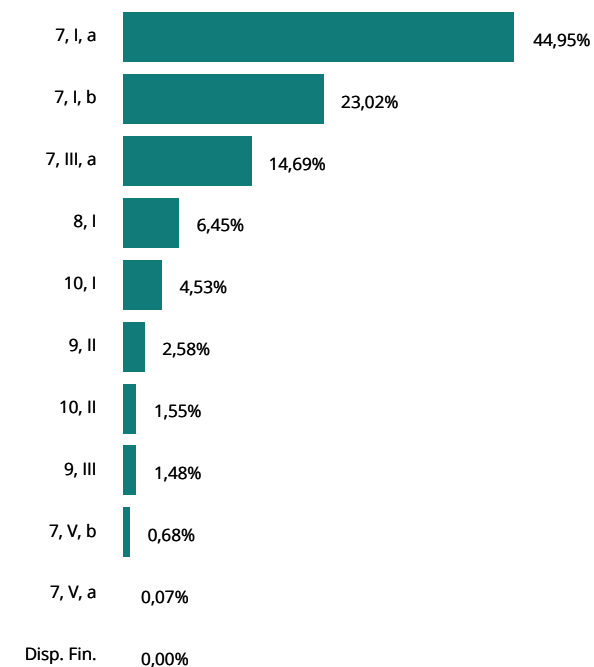


ATIVOS	%	DEZEMBRO	NOVEMBRO
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	13,9%	520.019.427,66	515.744.499,83
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2023)	0,0%	1.493.682,25	1.464.381,81
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 17/05/2018)	0,2%	8.812.284,67	8.639.420,72
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 19/03/2018)	0,1%	5.287.370,80	5.183.652,43
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 21/10/2021) 324819	0,2%	8.812.284,68	8.639.420,72
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/08/2023) 005EFE6	0,3%	10.574.741,61	10.367.304,86
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/10/2021) 325075	0,0%	881.228,47	863.942,07
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 05/07/2023)	0,3%	13.091.122,29	12.792.554,77
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 08/11/2018) 265743	0,2%	8.914.621,92	8.711.307,30
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 16/02/2022) 335567	0,2%	6.685.966,44	6.533.480,48
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 20/07/2022) 349906	0,1%	3.788.714,32	3.702.305,60
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 24/03/2022) 338960	0,2%	7.354.563,08	7.186.828,52
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/09/2022) 0056DF3	0,5%	17.881.729,62	17.439.661,42
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 26/08/2022) 00562E2	0,6%	22.352.162,03	21.799.576,78
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 30/08/2022) 00563E2	0,6%	22.352.162,03	21.799.576,78
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 25/03/2022) 339157	0,1%	3.421.602,13	3.280.412,69
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 04/06/2021) 313399	0,0%	918.792,27	876.297,27
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 05/10/2022) 00575E0	0,1%	2.986.074,87	2.847.966,11
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 15/06/2018) 260982	0,7%	25.726.183,45	24.536.323,44
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) i	0,0%	542.087,44	517.015,39
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) ii	0,2%	8.269.130,40	7.886.675,39
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) i	0,0%	114.849,03	109.537,16
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) ii	0,1%	4.593.961,33	4.381.486,33
NTN-F 01/01/2027 (Compra em 17/08/2023) 0046601	0,1%	3.250.679,80	3.199.312,31
NTN-F 01/01/2031 (Compra em 05/10/2022) 003FA75	0,3%	10.371.226,22	10.061.383,59
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	31,1%	1.165.054.093,15	1.153.330.532,36
NTN-B XP 2028-08 (Compra 14/07/22 Tx 6.1310)	1,4%	52.233.204,05	51.760.741,99
NTN-B XP 2028-08 (Compra 19/07/22 Tx 6.2780)	0,4%	15.694.988,29	15.551.091,22
NTN-B XP 2030-08 (Compra 01/11/23 Tx 5.8570)	0,8%	30.408.095,48	30.130.129,73
NTN-B XP 2030-08 (Compra 09/10/23 Tx 5.8465)	0,8%	30.631.631,43	30.351.918,65
NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/11/22 Tx 6.0750)	0,8%	28.696.924,64	28.429.043,67
NTN-B XP 2030-08 (Compra 23/05/23 Tx 5.5625)	0,5%	20.380.120,99	20.199.185,49
NTN-B XP 2030-08 (Compra 24/11/22 Tx 6.2550)	0,6%	21.215.887,02	21.014.461,91

POR SEGMENTO

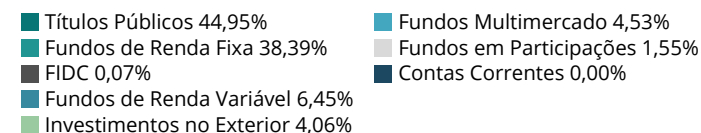


POR TIPO DE ATIVO

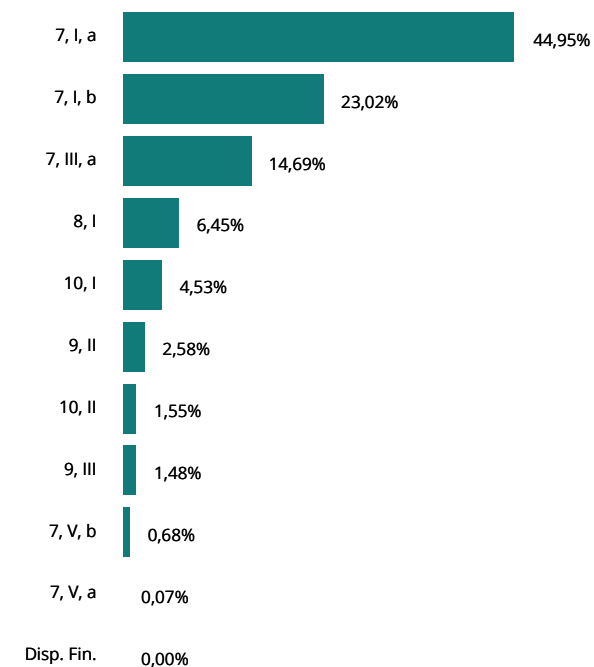


ATIVOS	%	DEZEMBRO	NOVEMBRO
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	31,1%	1.165.054.093,15	1.153.330.532,36
NTN-B XP 2032-08 (Compra 21/07/22 Tx 6.2610)	0,8%	31.399.002,07	31.091.082,80
NTN-B XP 2035-05 (Compra 05/04/23 Tx 6.0750)	0,8%	30.262.650,67	29.967.418,48
NTN-B XP 2035-05 (Compra 06/03/23 Tx 6.4290)	0,8%	28.473.163,63	28.185.956,65
NTN-B XP 2035-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.4200)	0,0%	1.052.558,04	1.042.940,49
NTN-B XP 2035-05 (Compra 15/05/23 Tx 5.6650)	0,0%	889.111,94	880.781,24
NTN-B XP 2035-05 (Compra 18/11/22 Tx 6.2000)	0,4%	15.938.132,59	15.780.773,45
NTN-B XP 2035-05 (Compra 20/04/23 Tx 6.0550)	0,8%	30.108.333,26	29.815.189,61
NTN-B XP 2035-05 (Compra 27/02/23 Tx 6.3150)	0,4%	15.404.093,61	15.250.358,33
NTN-B XP 2040-08 (Compra 14/06/22 Tx 5.7600)	1,4%	52.784.477,27	52.268.470,77
NTN-B XP 2040-08 (Compra 15/12/22 Tx 6.3520)	1,4%	52.728.933,57	52.183.370,66
NTN-B XP 2040-08 (Compra 17/05/22 Tx 5.6700)	0,1%	5.321.542,00	5.269.985,13
NTN-B XP 2040-08 (Compra 30/01/23 Tx 6.4500)	1,0%	36.313.287,37	35.934.187,24
NTN-B XP 2045-05 (Compra 04/05/22 Tx 5.8250)	2,8%	104.371.156,62	103.311.853,71
NTN-B XP 2045-05 (Compra 06/07/22 Tx 6.1150)	0,7%	26.208.018,18	25.934.568,28
NTN-B XP 2045-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.5600)	0,3%	10.583.677,42	10.479.029,34
NTN-B XP 2045-05 (Compra 13/04/22 Tx 5.7400)	2,8%	105.366.972,22	104.306.278,15
NTN-B XP 2045-05 (Compra 16/05/23 Tx 5.8255)	0,4%	13.922.250,28	13.780.929,37
NTN-B XP 2045-05 (Compra 24/11/22 Tx 6.2900)	0,8%	31.836.361,91	31.498.796,49
NTN-B XP 2050-08 (Compra 09/05/22 Tx 5.8420)	1,4%	53.604.828,63	53.047.182,72
NTN-B XP 2050-08 (Compra 11/05/22 Tx 5.8810)	1,4%	53.534.952,33	52.976.046,19
NTN-B XP 2050-08 (Compra 24/06/22 Tx 5.9201)	1,4%	52.679.787,25	52.127.742,45
NTN-B XP 2050-08 (Compra 26/04/22 Tx 5.7950)	1,4%	53.967.713,86	53.408.758,96
NTN-B XP 2050-08 (Compra 29/04/22 Tx 5.8200)	1,4%	53.830.377,66	53.271.598,60
NTN-B XP 2055-05 (Compra 28/06/22 Tx 6.0310)	2,8%	105.211.858,87	104.080.660,59
FUNDOS DE RENDA FIXA	38,4%	1.439.005.731,62	1.396.126.522,94
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	4,1%	155.059.929,23 ▲	125.346.992,47
BB FIC Previdenciário Fluxo	0,7%	27.027.676,70 ▼	30.356.631,60
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	1,2%	44.186.069,34	43.556.879,14
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	6,4%	239.014.730,68 ▲	230.747.242,04
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	5,3%	198.678.180,08	191.162.531,26
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	0,1%	2.904.336,14	2.877.856,05
Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa	1,6%	59.940.558,07	59.419.237,43

POR SEGMENTO

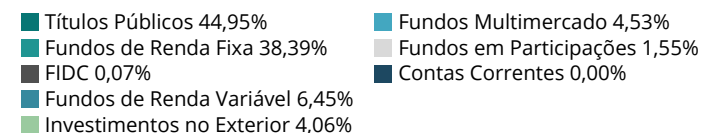


POR TIPO DE ATIVO

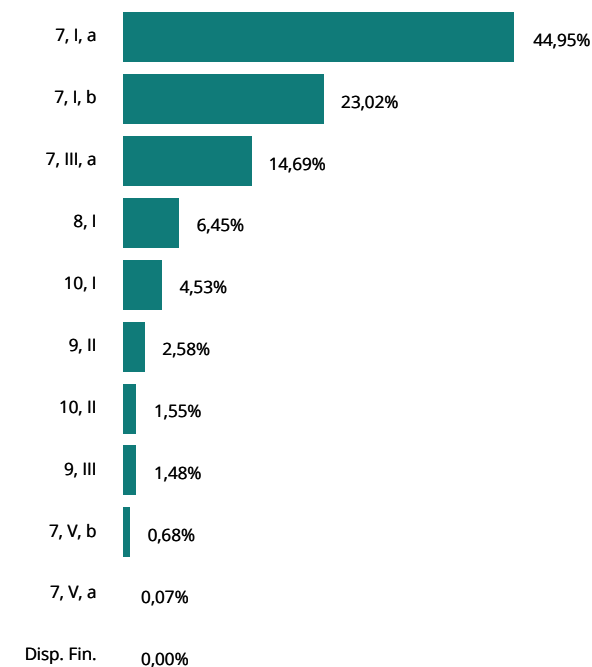


ATIVOS	%	DEZEMBRO	NOVEMBRO
FUNDOS DE RENDA FIXA	38,4%	1.439.005.731,62	1.396.126.522,94
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA Geral	0,6%	23.339.699,19	22.974.550,91
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B	0,7%	27.401.285,37	26.676.254,48
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5	0,9%	32.696.760,77	32.233.643,81
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5+	0,4%	15.509.953,62	14.925.738,11
Bradesco FIC Performance Inst. Crédito Privado	0,5%	18.163.324,15	17.991.098,58
Bradesco Institucional Renda Fixa IRF-M	0,2%	6.262.254,14	6.171.378,78
Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa	0,0%	12.003,07	11.903,01
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	3,2%	118.552.531,76	117.387.890,82
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	0,2%	7.151.481,00	7.050.846,00
Caixa Brasil Referenciado	0,0%	1.171.234,89	1.160.508,27
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	1,0%	37.354.270,00	37.013.001,40
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	1,1%	40.825.221,48	39.741.630,19
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	0,9%	33.388.135,54	32.125.025,70
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	0,0%	6.383,55 ▲	5.194,88
Itaú FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa	1,1%	40.821.919,82	40.174.907,16
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	0,6%	21.425.067,14	21.185.860,82
Itaú FIC IMA-B 5+	1,5%	55.758.894,90	53.656.658,40
Itaú FIC Institucional IMA-B	0,5%	17.022.010,42	16.569.746,57
Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa	0,4%	15.958.612,63	15.803.402,43
Trend Cash FIC Simples	0,0%	793.585,62	786.616,68
Vinci Institucional Referenciado	0,0%	1.010.422,76	1.001.345,60
Western Asset Ativo IMA-B	0,7%	25.940.835,00	25.211.928,02
Western Asset Ativo IMA-B 5	1,5%	58.081.154,98 ▼	65.580.809,97
Western Asset Soberano II Referenciado Selic	0,7%	27.324.548,87 ▼	27.224.867,82
Western Ativo Max	0,2%	7.812.266,86	7.714.634,94
Western Max Referenciado DI Renda Fixa	0,9%	31.883.591,44 ▲	22.394.406,52
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	0,0%	614.104,74 ▼	14.543.666,27
XP Inflação Referenciado IPCA	0,3%	12.774.925,13	12.505.488,65
XP Trend Simples	0,9%	33.137.772,54	32.836.148,16
FIDC	0,1%	2.717.654,67	2.659.051,42
BRPP FIDC Multisetorial Master	0,0%	40.191,77 ▼	40.630,07
Vila Rica FIDC Multisetorial Itália	0,1%	2.677.462,90	2.618.421,35

POR SEGMENTO

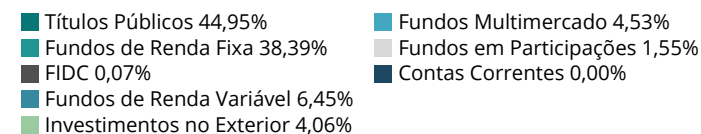


POR TIPO DE ATIVO

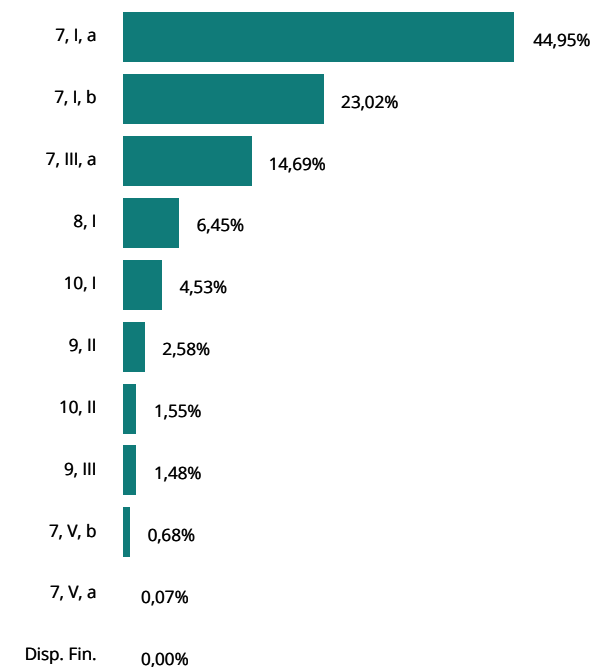


ATIVOS	%	DEZEMBRO	NOVEMBRO
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	6,4%	241.680.408,67	238.714.199,64
BB FIA Governança	0,1%	3.032.671,63	2.874.031,49
BB FIC FIA Bolsa Brasileira	0,0%	- ▼	10.132.895,89
BB FIC FIA Dividendos	1,5%	56.267.954,62	52.906.855,96
BB FIC FIA Seleção Fatorial	0,2%	6.836.258,23	6.497.118,60
Bradesco FIA MID Small Cap	0,1%	3.305.180,93	3.125.124,11
Bradesco FIA Selection	0,2%	8.052.493,82	7.578.462,72
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX	0,6%	24.085.886,07	22.812.987,35
Caixa FIC FIA Valor Vinci Exp. Dividendos RPPS	0,4%	13.395.839,98	12.648.206,94
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	0,4%	13.709.463,32	12.949.818,87
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	1,7%	62.069.624,56	58.909.585,20
Occam FIC FIA	0,3%	11.893.609,25	11.339.085,01
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	0,0%	1.535.036,50	1.463.008,84
Vinci FIA Fatorial Dinâmico	0,2%	7.080.438,89	6.707.547,73
Vinci FIA Gas Dividendos	0,1%	2.977.402,26	2.821.978,29
Vinci FIA Selection Equities	0,6%	21.383.494,28	20.189.099,07
Western Asset FIA Valuation	0,1%	3.280.186,69	3.121.277,54
Western Asset FIC FIA Alpha IBrX	0,1%	2.454.060,94	2.331.977,13
XP FIC FIA Investor 30	0,0%	320.806,70	305.138,90
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	4,1%	152.280.882,69	149.418.767,93
BB FIA ESG BDR Nível I	0,5%	17.893.720,17	17.366.985,84
BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior	0,7%	27.013.193,67	26.061.600,97
BB Schroder Multimercado IE	0,1%	3.728.413,82	3.636.501,93
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	0,0%	1.755.481,02	1.705.306,69
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	0,1%	4.671.583,80	4.541.596,51
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	0,6%	21.742.378,02	21.193.781,36
Morgan Stanley FIC FIA Global Brands Advisory IE	0,0%	- ▼	1.576.167,17
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	0,6%	21.981.942,70	21.130.700,59
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	0,1%	4.599.700,27	4.517.118,43
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	0,1%	3.008.893,68	2.992.148,05
Wellington Ventura FIC FIA Dólar Advisory IE	0,0%	- ▼	495.908,41
Western Asset FIA BDR Nível I	0,3%	11.106.500,64	10.806.926,25
Western Macro Opportunities Multimercado IE	0,2%	9.347.855,04	8.528.948,33

POR SEGMENTO

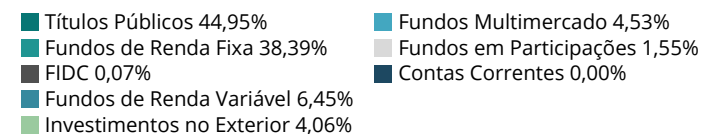


POR TIPO DE ATIVO

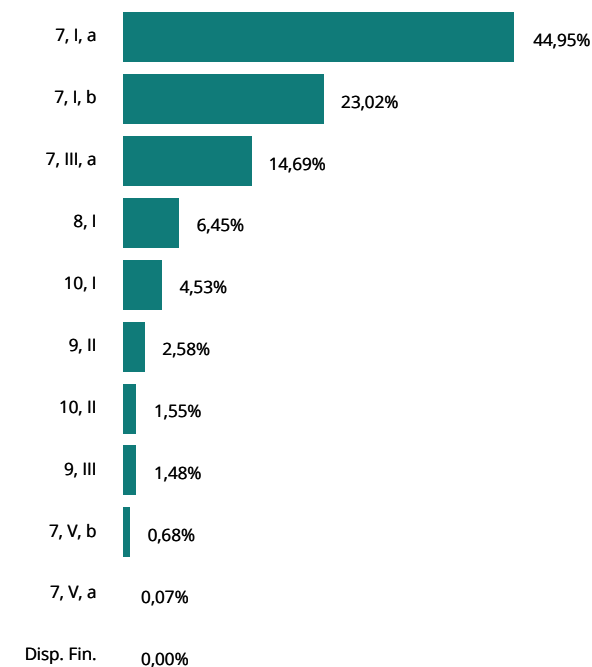


ATIVOS	%	DEZEMBRO	NOVEMBRO
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	4,1%	152.280.882,69	149.418.767,93
XP FIC FIA J China Equity Dolar Advisory IE	0,0%	- ▼	200.162,88
XP FIC FIM Nordea Alfa 10 Advisory	0,1%	4.045.688,82	4.090.057,97
XP FIC Moneda Latam Credit Advisory Mult. IE	0,1%	2.855.000,71	2.760.493,48
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	0,5%	18.530.530,33	17.814.363,07
FUNDOS MULTIMERCADO	4,5%	169.840.307,94	165.382.725,50
BB FIC Dinâmico Multimercado	0,0%	1.685.107,02	1.661.558,42
BB FIC Juros e Moedas Multimercado	0,7%	27.592.687,73	27.335.244,27
BB FIC Macro Multimercado	0,1%	1.931.638,87	1.896.432,35
Caixa Bolsa Americana Multimercado	1,0%	36.256.755,22	34.467.698,11
Itaú FIC Private Multimercado SP500	0,8%	28.910.456,67	27.488.919,15
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado	0,2%	6.629.649,53	6.537.508,60
Vinci Multiestratégia Multimercado	0,7%	26.294.417,86	26.036.274,14
Vinci Valorem Multimercado	1,1%	40.117.040,28	39.536.111,03
Western Long Short Multimercado	0,0%	422.554,76	422.979,43
FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES	1,5%	57.955.545,27	58.307.594,21
BTG FIP Economia Real II	0,0%	625.756,33	646.404,92
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II	0,0%	140.952,37	145.003,35
BTG Pactual FIC FIP Principal Investments	0,0%	73.565,62	73.807,38
FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia	0,1%	2.313.796,03	2.314.372,20
Kinea FIP Private Equity II	0,1%	2.014.741,02	2.007.351,82
Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.	1,2%	44.977.414,04	44.797.743,51
Kinea FIP Private Equity V Feeder Inst. I Mult.	0,1%	2.344.572,11	2.356.511,74
Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III	0,1%	5.464.747,75 ▼	5.966.399,29
CONTAS A PAGAR E A RECEBER	0,1%	2.294.586,00	-
A Pagar	0,1%	2.294.586,00	-
CONTAS CORRENTES	0,0%	15.017,73	10.917,92
Banco do Brasil	0,0%	10.096,63	10.000,39
BNP Paribas	0,0%	1.043,42	916,53
Bradesco	0,0%	3.877,68	-
Brasil Plural	0,0%	-	-
BRL	0,0%	-	-
BTG Pactual	0,0%	-	-

POR SEGMENTO



POR TIPO DE ATIVO



ATIVOS	%	DEZEMBRO	NOVEMBRO
CONTAS CORRENTES	0,0%	15.017,73	10.917,92
Caixa Econômica Federal	0,0%	-	-
Daycoval	0,0%	-	-
Itaú Unibanco	0,0%	-	-
Santander	0,0%	-	1,00
XP Investimentos	0,0%	-	-
TOTAL DA CARTEIRA	100,0%	3.750.863.655,40	3.679.694.811,75

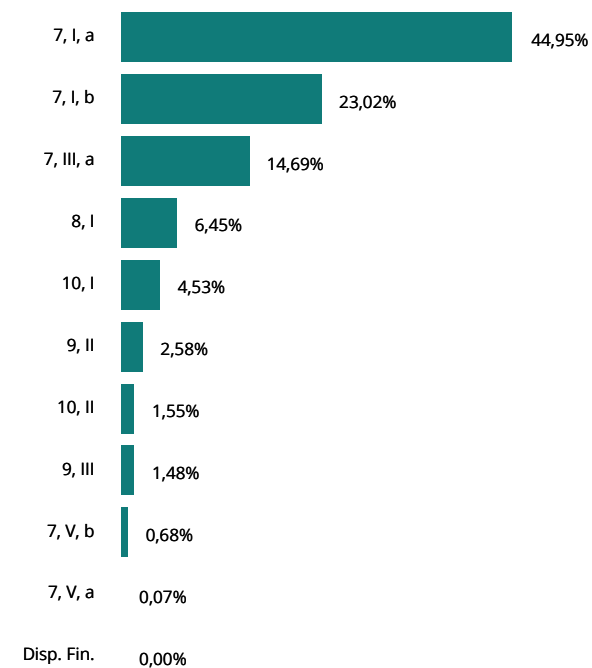
▲ Entrada de Recursos
▲ Nova Aplicação
▼ Saída de Recursos
▼ Resgate Total

POR SEGMENTO



■ Títulos Públicos 44,95%
■ Fundos Multimercado 4,53%
■ Fundos de Renda Fixa 38,39%
■ Fundos em Participações 1,55%
■ FIDC 0,07%
■ Contas Correntes 0,00%
■ Fundos de Renda Variável 6,45%
■ Investimentos no Exterior 4,06%

POR TIPO DE ATIVO



ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	49.707.244,50	4.173.983,80	(829.402,64)	(4.400.743,65)	(3.429.543,23)	13.648.407,62	12.473.252,26	71.343.198,66
LFT 01/03/2023 (Compra em 17/02/2021)	16.997,11	-	-	-	-	-	-	16.997,11
LFT 01/03/2023 (Compra em 17/11/2021)	5.311,59	-	-	-	-	-	-	5.311,59
LFT 01/03/2024 (Compra em 17/02/2023)	42.821,66	10.331,59	11.189,06	9.651,54	9.958,24	9.257,42	9.133,13	102.342,64
LFT 01/03/2024 (Compra em 21/11/2022)	57.450,13	10.044,59	10.878,26	9.383,44	9.681,62	9.000,27	8.879,43	115.317,74
LFT 01/03/2025 (Compra em 06/03/2023)	44.913,84	11.858,42	13.267,55	11.322,27	11.637,76	10.686,28	10.696,24	114.382,36
LFT 01/03/2025 (Compra em 18/05/2020)	46.250,78	7.905,61	8.845,03	7.548,18	7.758,51	7.124,18	7.130,83	92.563,12
LFT 01/03/2026 (Compra em 17/05/2023)	98.287,64	64.180,13	75.932,84	63.188,65	62.746,75	56.613,19	57.957,28	478.906,48
LFT 01/09/2024 (Compra em 06/12/2018)	3.286,05	571,31	624,34	536,75	552,62	513,80	508,01	6.592,88
LFT 01/09/2024 (Compra em 18/11/2019)	41.075,56	7.141,43	7.804,15	6.709,40	6.907,82	6.422,39	6.350,25	82.411,00
LFT 01/09/2025 (Compra em 16/05/2023)	89.684,50	56.753,24	63.708,91	54.091,59	55.435,51	49.768,43	51.052,66	420.494,84
LFT 01/09/2029 (Compra em 02/10/2023)	-	-	-	-	61.532,79	18.003,25	-	79.536,04
LTN 01/01/2024 (Compra em 07/07/2020) 459653	587.925,42	81.826,24	-	-	-	-	-	669.751,66
LTN 01/01/2024 (Compra em 13/12/2021)	58,79	10,17	11,01	9,31	9,50	9,02	8,94	116,74
LTN 01/01/2026 (Compra em 04/10/2022) 0000742A5	852.622,85	71.104,52	58.452,95	(2.284,44)	(8.269,82)	201.790,47	-	1.173.416,53
LTN 01/01/2026 (Compra em 25/07/2023) 000075647	-	14.768,67	89.140,75	(3.483,77)	(12.611,48)	354.853,60	77.816,45	520.484,22
LTN 01/01/2026 (Compra em 28/07/2023) 00007565E	-	7.451,11	46.762,36	(1.827,55)	(6.615,86)	186.152,71	99.219,64	331.142,41
LTN 01/07/2023 (Compra em 07/07/2020) 459654	1.530.314,95	12.794,70	-	-	-	-	-	1.543.109,65
LTN 01/07/2023 (Compra em 09/11/2021) 468950	61.212,60	511,79	-	-	-	-	-	61.724,39
LTN 01/07/2024 (Compra em 07/10/2022) 00007436D	625.056,69	78.667,16	-	-	-	-	-	703.723,85
NTN-B 15/05/2023 (Compra em 14/11/2016) 226229	713.922,56	-	-	-	-	-	-	713.922,56
NTN-B 15/05/2023 (Compra em 17/11/2021)	32.062,38	-	-	-	-	-	-	32.062,38
NTN-B 15/05/2023 (Compra em 19/05/2021)	196.221,83	-	-	-	-	-	-	196.221,83
NTN-B 15/05/2023 (Compra em 19/11/2021) 327501	213.749,27	-	-	-	-	-	-	213.749,27
NTN-B 15/05/2023 (Compra em 25/11/2021) 328083	85.499,71	-	-	-	-	-	-	85.499,71
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 14/06/2023) 005D3D3	106.088,49	140.354,01	132.191,89	94.900,31	1.171,75	191.701,70	199.775,84	866.183,99
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 17/05/2021) 312733	398.954,20	57.885,89	54.519,62	39.139,53	483,26	79.063,11	82.393,11	712.438,72
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 02/09/2022) 00565EE	1.863.797,04	178.175,57	89.975,79	(83.725,36)	(220.042,97)	545.349,36	362.266,18	2.735.795,61
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 05/10/2022) 00575E2	186.379,70	17.817,56	8.997,58	(8.372,54)	(22.004,29)	54.534,94	36.226,62	273.579,57
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 09/09/2022) 00569CA	1.863.797,04	178.175,57	89.975,79	(83.725,36)	(220.042,97)	545.349,36	362.266,18	2.735.795,61
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 17/08/2022) 352262	894.622,59	85.524,27	43.188,38	(40.188,18)	(105.620,62)	261.767,69	173.887,77	1.313.181,90
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 19/08/2022) 00560B1	335.483,47	32.071,60	16.195,64	(15.070,56)	(39.607,74)	98.162,88	65.207,92	492.443,21
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 26/09/2022) 0056FDF	372.759,42	35.635,11	17.995,16	(16.745,07)	(44.008,60)	109.069,88	72.453,24	547.159,14
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 02/01/2019)	39.072,96	1.123,71	(2.053,18)	(4.875,75)	(2.377,63)	8.144,98	9.696,01	48.731,10

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	49.707.244,50	4.173.983,80	(829.402,64)	(4.400.743,65)	(3.429.543,23)	13.648.407,62	12.473.252,26	71.343.198,66
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 03/06/2020)	558.185,12	16.052,89	(29.331,15)	(69.653,55)	(33.966,08)	116.356,81	138.514,38	696.158,42
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 07/07/2023) 005DD3D	-	147.538,61	(87.993,45)	(208.960,65)	(101.898,23)	349.070,44	415.543,13	513.299,85
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 10/05/2019)	580.512,53	16.695,00	(30.504,39)	(72.439,70)	(35.324,72)	121.011,09	144.054,95	724.004,76
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 11/01/2019)	154.617,27	4.446,65	(8.124,73)	(19.294,03)	(9.408,60)	32.230,84	38.368,48	192.835,88
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 13/05/2022) 343941	362.820,33	10.434,38	(19.065,25)	(45.274,80)	(22.077,95)	75.631,93	90.034,34	452.502,98
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 16/08/2019)	130.615,32	3.756,38	(6.863,49)	(16.298,93)	(7.948,06)	27.227,49	32.412,37	162.901,08
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 17/08/2022) 352264	474.457,35	13.644,96	(24.931,48)	(59.205,52)	(28.871,16)	98.903,29	117.737,22	591.734,66
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 18/02/2020)	150.709,98	4.334,28	(7.919,41)	(18.806,46)	(9.170,84)	31.416,34	37.398,88	187.962,77
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 21/11/2018)	558.185,12	16.052,89	(29.331,15)	(69.653,55)	(33.966,08)	116.356,81	138.514,38	696.158,42
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 25/07/2023) 005E442	-	106.255,57	(196.518,69)	(466.678,80)	(227.572,71)	779.590,65	928.046,32	923.122,34
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/10/2017)	1.227.449,09	35.300,28	(64.499,18)	(153.168,17)	(74.691,39)	255.868,63	304.593,11	1.530.852,37
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 04/10/2022) 0057548	2.783.441,12	218.392,24	(314.286,40)	(389.661,51)	(145.859,35)	669.764,48	760.610,55	3.582.401,13
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/07/2022) 349638	92.781,38	7.279,74	(10.476,21)	(12.988,72)	(4.861,98)	22.325,48	25.353,69	119.413,38
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/11/2022) 00587CF	463.906,85	36.398,71	(52.381,07)	(64.943,58)	(24.309,89)	111.627,40	126.768,43	597.066,85
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/05/2022) 344518	216.489,86	16.986,07	(24.444,50)	(30.307,01)	(11.344,61)	52.092,78	59.158,60	278.631,19
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/08/2022) 00560AF	556.688,22	43.678,45	(62.857,28)	(77.932,30)	(29.171,87)	133.952,90	152.122,11	716.480,23
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 28/03/2022) 339279	525.761,10	41.251,87	(59.365,21)	(73.602,73)	(27.551,21)	126.511,07	143.670,88	676.675,77
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 16/08/2021)	117.162,13	6.261,29	(16.271,13)	(19.028,62)	(8.468,08)	30.169,90	37.619,81	147.445,30
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 17/12/2019)	64.783,76	3.462,12	(8.996,98)	(10.521,71)	(4.682,34)	16.682,17	20.801,53	81.528,55
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 01/02/2022) 334348	791.044,16	156.557,50	134.353,47	160.915,79	66.064,04	117.707,17	138.854,43	1.565.496,56
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 04/01/2022)	69.611,88	13.777,06	11.823,11	14.160,59	5.813,63	10.358,24	12.219,19	137.763,70
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/01/2023) 0059FF9	1.007.905,59	191.511,96	-	-	-	-	-	1.199.417,55
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/05/2019)	32.997,84	6.530,68	5.604,45	6.712,49	2.755,82	4.910,07	5.792,21	65.303,56
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 19/01/2023) 005A163	391.182,48	76.604,79	-	-	-	-	-	467.787,27
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 20/01/2022) 333549	836.246,68	164.860,81	129.717,52	50.573,54	20.762,98	36.993,68	43.639,97	1.282.795,18
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 22/02/2022)	48.140,69	9.527,64	8.176,36	9.792,88	4.020,47	7.163,32	8.450,28	95.271,64
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 03/07/2018)	27.959,53	3.251,83	2.405,60	(1.032,37)	(2.370,56)	7.844,68	5.370,05	43.428,76
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 07/03/2022) 336701	293.402,37	34.124,19	25.244,21	(10.833,71)	(24.876,21)	82.320,75	56.352,22	455.733,82
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 09/08/2017) 244294	345.179,27	40.146,10	29.699,08	(12.745,54)	(29.266,13)	96.847,94	66.296,73	536.157,45
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 10/03/2022) 337480	300.305,97	34.927,11	25.838,19	(11.088,62)	(25.461,53)	84.257,71	57.678,15	466.456,98
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 13/07/2022) 349261	258.884,46	30.109,57	22.274,31	(9.559,16)	(21.949,59)	72.635,95	49.722,55	402.118,09
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/07/2022) 349480	258.884,46	30.109,57	22.274,31	(9.559,16)	(21.949,59)	72.635,95	49.722,55	402.118,09
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/12/2022) 00593A4	293.402,38	34.124,19	25.244,20	(10.833,71)	(24.876,21)	82.320,75	56.352,22	455.733,82

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	49.707.244,50	4.173.983,80	(829.402,64)	(4.400.743,65)	(3.429.543,23)	13.648.407,62	12.473.252,26	71.343.198,66
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/05/2023)	62.038,36	56.806,73	42.024,19	(18.034,93)	(41.411,58)	137.039,84	93.809,86	332.272,47
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/09/2021) 321107	690.358,55	80.292,20	59.398,16	(25.491,08)	(58.532,26)	193.695,88	132.593,45	1.072.314,90
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2021) 318118	345.179,27	40.146,10	29.699,08	(12.745,54)	(29.266,13)	96.847,94	66.296,73	536.157,45
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2023) 005ECDD	-	-	(12.781,71)	(9.304,25)	(21.364,27)	70.698,99	48.396,61	75.645,37
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/02/2018)	62.132,27	7.226,29	5.345,84	(2.294,20)	(5.267,90)	17.432,63	11.933,40	96.508,33
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/03/2018)	15.187,89	1.766,43	1.306,77	(560,81)	(1.287,71)	4.261,31	2.917,06	23.590,94
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 22/11/2022) 0058918	345.179,27	40.146,10	29.699,08	(12.745,54)	(29.266,13)	96.847,94	66.296,73	536.157,45
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2021) 325234	34.517,93	4.014,61	2.969,89	(1.274,55)	(2.926,61)	9.684,79	6.629,67	53.615,73
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 29/06/2021)	37.969,71	4.416,08	3.266,90	(1.402,01)	(3.219,28)	10.653,28	7.292,64	58.977,32
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 30/11/2022) 0058C49	345.179,27	40.146,10	29.699,08	(12.745,54)	(29.266,13)	96.847,94	66.296,73	536.157,45
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/09/2021) 320543	512.352,18	43.127,48	1.538,16	(37.713,56)	(36.340,74)	127.737,65	103.718,38	714.419,55
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323671	192.132,06	16.172,81	576,80	(14.142,59)	(13.627,78)	47.901,62	38.894,39	267.907,31
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323677	853.920,31	71.879,13	2.563,62	(62.855,93)	(60.567,91)	212.896,09	172.863,96	1.190.699,27
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/02/2019)	122.110,60	10.278,71	366,61	(8.988,40)	(8.661,21)	30.444,14	24.719,56	170.270,01
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2022)	91.690,06	7.691,06	274,31	(6.725,59)	(6.480,77)	22.779,89	18.496,44	127.725,40
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2023)	-	-	(23.522,25)	(10.654,09)	(10.266,26)	36.085,89	29.300,44	20.943,73
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 17/05/2018)	853.920,30	71.879,15	2.563,59	(62.855,93)	(60.567,91)	212.896,09	172.863,95	1.190.699,24
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 19/03/2018)	512.352,19	43.127,48	1.538,15	(37.713,56)	(36.340,74)	127.737,65	103.718,37	714.419,54
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 21/10/2021) 324819	853.920,31	71.879,13	2.563,62	(62.855,93)	(60.567,91)	212.896,09	172.863,96	1.190.699,27
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/08/2023) 005EFE6	-	-	(88.010,58)	(75.427,13)	(72.681,49)	255.475,31	207.436,75	226.792,86
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/10/2021) 325075	85.392,03	7.187,91	256,34	(6.285,60)	(6.056,79)	21.289,61	17.286,40	119.069,90
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 05/07/2023)	-	65.533,02	(30.405,04)	(153.288,55)	(103.938,05)	339.403,02	298.567,52	415.871,92
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 08/11/2018) 265743	946.590,10	64.819,03	(20.704,82)	(104.384,44)	(70.778,37)	231.122,24	203.314,62	1.249.978,36
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 16/02/2022) 335567	709.942,58	48.614,27	(15.528,61)	(78.288,34)	(53.083,78)	173.341,69	152.485,96	937.483,77
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 20/07/2022) 349906	402.300,79	27.548,09	(8.799,57)	(44.363,39)	(30.080,81)	98.226,95	86.408,72	531.240,78
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 24/03/2022) 338960	780.936,84	53.475,70	(17.081,48)	(86.117,17)	(58.392,16)	190.675,85	167.734,56	1.031.232,14
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/09/2022) 0056DF3	2.078.611,16	65.485,48	(57.648,72)	(195.173,94)	(180.313,11)	459.060,59	442.068,20	2.612.089,66
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 26/08/2022) 00562E2	2.598.263,96	81.856,85	(72.060,83)	(243.967,42)	(225.391,39)	573.825,74	552.585,25	3.265.112,16
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 30/08/2022) 00563E2	2.598.263,96	81.856,85	(72.060,83)	(243.967,42)	(225.391,39)	573.825,74	552.585,25	3.265.112,16
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 25/03/2022) 339157	451.445,37	25.228,09	(28.503,24)	(73.964,10)	(30.276,62)	100.489,79	141.189,44	585.608,73
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 04/06/2021) 313399	133.743,62	6.085,61	(16.620,56)	(18.591,50)	(10.614,52)	33.555,87	42.495,00	170.053,52
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 05/10/2022) 00575E0	434.666,77	19.778,24	(54.016,76)	(60.422,38)	(34.497,19)	109.056,57	138.108,76	552.674,01
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 15/06/2018) 260982	3.744.821,50	170.397,10	(465.374,87)	(520.562,03)	(297.206,54)	939.564,30	1.189.860,01	4.761.499,47

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	49.707.244,50	4.173.983,80	(829.402,64)	(4.400.743,65)	(3.429.543,23)	13.648.407,62	12.473.252,26	71.343.198,66
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) i	78.908,75	3.590,51	(9.806,11)	(10.968,99)	(6.262,56)	19.797,96	25.072,05	100.331,61
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) ii	1.203.692,61	54.770,50	(149.584,80)	(167.323,51)	(95.530,67)	302.002,81	382.455,01	1.530.481,95
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) i	16.717,95	760,70	(2.077,56)	(2.323,94)	(1.326,82)	4.194,49	5.311,87	21.256,69
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) ii	668.718,13	30.428,05	(83.102,67)	(92.957,50)	(53.072,60)	167.779,34	212.475,00	850.267,75
NTN-F 01/01/2027 (Compra em 17/08/2023) 0046601	-	-	2.895,03	(10.699,77)	(1.442,53)	110.661,83	51.367,49	152.782,05
NTN-F 01/01/2031 (Compra em 05/10/2022) 003FA75	1.464.692,74	18.502,86	(46.354,39)	(144.827,57)	(12.172,73)	533.546,65	309.842,63	2.123.230,19
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	60.082.844,18	5.315.519,31	8.202.754,50	7.719.564,90	8.100.249,86	8.106.417,50	11.723.560,79	109.250.911,04
NTN-B XP 2028-08 (Compra 14/07/22 Tx 6.1310)	3.121.423,38	257.575,27	391.877,58	366.063,35	377.440,05	367.915,08	472.462,06	5.354.756,77
NTN-B XP 2028-08 (Compra 19/07/22 Tx 6.2780)	944.599,05	79.154,91	119.639,93	111.624,15	115.150,31	112.231,95	143.897,07	1.626.297,37
NTN-B XP 2030-08 (Compra 01/11/23 Tx 5.8570)	-	-	-	-	-	197.421,05	277.965,75	475.386,80
NTN-B XP 2030-08 (Compra 09/10/23 Tx 5.8465)	-	-	-	-	145.434,49	209.311,60	279.712,78	634.458,87
NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/11/22 Tx 6.0750)	1.709.974,13	140.243,10	213.908,95	199.904,59	206.078,07	200.879,66	267.880,97	2.938.869,47
NTN-B XP 2030-08 (Compra 23/05/23 Tx 5.5625)	126.659,71	91.612,91	143.309,83	134.541,56	138.425,24	135.038,25	180.935,50	950.523,00
NTN-B XP 2030-08 (Compra 24/11/22 Tx 6.2550)	1.274.021,18	106.601,86	161.288,45	150.486,78	155.239,38	151.306,45	201.425,11	2.200.369,21
NTN-B XP 2032-08 (Compra 21/07/22 Tx 6.2610)	1.891.106,83	157.875,93	238.775,23	222.795,85	229.796,84	223.984,47	307.919,27	3.272.254,42
NTN-B XP 2035-05 (Compra 05/04/23 Tx 6.0750)	702.232,73	147.833,67	229.152,12	217.000,60	223.658,42	214.704,61	295.232,19	2.029.814,34
NTN-B XP 2035-05 (Compra 06/03/23 Tx 6.4290)	1.081.515,17	146.793,25	224.106,79	211.651,57	218.448,48	209.513,28	287.206,98	2.379.235,52
NTN-B XP 2035-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.4200)	60.606,24	4.612,60	7.384,87	7.032,11	7.230,57	6.950,63	9.617,55	103.434,57
NTN-B XP 2035-05 (Compra 15/05/23 Tx 5.6650)	7.912,34	4.064,69	6.423,78	6.102,37	6.281,66	6.034,93	8.330,70	45.150,47
NTN-B XP 2035-05 (Compra 18/11/22 Tx 6.2000)	972.038,36	79.378,68	122.373,78	115.764,25	119.382,18	114.559,46	157.359,14	1.680.855,85
NTN-B XP 2035-05 (Compra 20/04/23 Tx 6.0550)	544.477,12	146.643,78	227.496,12	215.406,67	222.045,70	213.180,42	293.143,65	1.862.393,46
NTN-B XP 2035-05 (Compra 27/02/23 Tx 6.3150)	628.358,31	78.085,59	119.768,00	113.197,73	116.784,32	112.052,70	153.735,28	1.321.981,93
NTN-B XP 2040-08 (Compra 14/06/22 Tx 5.7600)	3.122.912,64	245.015,09	379.394,39	355.660,64	366.175,78	357.118,01	516.006,50	5.342.283,05
NTN-B XP 2040-08 (Compra 15/12/22 Tx 6.3520)	3.163.882,09	268.748,82	404.764,04	377.341,43	389.351,20	379.467,14	545.562,91	5.529.117,63
NTN-B XP 2040-08 (Compra 17/05/22 Tx 5.6700)	314.131,62	24.331,91	37.853,26	35.518,21	36.550,20	35.654,76	51.556,87	535.596,83
NTN-B XP 2040-08 (Compra 30/01/23 Tx 6.4500)	1.773.733,20	187.801,14	281.713,92	262.380,98	270.793,83	263.924,21	379.100,13	3.419.447,41
NTN-B XP 2045-05 (Compra 04/05/22 Tx 5.8250)	6.188.568,87	489.454,06	767.686,33	728.268,36	750.005,69	720.443,52	1.059.302,91	10.703.729,74
NTN-B XP 2045-05 (Compra 06/07/22 Tx 6.1150)	1.587.956,82	128.787,19	199.230,90	188.571,87	194.435,95	186.606,71	273.449,90	2.759.039,34
NTN-B XP 2045-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.5600)	614.986,09	47.472,23	75.435,11	71.736,65	73.810,82	70.942,86	104.648,08	1.059.031,84
NTN-B XP 2045-05 (Compra 13/04/22 Tx 5.7400)	6.207.590,27	487.268,91	767.264,97	728.414,32	749.967,60	720.614,49	1.060.694,07	10.721.814,63
NTN-B XP 2045-05 (Compra 16/05/23 Tx 5.8255)	120.377,91	65.306,21	102.393,84	97.148,61	100.048,41	96.104,82	141.320,91	722.700,71
NTN-B XP 2045-05 (Compra 24/11/22 Tx 6.2900)	1.953.836,05	160.714,09	246.765,65	233.304,39	240.616,92	230.884,25	337.565,42	3.403.686,77
NTN-B XP 2050-08 (Compra 09/05/22 Tx 5.8420)	3.131.766,96	252.069,38	388.705,38	364.098,41	374.981,37	365.667,27	557.645,91	5.434.934,68

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	60.082.844,18	5.315.519,31	8.202.754,50	7.719.564,90	8.100.249,86	8.106.417,50	11.723.560,79	109.250.911,04
NTN-B XP 2050-08 (Compra 11/05/22 Tx 5.8810)	3.129.409,41	253.291,97	389.998,61	365.084,20	376.075,90	366.728,03	558.906,14	5.439.494,26
NTN-B XP 2050-08 (Compra 24/06/22 Tx 5.9201)	3.081.035,20	250.881,13	385.399,80	360.747,70	371.635,39	362.340,87	552.044,80	5.364.084,89
NTN-B XP 2050-08 (Compra 26/04/22 Tx 5.7950)	3.150.875,46	251.809,74	389.253,84	364.757,79	375.627,14	366.254,70	558.954,90	5.457.533,57
NTN-B XP 2050-08 (Compra 29/04/22 Tx 5.8200)	3.143.985,34	252.171,19	389.378,15	364.773,61	375.661,51	366.385,28	558.779,06	5.451.134,14
NTN-B XP 2055-05 (Compra 28/06/22 Tx 6.0310)	6.332.871,70	509.920,01	792.010,88	750.186,15	773.116,44	742.196,04	1.131.198,28	11.031.499,50
FUNDOS DE RENDA FIXA	110.366.530,26	13.906.736,98	721.586,68	(5.730.359,00)	(1.537.558,45)	28.316.656,24	29.510.675,90	175.554.268,61
BB FIC Curto Prazo Automático	50,91	-	-	-	-	-	-	50,91
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	7.381.126,68	1.169.921,66	1.275.692,75	1.102.070,81	1.220.347,44	1.115.864,03	1.240.673,11	14.505.696,48
BB FIC Previdenciário Fluxo	3.012.736,31	245.131,01	242.830,63	222.822,24	183.465,57	195.203,11	292.279,05	4.394.467,92
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	11.982.034,44	525.201,74	252.286,66	48.555,48	(140.390,71)	764.684,82	629.190,20	14.061.562,63
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	29.637.407,24	2.203.919,33	(1.277.374,73)	(3.146.168,75)	(1.716.411,81)	5.947.000,95	6.350.959,87	37.999.332,10
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	9.522.221,28	2.681.426,66	(2.484.074,50)	(3.725.157,29)	(1.845.435,56)	6.244.756,53	7.515.648,82	17.909.385,94
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA	969.336,15	-	-	-	-	-	-	969.336,15
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	151.071,43	29.931,00	25.578,61	30.785,31	12.363,25	22.382,25	26.480,09	298.591,94
Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa	4.440.637,87	756.737,42	821.786,77	622.136,80	546.490,72	513.260,78	521.320,64	8.222.371,00
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA Geral	1.868.220,10	213.334,04	106.955,71	18.128,42	(14.512,70)	443.771,70	365.148,28	3.001.045,55
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B	2.712.870,22	209.786,73	(103.885,02)	(300.086,26)	(146.146,48)	646.154,34	725.030,89	3.743.724,42
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5	1.695.746,25	296.323,82	182.649,74	31.883,04	(104.264,75)	563.672,58	463.116,96	3.129.127,64
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5+	1.943.528,76	103.874,60	(193.848,45)	(291.397,61)	(146.375,30)	486.101,62	584.215,51	2.486.099,13
Bradesco FIC Performance Inst. Crédito Privado	-	-	-	97.174,01	205.123,94	188.800,63	172.225,57	663.324,15
Bradesco Institucional Renda Fixa IRF-M	522.551,05	52.659,65	44.661,09	9.940,60	21.862,46	148.488,40	90.875,36	891.038,61
Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa	658,99	114,12	126,40	107,87	109,65	99,88	100,06	1.316,97
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	3.875.564,31	1.022.653,40	1.099.410,53	1.024.454,37	1.391.707,61	1.242.252,32	1.164.640,94	10.820.683,48
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	440.049,00	77.277,00	63.894,00	5.124,00	(21.465,00)	131.802,00	100.635,00	797.316,00
Caixa Brasil Referenciado	49.248,18	12.551,80	13.764,14	11.558,53	11.571,19	11.111,27	10.726,62	120.531,73
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	1.939.283,16	384.428,80	329.474,86	396.805,00	159.312,20	288.525,40	341.268,60	3.839.098,02
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	3.962.081,65	314.184,62	(146.510,59)	(376.771,67)	(259.077,81)	1.010.212,85	1.083.591,29	5.587.710,34
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	3.947.217,05	230.297,35	(415.695,25)	(594.817,79)	(301.889,64)	1.047.146,86	1.263.109,84	5.175.368,42
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	3.922,91	346,02	1.674,50	144,32	977,23	319,25	114,36	7.498,59
Icatu Vanguarda Inflação Crédito Privado	511.073,13	-	-	-	-	-	-	511.073,13
Itaú FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa	3.622.159,44	349.016,49	145.195,33	(117.758,21)	(81.622,82)	1.017.903,93	647.012,66	5.581.906,82
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	471.959,54	200.954,16	134.586,90	86.522,87	145.878,82	254.859,44	239.206,32	1.533.968,05
Itaú FIC IMA-B 5+	-	729.708,53	(694.043,13)	(1.034.169,33)	(519.677,44)	1.749.621,89	2.102.236,50	2.333.677,02

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
FUNDOS DE RENDA FIXA	110.366.530,26	13.906.736,98	721.586,68	(5.730.359,00)	(1.537.558,45)	28.316.656,24	29.510.675,90	175.554.268,61
Itaú FIC Institucional IMA-B	-	-	(83.607,05)	(157.540,35)	(109.194,57)	420.088,54	452.263,85	522.010,42
Itaú FIC Institucional IMA-B 5	3.457.091,75	179.861,64	-	-	-	-	-	3.636.953,39
Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa	117.895,89	161.418,74	161.272,87	117.583,13	126.154,89	119.076,91	155.210,20	958.612,63
Trend Cash FIC Simples	5,64	6.368,75	8,27	16,56	16,67	3.447,87	6.968,94	16.832,70
Vinci Institucional Referenciado	-	-	-	-	-	1.345,60	9.077,16	10.422,76
Western Asset Ativo IMA-B	3.336.259,58	198.292,21	(114.246,05)	(344.023,33)	(278.025,39)	822.950,95	728.906,98	4.350.114,95
Western Asset Ativo IMA-B 5	2.355.385,10	564.439,53	301.507,40	(208.300,06)	(516.737,72)	1.623.376,22	1.000.345,01	5.120.015,48
Western Asset Renda Fixa	1.598.183,61	-	-	-	-	-	-	1.598.183,61
Western Asset Soberano II Referenciado Selic	1.491.009,26	465.571,33	539.117,77	473.658,35	368.771,37	239.081,27	249.781,05	3.826.990,40
Western Ativo Max	635.287,68	82.648,33	86.241,51	3.503,38	(13.225,04)	207.179,08	97.631,92	1.099.266,86
Western Max Referenciado DI Renda Fixa	-	-	-	-	36.939,55	194.366,97	239.184,92	470.491,44
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	69.154,24	3.410,09	3.805,28	3.274,78	3.235,58	65.555,30	70.438,47	218.873,74
XP Inflação Referenciado IPCA	724.054,89	102.813,27	30.560,18	(60.078,77)	(68.873,88)	293.638,23	269.436,48	1.291.550,40
XP Trend Simples	1.919.446,57	332.133,14	371.789,55	319.660,55	311.440,03	292.552,47	301.624,38	3.848.646,69
FIDC	(143.770,29)	14.249,28	4.999,17	326.753,12	1.960.802,56	183.941,89	61.854,89	2.408.830,62
BRPP FIDC Multisetorial Master	(2.237,93)	5.968,32	2.095,37	224.198,70	8.930,57	(2.585,73)	2.813,34	239.182,64
Vila Rica FIDC Multisetorial Itália	(141.532,36)	8.280,96	2.903,80	102.554,42	1.951.871,99	186.527,62	59.041,55	2.169.647,98
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	16.475.597,23	8.065.982,54	(13.494.802,62)	1.420.719,64	(8.193.007,11)	24.440.264,06	13.266.753,42	41.981.507,16
BB FIA Energia	(375.854,10)	-	-	-	-	-	-	(375.854,10)
BB FIA Governança	164.255,04	92.580,98	(144.502,14)	23.771,05	(96.093,13)	311.564,63	158.640,14	510.216,57
BB FIC FIA Bolsa Brasileira	515.115,87	624.333,70	(1.046.729,66)	119.368,20	(611.014,02)	1.118.149,22	167.648,50	886.871,81
BB FIC FIA Dividendos	3.270.468,19	1.080.296,68	(1.690.990,55)	442.631,64	(1.396.786,10)	5.065.045,02	3.361.098,66	10.131.763,54
BB FIC FIA Seleção Fatorial	297.012,36	197.885,90	(268.376,08)	28.103,03	(174.234,32)	668.924,90	339.139,63	1.088.455,42
Bradesco FIA Dividendos	1.350.429,66	699.662,70	(1.113.164,45)	423.101,52	-	-	-	1.360.029,43
Bradesco FIA MID Small Cap	13.721,80	96.840,83	(351.969,19)	(75.981,77)	(229.686,03)	357.997,32	180.056,82	(9.020,22)
Bradesco FIA Plus Ibovespa	746.803,21	336.407,60	(544.341,22)	264.866,62	-	-	-	803.736,21
Bradesco FIA Selection	89.505,06	44.744,16	(110.010,33)	(27.167,93)	(272.416,70)	747.347,79	474.031,10	946.033,15
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBRX	1.659.884,53	854.905,06	(1.640.942,70)	82.185,81	(933.794,28)	2.565.066,03	1.272.898,72	3.860.203,17
Caixa FIC FIA Valor Vinci Exp. Dividendos RPPS	1.095.130,81	327.039,42	(422.387,27)	63.748,83	(358.200,09)	1.116.429,20	747.633,04	2.569.393,94
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	840.468,21	423.590,48	(649.141,28)	8.948,81	(471.530,00)	1.430.567,94	759.644,45	2.342.548,61
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	4.538.242,65	1.899.117,39	(2.976.304,17)	38.194,71	(2.022.170,93)	6.066.292,35	3.160.039,36	10.703.411,36
Occam FIC FIA	468.404,07	306.731,60	(637.091,32)	81.779,54	(248.312,09)	1.091.817,25	554.524,24	1.617.853,29

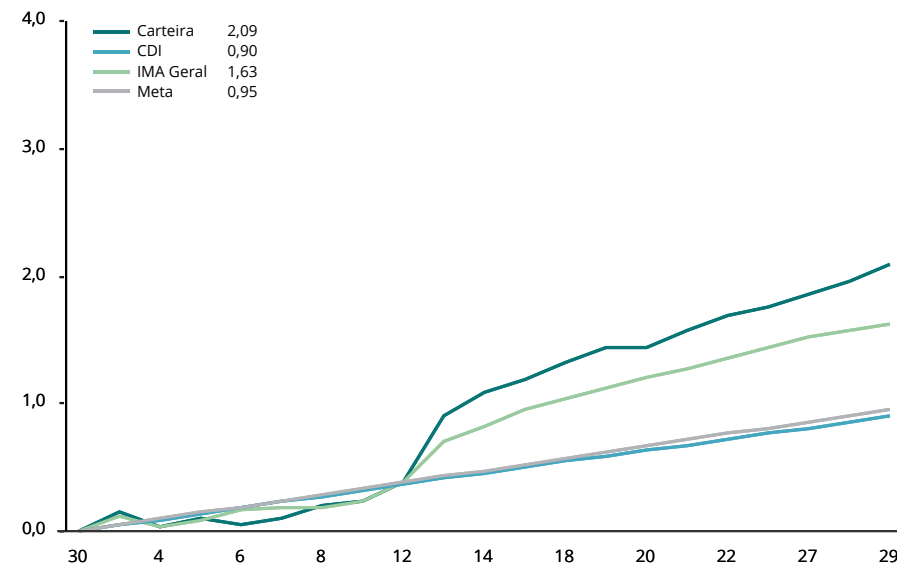
ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	16.475.597,23	8.065.982,54	(13.494.802,62)	1.420.719,64	(8.193.007,11)	24.440.264,06	13.266.753,42	41.981.507,16
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	78.332,59	52.130,26	(109.736,13)	(20.475,34)	(70.553,54)	159.691,96	72.027,66	161.417,46
Vinci FIA Fatorial Dinâmico	423.748,73	232.114,60	(320.040,87)	20.562,37	(234.996,40)	749.434,73	372.891,16	1.243.714,32
Vinci FIA Gas Dividendos	178.978,42	80.750,51	(115.623,64)	2.119,36	(78.867,97)	290.322,20	155.423,97	513.102,85
Vinci FIA Selection Equities	1.152.048,57	590.375,71	(1.043.927,96)	(54.578,62)	(804.082,00)	2.100.469,18	1.194.395,21	3.134.700,09
Western Asset FIA Valuation	(45.090,29)	57.052,72	(187.872,64)	(21.769,88)	(113.970,69)	327.959,62	158.909,15	175.217,99
Western Asset FIC FIA Alpha IBrX	(17.828,32)	67.150,10	(109.435,63)	14.885,07	(65.403,96)	239.816,28	122.083,81	251.267,35
XP FIC FIA Investor 30	31.820,17	2.272,14	(12.215,39)	6.426,62	(10.894,86)	33.368,44	15.667,80	66.444,92
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	8.372.612,38	2.697.393,12	3.027.629,29	(4.322.357,26)	(3.037.969,88)	9.204.443,70	5.156.700,76	21.098.452,11
BB FIA ESG BDR Nível I	1.167.564,25	360.283,48	472.615,63	(564.815,77)	(262.209,09)	1.000.434,22	526.734,33	2.700.607,05
BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior	914.381,81	450.161,33	574.076,03	(593.298,70)	(776.562,07)	1.567.262,16	951.592,70	3.087.613,26
BB Schroder Multimercado IE	63.268,67	64.603,03	97.299,55	(70.102,20)	(85.474,65)	203.572,01	91.911,89	365.078,30
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	46.959,04	26.865,72	30.103,27	(51.553,31)	(39.606,16)	98.922,26	50.174,33	161.865,15
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	324.310,69	69.592,74	143.974,54	(153.491,09)	(61.162,14)	251.555,55	129.987,29	704.767,58
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	2.528.914,37	421.753,08	591.063,92	(748.814,66)	(282.596,78)	1.278.655,99	548.596,66	4.337.572,58
Morgan Stanley FIC FIA Global Brands Advisory IE	16.086,49	2.689,75	67.728,76	(64.408,51)	(39.158,59)	80.025,70	20.219,71	83.183,31
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	205.289,90	360.695,92	432.942,03	(588.491,05)	(675.155,07)	1.295.831,11	851.242,11	1.882.354,95
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	(264.431,60)	(78.888,93)	(45.553,92)	266.703,38	110.301,51	(289.254,01)	82.581,84	(218.541,73)
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	(130.806,32)	(31.964,17)	129.121,81	2.315,36	(5.440,32)	21.765,92	16.745,63	1.737,91
Wellington Ventura FIC FIA Dólar Advisory IE	7.968,42	8.345,04	11.224,89	(7.129,19)	(12.467,98)	31.318,78	13.953,12	53.213,08
Western Asset FIA BDR Nível I	153.057,60	58.841,38	323.907,64	(524.894,44)	18.900,75	877.113,32	299.574,39	1.206.500,64
Western Macro Opportunities Multimercado IE	279.753,38	297.978,68	(151.341,60)	(532.412,01)	(263.407,01)	748.376,89	818.906,71	1.197.855,04
XP FIC FIA J China Equity Dolar Advisory IE	(38.015,61)	5.579,05	(4.574,26)	(4.999,29)	(12.926,90)	(8.410,41)	(11.825,29)	(75.172,71)
XP FIC FIA Wellington Ventura 30 Dolar Advisory IE	(3.526,67)	-	-	-	-	-	-	(3.526,67)
XP FIC FIM Nordea Alfa 10 Advisory	71.632,76	15.927,97	122.528,83	(38.117,68)	50.608,91	(33.889,33)	(44.369,15)	144.322,31
XP FIC Moeda Latam Credit Advisory Mult. IE	113.584,34	81.417,22	4.710,67	(1.908,54)	(34.886,60)	107.292,21	94.507,23	364.716,53
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	2.916.620,86	583.511,83	227.801,50	(646.939,56)	(666.727,69)	1.973.871,33	716.167,26	5.104.305,53
FUNDOS MULTIMERCADO	16.805.938,62	3.184.226,36	(32.511,90)	(2.501.846,16)	(621.806,82)	6.509.840,31	4.457.582,44	27.801.422,85
BB FIC Dinâmico Multimercado	71.798,76	43.825,32	(38.515,24)	(71.080,98)	(96.282,15)	8.549,10	23.548,60	(58.156,59)
BB FIC Juros e Moedas Multimercado	1.558.297,03	263.818,22	252.503,05	208.199,77	204.377,12	374.241,49	257.443,46	3.118.880,14
BB FIC Macro Multimercado	91.929,63	18.182,29	(2.683,79)	(984,81)	(14.510,54)	56.841,56	35.206,52	183.980,86
Caixa Bolsa Americana Multimercado	5.489.949,07	1.190.578,94	(310.762,05)	(1.497.462,15)	(568.495,72)	2.947.784,07	1.789.057,11	9.040.649,27
Itaú FIC Private Multimercado SP500	5.141.428,22	948.889,23	(255.612,52)	(1.189.446,26)	(447.154,72)	2.346.435,23	1.421.537,52	7.966.076,70

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
FUNDOS MULTIMERCADO	16.805.938,62	3.184.226,36	(32.511,90)	(2.501.846,16)	(621.806,82)	6.509.840,31	4.457.582,44	27.801.422,85
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado	209.088,06	99.855,34	(28.363,19)	85.953,42	1.279,07	172.360,20	92.140,93	632.313,83
Vinci Multiestratégia Multimercado	1.489.276,06	211.367,05	148.841,08	151.786,62	186.519,39	277.911,14	258.143,72	2.723.845,06
Vinci Valorem Multimercado	1.999.654,07	400.655,18	198.189,48	(192.327,91)	113.431,24	323.484,06	580.929,25	3.424.015,37
Western Long Short Multimercado	38.276,28	7.054,79	3.891,28	3.516,14	(970,51)	2.233,46	(424,67)	53.576,77
Western Multimercado US 500	716.241,44	-	-	-	-	-	-	716.241,44
FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES	(1.165.850,38)	(121.055,73)	261.255,68	23.061,67	(67.469,34)	413.265,41	349.184,35	(307.608,34)
BTG FIP Economia Real II	(33.964,54)	(10.830,34)	(16.905,02)	(13.972,48)	(14.677,98)	(14.001,53)	(20.648,59)	(125.000,48)
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II	(28.815,78)	(3.681,54)	(3.966,02)	(3.522,45)	(3.651,81)	(3.626,04)	(4.050,98)	(51.314,62)
BTG Pactual FIC FIP Principal Investments	88.360,00	(94,06)	(187,41)	(211,15)	3.351,74	1.316,55	(241,76)	92.293,91
FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia	813.724,81	(863,36)	(535,48)	(676,75)	(563,44)	(828,73)	(576,17)	809.680,88
Kinea FIP Private Equity II	109.145,52	(129.322,82)	18.620,31	18.516,50	14.894,84	4.536,65	7.389,20	43.780,20
Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.	(1.982.107,77)	79.675,36	289.129,42	(57.161,18)	(155.774,36)	441.867,61	179.670,53	(1.204.700,39)
Kinea FIP Private Equity V Feeder Inst. I Mult.	(228.043,58)	(15.984,89)	(12.980,61)	(20.109,91)	(16.681,44)	(16.111,37)	(11.939,63)	(321.851,43)
Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III	94.553,53	(8.698,23)	(11.524,18)	100.199,09	105.633,11	112,27	199.581,75	479.857,34
Pátria FIC FIP Special Opportunities I	1.297,43	(31.255,85)	(395,33)	-	-	-	-	(30.353,75)
TOTAL	260.501.146,50	37.237.035,66	(2.138.491,84)	(7.465.206,74)	(6.826.302,41)	90.823.236,73	76.999.564,81	449.130.982,71

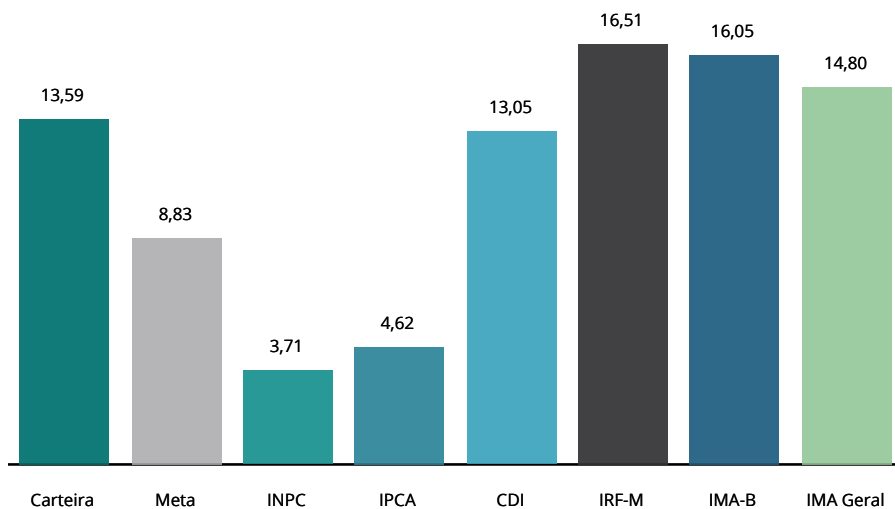
RENTABILIDADE DA CARTEIRA, INDICADORES E META ATUARIAL (INPC + 4,94% A.A.)

MÊS	CARTEIRA	META	CDI	IMA-G	% META	% CDI	% IMA-G
Janeiro	0,98	0,86	1,12	0,70	113	87	140
Fevereiro	0,40	1,18	0,92	1,03	34	43	38
Março	1,41	1,05	1,17	1,86	135	120	76
Abril	1,28	0,93	0,92	1,25	136	139	102
Mai	1,73	0,76	1,12	1,77	226	154	98
Junho	1,86	0,30	1,07	1,74	615	173	107
Julho	1,04	0,31	1,07	0,98	332	97	106
Agosto	(0,06)	0,60	1,14	0,63	-9	-5	-9
Setembro	(0,20)	0,51	0,97	0,18	-39	-21	-113
Outubro	(0,19)	0,52	1,00	0,30	-36	-19	-64
Novembro	2,53	0,50	0,92	1,84	502	275	137
Dezembro	2,09	0,95	0,90	1,63	219	233	128
TOTAL	13,59	8,83	13,05	14,80	154	104	92

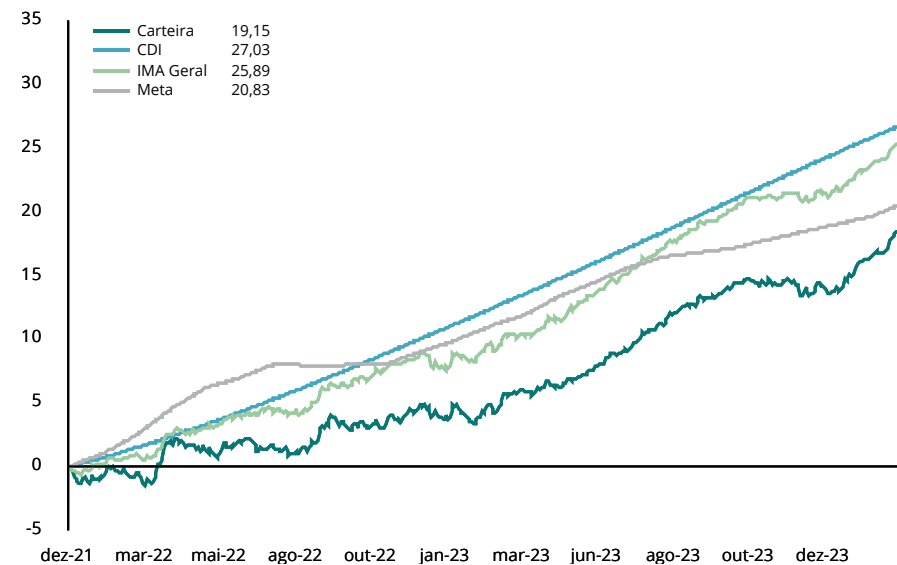
RENTABILIDADE ACUMULADA NO MÊS



CARTEIRA x INDICADORES EM 2023



RENTABILIDADE ACUMULADA DESDE DEZEMBRO/2021



RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
LFT 01/03/2024 (Compra em 17/02/2023)	Sem bench	0,90	94%	13,05	148%	13,05	148%	0,01	0,04	0,02	0,06	4.819,96	-17,02	0,00	0,00
LFT 01/03/2024 (Compra em 21/11/2022)	Sem bench	0,90	94%	13,05	148%	13,05	148%	0,01	0,04	0,02	0,06	4.819,96	-17,02	0,00	0,00
LFT 01/03/2025 (Compra em 06/03/2023)	Sem bench	0,90	94%	13,10	148%	13,10	148%	0,03	0,05	0,06	0,08	2.038,41	-7,17	0,00	0,00
LFT 01/03/2025 (Compra em 18/05/2020)	Sem bench	0,90	94%	13,10	148%	13,10	148%	0,03	0,05	0,06	0,08	2.038,41	-7,17	0,00	0,00
LFT 01/03/2026 (Compra em 17/05/2023)	Sem bench	0,90	94%	13,29	151%	13,29	151%	0,03	0,08	0,04	0,14	2.661,05	8,91	0,00	0,00
LFT 01/09/2024 (Compra em 06/12/2018)	Sem bench	0,90	94%	13,06	148%	13,06	148%	0,01	0,04	0,02	0,06	4.769,67	-14,69	0,00	0,00
LFT 01/09/2024 (Compra em 18/11/2019)	Sem bench	0,90	94%	13,06	148%	13,06	148%	0,01	0,04	0,02	0,06	4.769,67	-14,69	0,00	0,00
LFT 01/09/2025 (Compra em 16/05/2023)	Sem bench	0,90	94%	13,18	149%	13,18	149%	0,02	0,06	0,03	0,10	3.959,45	1,87	0,00	0,00
LTN 01/01/2024 (Compra em 13/12/2021)	Sem bench	0,90	95%	13,22	150%	13,22	150%	0,02	0,53	0,03	0,87	4.627,33	0,69	0,00	-0,17
LTN 01/01/2026 (Compra em 25/07/2023) 000075647	Sem bench	1,52	159%	19,03	215%	19,03	215%	1,75	4,24	2,87	6,97	65,52	7,74	-0,18	-1,68
LTN 01/01/2026 (Compra em 28/07/2023) 00007565E	Sem bench	1,52	159%	19,03	215%	19,03	215%	1,75	4,24	2,87	6,97	65,52	7,74	-0,18	-1,68
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 14/06/2023) 005D3D3	Sem bench	1,31	137%	12,07	137%	12,07	137%	0,68	4,47	1,12	7,36	150,38	-9,53	-0,01	-3,34
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 17/05/2021) 312733	Sem bench	1,31	137%	12,07	137%	12,07	137%	0,68	4,47	1,12	7,36	150,38	-9,53	-0,01	-3,34
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 02/09/2022) 00565EE	Sem bench	1,71	179%	13,87	157%	13,87	157%	1,76	4,96	2,90	8,16	76,05	-6,38	-0,14	-3,27
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 05/10/2022) 00575E2	Sem bench	1,71	179%	13,87	157%	13,87	157%	1,76	4,96	2,90	8,16	76,05	-6,38	-0,14	-3,27
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 09/09/2022) 00569CA	Sem bench	1,71	179%	13,87	157%	13,87	157%	1,76	4,96	2,90	8,16	76,05	-6,38	-0,14	-3,27
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 17/08/2022) 352262	Sem bench	1,71	179%	13,87	157%	13,87	157%	1,76	4,96	2,90	8,16	76,05	-6,38	-0,14	-3,27
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 19/08/2022) 00560B1	Sem bench	1,71	179%	13,87	157%	13,87	157%	1,76	4,96	2,90	8,16	76,05	-6,38	-0,14	-3,27
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 26/09/2022) 0056FDF	Sem bench	1,71	179%	13,87	157%	13,87	157%	1,76	4,96	2,90	8,16	76,05	-6,38	-0,14	-3,27
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 02/01/2019)	Sem bench	3,21	336%	17,71	201%	17,71	201%	4,88	7,01	8,03	11,54	49,08	-1,30	-0,55	-4,83
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 03/06/2020)	Sem bench	3,21	336%	17,71	201%	17,71	201%	4,88	7,01	8,03	11,54	49,08	-1,30	-0,55	-4,83
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 07/07/2023) 005DD3D	Sem bench	3,21	336%	17,71	201%	17,71	201%	4,88	7,01	8,03	11,54	49,08	-1,30	-0,55	-4,83
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 10/05/2019)	Sem bench	3,21	336%	17,71	201%	17,71	201%	4,88	7,01	8,03	11,54	49,08	-1,30	-0,55	-4,83
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 11/01/2019)	Sem bench	3,21	336%	17,71	201%	17,71	201%	4,88	7,01	8,03	11,54	49,08	-1,30	-0,55	-4,83
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 13/05/2022) 343941	Sem bench	3,21	336%	17,71	201%	17,71	201%	4,88	7,01	8,03	11,54	49,08	-1,30	-0,55	-4,83
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 16/08/2019)	Sem bench	3,21	336%	17,71	201%	17,71	201%	4,88	7,01	8,03	11,54	49,08	-1,30	-0,55	-4,83
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 17/08/2022) 352264	Sem bench	3,21	336%	17,71	201%	17,71	201%	4,88	7,01	8,03	11,54	49,08	-1,30	-0,55	-4,83
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 18/02/2020)	Sem bench	3,21	336%	17,71	201%	17,71	201%	4,88	7,01	8,03	11,54	49,08	-1,30	-0,55	-4,83
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 21/11/2018)	Sem bench	3,21	336%	17,71	201%	17,71	201%	4,88	7,01	8,03	11,54	49,08	-1,30	-0,55	-4,83
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 25/07/2023) 005E442	Sem bench	3,21	336%	17,71	201%	17,71	201%	4,88	7,01	8,03	11,54	49,08	-1,30	-0,55	-4,83
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/10/2017)	Sem bench	3,21	336%	17,71	201%	17,71	201%	4,88	7,01	8,03	11,54	49,08	-1,30	-0,55	-4,83
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 04/10/2022) 0057548	Sem bench	3,91	409%	20,55	233%	20,55	233%	5,75	8,43	9,46	13,87	48,99	0,81	-0,61	-6,49
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/07/2022) 349638	Sem bench	3,91	409%	20,55	233%	20,55	233%	5,75	8,43	9,46	13,87	48,99	0,81	-0,61	-6,49

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/11/2022) 00587CF	Sem bench	3,91	409%	20,55	233%	20,55	233%	5,75	8,43	9,46	13,87	48,99	0,81	-0,61	-6,49
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/05/2022) 344518	Sem bench	3,91	409%	20,55	233%	20,55	233%	5,75	8,43	9,46	13,87	48,99	0,81	-0,61	-6,49
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/08/2022) 00560AF	Sem bench	3,91	409%	20,55	233%	20,55	233%	5,75	8,43	9,46	13,87	48,99	0,81	-0,61	-6,49
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 28/03/2022) 339279	Sem bench	3,91	409%	20,55	233%	20,55	233%	5,75	8,43	9,46	13,87	48,99	0,81	-0,61	-6,49
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 16/08/2021)	Sem bench	5,11	535%	22,48	255%	22,48	255%	6,44	9,64	10,61	15,86	58,71	1,85	-0,51	-8,45
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 17/12/2019)	Sem bench	5,11	535%	22,48	255%	22,48	255%	6,44	9,64	10,61	15,86	58,71	1,85	-0,51	-8,45
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 01/02/2022) 334348	Sem bench	0,94	98%	11,39	129%	11,39	129%	0,72	4,02	1,19	6,61	105,89	-11,63	-0,02	-2,76
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 04/01/2022)	Sem bench	0,94	98%	11,39	129%	11,39	129%	0,72	4,02	1,19	6,61	105,89	-11,63	-0,02	-2,76
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/05/2019)	Sem bench	0,94	98%	11,39	129%	11,39	129%	0,72	4,02	1,19	6,61	105,89	-11,63	-0,02	-2,76
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 20/01/2022) 333549	Sem bench	0,94	98%	11,39	129%	11,39	129%	0,72	4,02	1,19	6,61	105,89	-11,63	-0,02	-2,76
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 22/02/2022)	Sem bench	0,94	98%	11,39	129%	11,39	129%	0,72	4,02	1,19	6,61	105,89	-11,63	-0,02	-2,76
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 03/07/2018)	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 07/03/2022) 336701	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 09/08/2017) 244294	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 10/03/2022) 337480	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 13/07/2022) 349261	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/07/2022) 349480	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/12/2022) 00593A4	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/05/2023)	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/09/2021) 321107	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2021) 318118	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2023) 005ECDD	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/02/2018)	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/03/2018)	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 22/11/2022) 0058918	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2021) 325234	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 29/06/2021)	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 30/11/2022) 0058C49	Sem bench	1,55	162%	13,60	154%	13,60	154%	1,29	4,64	2,13	7,63	92,91	-7,21	-0,10	-4,27
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/09/2021) 320543	Sem bench	2,00	210%	15,15	172%	15,15	172%	2,30	5,19	3,78	8,54	69,31	-4,73	-0,18	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323671	Sem bench	2,00	210%	15,15	172%	15,15	172%	2,30	5,19	3,78	8,54	69,31	-4,73	-0,18	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323677	Sem bench	2,00	210%	15,15	172%	15,15	172%	2,30	5,19	3,78	8,54	69,31	-4,73	-0,18	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/02/2019)	Sem bench	2,00	210%	15,15	172%	15,15	172%	2,30	5,19	3,78	8,54	69,31	-4,73	-0,18	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2022)	Sem bench	2,00	210%	15,15	172%	15,15	172%	2,30	5,19	3,78	8,54	69,31	-4,73	-0,18	-5,39

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2023)	Sem bench	2,00	210%	15,15	172%	15,15	172%	2,30	5,19	3,78	8,54	69,31	-4,73	-0,18	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 17/05/2018)	Sem bench	2,00	210%	15,15	172%	15,15	172%	2,30	5,19	3,78	8,54	69,31	-4,73	-0,18	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 19/03/2018)	Sem bench	2,00	210%	15,15	172%	15,15	172%	2,30	5,19	3,78	8,54	69,31	-4,73	-0,18	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 21/10/2021) 324819	Sem bench	2,00	210%	15,15	172%	15,15	172%	2,30	5,19	3,78	8,54	69,31	-4,73	-0,18	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/08/2023) 005EFE6	Sem bench	2,00	210%	15,15	172%	15,15	172%	2,30	5,19	3,78	8,54	69,31	-4,73	-0,18	-5,39
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/10/2021) 325075	Sem bench	2,00	210%	15,15	172%	15,15	172%	2,30	5,19	3,78	8,54	69,31	-4,73	-0,18	-5,39
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 05/07/2023)	Sem bench	2,33	244%	15,84	179%	15,84	179%	3,22	5,91	5,30	9,73	56,66	-3,44	-0,33	-6,29
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 08/11/2018) 265743	Sem bench	2,33	244%	15,84	179%	15,84	179%	3,22	5,91	5,30	9,73	56,66	-3,44	-0,33	-6,29
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 16/02/2022) 335567	Sem bench	2,33	244%	15,84	179%	15,84	179%	3,22	5,91	5,30	9,73	56,66	-3,44	-0,33	-6,29
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 20/07/2022) 349906	Sem bench	2,33	244%	15,84	179%	15,84	179%	3,22	5,91	5,30	9,73	56,66	-3,44	-0,33	-6,29
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 24/03/2022) 338960	Sem bench	2,33	244%	15,84	179%	15,84	179%	3,22	5,91	5,30	9,73	56,66	-3,44	-0,33	-6,29
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/09/2022) 0056DF3	Sem bench	2,53	265%	16,64	188%	16,64	188%	3,99	6,38	6,57	10,50	49,44	-2,50	-0,37	-6,65
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 26/08/2022) 00562E2	Sem bench	2,53	265%	16,64	188%	16,64	188%	3,99	6,38	6,57	10,50	49,44	-2,50	-0,37	-6,65
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 30/08/2022) 00563E2	Sem bench	2,53	265%	16,64	188%	16,64	188%	3,99	6,38	6,57	10,50	49,44	-2,50	-0,37	-6,65
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 25/03/2022) 339157	Sem bench	4,30	451%	20,16	228%	20,16	228%	5,10	7,79	8,40	12,81	63,68	0,43	-0,55	-8,65
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 04/06/2021) 313399	Sem bench	4,85	508%	22,20	251%	22,20	251%	6,09	9,12	10,03	15,01	58,17	1,59	-0,45	-10,07
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 05/10/2022) 00575E0	Sem bench	4,85	508%	22,20	251%	22,20	251%	6,09	9,12	10,03	15,01	58,17	1,59	-0,45	-10,07
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 15/06/2018) 260982	Sem bench	4,85	508%	22,20	251%	22,20	251%	6,09	9,12	10,03	15,01	58,17	1,59	-0,45	-10,07
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) i	Sem bench	4,85	508%	22,20	251%	22,20	251%	6,09	9,12	10,03	15,01	58,17	1,59	-0,45	-10,07
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) ii	Sem bench	4,85	508%	22,20	251%	22,20	251%	6,09	9,12	10,03	15,01	58,17	1,59	-0,45	-10,07
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) i	Sem bench	4,85	508%	22,20	251%	22,20	251%	6,09	9,12	10,03	15,01	58,17	1,59	-0,45	-10,07
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) ii	Sem bench	4,85	508%	22,20	251%	22,20	251%	6,09	9,12	10,03	15,01	58,17	1,59	-0,45	-10,07
NTN-F 01/01/2027 (Compra em 17/08/2023) 0046601	Sem bench	1,61	168%	19,61	222%	19,61	222%	2,35	8,92	3,87	14,68	51,83	-2,82	-0,29	-6,84
NTN-F 01/01/2031 (Compra em 05/10/2022) 003FA75	Sem bench	3,08	323%	24,71	280%	24,71	280%	5,03	11,75	8,28	19,34	48,64	0,03	-0,62	-8,25
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
NTN-B XP 2028-08 (Compra 14/07/22 Tx 6.1310)	Sem bench	0,91	96%	11,09	126%	11,09	126%	0,46	4,12	0,76	6,77	158,28	-11,76	0,00	-2,86
NTN-B XP 2028-08 (Compra 19/07/22 Tx 6.2780)	Sem bench	0,93	97%	11,23	127%	11,23	127%	0,46	4,14	0,76	6,81	158,69	-11,53	0,00	-2,87
NTN-B XP 2030-08 (Compra 01/11/23 Tx 5.8570)	Sem bench	0,92	97%	1,59	18%	-	-	0,57	-	0,94	-	129,56	-	0,00	-
NTN-B XP 2030-08 (Compra 09/10/23 Tx 5.8465)	Sem bench	0,92	97%	2,12	24%	-	-	0,57	-	0,93	-	129,62	-	0,00	-
NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/11/22 Tx 6.0750)	Sem bench	0,94	99%	11,08	126%	11,08	126%	0,58	4,11	0,95	6,76	129,73	-11,79	0,00	-2,85
NTN-B XP 2030-08 (Compra 23/05/23 Tx 5.5625)	Sem bench	0,90	94%	4,84	55%	-	-	0,55	-	0,91	-	129,43	-	0,00	-
NTN-B XP 2030-08 (Compra 24/11/22 Tx 6.2550)	Sem bench	0,96	100%	11,24	127%	11,24	127%	0,59	4,15	0,97	6,83	129,76	-11,50	0,00	-2,88

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
NTN-B XP 2032-08 (Compra 21/07/22 Tx 6.2610)	Sem bench	0,99	104%	11,30	128%	11,30	128%	0,70	4,17	1,15	6,85	112,78	-11,43	0,00	-2,89
NTN-B XP 2035-05 (Compra 05/04/23 Tx 6.0750)	Sem bench	0,99	103%	6,94	79%	-	-	0,73	-	1,21	-	107,40	-	0,00	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 06/03/23 Tx 6.4290)	Sem bench	1,02	107%	8,75	99%	-	-	0,76	-	1,25	-	107,34	-	0,00	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.4200)	Sem bench	0,92	97%	10,43	118%	10,43	118%	0,69	3,90	1,13	6,42	107,56	-12,92	0,00	-2,71
NTN-B XP 2035-05 (Compra 15/05/23 Tx 5.6650)	Sem bench	0,95	99%	5,22	59%	-	-	0,70	-	1,16	-	107,48	-	0,00	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 18/11/22 Tx 6.2000)	Sem bench	1,00	104%	11,25	127%	11,25	127%	0,74	4,15	1,22	6,83	107,35	-11,54	0,00	-2,88
NTN-B XP 2035-05 (Compra 20/04/23 Tx 6.0550)	Sem bench	0,98	103%	6,38	72%	-	-	0,73	-	1,20	-	107,39	-	0,00	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 27/02/23 Tx 6.3150)	Sem bench	1,01	106%	9,02	102%	-	-	0,75	-	1,24	-	107,33	-	0,00	-
NTN-B XP 2040-08 (Compra 14/06/22 Tx 5.7600)	Sem bench	0,99	103%	10,94	124%	10,94	124%	0,83	4,00	1,36	6,58	95,60	-12,22	0,00	-2,77
NTN-B XP 2040-08 (Compra 15/12/22 Tx 6.3520)	Sem bench	1,05	109%	11,37	129%	11,37	129%	0,88	4,24	1,44	6,98	95,64	-11,19	0,00	-2,94
NTN-B XP 2040-08 (Compra 17/05/22 Tx 5.6700)	Sem bench	0,98	102%	10,88	123%	10,88	123%	0,82	3,96	1,35	6,52	95,63	-12,39	0,00	-2,75
NTN-B XP 2040-08 (Compra 30/01/23 Tx 6.4500)	Sem bench	1,05	110%	10,14	115%	-	-	0,88	-	1,45	-	95,63	-	0,00	-
NTN-B XP 2045-05 (Compra 04/05/22 Tx 5.8250)	Sem bench	1,03	107%	10,92	124%	10,92	124%	0,95	4,01	1,56	6,59	86,87	-12,09	0,00	-2,78
NTN-B XP 2045-05 (Compra 06/07/22 Tx 6.1150)	Sem bench	1,05	110%	11,23	127%	11,23	127%	0,97	4,14	1,60	6,81	86,95	-11,56	0,00	-2,87
NTN-B XP 2045-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.5600)	Sem bench	1,00	105%	10,64	121%	10,64	121%	0,92	3,88	1,52	6,39	86,80	-12,60	0,00	-2,69
NTN-B XP 2045-05 (Compra 13/04/22 Tx 5.7400)	Sem bench	1,02	106%	10,83	123%	10,83	123%	0,94	3,97	1,55	6,53	86,82	-12,25	0,00	-2,75
NTN-B XP 2045-05 (Compra 16/05/23 Tx 5.8255)	Sem bench	1,03	107%	5,35	61%	-	-	0,95	-	1,56	-	86,84	-	0,00	-
NTN-B XP 2045-05 (Compra 24/11/22 Tx 6.2900)	Sem bench	1,07	112%	11,42	129%	11,42	129%	0,99	4,22	1,62	6,95	87,05	-11,26	0,00	-2,93
NTN-B XP 2050-08 (Compra 09/05/22 Tx 5.8420)	Sem bench	1,05	110%	10,97	124%	10,97	124%	1,03	4,02	1,70	6,61	81,50	-11,99	0,00	-2,78
NTN-B XP 2050-08 (Compra 11/05/22 Tx 5.8810)	Sem bench	1,06	110%	11,00	125%	11,00	125%	1,04	4,04	1,71	6,64	81,55	-11,91	0,00	-2,79
NTN-B XP 2050-08 (Compra 24/06/22 Tx 5.9201)	Sem bench	1,06	111%	11,02	125%	11,02	125%	1,04	4,06	1,71	6,67	81,57	-11,84	0,00	-2,81
NTN-B XP 2050-08 (Compra 26/04/22 Tx 5.7950)	Sem bench	1,05	110%	10,94	124%	10,94	124%	1,03	3,99	1,70	6,57	81,47	-12,08	0,00	-2,76
NTN-B XP 2050-08 (Compra 29/04/22 Tx 5.8200)	Sem bench	1,05	110%	10,96	124%	10,96	124%	1,03	4,00	1,70	6,59	81,48	-12,03	0,00	-2,77
NTN-B XP 2055-05 (Compra 28/06/22 Tx 6.0310)	Sem bench	1,09	114%	11,19	127%	11,19	127%	1,11	4,10	1,83	6,75	78,48	-11,64	0,00	-2,84
FUNDOS DE RENDA FIXA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	CDI	0,90	94%	12,98	147%	12,98	147%	0,02	0,08	0,04	0,14	3.210,58	-12,45	0,00	-0,02
BB FIC Previdenciário Fluxo	CDI	0,82	86%	11,93	135%	11,93	135%	0,02	0,04	0,04	0,07	2.830,48	-173,94	0,00	0,00
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	IMA-B 5	1,44	151%	11,93	135%	11,93	135%	1,06	1,97	1,75	3,25	107,45	-3,47	-0,07	-0,93
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	IMA-B	2,74	287%	15,77	179%	15,77	179%	3,14	4,45	5,17	7,33	66,02	3,41	-0,23	-3,60
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	IMA-B 5+	3,93	412%	18,87	214%	18,87	214%	5,13	6,98	8,46	11,48	56,81	4,72	-0,46	-6,19
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	IPCA	0,92	96%	11,14	126%	11,14	126%	0,72	1,37	1,18	2,25	104,16	-8,36	-0,02	-0,42
Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa	CDI	0,88	92%	12,74	144%	12,74	144%	0,02	0,04	0,04	0,07	3.187,99	-54,95	0,00	0,00

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
FUNDOS DE RENDA FIXA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA Geral	IMA Geral	1,59	166%	13,99	158%	13,99	158%	1,26	2,22	2,07	3,65	96,84	2,16	-0,10	-1,02
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B	IMA-B	2,72	285%	15,82	179%	15,82	179%	3,10	4,50	5,10	7,41	66,25	3,44	-0,23	-3,79
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5	IMA-B 5	1,44	150%	11,84	134%	11,84	134%	1,05	1,97	1,73	3,24	107,95	-3,74	-0,07	-0,94
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5+	IMA-B 5+	3,91	410%	18,91	214%	18,91	214%	5,13	7,02	8,45	11,55	56,55	4,72	-0,47	-6,19
Bradesco FIC Performance Inst. Crédito Privado	CDI	0,96	100%	14,21	161%	14,21	161%	0,09	0,18	0,15	0,29	814,27	33,57	0,00	-0,00
Bradesco Institucional Renda Fixa IRF-M	IRF-M	1,47	154%	16,59	188%	16,59	188%	1,43	2,66	2,35	4,38	79,89	7,23	-0,15	-0,93
Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa	CDI	0,84	88%	12,32	140%	12,32	140%	0,04	0,06	0,07	0,09	1.564,10	-83,24	0,00	0,00
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	CDI	0,94	98%	13,63	154%	13,63	154%	0,03	0,07	0,05	0,12	2.448,00	35,21	0,00	0,00
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	IPCA + 6%	1,43	149%	12,55	142%	12,55	142%	1,01	2,04	1,67	3,36	111,09	-1,63	-0,07	-0,92
Caixa Brasil Referenciado	CDI	0,92	97%	13,32	151%	13,32	151%	0,04	0,07	0,07	0,11	1.726,71	13,29	0,00	0,00
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	IPCA	0,92	97%	11,14	126%	11,14	126%	0,72	4,02	1,18	6,62	104,15	-11,44	-0,02	-2,90
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	IMA-B	2,73	286%	15,86	180%	15,86	180%	3,09	4,46	5,09	7,33	66,71	3,51	-0,23	-3,55
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	IMA-B 5+	3,93	412%	18,90	214%	18,90	214%	5,10	6,91	8,40	11,37	57,16	4,78	-0,45	-6,01
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	CDI	0,81	85%	11,58	131%	11,58	131%	0,01	0,03	0,02	0,05	4.562,07	-312,44	0,00	0,00
Itaú FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa	IMA Geral	1,61	169%	15,84	179%	15,84	179%	1,67	3,31	2,74	5,45	72,04	4,61	-0,18	-1,67
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	CDI	1,13	118%	12,69	144%	12,69	144%	0,54	0,83	0,90	1,37	161,64	-3,20	-0,01	-0,30
Itaú FIC IMA-B 5+	IMA-B 5+	3,92	410%	18,98	215%	18,98	215%	5,12	7,00	8,44	11,52	56,81	4,79	-0,46	-6,15
Itaú FIC Institucional IMA-B	IMA-B	2,73	286%	15,78	179%	15,78	179%	3,11	4,47	5,11	7,35	66,50	3,40	-0,23	-3,58
Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa	CDI	0,98	103%	12,64	143%	12,64	143%	0,26	0,56	0,42	0,93	305,27	-5,22	0,00	-0,05
Trend Cash FIC Simples	CDI	0,89	93%	12,83	145%	12,83	145%	0,03	0,05	0,04	0,08	2.626,03	-39,34	0,00	0,00
Vinci Institucional Referenciado	CDI	0,91	95%	-	-	-	-	0,02	-	0,03	-	3.875,19	-	0,00	-
Western Asset Ativo IMA-B	IMA-B	2,89	303%	15,93	180%	15,93	180%	3,58	5,16	5,90	8,49	60,45	3,15	-0,30	-4,86
Western Asset Ativo IMA-B 5	IMA-B 5	1,62	170%	12,11	137%	12,11	137%	1,62	2,77	2,66	4,55	77,52	-2,06	-0,14	-2,00
Western Asset Soberano II Referenciado Selic	Selic	0,89	94%	12,96	147%	12,96	147%	0,04	0,06	0,06	0,09	1.857,02	-19,66	0,00	0,00
Western Ativo Max	CDI	1,27	133%	13,10	148%	13,10	148%	1,39	2,31	2,29	3,80	67,70	-0,09	-0,15	-1,12
Western Max Referenciado DI Renda Fixa	CDI	0,95	100%	12,82	145%	12,82	145%	0,03	0,46	0,05	0,76	2.353,57	-4,18	0,00	-0,44
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	CDI	0,90	94%	12,96	147%	12,96	147%	0,03	0,05	0,06	0,09	2.081,85	-21,96	0,00	0,00
XP Inflação Referenciado IPCA	IMA-B 5	2,15	226%	11,25	127%	11,25	127%	2,44	3,65	4,02	6,01	65,93	-2,86	-0,17	-2,93
XP Trend Simples	CDI	0,92	96%	13,13	149%	13,13	149%	0,04	0,06	0,07	0,10	1.618,41	-2,55	0,00	0,00
FIDC	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BRPP FIDC Multisetorial Master	Sem bench	6,92	725%	2.672,09	30261%	2.672,09	30261%	-	-	-	-	-	-	-	-
Vila Rica FIDC Multisetorial Itália	Sem bench	2,25	236%	217,62	2465%	217,62	2465%	-	-	-	-	-	-	-	-

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIA Governança	IGC	5,52	578%	20,23	229%	20,23	229%	13,32	17,18	21,94	28,28	30,28	2,79	-2,00	-14,87
BB FIC FIA Dividendos	Sem bench	6,35	665%	21,36	242%	21,36	242%	10,70	15,37	17,63	25,30	44,19	3,38	-1,00	-13,85
BB FIC FIA Seleção Fatorial	Ibov.	5,22	547%	18,94	214%	18,94	214%	13,80	16,81	22,73	27,66	28,06	2,42	-2,40	-15,49
Bradesco FIA MID Small Cap	IBrX	5,76	603%	3,50	40%	3,50	40%	19,04	21,69	31,37	35,68	20,11	-1,94	-1,87	-20,35
Bradesco FIA Selection	Ibov.	6,25	655%	12,50	142%	12,50	142%	13,66	17,03	22,52	28,02	33,93	0,31	-1,72	-14,25
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX	IBrX	5,58	584%	17,34	196%	17,34	196%	13,65	17,15	22,48	28,22	29,48	1,88	-2,07	-14,76
Caixa FIC FIA Valor Vinci Exp. Dividendos RPPS	IDIV	5,91	619%	23,73	269%	23,73	269%	10,77	14,52	17,75	23,89	42,05	4,38	-0,98	-11,34
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	Ibov.	5,87	614%	20,61	233%	20,61	233%	13,80	17,37	22,74	28,59	30,78	2,88	-1,99	-14,13
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	Ibov.	5,36	562%	19,09	216%	19,09	216%	13,51	16,49	22,26	27,13	23,88	2,53	-1,85	-14,06
Occam FIC FIA	Sem bench	4,89	512%	15,74	178%	15,74	178%	13,47	15,75	22,19	25,91	28,42	1,41	-2,35	-13,73
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	Ibov.	4,92	516%	11,75	133%	11,75	133%	14,26	19,45	23,48	32,01	25,09	0,20	-2,10	-17,81
Vinci FIA Fatorial Dinâmico	Ibov.	5,56	582%	21,15	239%	21,15	239%	13,91	17,53	22,91	28,85	28,75	3,03	-2,06	-12,73
Vinci FIA Gas Dividendos	Ibov.	5,51	577%	20,82	236%	20,82	236%	12,96	15,93	21,36	26,22	31,11	3,12	-1,84	-12,96
Vinci FIA Selection Equities	Ibov.	5,92	620%	18,61	211%	18,61	211%	13,68	17,16	22,53	28,23	30,08	2,29	-1,69	-13,58
Western Asset FIA Valuation	Ibov.	5,09	533%	11,95	135%	11,95	135%	14,96	17,41	24,65	28,65	26,17	0,15	-1,60	-15,57
Western Asset FIC FIA Alpha IBrX	IBrX	5,24	548%	18,71	212%	18,71	212%	12,82	16,15	21,12	26,57	29,93	2,40	-1,82	-14,02
XP FIC FIA Investor 30	Ibov.	5,13	538%	26,12	296%	26,12	296%	10,03	15,74	16,52	25,91	33,98	4,89	-0,88	-11,25
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIA ESG BDR Nível I	Ibov.	3,03	318%	17,78	201%	17,78	201%	9,43	13,89	15,53	22,86	32,69	2,27	-1,16	-7,67
BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior	Sem bench	3,65	382%	12,91	146%	12,91	146%	8,82	12,98	14,53	21,36	36,48	0,30	-1,64	-6,84
BB Schroder Multimercado IE	MSCI World	2,53	265%	10,85	123%	10,85	123%	10,40	15,34	17,13	25,24	31,44	-0,38	-1,37	-8,17
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	Sem bench	2,94	308%	9,74	110%	9,74	110%	9,00	12,19	14,82	20,05	31,44	-1,23	-1,36	-7,71
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	Ibov.	2,86	300%	15,55	176%	15,55	176%	8,61	13,67	14,17	22,49	30,86	1,40	-1,33	-7,69
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	Sem bench	2,59	271%	24,92	282%	24,92	282%	8,55	15,20	14,07	25,02	29,64	4,62	-1,11	-7,79
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	Sem bench	4,03	422%	9,37	106%	9,37	106%	9,85	12,10	16,22	19,90	38,63	-1,42	-1,30	-8,39
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	Sem bench	1,83	191%	-4,54	-51%	-4,54	-51%	9,08	14,45	14,95	23,77	17,64	-7,04	-1,91	-13,84
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	Ibov.	0,56	59%	-0,52	-6%	-0,52	-6%	10,14	10,40	16,69	17,11	10,02	-7,58	-2,07	-9,64
Western Asset FIA BDR Nível I	Ibov.	2,77	290%	32,50	368%	32,50	368%	9,43	16,40	15,53	27,00	27,09	6,65	-1,30	-8,86
Western Macro Opportunities Multimercado IE	Sem bench	9,60	1006%	19,60	222%	19,60	222%	13,16	14,12	21,69	23,23	48,04	2,94	-1,23	-13,45
XP FIC FIM Nordea Alfa 10 Advisory	Sem bench	-1,08	-114%	3,70	42%	3,70	42%	8,79	6,69	14,45	11,01	-14,45	-8,11	-2,97	-5,00
XP FIC Moneda Latam Credit Advisory Mult. IE	Sem bench	3,42	359%	14,65	166%	14,65	166%	3,51	3,92	5,78	6,46	59,10	2,40	-0,24	-3,84
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	Ibov.	4,02	421%	38,02	431%	38,02	431%	16,13	22,13	26,58	36,44	26,98	6,42	-2,18	-11,20

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN		
FUNDOS MULTIMERCADO		BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIC Dinâmico Multimercado		CDI	1,42	148%	-3,34	-38%	-3,34	-38%	4,96	7,52	8,16	12,38	28,20	-13,12	-1,25	-11,78
BB FIC Juros e Moedas Multimercado		CDI	0,94	99%	12,74	144%	12,74	144%	0,30	0,56	0,50	0,93	242,94	-4,17	-0,01	-0,14
BB FIC Macro Multimercado		CDI	1,86	194%	10,53	119%	10,53	119%	1,73	2,38	2,85	3,91	79,74	-6,24	-0,07	-1,68
Caixa Bolsa Americana Multimercado		SP 500	5,19	544%	33,22	376%	33,22	376%	9,03	13,24	14,88	21,80	41,54	8,28	-1,27	-8,82
Itaú FIC Private Multimercado SP500		SP 500	5,17	542%	33,07	375%	33,07	375%	9,00	13,21	14,83	21,74	41,52	8,24	-1,26	-8,80
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado		CDI	1,41	148%	12,45	141%	12,45	141%	3,86	3,30	6,35	5,43	26,72	-1,12	-0,51	-1,15
Vinci Multiestratégia Multimercado		CDI	0,99	104%	12,62	143%	12,62	143%	0,55	0,81	0,91	1,33	135,07	-3,77	-0,05	-0,16
Vinci Valorem Multimercado		IMA-B 5	1,47	154%	11,80	134%	11,80	134%	1,17	1,57	1,92	2,59	98,13	-4,85	-0,02	-1,07
Western Long Short Multimercado		CDI	-0,10	-11%	7,53	85%	7,53	85%	3,86	3,27	6,35	5,38	0,56	-9,85	-0,53	-1,58
FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES		BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BTG FIP Economia Real II		IPCA + 8%	-3,19	-335%	-15,63	-177%	-	-	65,42	-	106,97	-	-23,69	-	-18,66	-
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II		IPCA + 15%	-2,79	-293%	-27,46	-311%	-27,46	-311%	0,49	17,65	0,80	29,00	-608,65	-23,39	-2,91	-42,37
BTG Pactual FIC FIP Principal Investments		Sem bench	-0,33	-34%	12,03	136%	12,03	136%	-	-	-	-	-	-	-	-
FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia		IPCA + 9,5%	-0,02	-3%	51,65	585%	51,65	585%	0,00	46,91	0,00	77,25	-9.999,99	4,77	-0,03	-2,92
Kinea FIP Private Equity II		IPCA + 10%	0,37	39%	0,16	2%	0,16	2%	-	-	-	-	-	-	-	-
Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.		Sem bench	0,40	42%	-4,20	-48%	-4,20	-48%	-	-	-	-	-	-	-	-
Kinea FIP Private Equity V Feeder Inst. I Mult.		Sem bench	-0,51	-53%	-6,01	-68%	-6,01	-68%	-	-	-	-	-	-	-	-
Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III		Sem bench	3,35	350%	10,53	119%	10,53	119%	45,61	67,37	74,82	110,58	-16,15	-9,67	-11,74	-74,19
INDICADORES			RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
Carteira			2,09	219%	13,59	154%	13,59	154%	1,86	2,50	3,06	4,12	50,26	1,30	-0,11	-1,24
IPCA			0,56	59%	4,62	52%	4,62	52%	-	-	-	-	-	-	-	-
INPC			0,55	58%	3,71	42%	3,71	42%	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI			0,90	94%	13,05	148%	13,05	148%	0,01	0,03	-	-	-	-	-	-
IRF-M			1,48	155%	16,51	187%	16,51	187%	1,36	2,62	2,24	4,32	33,84	7,58	-0,14	-0,92
IRF-M 1			0,91	96%	13,25	150%	13,25	150%	0,09	0,35	0,15	0,58	13,80	3,29	0,00	-0,04
IRF-M 1+			1,73	181%	18,52	210%	18,52	210%	1,93	3,88	3,18	6,39	33,85	8,04	-0,23	-1,55
IMA-B			2,75	288%	16,05	182%	16,05	182%	2,97	4,45	4,89	7,32	48,78	3,89	-0,23	-3,56
IMA-B 5			1,46	153%	12,13	137%	12,13	137%	1,00	1,96	1,64	3,22	44,51	-2,53	-0,07	-0,91
IMA-B 5+			3,94	413%	19,28	218%	19,28	218%	4,92	6,97	8,10	11,48	48,24	5,09	-0,45	-6,14
IMA Geral			1,63	170%	14,80	168%	14,80	168%	1,16	1,96	1,90	3,22	49,53	5,12	-0,09	-0,67
IDkA 2A			1,45	152%	12,13	137%	12,13	137%	0,86	2,11	1,42	3,47	50,81	-2,18	-0,03	-0,99
IDkA 20A			6,58	690%	27,13	307%	27,13	307%	8,54	12,51	14,07	20,58	51,36	6,43	-0,93	-11,12

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
	INDICADORES	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %
IGCT	5,68	595%	22,24	252%	22,24	252%	12,58	17,09	20,73	28,13	29,67	3,21	-1,96	-14,72
IBrX 50	5,31	557%	20,06	227%	20,06	227%	12,95	17,09	21,34	28,12	26,70	2,54	-2,25	-14,93
Ibovespa	5,38	564%	22,28	252%	22,28	252%	12,70	17,08	20,93	28,11	27,62	3,24	-2,00	-14,30
META ATUARIAL - INPC + 4,94% A.A.	0,95		8,83		8,83									

São apresentadas apenas as informações dos fundos que possuem histórico completo no período.

A rentabilidade do fundo Caixa FIC FIA Valor Dividendos RPPS não considera o pagamento de dividendos.

NOTAS METODOLÓGICAS E EXPLICATIVAS

Introdução

O risco está associado ao grau de incerteza sobre um investimento no futuro, havendo diversas formas de mensurá-lo. A tabela "Medidas de Risco da Carteira" traz algumas das métricas mais tradicionais de análise de risco, que serão brevemente explicadas a seguir.

Volatilidade Anualizada

Volatilidade é o nome que se dá ao Desvio Padrão dos retornos de um ativo. Dessa forma, a Volatilidade mede o quanto os retornos diários se afastam do retorno médio do período analisado. Assim sendo, uma Volatilidade alta representa maior risco, visto que os preços do ativo tendem a se afastar mais de seu valor médio.

Estima-se que os retornos diários da Carteira, em média, se afastam em 2,5041% do retorno diário médio dos últimos 12 meses. Como base para comparação, o IRF-M, que tende a ser menos volátil, apresentou um coeficiente de 2,62% no mesmo período. Já o IMA-B, que habitualmente manifesta alta volatilidade, ficou com 4,45% em 12 meses.

Value at Risk - VaR (95%)

Sintetiza a maior perda esperada para a Carteira no intervalo de um dia. Seu cálculo baseia-se na média e no desvio padrão dos retornos diários da Carteira, e supõe que estes seguem uma distribuição normal.

Dado o desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma perda de um dia para o outro, o prejuízo máximo será de 4,1202%. No mesmo período, o IRF-M detém um VaR de 4,32%, e o IMA-B de 7,32%.

Draw-Down

Auxilia a determinar o risco de um investimento ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da série representa a maior queda ocorrida no período.

Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, consequentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

Analisando os últimos 12 meses, percebe-se que a maior queda ocorrida na Carteira foi de 1,2413%. Já os índices IRF-M e IMA-B sofreram quedas de 0,92% e 3,56%, respectivamente.

Beta

Avalia a sensibilidade da Carteira em relação ao risco do mercado como um todo, representado pelo Índice Ibovespa. Dessa forma, assume-se que o Ibovespa possui um Beta igual a 100%. Calculando o Beta da Carteira, tem-se uma estimativa da sua exposição ao total desse risco.

Ou seja, nos últimos 12 meses, estima-se que a carteira está exposta a 11,8123% do risco experimentado pelo mercado.

Tracking Error

Mensura o quão aderente a Carteira é ao seu Benchmark, nesse caso, representado pela Meta do Instituto. Vistos os retornos dos últimos 12 meses, pode-se afirmar que há 66% de chance de que o retorno diário da Carteira fique entre 0,1581% e -0,1581% da Meta.

Sharpe

Quantifica a relação entre a Volatilidade da Carteira e seu retorno excedente a um ativo livre de risco, nesse caso, o CDI. Assim, esse indicador aponta o percentual de rentabilidade que a Carteira teve acima do CDI devido à sua maior exposição ao risco. Logo, quanto maior o Sharpe, melhor o desempenho da Carteira, enquanto valores negativos significam que o CDI superou a rentabilidade da Carteira no período.

Em 12 meses, o indicador apontou que para cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs, houve um prêmio de 1,2997% de rentabilidade acima daquela alcançada pelo CDI.

Treynor

Similar ao Sharpe, porém, utiliza o risco do mercado (Beta) no cálculo em vez da Volatilidade da Carteira. Valores negativos indicam que a Carteira teve rentabilidade menor do que a alcançada pelo mercado.

Em 12 meses, cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs foram convertidos em um prêmio de 0,0174% de rentabilidade acima do retorno do mercado.

Alfa de Jensen

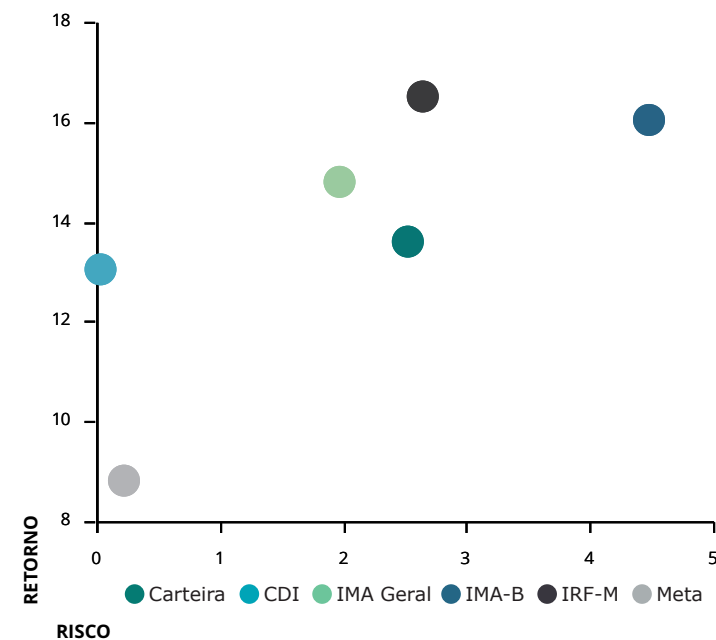
É uma medida do desempenho da Carteira, indicando uma boa performance caso o coeficiente seja significativamente positivo. Valores próximos de zero (tanto positivos quanto negativos) são neutros, devendo ser desconsiderados. Um coeficiente significativamente negativo aponta que o risco da Carteira não tem se convertido em maiores retornos.

MEDIDAS DE RISCO E DESEMPENHO DA CARTEIRA (%)

MEDIDA	NO MÊS	3 MESES	12 MESES
Volatilidade Anualizada	1,8600	2,7937	2,5041
VaR (95%)	3,0614	4,5972	4,1202
Draw-Down	-0,1097	-1,2413	-1,2413
Beta	12,4979	16,3537	11,8123
Tracking Error	0,1172	0,1749	0,1581
Sharpe	50,2559	14,7797	1,2997
Treynor	0,4712	0,1590	0,0174
Alfa de Jensen	0,0313	-0,0050	-0,0024

RELAÇÃO RISCO X RETORNO EM 12 MESES (%)

Em geral, há uma forte relação entre o risco e o retorno de um ativo: quanto maior o risco, maior a probabilidade de um retorno (ou perda) mais elevado. O gráfico representa as métricas dessa correlação para a Carteira e para os principais índices. Pontos mais acima no gráfico representam um retorno mais elevado, enquanto pontos mais à direita indicam maior risco.



METODOLOGIA DO STRESS TEST

O Stress Test é comumente utilizado para mensurar como situações de estresse no mercado podem vir a impactar uma Carteira de Investimentos. Por se tratar de uma medida de risco não estatística, esse teste é indicado como um complemento às métricas de risco mais usuais, como Volatilidade e VaR, por exemplo.

Em geral, o teste é formulado em duas etapas. A primeira consiste na elaboração de um cenário de estresse em que são aplicados choques exógenos aos fatores de risco que influenciam a Carteira. Na segunda etapa, analisa-se o impacto do cenário de estresse sobre os investimentos, como é apresentado na tabela "Stress Test" ao lado.

Contabilizamos os retornos mensais, dos últimos 24 meses, de todos os ativos presentes na Carteira. Dadas essas estatísticas, selecionamos a pior rentabilidade de cada ativo e, então, construímos um cenário hipotético no qual todos os ativos entregariam, juntos, as suas respectivas piores rentabilidades experimentadas ao longo do período.

Visando uma apresentação mais concisa, agrupamos os resultados por fatores de risco, que são os índices aos quais os ativos estão vinculados. A coluna Exposição denota o percentual do Patrimônio da Carteira que está atrelado a cada um desses fatores.

As duas colunas mais à direita mostram o impacto do cenário de estresse, em reais e em percentual do patrimônio, estimados para um intervalo de um mês a partir do período atual. Valores positivos indicam que, mesmo frente ao cenário projetado, os ativos atrelados ao respectivo fator de risco incorreriam em ganhos ao Instituto.

No mês atual, a maior exposição da Carteira é em IMA-B, com 67,82% de participação. Dado o cenário de estresse, haveria uma perda de R\$15.672.073,35 nos ativos atrelados a este índice.

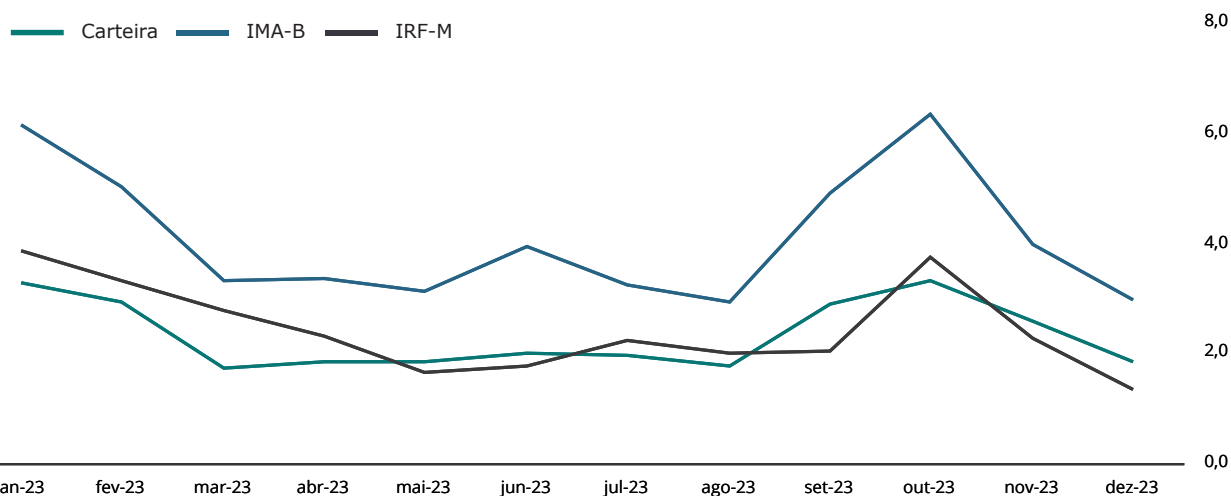
No cenário como um todo, o Instituto perderia R\$64.021.251,92, equivalente a uma queda de 1,71% no patrimônio investido.

Já o gráfico abaixo ilustra a trajetória da Volatilidade Mensal Anualizada da Carteira, em comparação com dois índices do mercado: o IRF-M, mais conservador, e o IMA-B, que apresenta volatilidade mais elevada.

Devido à relação intrínseca entre o risco e o retorno dos ativos, ao mesmo tempo que estar exposto a uma maior volatilidade traz a possibilidade de retornos mais elevados, aumenta-se também a exposição ao risco. Daí a importância de se manter uma Carteira diversificada, conforme a conjuntura do mercado.

VOLATILIDADE MENSAL ANUALIZADA (%)

Carteira IMA-B IRF-M



STRESS TEST (24 MESES)

FATORES DE RISCO	EXPOSIÇÃO	RESULTADOS DO CENÁRIO	
IRF-M	0,82%	-425.821,23	-0,01%
IRF-M	0,17%	-42.174,90	-0,00%
IRF-M 1	0,00%	0,00	0,00%
IRF-M 1+	0,00%	0,00	0,00%
Carência Pré	0,66%	-383.646,33	-0,01%
IMA-B	67,82%	-15.672.073,35	-0,42%
IMA-B	9,34%	-3.669.328,97	-0,10%
IMA-B 5	5,01%	-1.387.004,78	-0,04%
IMA-B 5+	8,09%	-5.903.974,57	-0,16%
Carência Pós	45,37%	-4.711.765,03	-0,13%
IMA GERAL	1,71%	-451.006,55	-0,01%
IDKA	0,00%	0,00	0,00%
IDkA 2 IPCA	0,00%	0,00	0,00%
IDkA 20 IPCA	0,00%	0,00	0,00%
Outros IDkA	0,00%	0,00	0,00%
FIDC	0,07%	-413.595,11	-0,01%
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	0,00%	0,00	0,00%
FUNDOS PARTICIPAÇÕES	1,55%	-3.312.550,02	-0,09%
FUNDOS DI	17,85%	-2.806.348,74	-0,07%
F. Crédito Privado	0,68%	150.981,10	0,00%
Fundos RF e Ref. DI	14,22%	3.711.033,71	0,10%
Multimercado	2,96%	-6.668.363,56	-0,18%
OUTROS RF	0,00%	0,00	0,00%
RENDA VARIÁVEL	10,18%	-40.939.856,90	-1,09%
Ibov., IBrX e IBrX-50	5,73%	-24.132.578,94	-0,64%
Governança Corp. (IGC)	0,00%	0,00	0,00%
Dividendos	1,94%	-7.033.458,51	-0,19%
Small Caps	0,09%	-503.810,22	-0,01%
Setorial	0,00%	0,00	0,00%
Outros RV	2,42%	-9.270.009,23	-0,25%
TOTAL	100,00%	-64.021.251,92	-1,71%

FUNDO	CNPJ	INVESTIDOR	RESGATE		OUTROS DADOS		
FUNDOS DE RENDA FIXA			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
BB FIC Previdenciário Fluxo	13.077.415/0001-05	Geral	D+0	D+0	1,00	Não há	Não há
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	03.543.447/0001-03	Geral	D+1	D+1	0,20	Não há	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	07.442.078/0001-05	Geral	D+1	D+1	0,20	Não há	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	13.327.340/0001-73	Geral	D+2	D+2	0,20	Não há	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	19.303.795/0001-35	Geral	D+0	D+0	0,20	15/08/2024	Não há
Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa	03.256.793/0001-00	Geral	D+0	D+0	0,15	Não há	Não há
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA Geral	08.246.318/0001-69	Geral	D+1	D+1	0,25	Não há	Não há
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B	08.702.798/0001-25	Geral	D+1	D+1	0,20	Não há	Não há
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5	20.216.216/0001-04	Geral	D+1	D+1	0,20	Não há	Não há
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5+	13.400.077/0001-09	Geral	D+1	D+1	0,20	Não há	Não há
Bradesco FIC Performance Inst. Crédito Privado	44.961.198/0001-45	Geral	D+4	D+5	0,00	Não há	Não há
Bradesco Institucional Renda Fixa IRF-M	18.085.876/0001-43	Geral	D+0	D+0	0,00	Não há	Não há
Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa	08.246.263/0001-97	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	03.399.411/0001-90	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	21.918.896/0001-62	Geral	D+0	D+0	0,20	1080 dias	Não há
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	18.598.288/0001-03	Geral	D+0	D+0	0,20	15/08/2024	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	10.740.658/0001-93	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	10.577.503/0001-88	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	Geral	D+0	D+0	0,80	Não há	Não há
Itaú FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa	21.838.150/0001-49	Geral	D+0	D+1	0,40	Não há	Não há
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	32.972.942/0001-28	Geral	D+0	D+1	0,50	Não há	20% exc CDI
Itaú FIC IMA-B 5+	14.437.684/0001-06	Geral	D+1	D+2	0,18	Não há	Não há
Itaú FIC Institucional IMA-B	10.474.513/0001-98	Geral	D+0	D+1	0,18	Não há	Não há
Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa	40.635.061/0001-40	Geral	D+0	D+1	0,50	Não há	20% exc CDI
Trend Cash FIC Simples	45.823.918/0001-79	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Vinci Institucional Referenciado	51.415.957/0001-30	Geral	D+0	D+0	0,15	Não há	Não há
Western Asset Ativo IMA-B	09.087.301/0001-79	Geral	D+0	D+1	0,50	Não há	Não há
Western Asset Ativo IMA-B 5	17.517.577/0001-78	Geral	D+0	D+1	0,40	Não há	Não há
Western Asset Soberano II Referenciado Selic	22.773.421/0001-98	Geral	D+0	D+0	0,15	Não há	Não há
Western Ativo Max	04.192.419/0001-43	Geral	D+0	D+1	0,80	Não há	Não há
Western Max Referenciado DI Renda Fixa	05.090.727/0001-20	Geral	D+0	D+0	0,15	Não há	Não há

FUNDO	CNPJ	INVESTIDOR	RESGATE		OUTROS DADOS		
FUNDOS DE RENDA FIXA			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	26.559.284/0001-44	Geral	D+0	D+0	0,15	Não há	Não há
XP Inflação Referenciado IPCA	14.146.491/0001-98	Geral	D+4	D+5	0,50	Não há	Não há
XP Trend Simples	32.893.503/0001-20	Geral	D+0	D+0	0,00	Não há	Não há
FUNDOS DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
BRPP FIDC Multisetorial Master	12.138.813/0001-21	Qualificado	Vide regulamento	No vencimento	0,38	180 dias	Vide regulamento
Vila Rica FIDC Multisetorial Itália	13.990.000/0001-28	Qualificado	Vide regulamento	No vencimento	0,39	No vencimento	Não há
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
BB FIA Governança	10.418.335/0001-88	Geral	D+1	D+3	1,00	Não há	Não há
BB FIC FIA Dividendos	05.100.191/0001-87	Geral	D+1	D+3	2,00	Não há	Não há
BB FIC FIA Seleção Fatorial	07.882.792/0001-14	Geral	D+1	D+3	1,00	Não há	20% exc Ibov
Bradesco FIA MID Small Cap	06.988.623/0001-09	Geral	D+1	D+3	1,50	Não há	Não há
Bradesco FIA Selection	03.660.879/0001-96	Geral	D+1	D+3	1,50	Não há	Não há
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX	14.099.976/0001-78	Geral	D+0	D+2	0,90	Não há	20% exc IBrX+2%aa
Caixa FIC FIA Valor Vinci Exp. Dividendos RPPS	15.154.441/0001-15	Geral	D+30	D+32	1,72	Não há	Não há
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	14.507.699/0001-95	Geral	D+21	D+23	1,72	Não há	Não há
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	08.817.414/0001-10	Geral	D+2	D+4	1,50	Não há	Não há
Occam FIC FIA	11.628.883/0001-03	Geral	D+15	D+17	2,00	Não há	20% exc Ibov
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	26.277.595/0001-10	Geral	D+30	D+32	2,90	Não há	Não há
Vinci FIA Fatorial Dinâmico	23.875.817/0001-09	Geral	D+5	D+7	1,00	Não há	20% exc Ibov
Vinci FIA Gas Dividendos	07.488.106/0001-25	Geral	D+30	D+32	1,97	Não há	20% exc Ibov
Vinci FIA Selection Equities	15.603.945/0001-75	Geral	D+60	D+62	0,97	Não há	20% exc Ibov
Western Asset FIA Valuation	09.087.523/0001-91	Geral	D+1	D+3	2,50	Não há	Não há
Western Asset FIC FIA Alpha IBrX	16.703.203/0001-84	Geral	D+0	D+2	0,75	Não há	20% exc IBrX
XP FIC FIA Investor 30	26.718.169/0001-75	Geral	D+30	D+32	2,00	Não há	20% exc Ibov
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
BB FIA ESG BDR Nível I	21.470.644/0001-13	Geral	D+1	D+4	0,50	Não há	Não há
BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior	31.964.961/0001-40	Qualificado	D+1	D+5	0,07	Não há	Não há
BB Schroder Multimercado IE	17.431.816/0001-72	Qualificado	D+1	D+5	0,08	Não há	Não há
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	18.085.924/0001-01	Qualificado	D+1	D+8	0,75	Não há	Não há
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	21.321.454/0001-34	Geral	D+1	D+4	0,80	Não há	Não há
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	17.502.937/0001-68	Geral	D+1	D+3	0,70	Não há	Não há
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	17.804.792/0001-50	Qualificado	D+1	D+8	1,00	Não há	Não há

FUNDO	CNPJ	INVESTIDOR	RESGATE		OUTROS DADOS		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	39.723.347/0001-06	Qualificado	D+3	D+8	0,60	Não há	Não há
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	19.587.174/0001-20	Qualificado	D+30	D+32	1,00	Não há	10% exc Dólar PTAX
Western Asset FIA BDR Nível I	19.831.126/0001-36	Geral	D+1	D+4	1,50	Não há	Não há
Western Macro Opportunities Multimercado IE	22.282.992/0001-20	Qualificado	D+1	D+5	0,10	Não há	Não há
XP FIC FIM Nordea Alfa 10 Advisory	39.818.102/0001-54	Qualificado	D+1	D+6	0,55	Não há	Não há
XP FIC Moneda Latam Credit Advisory Mult. IE	36.046.327/0001-41	Qualificado	D+1	D+6	0,70	Não há	Não há
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	33.913.562/0001-85	Qualificado	D+1	D+6	0,80	Não há	Não há
FUNDOS MULTIMERCADO			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
BB FIC Dinâmico Multimercado	13.079.634/0001-23	Geral	D+1	D+4	1,00	Não há	Não há
BB FIC Juros e Moedas Multimercado	06.015.368/0001-00	Geral	D+1	D+1	0,50	Não há	20% exc CDI
BB FIC Macro Multimercado	05.962.491/0001-75	Geral	D+1	D+1	1,00	Não há	Não há
Caixa Bolsa Americana Multimercado	30.036.235/0001-02	Geral	D+0	D+1	0,80	Não há	Não há
Itaú FIC Private Multimercado SP500	26.269.692/0001-61	Geral	D+0	D+1	0,80	Não há	Não há
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado	35.002.795/0001-51	Geral	D+9	D+10	1,90	Não há	20% exc CDI
Vinci Multiestratégia Multimercado	12.440.825/0001-06	Geral	D+0	D+1	0,96	Não há	20% exc CDI
Vinci Valorem Multimercado	13.396.703/0001-22	Geral	D+1	D+2	0,96	Não há	20% exc IMAB 5
Western Long Short Multimercado	07.672.392/0001-84	Geral	D+1	D+5	2,00	Não há	Não há
FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
BTG FIP Economia Real II	44.172.951/0001-13	Qualificado	No vencimento	No vencimento	2,10	No vencimento	20% exc IPCA+8%aa
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II	14.584.094/0001-06	Qualificado	D+0	D+0	2,00	No vencimento	20% exc IPCA+8%aa
BTG Pactual FIC FIP Principal Investments	11.998.505/0001-03	Qualificado	No vencimento	No vencimento	0,00	No vencimento	Vide regulamento
FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia	14.737.553/0001-36	Profissional	Vide regulamento	Vide regulamento	0,63	No vencimento	Vide regulamento
Kinea FIP Private Equity II	15.039.162/0001-00	Qualificado	Vide regulamento	Vide regulamento	0,00	No vencimento	20% exc IPCA+10%a.a.
Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.	27.782.774/0001-78	Qualificado	No vencimento	No vencimento	2,00	No vencimento	20% exc IPCA+6%aa
Kinea FIP Private Equity V Feeder Inst. I Mult.	41.745.796/0001-99	Qualificado	No Vencimento	No Vencimento	1,85	No Vencimento	20% exc IPCA+6%aa
Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III	17.870.798/0001-25	Qualificado	Vide regulamento	Vide regulamento	2,00	No vencimento	Vide regulamento

Considerando o patrimônio total do Instituto, seu prazo de resgate está dividido da seguinte maneira: 66,12% até 90 dias; 32,32% superior a 180 dias; os 1,55% restantes possuem regras mais específicas, ou não puderam ser medidos na data de publicação desse relatório.

APLICAÇÕES

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
01/12/2023	599.900,00	Aplicação	Western Asset Soberano II Referenciado Selic
04/12/2023	192,84	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
05/12/2023	1.899,72	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
06/12/2023	2.089,03	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
07/12/2023	2.800.364,57	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
07/12/2023	2.000.000,00	Aplicação	Western Asset Soberano II Referenciado Selic
08/12/2023	3.673,38	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
08/12/2023	1.500.000,00	Aplicação	Western Asset Soberano II Referenciado Selic
12/12/2023	8.958,34	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
13/12/2023	11.106.630,29	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
14/12/2023	40.143.888,42	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
15/12/2023	30.299.449,00	Aplicação	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
15/12/2023	2.434,94	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
15/12/2023	1.699.053,43	Aplicação	BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B
15/12/2023	34.009,19	Aplicação	Caixa FIC Brasil Disponibilidades
18/12/2023	589.773,73	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
19/12/2023	119.676,53	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
19/12/2023	217.475,34	Aplicação	BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B
19/12/2023	23.650.897,19	Aplicação	Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa
20/12/2023	1.778,16	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
20/12/2023	9.250.000,00	Aplicação	Western Max Referenciado DI Renda Fixa
21/12/2023	414.982,16	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
28/12/2023	661.892,06	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
28/12/2023	5.000.000,00	Aplicação	Western Asset Soberano II Referenciado Selic

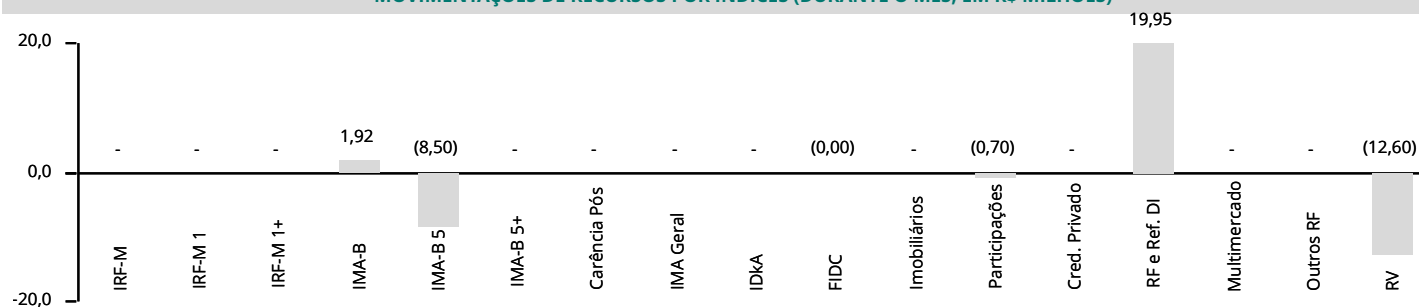
RESGATES

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
01/12/2023	28.528,67	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
04/12/2023	6.158,28	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
05/12/2023	880.000,00	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
05/12/2023	52.173,64	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
05/12/2023	3.251,64	Amortização	BRPP FIDC Multisetorial Master
06/12/2023	2.105,05	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
06/12/2023	2.000.000,00	Resgate	Western Asset Ativo IMA-B 5
07/12/2023	15.987,37	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
07/12/2023	8.198.324,43	Venda	LTN 01/01/2026 (Compra em 25/07/2023) 000075647
07/12/2023	1.500.000,00	Resgate	Western Asset Ativo IMA-B 5
08/12/2023	1.445.359,89	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
11/12/2023	29.943,33	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
13/12/2023	10.300.544,39	Rg. Total	BB FIC FIA Bolsa Brasileira
13/12/2023	3.277,59	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
14/12/2023	175.000,00	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
14/12/2023	14.000.000,00	Resgate	XP FIC Trend Pós-Fixado Simples
15/12/2023	21.591.485,46	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
19/12/2023	250.000,00	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
19/12/2023	34.972.882,30	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
19/12/2023	15.289,35	Resgate	Caixa FIC Brasil Disponibilidades
20/12/2023	34.289,27	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
20/12/2023	1.596.386,88	Rg. Total	Morgan Stanley FIC FIA Global Brands Advisory IE
20/12/2023	509.861,53	Rg. Total	Wellington Ventura FIC FIA Dólar Advisory IE
20/12/2023	9.250.000,00	Resgate	Western Asset Soberano II Referenciado Selic
20/12/2023	188.337,59	Rg. Total	XP FIC FIA J China Equity Dolar Advisory IE
21/12/2023	500.000,00	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
21/12/2023	3.270,22	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo

TOTALIZAÇÃO DAS MOVIMENTAÇÕES

Aplicações	130.109.018,32
Resgates	138.238.425,29
Saldo	8.129.406,97

MOVIMENTAÇÕES DE RECURSOS POR ÍNDICES (DURANTE O MÊS, EM R\$ MILHÕES)



APLICAÇÕES

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
------	-------	-----------	-------

RESGATES

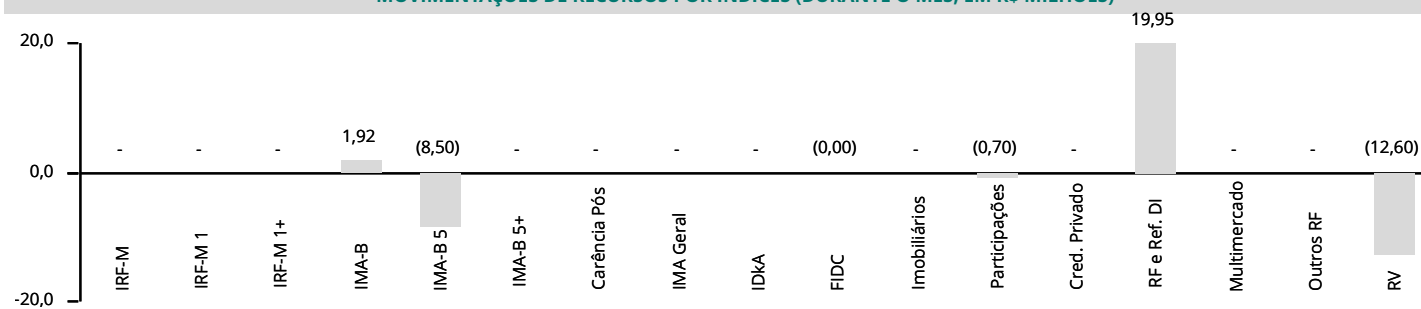
DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
------	-------	-----------	-------

22/12/2023	22.185,35	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
22/12/2023	1.259.930,44	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
26/12/2023	6.644,74	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
27/12/2023	3.221,26	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
27/12/2023	5.000.000,00	Resgate	Western Asset Ativo IMA-B 5
28/12/2023	2.660,40	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
28/12/2023	23.650.897,19	Resgate	Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa
28/12/2023	17.645,53	Resgate	Caixa FIC Brasil Disponibilidades
28/12/2023	701.233,29	Amortização	Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III
29/12/2023	21.550,21	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo

TOTALIZAÇÃO DAS MOVIMENTAÇÕES

Aplicações	130.109.018,32
Resgates	138.238.425,29
Saldo	8.129.406,97

MOVIMENTAÇÕES DE RECURSOS POR ÍNDICES (DURANTE O MÊS, EM R\$ MILHÕES)



PATRIMÔNIO DOS GESTORES DE RECURSOS

GESTOR	CNPJ	ART. 21	PATRIMÔNIO SOB GESTÃO	% PARTICIPAÇÃO	
BB Gestão DTVM	30.822.936/0001-69	Sim	1.527.440.526.850,00	0,05	✓
BRAM	62.375.134/0001-44	Sim	655.854.986.997,33	0,05	✓
BRPP Estruturados	22.119.959/0001-83	Não	63.418.894.082,84	0,00	✓
BRZ Investimentos	02.888.152/0001-06	Não	2.573.863.706,57	0,09	✓
BTG Pactual Gestora	09.631.542/0001-37	Não	351.626.820.926,71	0,00	✓
Caixa DTVM	42.040.639/0001-40	Não	500.848.247.751,43	0,04	✓
Itaú DTVM	33.311.713/0001-25	Sim	868.537.342.541,52	0,01	✓
Itaú Unibanco	60.701.190/0001-04	Sim	868.537.342.541,52	0,00	✓
Itaú Unibanco Asset	40.430.971/0001-96	Não	868.537.342.541,52	0,02	✓
Kinea Private Equity	04.661.817/0001-61	Não	131.942.001.854,72	0,04	✓
Occam Brasil Gestão	27.916.161/0001-86	Não	4.876.790.972,00	0,24	✓
Pátria Investimentos	12.461.756/0001-17	Não	46.858.608.739,86	0,01	✓
Santander Asset	10.231.177/0001-52	Não	325.908.101.920,19	0,01	✓
Truxt Investimentos	23.890.968/0001-36	Não	7.483.330.865,67	0,02	✓
Vila Rica Capital	14.751.574/0001-06	Não	601.608.518,82	0,45	✓
Vinci Equities	10.917.835/0001-64	Não	50.453.746.645,06	0,02	✓
Vinci Soluções	13.421.810/0001-63	Não	50.453.746.645,06	0,09	✓
Vinci Gestora	11.077.576/0001-73	Não	50.453.746.645,06	0,07	✓
Western Asset	07.437.241/0001-41	Não	35.976.787.678,10	0,49	✓
XP Allocation Asset Management	37.918.829/0001-88	Não	164.022.317.216,36	0,04	✓
XP Gestão	07.625.200/0001-89	Não	164.022.317.216,36	0,00	✓
XP Vista	16.789.525/0001-98	Não	164.022.317.216,36	0,01	✓

Obs.: Patrimônio em 11/2023, o mais recente divulgado pela Anbima na data de publicação desse relatório.

O % Participação denota o quanto o RPPS detém do PL do Gestor, sendo limitado a 5% pelo Art. 20. O Art. 21 indica se a instituição atende ao disposto no inciso I do parágrafo 2º, sendo necessário que ou o gestor ou o administrador do fundo respeite a regra.

INVESTIMENTOS POR GESTOR DE RECURSOS

BB Gestão DTVM - 30.822.936/0001-69	21,68%
BRAM - 62.375.134/0001-44	9,17%
Caixa DTVM - 42.040.639/0001-40	5,47%
Western Asset - 07.437.241/0001-41	4,74%
Itaú Unibanco Asset - 40.430.971/0001-96	4,35%
Vinci Soluções - 13.421.810/0001-63	1,75%
XP Allocation Asset Management - 37.918.829/0001-88	1,72%
Itaú DTVM - 33.311.713/0001-25	1,66%
Kinea Private Equity - 04.661.817/0001-61	1,32%
Vinci Gestora - 11.077.576/0001-73	0,88%
Santander Asset - 10.231.177/0001-52	0,59%
Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	0,45%
XP Vista - 16.789.525/0001-98	0,34%
Occam Brasil Gestão - 27.916.161/0001-86	0,32%
Vinci Equities - 10.917.835/0001-64	0,27%
Pátria Investimentos - 12.461.756/0001-17	0,15%
Vila Rica Capital - 14.751.574/0001-06	0,07%
BRZ Investimentos - 02.888.152/0001-06	0,06%
Truxt Investimentos - 23.890.968/0001-36	0,04%
BTG Pactual Gestora - 09.631.542/0001-37	0,02%
XP Gestão - 07.625.200/0001-89	0,01%
BRPP Estruturados - 22.119.959/0001-83	0,00%

INVESTIMENTOS POR ADMINISTRADOR DE RECURSOS

BB Gestão DTVM - 30.822.936/0001-69	21,68%
Banco Bradesco - 60.746.948/0001-12	8,22%
Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	6,45%
BNP Paribas Banco - 01.522.368/0001-82	5,56%
Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-04	5,47%
BEM DTVM - 00.066.670/0001-00	3,90%
Lions Trust - 15.675.095/0001-10	1,25%
XP Investimentos - 02.332.886/0001-04	0,91%
Banco Santander - 90.400.888/0001-42	0,59%
Santander Caceis - 62.318.407/0001-19	0,34%
BTG Pactual SF DTVM - 59.281.253/0001-23	0,28%
BRL Trust Investimentos - 23.025.053/0001-62	0,15%
Intrag DTVM - 62.418.140/0001-31	0,10%
BRL Trust - 13.486.793/0001-42	0,07%
Daycoval Banco - 62.232.889/0001-90	0,06%
Genial Investimentos - 27.652.684/0001-62	0,00%

FUNDOS	CNPJ	ENQ.	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	ART. 18	ART. 19	ART. 21	GESTOR	ADMINISTRADOR	STATUS
FUNDOS DE RENDA FIXA									
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	7, III, a	16.475.113.370,57	4,14	0,94	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC Previdenciário Fluxo	13.077.415/0001-05	7, III, a	4.049.178.389,19	0,72	0,67	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	03.543.447/0001-03	7, I, b	5.230.672.087,91	1,18	0,84	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	07.442.078/0001-05	7, I, b	5.283.374.941,87	6,38	4,52	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	13.327.340/0001-73	7, I, b	1.649.727.443,32	5,30	12,04	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	19.303.795/0001-35	7, I, b	192.522.932,52	0,08	1,51	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa	03.256.793/0001-00	7, III, a	10.724.175.764,47	1,60	0,56	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA Geral	08.246.318/0001-69	7, III, a	197.135.861,50	0,62	11,84	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B	08.702.798/0001-25	7, III, a	543.399.103,62	0,73	5,04	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5	20.216.216/0001-04	7, III, a	887.568.400,13	0,87	3,68	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5+	13.400.077/0001-09	7, III, a	162.031.359,07	0,41	9,57	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco FIC Performance Inst. Crédito Privado	44.961.198/0001-45	7, V, b	536.534.004,79	0,48	3,39	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco Institucional Renda Fixa IRF-M	18.085.876/0001-43	7, III, a	654.634.469,16	0,17	0,96	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa	08.246.263/0001-97	7, III, a	469.591.631,13	0,00	0,00	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	03.399.411/0001-90	7, III, a	10.327.922.782,38	3,16	1,15	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	21.918.896/0001-62	7, V, b	223.010.176,10	0,19	3,21	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	7, III, a	13.988.008.512,08	0,03	0,01	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	18.598.288/0001-03	7, I, b	499.145.687,94	1,00	7,48	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	10.740.658/0001-93	7, I, b	5.157.397.073,53	1,09	0,79	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	10.577.503/0001-88	7, I, b	1.451.468.758,30	0,89	2,30	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	7, III, a	959.626.212,50	0,00	0,00	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Itaú FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa	21.838.150/0001-49	7, I, b	2.287.059.745,87	1,09	1,78	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	32.972.942/0001-28	7, III, a	2.357.597.914,23	0,57	0,91	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Itaú FIC IMA-B 5+	14.437.684/0001-06	7, I, b	399.333.268,42	1,49	13,96	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Itaú FIC Institucional IMA-B	10.474.513/0001-98	7, I, b	275.179.124,16	0,45	6,19	Sim	60.701.190/0001-04	60.701.190/0001-04	✓
Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa	40.635.061/0001-40	7, III, a	1.263.321.327,45	0,43	1,26	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Trend Cash FIC Simples	45.823.918/0001-79	7, III, a	740.554.017,05	0,02	0,11	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
Vinci Institucional Referenciado	51.415.957/0001-30	7, III, a	93.859.145,41	0,03	1,08	Sim	13.421.810/0001-63	00.066.670/0001-00	✓
Western Asset Ativo IMA-B	09.087.301/0001-79	7, I, b	182.650.754,21	0,69	14,20	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
Western Asset Ativo IMA-B 5	17.517.577/0001-78	7, I, b	407.363.346,59	1,55	14,26	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
Western Asset Soberano II Referenciado Selic	22.773.421/0001-98	7, I, b	302.096.985,91	0,73	9,04	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
Western Ativo Max	04.192.419/0001-43	7, I, b	54.212.100,88	0,21	14,41	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
Western Max Referenciado DI Renda Fixa	05.090.727/0001-20	7, III, a	687.312.062,65	0,85	4,64	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓

FUNDOS	CNPJ	ENQ.	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	ART. 18	ART. 19	ART. 21	GESTOR	ADMINISTRADOR	STATUS
FUNDOS DE RENDA FIXA									
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	26.559.284/0001-44	7, I, b	9.468.179.494,45	0,02	0,01	Sim	37.918.829/0001-88	02.332.886/0001-04	✓
XP Inflação Referenciado IPCA	14.146.491/0001-98	7, III, a	306.688.027,12	0,34	4,17	Sim	16.789.525/0001-98	62.318.407/0001-19	✓
XP Trend Simples	32.893.503/0001-20	7, I, b	3.905.761.101,41	0,88	0,85	Sim	37.918.829/0001-88	02.332.886/0001-04	✓
FUNDOS DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS									
BRPP FIDC Multisetorial Master	12.138.813/0001-21	7, V, a	1.146.467,50	0,00	3,51	Não	22.119.959/0001-83	27.652.684/0001-62	✓
Vila Rica FIDC Multisetorial Itália	13.990.000/0001-28	7, V, a	59.586.252,16	0,07	4,49	Não	14.751.574/0001-06	13.486.793/0001-42	✓
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL									
BB FIA Governança	10.418.335/0001-88	8, I	783.566.811,58	0,08	0,39	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC FIA Dividendos	05.100.191/0001-87	8, I	613.943.691,61	1,50	9,17	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC FIA Seleção Fatorial	07.882.792/0001-14	8, I	1.502.801.211,89	0,18	0,45	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
Bradesco FIA MID Small Cap	06.988.623/0001-09	8, I	751.899.438,06	0,09	0,44	Sim	62.375.134/0001-44	00.066.670/0001-00	✓
Bradesco FIA Selection	03.660.879/0001-96	8, I	454.422.244,72	0,21	1,77	Sim	62.375.134/0001-44	00.066.670/0001-00	✓
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX	14.099.976/0001-78	8, I	433.284.788,24	0,64	5,56	Sim	62.375.134/0001-44	00.066.670/0001-00	✓
Caixa FIC FIA Valor Vinci Exp. Dividendos RPPS	15.154.441/0001-15	8, I	1.019.487.668,90	0,36	1,31	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	14.507.699/0001-95	8, I	716.164.953,12	0,37	1,91	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	08.817.414/0001-10	8, I	448.886.802,94	1,66	13,83	Sim	33.311.713/0001-25	60.701.190/0001-04	✓
Occam FIC FIA	11.628.883/0001-03	8, I	808.496.565,25	0,32	1,47	Sim	27.916.161/0001-86	00.066.670/0001-00	✓
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	26.277.595/0001-10	8, I	606.896.061,56	0,04	0,25	Sim	23.890.968/0001-36	62.418.140/0001-31	✓
Vinci FIA Fatorial Dinâmico	23.875.817/0001-09	8, I	118.033.981,81	0,19	6,00	Sim	10.917.835/0001-64	00.066.670/0001-00	✓
Vinci FIA Gas Dividendos	07.488.106/0001-25	8, I	603.298.928,02	0,08	0,49	Sim	10.917.835/0001-64	00.066.670/0001-00	✓
Vinci FIA Selection Equities	15.603.945/0001-75	8, I	587.275.120,11	0,57	3,64	Sim	13.421.810/0001-63	00.066.670/0001-00	✓
Western Asset FIA Valuation	09.087.523/0001-91	8, I	55.817.674,92	0,09	5,88	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
Western Asset FIC FIA Alpha IBrX	16.703.203/0001-84	8, I	33.115.432,66	0,07	7,41	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
XP FIC FIA Investor 30	26.718.169/0001-75	8, I	219.816.584,01	0,01	0,15	Sim	07.625.200/0001-89	02.332.886/0001-04	✓
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR									
BB FIA ESG BDR Nível I	21.470.644/0001-13	9, III	1.297.128.287,58	0,48	1,38	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior	31.964.961/0001-40	9, II	372.322.461,18	0,72	7,26	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Schroder Multimercado IE	17.431.816/0001-72	9, II	505.522.079,05	0,10	0,74	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	18.085.924/0001-01	9, II	317.508.554,85	0,05	0,55	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	21.321.454/0001-34	9, III	115.913.238,93	0,12	4,03	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	17.502.937/0001-68	9, III	1.995.875.754,00	0,58	1,09	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	17.804.792/0001-50	9, II	593.311.643,56	0,59	3,70	Sim	10.231.177/0001-52	90.400.888/0001-42	✓

FUNDOS	CNPJ	ENQ.	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	ART. 18	ART. 19	ART. 21	GESTOR	ADMINISTRADOR	STATUS
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR									
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	39.723.347/0001-06	9, II	167.780.219,50	0,12	2,74	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	19.587.174/0001-20	9, II	104.590.537,78	0,08	2,88	Sim	13.421.810/0001-63	59.281.253/0001-23	✓
Western Asset FIA BDR Nível I	19.831.126/0001-36	9, III	1.398.458.692,08	0,30	0,79	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
Western Macro Opportunities Multimercado IE	22.282.992/0001-20	9, II	176.841.238,90	0,25	5,29	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
XP FIC FIM Nordea Alfa 10 Advisory	39.818.102/0001-54	9, II	20.468.799.680,00	0,11	0,02	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
XP FIC Moneda Latam Credit Advisory Mult. IE	36.046.327/0001-41	9, II	720.579.092,00	0,08	0,40	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	33.913.562/0001-85	9, II	687.792.180,37	0,49	2,69	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
FUNDOS MULTIMERCADO									
BB FIC Dinâmico Multimercado	13.079.634/0001-23	10, I	217.507.617,24	0,04	0,77	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC Juros e Moedas Multimercado	06.015.368/0001-00	10, I	15.341.869.223,01	0,74	0,18	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC Macro Multimercado	05.962.491/0001-75	10, I	1.778.520.210,33	0,05	0,11	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
Caixa Bolsa Americana Multimercado	30.036.235/0001-02	10, I	1.635.814.462,49	0,97	2,22	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Itaú FIC Private Multimercado SP500	26.269.692/0001-61	10, I	1.210.908.559,23	0,77	2,39	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado	35.002.795/0001-51	10, I	68.989.621,35	0,18	9,61	Sim	11.077.576/0001-73	59.281.253/0001-23	✓
Vinci Multiestratégia Multimercado	12.440.825/0001-06	10, I	290.339.004,24	0,70	9,06	Sim	11.077.576/0001-73	00.066.670/0001-00	✓
Vinci Valorem Multimercado	13.396.703/0001-22	10, I	1.434.785.250,36	1,07	2,80	Sim	13.421.810/0001-63	00.066.670/0001-00	✓
Western Long Short Multimercado	07.672.392/0001-84	10, I	13.960.545,72	0,01	3,03	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES									
BTG FIP Economia Real II	44.172.951/0001-13	10, II	121.486.735,32	0,02	0,52	Sim	09.631.542/0001-37	59.281.253/0001-23	✓
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II	14.584.094/0001-06	10, II	21.357.102,41	0,00	0,66	Sim	09.631.542/0001-37	59.281.253/0001-23	✓
BTG Pactual FIC FIP Principal Investments	11.998.505/0001-03	10, II	5.014.083,27	0,00	1,47	Sim	09.631.542/0001-37	62.318.407/0001-19	✓
FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia	14.737.553/0001-36	10, II	260.279.963,34	0,06	0,89	Sim	02.888.152/0001-06	62.232.889/0001-90	✓
Kinea FIP Private Equity II	15.039.162/0001-00	10, II	162.087.615,73	0,05	1,24	Não	04.661.817/0001-61	15.675.095/0001-10	✓
Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.	27.782.774/0001-78	10, II	358.694.887,42	1,20	12,54	Não	04.661.817/0001-61	15.675.095/0001-10	✓
Kinea FIP Private Equity V Feeder Inst. I Mult.	41.745.796/0001-99	10, II	128.013.637,29	0,06	1,83	Sim	04.661.817/0001-61	62.418.140/0001-31	✓
Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III	17.870.798/0001-25	10, II	130.571.272,90	0,15	4,19	Não	12.461.756/0001-17	23.025.053/0001-62	✓

Art. 18 retrata o percentual do PL do RPPS que está aplicado no fundo, cujo limite é de 20%. Art. 19 denota o percentual do PL do fundo que o RPPS detém, sendo limitado a 5% em fundos enquadrados no Art. 7 V, e de 15% para os demais. Ambos os Art. 18 e 19 não se aplicam aos fundos enquadrados no Art. 7 I. Art. 21 aponta se o administrador ou o gestor atende às exigências, estando destacado o CNPJ da instituição caso ela não atenda.

POR SEGMENTO

ENQUADRAMENTO	SALDO EM R\$	% CARTEIRA	% LIMITE RESOLUÇÃO		% LIMITE PI 2023	
7, I	2.547.937.972,20	67,97	100,0	✓	100,0	✓
7, I, a	1.685.073.520,81	44,95	100,0	✓	100,0	✓
7, I, b	862.864.451,39	23,02	100,0	✓	100,0	✓
7, I, c	-	0,00	100,0	✓	100,0	✓
7, II	-	0,00	5,0	✓	5,0	✓
7, III	550.826.475,08	14,69	75,0	✓	70,0	✓
7, III, a	550.826.475,08	14,69	75,0	✓	70,0	✓
7, III, b	-	0,00	75,0	✓	70,0	✓
7, IV	-	0,00	20,0	✓	20,0	✓
7, V	28.032.459,82	0,75	30,0	✓	25,0	✓
7, V, a	2.717.654,67	0,07	15,0	✓	10,0	✓
7, V, b	25.314.805,15	0,68	15,0	✓	10,0	✓
7, V, c	-	0,00	15,0	✓	10,0	✓
ART. 7	3.126.796.907,10	83,41	100,0	✓	100,0	✓
8, I	241.680.408,67	6,45	45,0	✓	40,0	✓
8, II	-	0,00	45,0	✓	40,0	✓
ART. 8	241.680.408,67	6,45	45,0	✓	40,0	✓
9, I	-	0,00	10,0	✓	10,0	✓
9, II	96.866.700,06	2,58	10,0	✓	10,0	✓
9, III	55.414.182,63	1,48	10,0	✓	10,0	✓
ART. 9	152.280.882,69	4,06	10,0	✓	10,0	✓
10, I	169.840.307,94	4,53	15,0	✓	10,0	✓
10, II	57.955.545,27	1,55	10,0	✓	5,0	✓
10, III	-	0,00	10,0	✓	5,0	✓
ART. 10	227.795.853,21	6,08	20,0	✓	15,0	✓
ART. 11	-	0,00	15,0	✓	10,0	✓
ART. 12	-	0,00	10,0	✓	10,0	✓
ART. 8, 10 E 11	469.476.261,88	12,52	50,0	✓	40,0	✓
PATRIMÔNIO INVESTIDO	3.748.554.051,67					

Obs.: Para fins de enquadramento, são desconsideradas as disponibilidades financeiras mantidas em conta corrente e poupança.

PRÓ GESTÃO

O IPREVILLE comprovou adoção de melhores práticas de gestão previdenciária à Secretaria de Previdência, ao NÍVEL III de aderência na forma por ela estabelecidos.

PARECER SOBRE ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA

- ✓ Enquadrada em relação à Resolução CMN 4.963/2021.
- ✓ Enquadrada em relação à Política de Investimento vigente.
- ✓ O administrador e o gestor dos fundos devem atender ao disposto no parágrafo 2º do Art. 21 da Resolução CMN 4.963/2021. Entretanto, o parágrafo 9º do referido artigo estipula que tais requisitos devem ser observados no momento da aplicação. Assim sendo, os fundos que estiverem irregulares, mas cujo aporte seja anterior a 03/01/2022, podem ser mantidos na carteira com status de enquadrados.

O mercado permaneceu otimista em dezembro, principalmente, devido à confirmação do fim do ciclo de alta de juros pelo Federal Reserve (Fed). Toda a construção de um cenário mais benigno nos Estados Unidos promoveu uma queda nos juros dos títulos públicos americanos e uma recuperação dos ativos de risco a nível mundial.

A economia dos Estados Unidos seguiu a trajetória de resiliência com melhores resultados nos indicadores. A apuração oficial do Produto Interno Bruto (PIB) do terceiro trimestre apresentou um crescimento de 4,9%. Em consonância, o relatório Payroll também mostrou essa força econômica com a criação de 199 mil postos de trabalho em novembro e contrariou os relatórios ADP e Jolts, que evidenciavam um enfraquecimento do mercado de trabalho. Essa conjuntura está em linha com as declarações dos diretores do Federal Reserve de que conseguiriam promover um pouso suave, isto é, controlar a inflação sem trazer grandes custos para a economia.

Ainda que se observe uma economia aquecida, a inflação americana permanece com tendência de queda. Tanto o Índice de Preços ao Consumidor (CPI), quanto o Índice de Preços para Despesas Pessoais (PCE) e seus núcleos vem apresentando um bom comportamento de desaceleração. O Federal Reserve acredita ser prudente manter as taxas de juros entre 5,25% e 5,50%, mas a parte otimista foi a contratação de redução dos juros em 2024. O presidente do Fed, Jerome Powell, também reconheceu que os juros chegaram no patamar ideal e que o foco da autoridade monetária começa a mudar, a fim de afastar a economia de uma recessão em geral.

Na Zona do Euro, a atividade econômica permanece deteriorada. O PIB do terceiro trimestre consolidou os resultados preliminares e caiu 0,1%. Em contrapartida, o número de pessoas empregadas cresceu 0,2%, evidenciando uma resiliência do mercado de trabalho e consequentemente, uma persistência inflacionária.

Apesar da tendência de desaceleração da variação dos preços, a preocupação com a inflação deriva do setor de serviços, seguido de alimentos. Na base anual a inflação registrou uma variação de 2,4%. Ainda que tenha apresentado uma queda de 0,6% e esteja perto da meta de 2%, o Banco Central Europeu mantém uma postura mais cautelosa. Contudo, o mercado projetava um cenário mais otimista com uma antecipação do início da queda dos juros no primeiro trimestre do próximo ano.

Na China, os indicadores de atividade econômica apresentaram resultados mistos. Os dados divulgados pelo Caixin mostraram uma evolução da indústria e serviços, ao contrário dos resultados da S&P Global. No entanto, é relevante expor que a pesquisa de Caixin difere dos dados do governo, pois se concentra mais nas empresas privadas menores do que nas grandes empresas estatais. Há a possibilidade de que as medidas de estímulos do governo estejam sendo eficientes, mas ainda existe espaço para mais incentivos a fim de consolidar uma recuperação econômica saudável nos próximos meses.

O CPI chinês recuou novamente em novembro e continua demonstrando uma demanda local enfraquecida. O índice caiu 0,5% em comparação ao mesmo mês do ano anterior e 0,2% comparado a outubro. Ainda assim, o Banco Popular da China permaneceu com a decisão de manter a taxa básica de juros de referência em 3,45% para um ano e 4,20% para cinco anos.

No Brasil, o principal sinal observado foi a entrada de dólares no país, uma vez que a conjuntura econômica está atrativa dentre os mercados emergentes. As melhores condições econômicas proporcionaram a manutenção da estratégia do Banco Central em reduzir a taxa de juros em 0,50 ponto percentual nas próximas reuniões. No entanto, existem dois fatores que podem alterar a estratégia do Copom, a desaceleração da economia e a dinâmica fiscal com suas possíveis alterações nas expectativas de inflação.

O campo fiscal foi agitado dada a necessidade de aprovar importantes medidas para elevar a arrecadação e promover a tentativa de equilíbrio das contas públicas. O Congresso aprovou a tributação de apostas esportivas e a subvenção do ICMS, projetos que podem aumentar a receita do governo em aproximadamente R\$ 37 bilhões. Mesmo que esse montante não seja suficiente para atingir a meta estipulada na Lei de Diretrizes Orçamentárias de 2024, é um grande passo para os objetivos almejados pela equipe econômica do governo. Outro importante projeto que seguiu adiante foi a promulgação da Reforma Tributária que contribuiu para um ambiente político mais favorável para os investimentos.

Sobre os dados econômicos, o PIB do terceiro trimestre surpreendeu o mercado com um crescimento de 0,1%, contra uma expectativa de recuo das atividades. De janeiro a setembro, o PIB acumulou alta de 3,2% na comparação com o mesmo período do ano passado. Esse resultado é justificado pelo crescimento marginal da indústria e serviços pela ótica da oferta, mas com queda na agropecuária.

Pela ótica da demanda, ocorreu um aumento de consumo das famílias e do governo devido à transferência de renda, melhoria do mercado de trabalho e um processo desinflacionário. No entanto, os investimentos recuam pela quarta vez e comprometem as expectativas de um crescimento saudável no longo prazo.

Os dados mistos das atividades, em que indústria cresceu marginalmente, enquanto serviços e varejo recuaram em outubro mostraram a perda de dinamismo da economia, com menores expectativas de produção agropecuária e queda do consumo. O aperto monetário está mais presente na economia e reforça a necessidade de o Copom avaliar a condução monetária nos próximos meses.

Outra evidência de enfraquecimento da economia pode ser observada no Índice de Atividade Econômica (IBC-Br) que caiu 0,06% em outubro, sinalizando maior possibilidade de um PIB mais debilitado no quarto trimestre. Em contrapartida, o Monitor do PIB-FGV apontou um crescimento de 0,1% no mesmo mês de referência.

Apesar da tendência de enfraquecimento da economia, o mercado de trabalho encontra-se resiliente. Em novembro, foram geradas cerca de 130 mil novas vagas com elevação do salário. O crescimento do emprego formal ocorreu no setor de serviços e comércio, em detrimento da perda de trabalhadores na indústria. Diante dessas informações, a taxa de desocupação do país chegou a 7,5% no trimestre encerrado em novembro, com aumento da população ocupada, tanto nos empregos formais quanto nos informais.

Assim como novembro, o mês de dezembro manteve uma melhor percepção do cenário econômico. Os melhores dados dos Estados Unidos e o comunicado do presidente do Fed, Jerome Powell, a respeito do processo de queda dos juros foram as notícias que consolidaram o otimismo dos investidores. No mercado local, a aprovação de algumas medidas que irão aumentar a arrecadação em 2024 pelo Congresso, também foi responsável pela propensão ao risco. As bolsas encerraram no campo positivo, os juros de longo prazo recuaram e o real se valorizou em relação ao dólar.