

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS AGOSTO - 2023



Carteira Consolidada

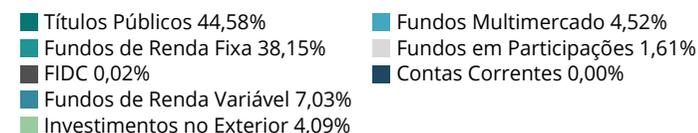
Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos do Município de Joinville - SC



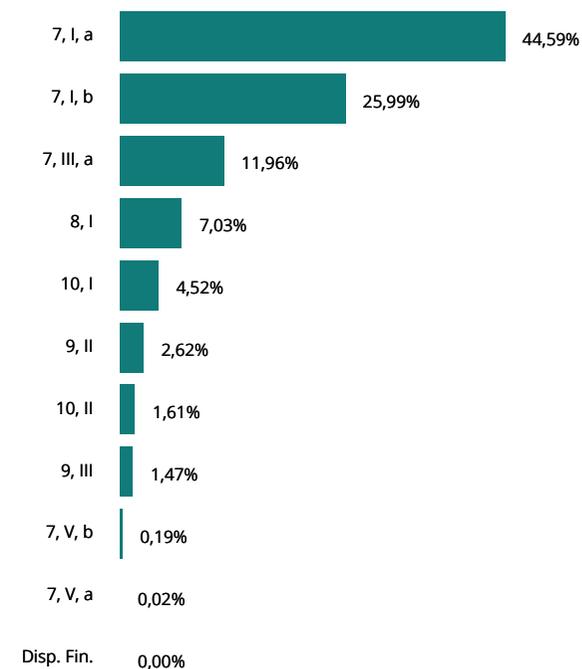
Distribuição da Carteira	3
Retorno da Carteira por Ativo	10
Rentabilidade da Carteira (em %)	18
Rentabilidade e Risco dos Ativos	19
Análise do Risco da Carteira	26
Liquidez e Custos das Aplicações	28
Movimentações	31
Enquadramento da Carteira	35
Comentários do Mês	40

ATIVOS	%	AGOSTO	JULHO
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	14,5%	523.693.658,93	524.411.772,08
LFT 01/03/2024 (Compra em 17/02/2023)	0,0%	989.410,34	978.221,28
LFT 01/03/2024 (Compra em 21/11/2022)	0,0%	961.926,72	951.048,46
LFT 01/03/2025 (Compra em 06/03/2023)	0,0%	1.154.230,11	1.140.962,56
LFT 01/03/2025 (Compra em 18/05/2020)	0,0%	769.486,74	760.641,71
LFT 01/03/2026 (Compra em 17/05/2023)	0,2%	6.245.964,79	6.170.031,95
LFT 01/09/2024 (Compra em 06/12/2018)	0,0%	54.967,30	54.342,96
LFT 01/09/2024 (Compra em 18/11/2019)	0,0%	687.091,20	679.287,05
LFT 01/09/2025 (Compra em 16/05/2023)	0,2%	5.509.738,55	5.446.029,64
LTN 01/01/2024 (Compra em 13/12/2021)	0,0%	962,78	951,77
LTN 01/01/2026 (Compra em 04/10/2022) 0000742A5	0,2%	7.963.484,25	7.905.031,30
LTN 01/01/2026 (Compra em 25/07/2023) 000075647	0,3%	12.144.313,48	12.055.172,73
LTN 01/01/2026 (Compra em 28/07/2023) 00007565E	0,2%	6.370.787,40	6.324.025,04
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 14/06/2023) 005D3D3	0,4%	15.386.299,16	15.254.107,27
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 17/05/2021) 312733	0,2%	6.345.737,90	6.291.218,28
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 02/09/2022) 00565EE	0,6%	21.546.849,29	21.456.873,50
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 05/10/2022) 00575E2	0,1%	2.154.684,93	2.145.687,35
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 09/09/2022) 00569CA	0,6%	21.546.849,29	21.456.873,50
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 17/08/2022) 352262	0,3%	10.342.487,66	10.299.299,28
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 19/08/2022) 00560B1	0,1%	3.878.432,87	3.862.237,23
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 26/09/2022) 0056FDF	0,1%	4.309.369,86	4.291.374,70
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 02/01/2019)	0,0%	309.512,09	311.565,27
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 03/06/2020)	0,1%	4.421.601,24	4.450.932,39
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 07/07/2023) 005DD3D	0,4%	13.264.803,71	13.352.797,16
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 10/05/2019)	0,1%	4.598.465,29	4.628.969,68
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 11/01/2019)	0,0%	1.224.783,54	1.232.908,27
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 13/05/2022) 343941	0,1%	2.874.040,80	2.893.106,05
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 16/08/2019)	0,0%	1.034.654,69	1.041.518,18
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 17/08/2022) 352264	0,1%	3.758.361,05	3.783.292,53
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 18/02/2020)	0,0%	1.193.832,33	1.201.751,74
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 21/11/2018)	0,1%	4.421.601,24	4.450.932,39
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 25/07/2023) 005E442	0,8%	29.624.728,29	29.821.246,98
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/10/2017)	0,3%	9.723.101,12	9.787.600,30
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 04/10/2022) 0057548	0,6%	19.893.371,89	20.207.658,29
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/07/2022) 349638	0,0%	663.112,40	673.588,61
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/11/2022) 00587CF	0,1%	3.315.561,98	3.367.943,05

POR SEGMENTO

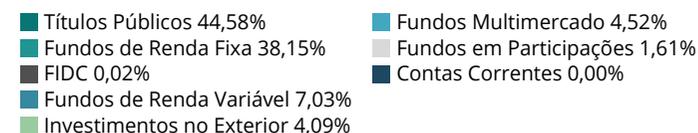


POR TIPO DE ATIVO

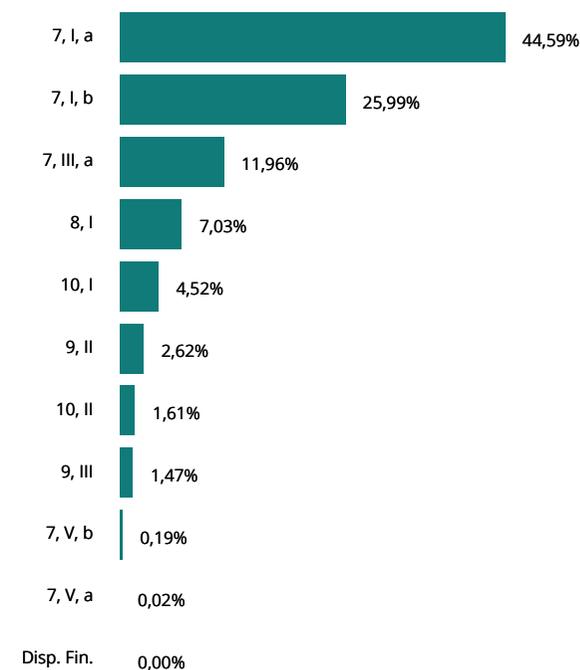


ATIVOS	%	AGOSTO	JULHO
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	14,5%	523.693.658,93	524.411.772,08
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/05/2022) 344518	0,0%	1.547.262,26	1.571.706,76
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/08/2022) 00560AF	0,1%	3.978.674,38	4.041.531,66
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 28/03/2022) 339279	0,1%	3.757.636,91	3.817.002,12
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 16/08/2021)	0,0%	755.067,94	771.339,07
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 17/12/2019)	0,0%	417.508,15	426.505,13
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 01/02/2022) 334348	0,4%	14.420.107,04 ▼	14.713.058,62
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 04/01/2022)	0,0%	1.268.969,42 ▼	1.294.749,16
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/05/2019)	0,0%	601.524,46 ▼	613.744,73
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 20/01/2022) 333549	0,1%	4.532.033,64 ▼	15.133.431,72
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 22/02/2022)	0,0%	877.566,51 ▼	895.394,71
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 03/07/2018)	0,0%	342.796,12 ▼	350.279,57
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 07/03/2022) 336701	0,1%	3.597.243,39 ▼	3.675.773,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 09/08/2017) 244294	0,1%	4.232.051,05 ▼	4.324.439,14
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 10/03/2022) 337480	0,1%	3.681.884,41 ▼	3.762.262,05
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 13/07/2022) 349261	0,1%	3.174.038,29 ▼	3.243.329,35
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/07/2022) 349480	0,1%	3.174.038,29 ▼	3.243.329,35
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/12/2022) 00593A4	0,1%	3.597.243,39 ▼	3.675.773,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/05/2023)	0,2%	5.988.352,23 ▼	6.119.081,38
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/09/2021) 321107	0,2%	8.464.102,10 ▼	8.648.878,28
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2021) 318118	0,1%	4.232.051,05 ▼	4.324.439,14
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2023) 005ECDD	0,1%	3.089.397,27 ▲	-
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/02/2018)	0,0%	761.769,19 ▼	778.399,04
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/03/2018)	0,0%	186.210,25 ▼	190.275,32
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 22/11/2022) 0058918	0,1%	4.232.051,05 ▼	4.324.439,14
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2021) 325234	0,0%	423.205,10 ▼	432.443,91
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 29/06/2021)	0,0%	465.525,62 ▼	475.688,31
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 30/11/2022) 0058C49	0,1%	4.232.051,05 ▼	4.324.439,14
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/09/2021) 320543	0,1%	5.129.969,08 ▼	5.274.935,52
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323671	0,1%	1.923.738,41 ▼	1.978.100,82
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323677	0,2%	8.549.948,47 ▼	8.791.559,19
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/02/2019)	0,0%	1.222.642,63 ▼	1.257.192,96
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2022)	0,0%	914.844,49 ▼	940.696,83
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2023)	0,0%	1.449.216,27 ▲	-
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 17/05/2018)	0,2%	8.549.948,47 ▼	8.791.559,20
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 19/03/2018)	0,1%	5.129.969,08 ▼	5.274.935,52

POR SEGMENTO



POR TIPO DE ATIVO



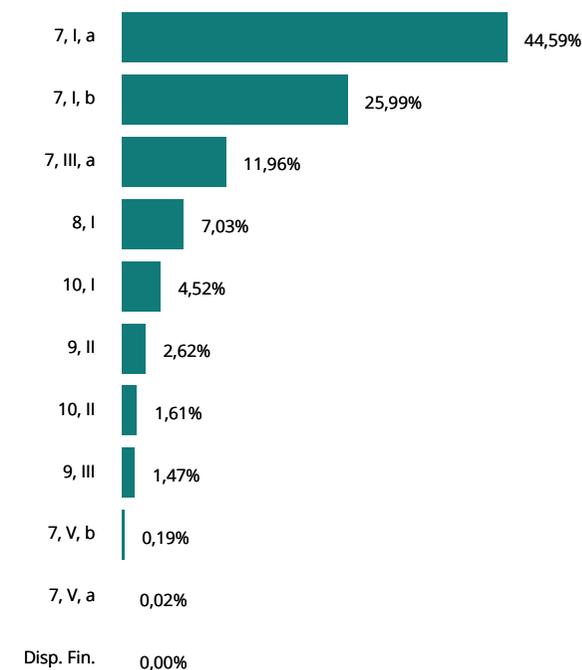
ATIVOS	%	AGOSTO	JULHO
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	14,5%	523.693.658,93	524.411.772,08
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 21/10/2021) 324819	0,2%	8.549.948,47 ▼	8.791.559,19
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/08/2023) 005EFE6	0,3%	10.259.938,17 ▲	-
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/10/2021) 325075	0,0%	854.994,85 ▼	879.155,92
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 05/07/2023)	0,4%	12.710.378,35 ▼	13.099.353,39
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 08/11/2018) 265743	0,2%	8.655.347,87 ▼	8.920.227,03
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 16/02/2022) 335567	0,2%	6.491.510,91 ▼	6.690.170,27
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 20/07/2022) 349906	0,1%	3.678.522,85 ▼	3.791.096,49
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 24/03/2022) 338960	0,2%	7.140.662,00 ▼	7.359.187,30
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/09/2022) 0056DF3	0,5%	17.356.087,88 ▼	17.902.085,21
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 26/08/2022) 00562E2	0,6%	21.695.109,85 ▼	22.377.606,52
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 30/08/2022) 00563E2	0,6%	21.695.109,85 ▼	22.377.606,52
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 25/03/2022) 339157	0,1%	3.284.163,62 ▼	3.404.232,23
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 04/06/2021) 313399	0,0%	871.947,42 ▼	912.985,38
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 05/10/2022) 00575E0	0,1%	2.833.829,11 ▼	2.967.202,50
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 15/06/2018) 260982	0,7%	24.414.527,71 ▼	25.563.590,75
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) i	0,0%	514.448,98 ▼	538.661,38
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) ii	0,2%	7.847.526,76 ▼	8.216.868,45
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) i	0,0%	108.993,43 ▼	114.123,17
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) ii	0,1%	4.359.737,09 ▼	4.564.926,92
NTN-F 01/01/2027 (Compra em 17/08/2023) 0046601	0,1%	3.100.792,78 ▲	-
NTN-F 01/01/2031 (Compra em 05/10/2022) 003FA75	0,3%	9.684.837,24	9.731.191,63
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	30,1%	1.084.519.382,22	1.092.899.971,35
NTN-B XP 2028-08 (Compra 14/07/22 Tx 6.1310)	1,4%	50.649.323,51 ▼	51.755.699,61
NTN-B XP 2028-08 (Compra 19/07/22 Tx 6.2780)	0,4%	15.212.084,81 ▼	15.545.144,08
NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/11/22 Tx 6.0750)	0,8%	27.822.181,35 ▼	28.429.674,84
NTN-B XP 2030-08 (Compra 23/05/23 Tx 5.5625)	0,5%	19.791.180,44 ▼	20.216.064,27
NTN-B XP 2030-08 (Compra 24/11/22 Tx 6.2550)	0,6%	20.557.429,30 ▼	21.009.018,41
NTN-B XP 2032-08 (Compra 21/07/22 Tx 6.2610)	0,8%	30.414.505,64 ▼	31.085.890,21
NTN-B XP 2035-05 (Compra 05/04/23 Tx 6.0750)	0,8%	30.198.376,54	29.969.224,42
NTN-B XP 2035-05 (Compra 06/03/23 Tx 6.4290)	0,8%	28.403.641,58	28.179.534,79
NTN-B XP 2035-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.4200)	0,0%	1.050.996,58	1.043.611,71
NTN-B XP 2035-05 (Compra 15/05/23 Tx 5.6650)	0,0%	887.573,32	881.149,54
NTN-B XP 2035-05 (Compra 18/11/22 Tx 6.2000)	0,4%	15.902.452,47	15.780.078,69
NTN-B XP 2035-05 (Compra 20/04/23 Tx 6.0550)	0,8%	30.044.975,44	29.817.479,32
NTN-B XP 2035-05 (Compra 27/02/23 Tx 6.3150)	0,4%	15.368.025,33	15.248.257,33

POR SEGMENTO



- Títulos Públicos 44,58%
- Fundos de Renda Fixa 38,15%
- FIDC 0,02%
- Fundos de Renda Variável 7,03%
- Investimentos no Exterior 4,09%
- Fundos Multimercado 4,52%
- Fundos em Participações 1,61%
- Contas Correntes 0,00%

POR TIPO DE ATIVO



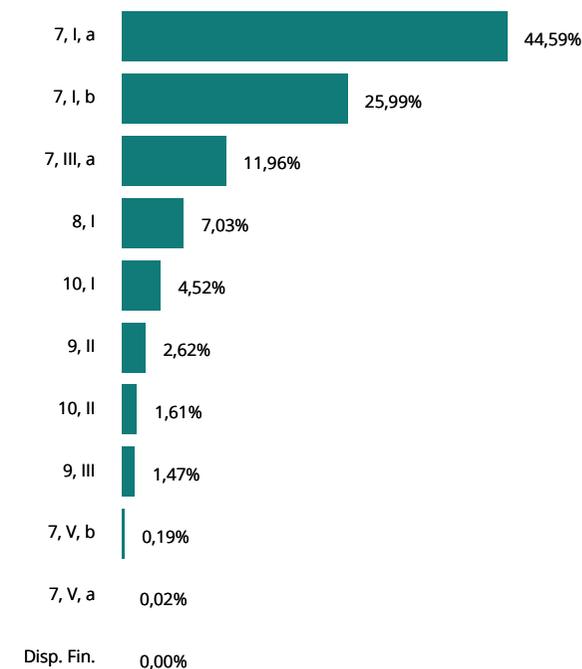
ATIVOS	%	AGOSTO	JULHO
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	30,1%	1.084.519.382,22	1.092.899.971,35
NTN-B XP 2040-08 (Compra 14/06/22 Tx 5.7600)	1,4%	51.189.516,34 ▼	52.277.731,75
NTN-B XP 2040-08 (Compra 15/12/22 Tx 6.3520)	1,4%	51.037.210,89 ▼	52.187.104,79
NTN-B XP 2040-08 (Compra 17/05/22 Tx 5.6700)	0,1%	5.162.261,96 ▼	5.271.035,38
NTN-B XP 2040-08 (Compra 30/01/23 Tx 6.4500)	1,0%	35.137.088,22 ▼	35.936.334,05
NTN-B XP 2045-05 (Compra 04/05/22 Tx 5.8250)	2,9%	104.087.177,71	103.319.491,38
NTN-B XP 2045-05 (Compra 06/07/22 Tx 6.1150)	0,7%	26.137.272,36	25.938.041,46
NTN-B XP 2045-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.5600)	0,3%	10.554.864,06	10.479.428,95
NTN-B XP 2045-05 (Compra 13/04/22 Tx 5.7400)	2,9%	105.079.970,52	104.312.705,55
NTN-B XP 2045-05 (Compra 16/05/23 Tx 5.8255)	0,4%	13.884.363,17	13.781.969,33
NTN-B XP 2045-05 (Compra 24/11/22 Tx 6.2900)	0,9%	31.751.149,50	31.504.383,85
NTN-B XP 2050-08 (Compra 09/05/22 Tx 5.8420)	1,4%	51.942.435,67 ▼	53.048.199,26
NTN-B XP 2050-08 (Compra 11/05/22 Tx 5.8810)	1,4%	51.868.158,06 ▼	52.978.122,35
NTN-B XP 2050-08 (Compra 24/06/22 Tx 5.9201)	1,4%	51.033.018,49 ▼	52.130.977,73
NTN-B XP 2050-08 (Compra 26/04/22 Tx 5.7950)	1,4%	52.302.119,33 ▼	53.408.433,25
NTN-B XP 2050-08 (Compra 29/04/22 Tx 5.8200)	1,4%	52.164.778,20 ▼	53.271.944,50
NTN-B XP 2055-05 (Compra 28/06/22 Tx 6.0310)	2,9%	104.885.251,43	104.093.240,55
FUNDOS DE RENDA FIXA	38,1%	1.376.236.466,81	1.355.665.510,23
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	3,1%	111.606.310,52 ▼	111.060.469,09
BB FIC Previdenciário Fluxo	0,5%	17.303.407,47 ▼	18.543.965,66
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	1,2%	43.684.029,55	43.431.742,89
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	8,5%	305.776.757,03 ▲	302.821.296,35
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	5,3%	190.488.367,58	192.972.442,08
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	0,1%	2.812.325,24 ▼	2.869.626,20
Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa	2,0%	73.611.949,13	72.790.162,36
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA Geral	0,6%	22.527.163,49	22.420.207,78
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B	0,7%	26.476.332,88	26.580.217,90
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5	0,9%	31.742.352,94	31.559.703,20
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5+	0,4%	14.877.409,40	15.071.257,85
Bradesco Institucional Renda Fixa IRF-M	0,2%	5.991.087,32	5.946.426,23
Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa	0,0%	11.585,61	11.459,21
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	2,2%	77.748.458,74 ▲	75.238.459,51
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	0,2%	6.935.385,00	6.871.491,00
Caixa Brasil Referenciado	0,0%	1.126.267,28	1.112.503,14
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	1,0%	36.168.358,80 ▼	36.783.319,40
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	1,1%	39.367.266,82	39.513.777,41

POR SEGMENTO



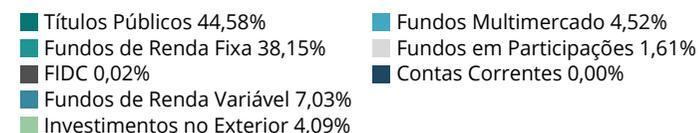
- Títulos Públicos 44,58%
- Fundos de Renda Fixa 38,15%
- FIDC 0,02%
- Fundos de Renda Variável 7,03%
- Investimentos no Exterior 4,09%
- Fundos Multimercado 4,52%
- Fundos em Participações 1,61%
- Contas Correntes 0,00%

POR TIPO DE ATIVO

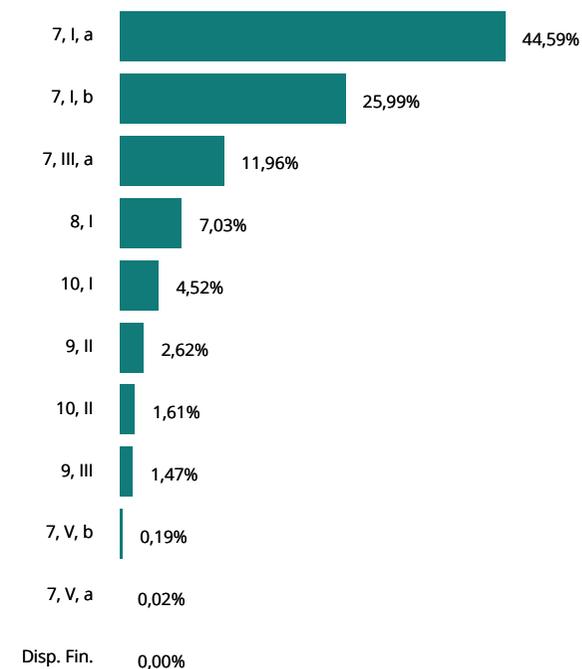


ATIVOS	%	AGOSTO	JULHO
FUNDOS DE RENDA FIXA	38,1%	1.376.236.466,81	1.355.665.510,23
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	0,9%	31.974.586,27 ▲	31.450.281,52
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	0,0%	9.397,52 ▲	2.930,20
Itaú FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa	1,1%	39.356.384,26	39.211.188,93
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	0,6%	20.698.599,69	20.564.012,79
Itaú FIC IMA-B 5+	1,5%	53.460.883,28	54.154.926,41
Itaú FIC Institucional IMA-B	0,5%	16.416.392,95 ▲	-
Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa	0,4%	15.440.587,50	15.279.314,63
Trend Cash FIC Simples	0,0%	1.716,41 ▲	-
Western Asset Ativo IMA-B	0,7%	25.011.025,79 ▼	26.925.271,84
Western Asset Ativo IMA-B 5	1,8%	64.682.471,53	64.380.964,13
Western Asset Soberano II Referenciado Selic	1,3%	47.801.864,20 ▲	44.872.746,43
Western Ativo Max	0,2%	8.542.177,52 ▼	9.045.936,01
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	0,0%	332.266,91	328.461,63
XP Inflação Referenciado IPCA	0,3%	12.340.803,07	12.310.242,89
XP Trend Simples	0,9%	31.912.495,11	31.540.705,56
FIDC	0,0%	886.664,21	881.665,04
BRPP FIDC Multisetorial Master	0,0%	14.900,76	12.805,39
Vila Rica FIDC Multisetorial Itália	0,0%	871.763,45	868.859,65
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	7,0%	253.581.799,46	267.856.602,08
BB FIA Governança	0,1%	2.634.788,94	2.779.291,08
BB FIC FIA Bolsa Brasileira	0,5%	19.506.392,49	20.553.122,15
BB FIC FIA Dividendos	1,1%	38.795.965,40	40.486.955,95
BB FIC FIA Seleção Fatorial	0,2%	5.974.324,99	6.242.701,07
Bradesco FIA Dividendos	0,6%	20.756.103,91	21.869.268,36
Bradesco FIA MID Small Cap	0,1%	3.072.794,59	3.424.763,78
Bradesco FIA Plus Ibovespa	0,3%	10.246.104,36	10.790.445,58
Bradesco FIA Selection	0,0%	1.630.699,56	1.740.709,89
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX	0,8%	27.444.929,79 ▼	29.865.872,49
Caixa FIC FIA Valor Vinci Exp. Dividendos RPPS	0,3%	11.826.229,00	12.248.616,27
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	0,3%	11.981.832,12	12.630.973,40
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	1,5%	54.827.269,07	57.803.573,24
Occam FIC FIA	0,3%	10.413.800,31	11.050.891,63
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	0,0%	1.394.345,76	1.504.081,89
Vinci FIA Fatorial Dinâmico	0,2%	6.172.547,03	6.492.587,90

POR SEGMENTO

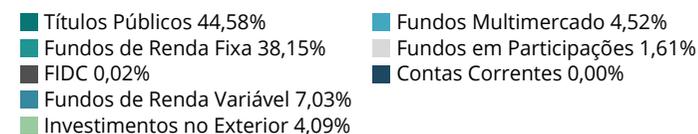


POR TIPO DE ATIVO

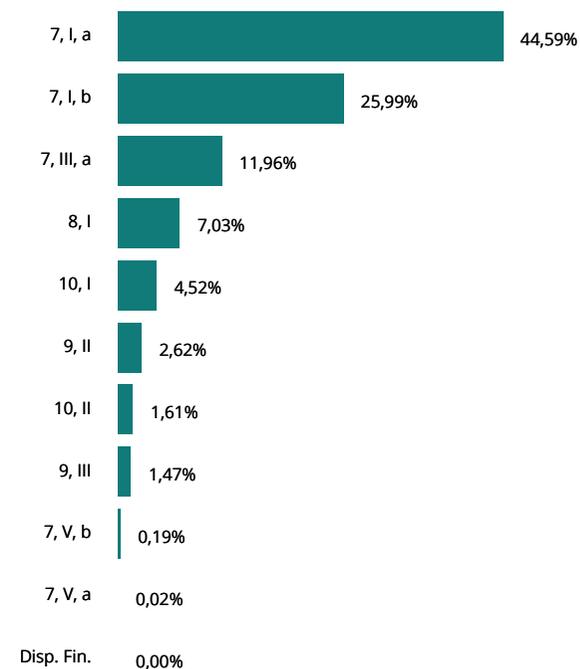


ATIVOS	%	AGOSTO	JULHO
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	7,0%	253.581.799,46	267.856.602,08
Vinci FIA Gas Dividendos	0,1%	2.608.404,70	2.724.028,34
Vinci FIA Selection Equities	0,5%	18.947.290,51	19.991.218,47
Western Asset FIA Valuation	0,1%	2.929.058,49	3.116.931,13
Western Asset FIC FIA Alpha IBrX	0,1%	2.142.679,74	2.252.115,37
XP FIC FIA Investor 30	0,0%	276.238,70	288.454,09
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	4,1%	147.574.651,37	144.547.022,08
BB FIA ESG BDR Nível I	0,5%	17.193.576,48	16.720.960,85
BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior	0,7%	25.864.199,58	25.290.123,55
BB Schroder Multimercado IE	0,1%	3.588.506,77	3.491.207,22
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	0,0%	1.697.543,90	1.667.440,63
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	0,1%	4.504.694,19	4.360.719,65
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	0,6%	20.946.536,81	20.355.472,89
Morgan Stanley FIC FIA Global Brands Advisory IE	0,0%	1.599.708,57	1.531.979,81
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	0,6%	21.098.515,60	20.665.573,57
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	0,1%	4.429.367,55	4.474.921,47
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	0,1%	2.973.507,09	2.844.385,28
Wellington Ventura FIC FIA Dólar Advisory IE	0,0%	484.186,80	472.961,91
Western Asset FIA BDR Nível I	0,3%	10.435.806,62	10.111.898,98
Western Macro Opportunities Multimercado IE	0,2%	8.576.390,46	8.727.732,06
XP FIC FIA J China Equity Dolar Advisory IE	0,0%	226.499,48	231.073,74
XP FIC FIM Nordea Alfa 10 Advisory	0,1%	4.111.456,07	3.988.927,24
XP FIC Moneda Latam Credit Advisory Mult. IE	0,1%	2.689.996,41	2.685.285,74
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	0,5%	17.154.158,99	16.926.357,49
FUNDOS MULTIMERCADO	4,5%	162.996.538,17	163.029.050,07
BB FIC Dinâmico Multimercado	0,1%	1.820.372,45	1.858.887,69
BB FIC Juros e Moedas Multimercado	0,7%	26.548.425,89	26.295.922,84
BB FIC Macro Multimercado	0,1%	1.855.086,14	1.857.769,93
Caixa Bolsa Americana Multimercado	0,9%	33.585.871,91	33.896.633,96
Itaú FIC Private Multimercado SP500	0,7%	26.779.084,90	27.034.697,42
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado	0,2%	6.277.915,91	6.306.279,10
Vinci Multiestratégia Multimercado	0,7%	25.420.056,99	25.271.215,91
Vinci Valorem Multimercado	1,1%	40.291.523,64	40.093.334,16
Western Long Short Multimercado	0,0%	418.200,34	414.309,06

POR SEGMENTO



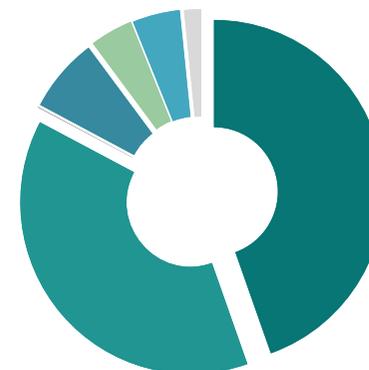
POR TIPO DE ATIVO



ATIVOS	%	AGOSTO	JULHO
FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES	1,6%	58.230.004,38	57.968.748,70
BTG FIP Economia Real II	0,0%	689.056,91	705.961,93
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II	0,0%	155.803,65	159.769,67
BTG Pactual FIC FIP Principal Investments	0,0%	72.585,75	72.773,16
FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia	0,1%	2.316.441,12	2.316.976,60
Kinea FIP Private Equity II	0,1%	1.969.403,83	1.950.783,52
Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.	1,3%	45.188.271,37	44.899.141,95
Kinea FIP Private Equity V Feeder Inst. I Mult.	0,1%	1.976.060,76	1.989.041,37
Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III	0,2%	5.862.380,99	5.873.905,17
Pátria FIC FIP Special Opportunities I	0,0%	-	395,33
CONTAS CORRENTES	0,0%	16.182,92	74.417,53
Banco do Brasil	0,0%	15.181,92	73.416,52
BNP Paribas	0,0%	1.000,00	1.000,00
Bradesco	0,0%	-	-
Brasil Plural	0,0%	-	-
BRL	0,0%	-	-
BTG Pactual	0,0%	-	-
Caixa Econômica Federal	0,0%	-	-
Daycoval	0,0%	-	-
Itaú Unibanco	0,0%	-	-
Santander	0,0%	1,00	1,00
XP Investimentos	0,0%	-	0,01
TOTAL DA CARTEIRA	100,0%	3.607.735.348,47	3.607.334.759,16

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

POR SEGMENTO

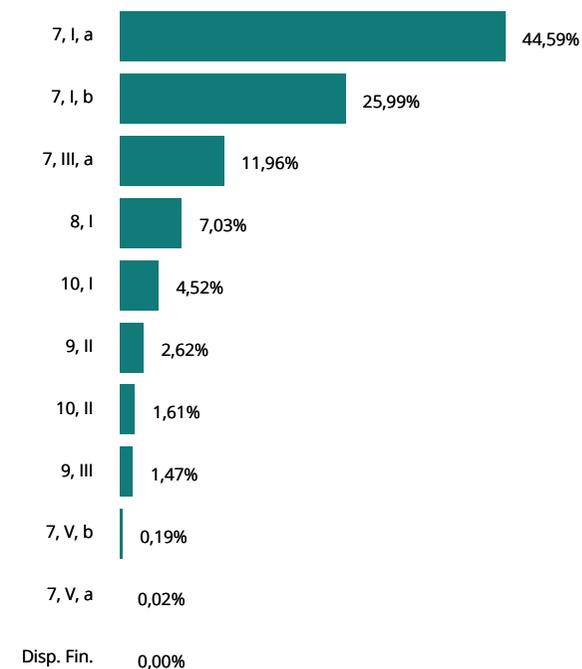


■ Títulos Públicos 44,58%
■ Fundos Multimercado 4,52%
■ Fundos em Participações 1,61%

■ Fundos de Renda Fixa 38,15%
■ FIDC 0,02%
■ Contas Correntes 0,00%

■ Fundos de Renda Variável 7,03%
■ Investimentos no Exterior 4,09%

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)					53.051.825,66
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					64.342,31
LFT 01/03/2024 (Compra em 21/11/2022)	57.450,13	10.044,59	10.878,26					78.372,98
LFT 01/03/2025 (Compra em 06/03/2023)	44.913,84	11.858,42	13.267,55					70.039,81
LFT 01/03/2025 (Compra em 18/05/2020)	46.250,78	7.905,61	8.845,03					63.001,42
LFT 01/03/2026 (Compra em 17/05/2023)	98.287,64	64.180,13	75.932,84					238.400,61
LFT 01/09/2024 (Compra em 06/12/2018)	3.286,05	571,31	624,34					4.481,70
LFT 01/09/2024 (Compra em 18/11/2019)	41.075,56	7.141,43	7.804,15					56.021,14
LFT 01/09/2025 (Compra em 16/05/2023)	89.684,50	56.753,24	63.708,91					210.146,65
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					79,97
LTN 01/01/2026 (Compra em 04/10/2022) 0000742A5	852.622,85	71.104,52	58.452,95					982.180,32
LTN 01/01/2026 (Compra em 25/07/2023) 000075647	-	14.768,67	89.140,75					103.909,42
LTN 01/01/2026 (Compra em 28/07/2023) 00007565E	-	7.451,11	46.762,36					54.213,47
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					378.634,39
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 17/05/2021) 312733	398.954,20	57.885,89	54.519,62					511.359,71
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 02/09/2022) 00565EE	1.863.797,04	178.175,57	89.975,79					2.131.948,40
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 05/10/2022) 00575E2	186.379,70	17.817,56	8.997,58					213.194,84
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 09/09/2022) 00569CA	1.863.797,04	178.175,57	89.975,79					2.131.948,40
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 17/08/2022) 352262	894.622,59	85.524,27	43.188,38					1.023.335,24
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 19/08/2022) 00560B1	335.483,47	32.071,60	16.195,64					383.750,71
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 26/09/2022) 0056FDF	372.759,42	35.635,11	17.995,16					426.389,69
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 02/01/2019)	39.072,96	1.123,71	(2.053,18)					38.143,49
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 03/06/2020)	558.185,12	16.052,89	(29.331,15)					544.906,86

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)					53.051.825,66
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 07/07/2023) 005DD3D	-	147.538,61	(87.993,45)					59.545,16
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 10/05/2019)	580.512,53	16.695,00	(30.504,39)					566.703,14
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 11/01/2019)	154.617,27	4.446,65	(8.124,73)					150.939,19
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 13/05/2022) 343941	362.820,33	10.434,38	(19.065,25)					354.189,46
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 16/08/2019)	130.615,32	3.756,38	(6.863,49)					127.508,21
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 17/08/2022) 352264	474.457,35	13.644,96	(24.931,48)					463.170,83
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 18/02/2020)	150.709,98	4.334,28	(7.919,41)					147.124,85
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 21/11/2018)	558.185,12	16.052,89	(29.331,15)					544.906,86
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 25/07/2023) 005E442	-	106.255,57	(196.518,69)					(90.263,12)
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/10/2017)	1.227.449,09	35.300,28	(64.499,18)					1.198.250,19
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 04/10/2022) 0057548	2.783.441,12	218.392,24	(314.286,40)					2.687.546,96
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/07/2022) 349638	92.781,38	7.279,74	(10.476,21)					89.584,91
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/11/2022) 00587CF	463.906,85	36.398,71	(52.381,07)					447.924,49
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/05/2022) 344518	216.489,86	16.986,07	(24.444,50)					209.031,43
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/08/2022) 00560AF	556.688,22	43.678,45	(62.857,28)					537.509,39
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 28/03/2022) 339279	525.761,10	41.251,87	(59.365,21)					507.647,76
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 16/08/2021)	117.162,13	6.261,29	(16.271,13)					107.152,29
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 17/12/2019)	64.783,76	3.462,12	(8.996,98)					59.248,90
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 01/02/2022) 334348	791.044,16	156.557,50	134.353,47					1.081.955,13
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 04/01/2022)	69.611,88	13.777,06	11.823,11					95.212,05
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					45.132,97
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					1.130.825,01
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 22/02/2022)	48.140,69	9.527,64	8.176,36					65.844,69
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 03/07/2018)	27.959,53	3.251,83	2.405,60					33.616,96
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 07/03/2022) 336701	293.402,37	34.124,19	25.244,21					352.770,77
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 09/08/2017) 244294	345.179,27	40.146,10	29.699,08					415.024,45
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 10/03/2022) 337480	300.305,97	34.927,11	25.838,19					361.071,27
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 13/07/2022) 349261	258.884,46	30.109,57	22.274,31					311.268,34
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/07/2022) 349480	258.884,46	30.109,57	22.274,31					311.268,34
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/12/2022) 00593A4	293.402,38	34.124,19	25.244,20					352.770,77
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/05/2023)	62.038,36	56.806,73	42.024,19					160.869,28

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)					53.051.825,66
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/09/2021) 321107	690.358,55	80.292,20	59.398,16					830.048,91
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2021) 318118	345.179,27	40.146,10	29.699,08					415.024,45
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2023) 005ECDD	-	-	(12.781,71)					(12.781,71)
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/02/2018)	62.132,27	7.226,29	5.345,84					74.704,40
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/03/2018)	15.187,89	1.766,43	1.306,77					18.261,09
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 22/11/2022) 0058918	345.179,27	40.146,10	29.699,08					415.024,45
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2021) 325234	34.517,93	4.014,61	2.969,89					41.502,43
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 29/06/2021)	37.969,71	4.416,08	3.266,90					45.652,69
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 30/11/2022) 0058C49	345.179,27	40.146,10	29.699,08					415.024,45
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/09/2021) 320543	512.352,18	43.127,48	1.538,16					557.017,82
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323671	192.132,06	16.172,81	576,80					208.881,67
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323677	853.920,31	71.879,13	2.563,62					928.363,06
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/02/2019)	122.110,60	10.278,71	366,61					132.755,92
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2022)	91.690,06	7.691,06	274,31					99.655,43
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2023)	-	-	(23.522,25)					(23.522,25)
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 17/05/2018)	853.920,30	71.879,15	2.563,59					928.363,04
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 19/03/2018)	512.352,19	43.127,48	1.538,15					557.017,82
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 21/10/2021) 324819	853.920,31	71.879,13	2.563,62					928.363,06
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/08/2023) 005EFE6	-	-	(88.010,58)					(88.010,58)
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/10/2021) 325075	85.392,03	7.187,91	256,34					92.836,28
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 05/07/2023)	-	65.533,02	(30.405,04)					35.127,98
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 08/11/2018) 265743	946.590,10	64.819,03	(20.704,82)					990.704,31
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 16/02/2022) 335567	709.942,58	48.614,27	(15.528,61)					743.028,24
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 20/07/2022) 349906	402.300,79	27.548,09	(8.799,57)					421.049,31
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 24/03/2022) 338960	780.936,84	53.475,70	(17.081,48)					817.331,06
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/09/2022) 0056DF3	2.078.611,16	65.485,48	(57.648,72)					2.086.447,92
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 26/08/2022) 0056E2E	2.598.263,96	81.856,85	(72.060,83)					2.608.059,98
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 30/08/2022) 00563E2	2.598.263,96	81.856,85	(72.060,83)					2.608.059,98
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 25/03/2022) 339157	451.445,37	25.228,09	(28.503,24)					448.170,22
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 04/06/2021) 313399	133.743,62	6.085,61	(16.620,56)					123.208,67
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 05/10/2022) 00575E0	434.666,77	19.778,24	(54.016,76)					400.428,25
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 15/06/2018) 260982	3.744.821,50	170.397,10	(465.374,87)					3.449.843,73
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) i	78.908,75	3.590,51	(9.806,11)					72.693,15

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)					53.051.825,66
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) ii	1.203.692,61	54.770,50	(149.584,80)					1.108.878,31
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) i	16.717,95	760,70	(2.077,56)					15.401,09
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) ii	668.718,13	30.428,05	(83.102,67)					616.043,51
NTN-F 01/01/2027 (Compra em 17/08/2023) 0046601	-	-	2.895,03					2.895,03
NTN-F 01/01/2031 (Compra em 05/10/2022) 003FA75	1.464.692,74	18.502,86	(46.354,39)					1.436.841,21
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	60.082.844,18	5.315.519,31	8.202.754,50					73.601.117,99
NTN-B XP 2028-08 (Compra 14/07/22 Tx 6.1310)	3.121.423,38	257.575,27	391.877,58					3.770.876,23
NTN-B XP 2028-08 (Compra 19/07/22 Tx 6.2780)	944.599,05	79.154,91	119.639,93					1.143.393,89
NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/11/22 Tx 6.0750)	1.709.974,13	140.243,10	213.908,95					2.064.126,18
NTN-B XP 2030-08 (Compra 23/05/23 Tx 5.5625)	126.659,71	91.612,91	143.309,83					361.582,45
NTN-B XP 2030-08 (Compra 24/11/22 Tx 6.2550)	1.274.021,18	106.601,86	161.288,45					1.541.911,49
NTN-B XP 2032-08 (Compra 21/07/22 Tx 6.2610)	1.891.106,83	157.875,93	238.775,23					2.287.757,99
NTN-B XP 2035-05 (Compra 05/04/23 Tx 6.0750)	702.232,73	147.833,67	229.152,12					1.079.218,52
NTN-B XP 2035-05 (Compra 06/03/23 Tx 6.4290)	1.081.515,17	146.793,25	224.106,79					1.452.415,21
NTN-B XP 2035-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.4200)	60.606,24	4.612,60	7.384,87					72.603,71
NTN-B XP 2035-05 (Compra 15/05/23 Tx 5.6650)	7.912,34	4.064,69	6.423,78					18.400,81
NTN-B XP 2035-05 (Compra 18/11/22 Tx 6.2000)	972.038,36	79.378,68	122.373,78					1.173.790,82
NTN-B XP 2035-05 (Compra 20/04/23 Tx 6.0550)	544.477,12	146.643,78	227.496,12					918.617,02
NTN-B XP 2035-05 (Compra 27/02/23 Tx 6.3150)	628.358,31	78.085,59	119.768,00					826.211,90
NTN-B XP 2040-08 (Compra 14/06/22 Tx 5.7600)	3.122.912,64	245.015,09	379.394,39					3.747.322,12
NTN-B XP 2040-08 (Compra 15/12/22 Tx 6.3520)	3.163.882,09	268.748,82	404.764,04					3.837.394,95
NTN-B XP 2040-08 (Compra 17/05/22 Tx 5.6700)	314.131,62	24.331,91	37.853,26					376.316,79
NTN-B XP 2040-08 (Compra 30/01/23 Tx 6.4500)	1.773.733,20	187.801,14	281.713,92					2.243.248,26
NTN-B XP 2045-05 (Compra 04/05/22 Tx 5.8250)	6.188.568,87	489.454,06	767.686,33					7.445.709,26
NTN-B XP 2045-05 (Compra 06/07/22 Tx 6.1150)	1.587.956,82	128.787,19	199.230,90					1.915.974,91
NTN-B XP 2045-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.5600)	614.986,09	47.472,23	75.435,11					737.893,43
NTN-B XP 2045-05 (Compra 13/04/22 Tx 5.7400)	6.207.590,27	487.268,91	767.264,97					7.462.124,15
NTN-B XP 2045-05 (Compra 16/05/23 Tx 5.8255)	120.377,91	65.306,21	102.393,84					288.077,96
NTN-B XP 2045-05 (Compra 24/11/22 Tx 6.2900)	1.953.836,05	160.714,09	246.765,65					2.361.315,79
NTN-B XP 2050-08 (Compra 09/05/22 Tx 5.8420)	3.131.766,96	252.069,38	388.705,38					3.772.541,72
NTN-B XP 2050-08 (Compra 11/05/22 Tx 5.8810)	3.129.409,41	253.291,97	389.998,61					3.772.699,99
NTN-B XP 2050-08 (Compra 24/06/22 Tx 5.9201)	3.081.035,20	250.881,13	385.399,80					3.717.316,13
NTN-B XP 2050-08 (Compra 26/04/22 Tx 5.7950)	3.150.875,46	251.809,74	389.253,84					3.791.939,04

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					73.601.117,99
NTN-B XP 2050-08 (Compra 29/04/22 Tx 5.8200)	3.143.985,34	252.171,19	389.378,15					3.785.534,68
NTN-B XP 2055-05 (Compra 28/06/22 Tx 6.0310)	6.332.871,70	509.920,01	792.010,88					7.634.802,59
FUNDOS DE RENDA FIXA	110.366.530,26	13.906.736,98	721.586,68					124.994.853,92
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					9.826.741,09
BB FIC Previdenciário Fluxo	3.012.736,31	245.131,01	242.830,63					3.500.697,95
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	11.982.034,44	525.201,74	252.286,66					12.759.522,84
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	29.637.407,24	2.203.919,33	(1.277.374,73)					30.563.951,84
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	9.522.221,28	2.681.426,66	(2.484.074,50)					9.719.573,44
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					206.581,04
Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa	4.440.637,87	756.737,42	821.786,77					6.019.162,06
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA Geral	1.868.220,10	213.334,04	106.955,71					2.188.509,85
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B	2.712.870,22	209.786,73	(103.885,02)					2.818.771,93
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5	1.695.746,25	296.323,82	182.649,74					2.174.719,81
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5+	1.943.528,76	103.874,60	(193.848,45)					1.853.554,91
Bradesco Institucional Renda Fixa IRF-M	522.551,05	52.659,65	44.661,09					619.871,79
Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa	658,99	114,12	126,40					899,51
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	3.875.564,31	1.022.653,40	1.099.410,53					5.997.628,24
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	440.049,00	77.277,00	63.894,00					581.220,00
Caixa Brasil Referenciado	49.248,18	12.551,80	13.764,14					75.564,12
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	1.939.283,16	384.428,80	329.474,86					2.653.186,82
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	3.962.081,65	314.184,62	(146.510,59)					4.129.755,68
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	3.947.217,05	230.297,35	(415.695,25)					3.761.819,15
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	3.922,91	346,02	1.674,50					5.943,43
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					4.116.371,26
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	471.959,54	200.954,16	134.586,90					807.500,60
Itaú FIC IMA-B 5+	-	729.708,53	(694.043,13)					35.665,40
Itaú FIC Institucional IMA-B	-	-	(83.607,05)					(83.607,05)
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					440.587,50
Trend Cash FIC Simples	5,64	6.368,75	8,27					6.382,66

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					124.994.853,92
Western Asset Ativo IMA-B	3.336.259,58	198.292,21	(114.246,05)					3.420.305,74
Western Asset Ativo IMA-B 5	2.355.385,10	564.439,53	301.507,40					3.221.332,03
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					2.495.698,36
Western Ativo Max	635.287,68	82.648,33	86.241,51					804.177,52
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	69.154,24	3.410,09	3.805,28					76.369,61
XP Inflação Referenciado IPCA	724.054,89	102.813,27	30.560,18					857.428,34
XP Trend Simples	1.919.446,57	332.133,14	371.789,55					2.623.369,26
FIDC	(143.770,29)	14.249,28	4.999,17					(124.521,84)
BRPP FIDC Multisetorial Master	(2.237,93)	5.968,32	2.095,37					5.825,76
Vila Rica FIDC Multisetorial Itália	(141.532,36)	8.280,96	2.903,80					(130.347,60)
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	16.475.597,23	8.065.982,54	(13.494.802,62)					11.046.777,15
BB FIA Energia	(375.854,10)	-	-					(375.854,10)
BB FIA Governança	164.255,04	92.580,98	(144.502,14)					112.333,88
BB FIC FIA Bolsa Brasileira	515.115,87	624.333,70	(1.046.729,66)					92.719,91
BB FIC FIA Dividendos	3.270.468,19	1.080.296,68	(1.690.990,55)					2.659.774,32
BB FIC FIA Seleção Fatorial	297.012,36	197.885,90	(268.376,08)					226.522,18
Bradesco FIA Dividendos	1.350.429,66	699.662,70	(1.113.164,45)					936.927,91
Bradesco FIA MID Small Cap	13.721,80	96.840,83	(351.969,19)					(241.406,56)
Bradesco FIA Plus Ibovespa	746.803,21	336.407,60	(544.341,22)					538.869,59
Bradesco FIA Selection	89.505,06	44.744,16	(110.010,33)					24.238,89
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX	1.659.884,53	854.905,06	(1.640.942,70)					873.846,89
Caixa FIC FIA Valor Vinci Exp. Dividendos RPPS	1.095.130,81	327.039,42	(422.387,27)					999.782,96
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	840.468,21	423.590,48	(649.141,28)					614.917,41
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	4.538.242,65	1.899.117,39	(2.976.304,17)					3.461.055,87
Occam FIC FIA	468.404,07	306.731,60	(637.091,32)					138.044,35
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	78.332,59	52.130,26	(109.736,13)					20.726,72
Vinci FIA Fatorial Dinâmico	423.748,73	232.114,60	(320.040,87)					335.822,46
Vinci FIA Gas Dividendos	178.978,42	80.750,51	(115.623,64)					144.105,29
Vinci FIA Selection Equities	1.152.048,57	590.375,71	(1.043.927,96)					698.496,32
Western Asset FIA Valuation	(45.090,29)	57.052,72	(187.872,64)					(175.910,21)
Western Asset FIC FIA Alpha IBrX	(17.828,32)	67.150,10	(109.435,63)					(60.113,85)

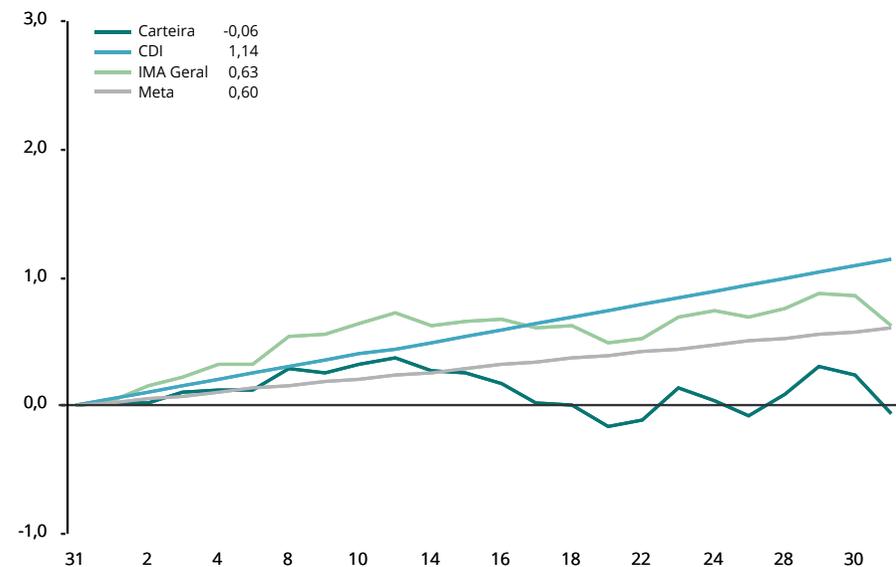
ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	16.475.597,23	8.065.982,54	(13.494.802,62)					11.046.777,15
XP FIC FIA Investor 30	31.820,17	2.272,14	(12.215,39)					21.876,92
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	8.372.612,38	2.697.393,12	3.027.629,29					14.097.634,79
BB FIA ESG BDR Nível I	1.167.564,25	360.283,48	472.615,63					2.000.463,36
BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior	914.381,81	450.161,33	574.076,03					1.938.619,17
BB Schroder Multimercado IE	63.268,67	64.603,03	97.299,55					225.171,25
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	46.959,04	26.865,72	30.103,27					103.928,03
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	324.310,69	69.592,74	143.974,54					537.877,97
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	2.528.914,37	421.753,08	591.063,92					3.541.731,37
Morgan Stanley FIC FIA Global Brands Advisory IE	16.086,49	2.689,75	67.728,76					86.505,00
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	205.289,90	360.695,92	432.942,03					998.927,85
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	(264.431,60)	(78.888,93)	(45.553,92)					(388.874,45)
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	(130.806,32)	(31.964,17)	129.121,81					(33.648,68)
Wellington Ventura FIC FIA Dólar Advisory IE	7.968,42	8.345,04	11.224,89					27.538,35
Western Asset FIA BDR Nível I	153.057,60	58.841,38	323.907,64					535.806,62
Western Macro Opportunities Multimercado IE	279.753,38	297.978,68	(151.341,60)					426.390,46
XP FIC FIA J China Equity Dolar Advisory IE	(38.015,61)	5.579,05	(4.574,26)					(37.010,82)
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					210.089,56
XP FIC Moneda Latam Credit Advisory Mult. IE	113.584,34	81.417,22	4.710,67					199.712,23
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	2.916.620,86	583.511,83	227.801,50					3.727.934,19
FUNDOS MULTIMERCADO	16.805.938,62	3.184.226,36	(32.511,90)					19.957.653,08
BB FIC Dinâmico Multimercado	71.798,76	43.825,32	(38.515,24)					77.108,84
BB FIC Juros e Moedas Multimercado	1.558.297,03	263.818,22	252.503,05					2.074.618,30
BB FIC Macro Multimercado	91.929,63	18.182,29	(2.683,79)					107.428,13
Caixa Bolsa Americana Multimercado	5.489.949,07	1.190.578,94	(310.762,05)					6.369.765,96
Itaú FIC Private Multimercado SP500	5.141.428,22	948.889,23	(255.612,52)					5.834.704,93
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado	209.088,06	99.855,34	(28.363,19)					280.580,21
Vinci Multiestratégia Multimercado	1.489.276,06	211.367,05	148.841,08					1.849.484,19
Vinci Valorem Multimercado	1.999.654,07	400.655,18	198.189,48					2.598.498,73
Western Long Short Multimercado	38.276,28	7.054,79	3.891,28					49.222,35
Western Multimercado US 500	716.241,44	-	-					716.241,44

ATIVOS	1º SEMESTRE	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
FUNDOS EM PARTICIPAÇÕES	(1.165.850,38)	(121.055,73)	261.255,68					(1.025.650,43)
BTG FIP Economia Real II	(33.964,54)	(10.830,34)	(16.905,02)					(61.699,90)
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II	(28.815,78)	(3.681,54)	(3.966,02)					(36.463,34)
BTG Pactual FIC FIP Principal Investments	88.360,00	(94,06)	(187,41)					88.078,53
FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia	813.724,81	(863,36)	(535,48)					812.325,97
Kinea FIP Private Equity II	109.145,52	(129.322,82)	18.620,31					(1.556,99)
Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.	(1.982.107,77)	79.675,36	289.129,42					(1.613.302,99)
Kinea FIP Private Equity V Feeder Inst. I Mult.	(228.043,58)	(15.984,89)	(12.980,61)					(257.009,08)
Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III	94.553,53	(8.698,23)	(11.524,18)					74.331,12
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)					295.599.690,32

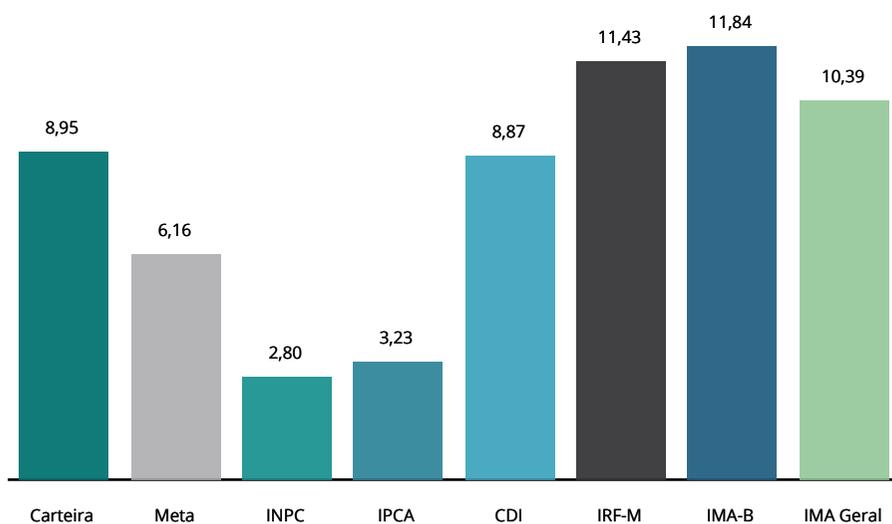
RENTABILIDADE DA CARTEIRA, INDICADORES E META ATUARIAL (INPC + 4,94% A.A.)

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							
Outubro							
Novembro							
Dezembro							
TOTAL	8,95	6,16	8,87	10,39	145	101	86

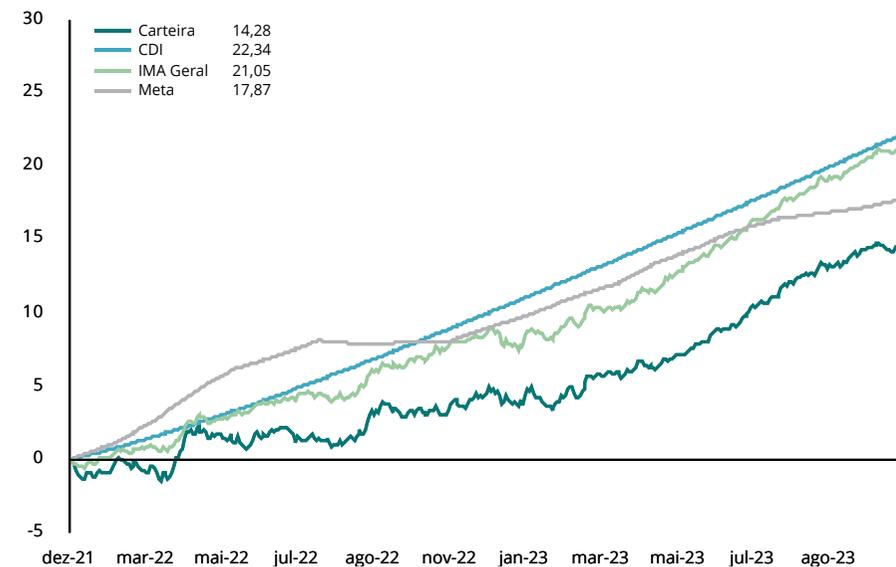
RENTABILIDADE ACUMULADA NO MÊS



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	1,14	190%	8,87	144%	13,60	149%	0,01	0,02	0,02	0,03	-143,46	3,33	0,00	0,00
LFT 01/03/2024 (Compra em 21/11/2022)	Sem bench	1,14	190%	8,87	144%	13,60	149%	0,01	0,02	0,02	0,03	-143,46	3,33	0,00	0,00
LFT 01/03/2025 (Compra em 06/03/2023)	Sem bench	1,16	193%	8,92	145%	13,76	150%	0,03	0,03	0,05	0,05	-29,81	28,81	0,00	0,00
LFT 01/03/2025 (Compra em 18/05/2020)	Sem bench	1,16	193%	8,92	145%	13,76	150%	0,03	0,03	0,05	0,05	-29,81	28,81	0,00	0,00
LFT 01/03/2026 (Compra em 17/05/2023)	Sem bench	1,23	204%	9,09	148%	13,93	152%	0,06	0,07	0,10	0,11	59,04	27,16	0,00	0,00
LFT 01/09/2024 (Compra em 06/12/2018)	Sem bench	1,15	190%	8,88	144%	13,67	149%	0,01	0,03	0,02	0,04	-129,46	17,69	0,00	0,00
LFT 01/09/2024 (Compra em 18/11/2019)	Sem bench	1,15	190%	8,88	144%	13,67	149%	0,01	0,03	0,02	0,04	-129,46	17,69	0,00	0,00
LFT 01/09/2025 (Compra em 16/05/2023)	Sem bench	1,17	194%	9,02	146%	13,88	152%	0,05	0,05	0,07	0,08	-7,88	33,87	0,00	0,00
LTN 01/01/2024 (Compra em 13/12/2021)	Sem bench	1,16	192%	9,06	147%	13,22	144%	0,25	1,36	0,42	2,23	-1,79	-0,85	0,00	-1,04
LTN 01/01/2026 (Compra em 04/10/2022) 0000742A5	Sem bench	0,74	123%	14,07	228%	16,10	176%	3,04	6,65	5,00	10,94	-6,12	2,62	-0,73	-5,63
LTN 01/01/2026 (Compra em 25/07/2023) 000075647	Sem bench	0,74	123%	14,07	228%	16,10	176%	3,04	6,65	5,00	10,94	-6,12	2,62	-0,73	-5,63
LTN 01/01/2026 (Compra em 28/07/2023) 00007565E	Sem bench	0,74	123%	14,07	228%	16,10	176%	3,04	6,65	5,00	10,94	-6,12	2,62	-0,73	-5,63
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 14/06/2023) 005D3D3	Sem bench	0,87	144%	8,59	139%	11,49	126%	1,78	5,03	2,92	8,27	-9,34	-9,31	-0,16	-4,89
NTN-B 15/05/2025 (Compra em 17/05/2021) 312733	Sem bench	0,87	144%	8,59	139%	11,49	126%	1,78	5,03	2,92	8,27	-9,34	-9,31	-0,16	-4,89
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 02/09/2022) 00565EE	Sem bench	0,42	69%	10,72	174%	12,52	137%	2,73	5,72	4,49	9,41	-14,58	-6,92	-0,74	-5,25
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 05/10/2022) 00575E2	Sem bench	0,42	69%	10,72	174%	12,52	137%	2,73	5,72	4,49	9,41	-14,58	-6,92	-0,74	-5,25
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 09/09/2022) 00569CA	Sem bench	0,42	69%	10,72	174%	12,52	137%	2,73	5,72	4,49	9,41	-14,58	-6,92	-0,74	-5,25
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 17/08/2022) 352262	Sem bench	0,42	69%	10,72	174%	12,52	137%	2,73	5,72	4,49	9,41	-14,58	-6,92	-0,74	-5,25
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 19/08/2022) 00560B1	Sem bench	0,42	69%	10,72	174%	12,52	137%	2,73	5,72	4,49	9,41	-14,58	-6,92	-0,74	-5,25
NTN-B 15/05/2027 (Compra em 26/09/2022) 0056FDF	Sem bench	0,42	69%	10,72	174%	12,52	137%	2,73	5,72	4,49	9,41	-14,58	-6,92	-0,74	-5,25
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 02/01/2019)	Sem bench	-0,66	-109%	13,71	223%	15,26	167%	4,67	7,97	7,69	13,12	-21,20	-3,17	-1,73	-6,90
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 03/06/2020)	Sem bench	-0,66	-109%	13,71	223%	15,26	167%	4,67	7,97	7,69	13,12	-21,20	-3,17	-1,73	-6,90
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 07/07/2023) 005DD3D	Sem bench	-0,66	-109%	13,71	223%	15,26	167%	4,67	7,97	7,69	13,12	-20,70	-3,14	-1,73	-6,90
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 10/05/2019)	Sem bench	-0,66	-109%	13,71	223%	15,26	167%	4,67	7,97	7,69	13,12	-21,20	-3,17	-1,73	-6,90
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 11/01/2019)	Sem bench	-0,66	-109%	13,71	223%	15,26	167%	4,67	7,97	7,69	13,12	-21,20	-3,17	-1,73	-6,90
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 13/05/2022) 343941	Sem bench	-0,66	-109%	13,71	223%	15,26	167%	4,67	7,97	7,69	13,12	-20,70	-3,14	-1,73	-6,90
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 16/08/2019)	Sem bench	-0,66	-109%	13,71	223%	15,26	167%	4,67	7,97	7,69	13,12	-21,20	-3,17	-1,73	-6,90
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 17/08/2022) 352264	Sem bench	-0,66	-109%	13,71	223%	15,26	167%	4,67	7,97	7,69	13,12	-20,70	-3,14	-1,73	-6,90
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 18/02/2020)	Sem bench	-0,66	-109%	13,71	223%	15,26	167%	4,67	7,97	7,69	13,12	-21,20	-3,17	-1,73	-6,90
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 21/11/2018)	Sem bench	-0,66	-109%	13,71	223%	15,26	167%	4,67	7,97	7,69	13,12	-21,20	-3,17	-1,73	-6,90
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 25/07/2023) 005E442	Sem bench	-0,66	-109%	13,71	223%	15,26	167%	4,67	7,97	7,69	13,12	-20,70	-3,14	-1,73	-6,90
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 31/10/2017)	Sem bench	-0,66	-109%	13,71	223%	15,26	167%	4,67	7,97	7,69	13,12	-21,20	-3,17	-1,73	-6,90
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 04/10/2022) 0057548	Sem bench	-1,56	-258%	15,24	247%	15,61	171%	6,34	9,69	10,43	15,94	-24,02	-2,20	-2,86	-8,89
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/07/2022) 349638	Sem bench	-1,56	-258%	15,24	247%	15,61	171%	6,34	9,69	10,43	15,94	-24,02	-2,20	-2,86	-8,89
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/11/2022) 00587CF	Sem bench	-1,56	-258%	15,24	247%	15,61	171%	6,34	9,69	10,43	15,94	-24,02	-2,20	-2,86	-8,89

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 19/05/2022) 344518	Sem bench	-1,56	-258%	15,24	247%	15,61	171%	6,34	9,69	10,43	15,94	-24,02	-2,20	-2,86	-8,89
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 19/08/2022) 00560AF	Sem bench	-1,56	-258%	15,24	247%	15,61	171%	6,34	9,69	10,43	15,94	-24,02	-2,20	-2,86	-8,89
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 28/03/2022) 339279	Sem bench	-1,56	-258%	15,24	247%	15,61	171%	6,34	9,69	10,43	15,94	-24,02	-2,20	-2,86	-8,89
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 16/08/2021)	Sem bench	-2,11	-350%	16,12	262%	16,10	176%	7,56	10,96	12,44	18,03	-24,93	-1,65	-3,85	-10,10
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 17/12/2019)	Sem bench	-2,11	-350%	16,12	262%	16,10	176%	7,56	10,96	12,44	18,03	-24,93	-1,65	-3,85	-10,10
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 01/02/2022) 334348	Sem bench	0,91	151%	7,77	126%	11,30	124%	9,13	4,27	15,01	7,03	-22,58	-11,32	-2,76	-2,76
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 04/01/2022)	Sem bench	0,91	151%	7,77	126%	11,30	124%	9,13	4,27	15,01	7,03	-22,83	-11,37	-2,76	-2,76
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/05/2019)	Sem bench	0,91	151%	7,77	126%	11,30	124%	9,13	4,27	15,01	7,03	-22,83	-11,37	-2,76	-2,76
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 20/01/2022) 333549	Sem bench	0,91	151%	7,77	126%	11,30	124%	9,13	4,27	15,01	7,03	-22,58	-11,32	-2,76	-2,76
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 22/02/2022)	Sem bench	0,91	151%	7,77	126%	11,30	124%	9,13	4,27	15,01	7,03	-22,83	-11,37	-2,76	-2,76
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 03/07/2018)	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,32	-7,99	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 07/03/2022) 336701	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,08	-7,95	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 09/08/2017) 244294	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,08	-7,95	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 10/03/2022) 337480	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,08	-7,95	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 13/07/2022) 349261	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,08	-7,95	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/07/2022) 349480	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,08	-7,95	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/12/2022) 00593A4	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,08	-7,95	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/05/2023)	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,32	-7,99	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/09/2021) 321107	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,08	-7,95	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2021) 318118	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,08	-7,95	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2023) 005ECDD	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,08	-7,95	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/02/2018)	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,32	-7,99	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/03/2018)	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,32	-7,99	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 22/11/2022) 0058918	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,08	-7,95	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2021) 325234	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,08	-7,95	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 29/06/2021)	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,32	-7,99	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2026 (Compra em 30/11/2022) 0058C49	Sem bench	0,69	114%	10,44	169%	12,39	135%	9,43	5,11	15,50	8,41	-22,08	-7,95	-3,21	-3,21
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/09/2021) 320543	Sem bench	0,03	5%	11,73	190%	12,86	141%	9,38	5,73	15,41	9,43	-26,10	-6,66	-3,71	-3,71
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323671	Sem bench	0,03	5%	11,73	190%	12,86	141%	9,38	5,73	15,41	9,43	-26,10	-6,66	-3,71	-3,71
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323677	Sem bench	0,03	5%	11,73	190%	12,86	141%	9,38	5,73	15,41	9,43	-26,10	-6,66	-3,71	-3,71
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/02/2019)	Sem bench	0,03	5%	11,73	190%	12,86	141%	9,38	5,73	15,41	9,43	-26,34	-6,69	-3,71	-3,71
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2022)	Sem bench	0,03	5%	11,73	190%	12,86	141%	9,38	5,73	15,41	9,43	-26,34	-6,69	-3,71	-3,71
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2023)	Sem bench	0,03	5%	11,73	190%	12,86	141%	9,38	5,73	15,41	9,43	-26,10	-6,66	-3,71	-3,71
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 17/05/2018)	Sem bench	0,03	5%	11,73	190%	12,86	141%	9,38	5,73	15,41	9,43	-26,34	-6,69	-3,71	-3,71
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 19/03/2018)	Sem bench	0,03	5%	11,73	190%	12,86	141%	9,38	5,73	15,41	9,43	-26,34	-6,69	-3,71	-3,71

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 21/10/2021) 324819	Sem bench	0,03	5%	11,73	190%	12,86	141%	9,38	5,73	15,41	9,43	-26,10	-6,66	-3,71	-3,71
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/08/2023) 005EFE6	Sem bench	0,03	5%	11,73	190%	12,86	141%	9,38	5,73	15,41	9,43	-26,10	-6,66	-3,71	-3,71
NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/10/2021) 325075	Sem bench	0,03	5%	11,73	190%	12,86	141%	9,38	5,73	15,41	9,43	-26,10	-6,66	-3,71	-3,71
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 05/07/2023)	Sem bench	-0,23	-38%	12,47	203%	14,04	153%	9,44	6,47	15,52	10,65	-26,92	-4,97	-3,97	-3,97
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 08/11/2018) 265743	Sem bench	-0,23	-38%	12,47	203%	14,04	153%	9,44	6,47	15,52	10,65	-26,92	-4,97	-3,97	-3,97
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 16/02/2022) 335567	Sem bench	-0,23	-38%	12,47	203%	14,04	153%	9,44	6,47	15,52	10,65	-26,92	-4,97	-3,97	-3,97
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 20/07/2022) 349906	Sem bench	-0,23	-38%	12,47	203%	14,04	153%	9,44	6,47	15,52	10,65	-26,92	-4,97	-3,97	-3,97
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 24/03/2022) 338960	Sem bench	-0,23	-38%	12,47	203%	14,04	153%	9,44	6,47	15,52	10,65	-26,92	-4,97	-3,97	-3,97
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/09/2022) 0056DF3	Sem bench	-0,32	-53%	13,21	214%	14,77	161%	9,54	6,83	15,68	11,24	-27,27	-4,14	-4,21	-4,21
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 26/08/2022) 00562E2	Sem bench	-0,32	-53%	13,21	214%	14,77	161%	9,54	6,83	15,68	11,24	-27,27	-4,14	-4,21	-4,21
NTN-B 15/08/2032 (Compra em 30/08/2022) 00563E2	Sem bench	-0,32	-53%	13,21	214%	14,77	161%	9,54	6,83	15,68	11,24	-27,27	-4,14	-4,21	-4,21
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 25/03/2022) 339157	Sem bench	-0,84	-139%	15,33	249%	15,68	171%	9,85	8,34	16,19	13,73	-28,98	-2,74	-4,92	-7,21
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 04/06/2021) 313399	Sem bench	-1,82	-302%	15,97	259%	15,86	173%	10,64	9,82	17,48	16,15	-33,32	-2,13	-5,96	-8,15
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 05/10/2022) 00575E0	Sem bench	-1,82	-302%	15,97	259%	15,86	173%	10,64	9,82	17,48	16,15	-33,32	-2,13	-5,96	-8,15
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 15/06/2018) 260982	Sem bench	-1,82	-302%	15,97	259%	15,86	173%	10,64	9,82	17,48	16,15	-33,32	-2,13	-5,96	-8,15
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) i	Sem bench	-1,82	-302%	15,97	259%	15,86	173%	10,64	9,82	17,48	16,15	-33,54	-2,15	-5,96	-8,15
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) ii	Sem bench	-1,82	-302%	15,97	259%	15,86	173%	10,64	9,82	17,48	16,15	-33,54	-2,15	-5,96	-8,15
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) i	Sem bench	-1,82	-302%	15,97	259%	15,86	173%	10,64	9,82	17,48	16,15	-33,54	-2,15	-5,96	-8,15
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) ii	Sem bench	-1,82	-302%	15,97	259%	15,86	173%	10,64	9,82	17,48	16,15	-33,54	-2,15	-5,96	-8,15
NTN-F 01/01/2027 (Compra em 17/08/2023) 0046601	Sem bench	0,41	67%	14,10	229%	16,22	177%	4,00	10,26	6,58	16,88	-8,94	-4,08	-1,03	-7,96
NTN-F 01/01/2031 (Compra em 05/10/2022) 003FA75	Sem bench	-0,48	-79%	16,46	267%	18,14	198%	7,32	13,71	12,04	22,55	-10,54	-2,36	-2,23	-10,17
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	0,76	125%	7,72	125%	10,67	117%	9,37	4,10	15,40	6,74	-23,38	-12,91	-2,86	-2,86
NTN-B XP 2028-08 (Compra 19/07/22 Tx 6.2780)	Sem bench	0,77	128%	7,80	127%	10,81	118%	9,42	4,12	15,49	6,78	-23,27	-12,68	-2,87	-2,87
NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/11/22 Tx 6.0750)	Sem bench	0,75	125%	7,70	125%	-	-	9,35	-	15,37	-	-23,42	-	-2,85	-
NTN-B XP 2030-08 (Compra 23/05/23 Tx 5.5625)	Sem bench	0,71	117%	1,81	29%	-	-	9,10	-	14,95	-	-23,84	-	-2,78	-
NTN-B XP 2030-08 (Compra 24/11/22 Tx 6.2550)	Sem bench	0,77	127%	7,79	126%	-	-	9,44	-	15,51	-	-23,28	-	-2,88	-
NTN-B XP 2032-08 (Compra 21/07/22 Tx 6.2610)	Sem bench	0,77	127%	7,81	127%	10,80	118%	9,47	4,14	15,57	6,81	-23,27	-12,68	-2,89	-2,89
NTN-B XP 2035-05 (Compra 05/04/23 Tx 6.0750)	Sem bench	0,76	127%	3,65	59%	-	-	0,22	-	0,37	-	-126,80	-	0,00	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 06/03/23 Tx 6.4290)	Sem bench	0,80	132%	5,28	86%	-	-	0,23	-	0,37	-	-115,62	-	0,00	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.4200)	Sem bench	0,71	117%	7,25	118%	9,93	109%	0,22	3,86	0,36	6,35	-148,33	-14,30	0,00	-2,68
NTN-B XP 2035-05 (Compra 15/05/23 Tx 5.6650)	Sem bench	0,73	121%	2,12	34%	-	-	0,22	-	0,36	-	-140,33	-	0,00	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 18/11/22 Tx 6.2000)	Sem bench	0,78	129%	7,78	126%	-	-	0,23	-	0,37	-	-122,91	-	0,00	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 20/04/23 Tx 6.0550)	Sem bench	0,76	126%	3,11	51%	-	-	0,22	-	0,37	-	-127,36	-	0,00	-
NTN-B XP 2035-05 (Compra 27/02/23 Tx 6.3150)	Sem bench	0,79	130%	5,58	91%	-	-	0,23	-	0,37	-	-119,09	-	0,00	-

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 2040-08 (Compra 14/06/22 Tx 5.7600)	Sem bench	0,73	120%	7,59	123%	10,41	114%	9,08	3,97	14,93	6,53	-23,72	-13,59	-2,77	-2,77
NTN-B XP 2040-08 (Compra 15/12/22 Tx 6.3520)	Sem bench	0,78	129%	7,80	127%	-	-	9,64	-	15,84	-	-23,16	-	-2,94	-
NTN-B XP 2040-08 (Compra 17/05/22 Tx 5.6700)	Sem bench	0,72	119%	7,56	123%	10,34	113%	9,00	3,94	14,80	6,48	-23,81	-13,77	-2,75	-2,75
NTN-B XP 2040-08 (Compra 30/01/23 Tx 6.4500)	Sem bench	0,78	130%	6,57	107%	-	-	9,73	-	16,00	-	-23,08	-	-2,97	-
NTN-B XP 2045-05 (Compra 04/05/22 Tx 5.8250)	Sem bench	0,74	123%	7,53	122%	10,71	117%	0,22	4,00	0,36	6,58	-134,98	-13,43	0,00	-2,76
NTN-B XP 2045-05 (Compra 06/07/22 Tx 6.1150)	Sem bench	0,77	127%	7,72	125%	10,90	119%	0,22	4,10	0,37	6,75	-125,43	-12,98	0,00	-2,85
NTN-B XP 2045-05 (Compra 08/04/22 Tx 5.5600)	Sem bench	0,72	119%	7,35	119%	10,53	115%	0,22	3,84	0,36	6,32	-143,79	-14,11	0,00	-2,67
NTN-B XP 2045-05 (Compra 13/04/22 Tx 5.7400)	Sem bench	0,74	122%	7,47	121%	10,65	116%	0,22	3,93	0,36	6,46	-137,78	-13,73	0,00	-2,73
NTN-B XP 2045-05 (Compra 16/05/23 Tx 5.8255)	Sem bench	0,74	123%	2,12	34%	-	-	0,22	-	0,36	-	-134,86	-	0,00	-
NTN-B XP 2045-05 (Compra 24/11/22 Tx 6.2900)	Sem bench	0,78	130%	7,84	127%	-	-	0,23	-	0,37	-	-120,00	-	0,00	-
NTN-B XP 2050-08 (Compra 09/05/22 Tx 5.8420)	Sem bench	0,73	121%	7,53	122%	10,37	113%	9,12	3,99	14,99	6,56	-23,65	-13,45	-2,78	-2,78
NTN-B XP 2050-08 (Compra 11/05/22 Tx 5.8810)	Sem bench	0,74	122%	7,54	122%	10,40	114%	9,16	4,01	15,06	6,59	-23,61	-13,37	-2,79	-2,79
NTN-B XP 2050-08 (Compra 24/06/22 Tx 5.9201)	Sem bench	0,74	123%	7,55	123%	10,42	114%	9,21	4,03	15,14	6,62	-23,57	-13,29	-2,81	-2,81
NTN-B XP 2050-08 (Compra 26/04/22 Tx 5.7950)	Sem bench	0,73	121%	7,52	122%	10,34	113%	9,06	3,96	14,90	6,52	-23,70	-13,55	-2,76	-2,76
NTN-B XP 2050-08 (Compra 29/04/22 Tx 5.8200)	Sem bench	0,73	121%	7,52	122%	10,36	113%	9,09	3,98	14,94	6,54	-23,67	-13,50	-2,77	-2,77
NTN-B XP 2055-05 (Compra 28/06/22 Tx 6.0310)	Sem bench	0,76	126%	7,67	124%	10,56	115%	0,22	4,06	0,37	6,68	-128,19	-13,14	0,00	-2,82
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	1,16	191%	8,81	143%	13,60	149%	0,04	0,08	0,06	0,13	27,95	-0,78	0,00	-0,02
BB FIC Previdenciário Fluxo	CDI	1,05	175%	8,15	132%	12,50	137%	0,03	0,02	0,04	0,03	-226,58	-330,43	0,00	0,00
BB FIC Previdenciário IMA-B 5	IMA-B 5	0,58	96%	8,63	140%	11,88	130%	1,99	2,26	3,27	3,71	-17,29	-4,32	-0,32	-1,34
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	IMA-B	-0,40	-66%	11,65	189%	13,55	148%	3,70	4,88	6,08	8,02	-24,17	0,04	-1,52	-3,09
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	IMA-B 5+	-1,29	-213%	13,97	227%	14,63	160%	5,68	7,53	9,33	12,39	-24,30	0,98	-2,63	-5,36
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	IPCA + 6%	0,90	149%	7,62	124%	11,17	122%	1,27	2,03	2,09	3,35	-14,67	-6,77	-0,09	-1,33
Bradesco Federal Extra Referenciado Renda Fixa	CDI	1,13	187%	8,69	141%	13,33	146%	0,02	0,02	0,04	0,04	-141,66	-80,14	0,00	0,00
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA Geral	IMA Geral	0,48	79%	10,02	163%	13,28	145%	1,83	2,38	3,01	3,92	-21,43	-0,78	-0,37	-1,39
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B	IMA-B	-0,39	-65%	11,91	193%	13,71	150%	3,64	4,93	5,99	8,12	-24,21	0,22	-1,48	-3,17
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5	IMA-B 5	0,58	96%	8,58	139%	11,81	129%	1,90	2,25	3,13	3,70	-18,06	-4,51	-0,31	-1,33
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B 5+	IMA-B 5+	-1,29	-213%	14,06	228%	14,72	161%	5,64	7,59	9,27	12,48	-24,85	1,02	-2,62	-5,35
Bradesco Institucional Renda Fixa IRF-M	IRF-M	0,75	124%	11,54	187%	15,45	169%	2,25	3,32	3,70	5,47	-9,14	3,09	-0,45	-2,44
Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa	CDI	1,10	183%	8,42	137%	12,91	141%	0,05	0,04	0,08	0,07	-97,55	-102,72	0,00	0,00
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	CDI	1,27	210%	9,16	149%	14,12	154%	0,04	0,06	0,06	0,11	168,91	40,22	0,00	0,00
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	IPCA + 6%	0,93	154%	9,15	149%	12,46	136%	2,19	2,21	3,61	3,63	-1,00	-2,95	-0,29	-1,28
Caixa Brasil Referenciado	CDI	1,24	205%	8,97	146%	13,82	151%	0,05	0,07	0,09	0,11	81,04	14,39	0,00	0,00
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I	IMA-B	0,90	148%	7,61	124%	11,06	121%	8,31	4,28	13,67	7,04	-22,27	-11,15	-2,51	-2,90
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	IMA-B	-0,37	-61%	11,72	190%	13,60	149%	3,64	4,93	5,99	8,11	-24,06	0,10	-1,48	-3,17

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 %
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	IMA-B 5+	-1,26	-209%	13,86	225%	14,54	159%	5,57	7,49	9,17	12,32	-25,00	0,89	-2,56	-5,33
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	CDI	1,05	174%	7,80	127%	11,86	130%	0,01	0,02	0,02	0,03	-833,25	-518,54	0,00	0,00
Itaú FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa	IMA Geral	0,37	61%	11,68	190%	13,00	142%	2,63	3,92	4,32	6,46	-17,08	-0,79	-0,62	-2,96
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	CDI	0,65	108%	8,87	144%	13,05	143%	1,41	0,84	2,33	1,38	-22,33	-3,96	-0,24	-0,29
Itaú FIC IMA-B 5+	IMA-B 5+	-1,28	-212%	14,08	229%	14,77	161%	5,65	7,57	9,28	12,46	-24,77	1,06	-2,61	-5,33
Itaú FIC Institucional IMA-B	IMA-B	-0,39	-65%	11,66	189%	13,58	148%	3,68	4,90	6,05	8,07	-24,18	0,07	-1,50	-3,10
Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa	CDI	1,06	175%	8,98	146%	13,67	149%	0,51	0,66	0,83	1,08	-12,41	0,19	-0,01	-0,17
Trend Cash FIC Simples	CDI	1,13	187%	8,75	142%	-	-	0,03	-	0,05	-	-90,09	-	0,00	-
Western Asset Ativo IMA-B	IMA-B	-0,48	-80%	11,77	191%	12,39	135%	4,66	5,96	7,66	9,80	-19,90	-0,99	-1,94	-4,67
Western Asset Ativo IMA-B 5	IMA-B 5	0,47	78%	8,81	143%	11,00	120%	3,14	3,32	5,16	5,47	-12,78	-4,37	-0,69	-2,83
Western Asset Soberano II Referenciado Selic	Selic	1,17	194%	8,84	144%	13,60	149%	0,07	0,04	0,12	0,06	-1,85	-6,99	0,00	0,00
Western Ativo Max	CDI	0,96	159%	9,04	147%	11,35	124%	3,15	2,99	5,19	4,93	-3,03	-4,21	-0,66	-2,80
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	CDI	1,16	192%	8,83	143%	13,54	148%	0,04	0,08	0,07	0,13	-26,22	-8,25	0,00	0,00
XP Inflação Referenciado IPCA	IMA-B 5	0,25	41%	7,47	121%	9,49	104%	2,80	3,96	4,61	6,51	-18,00	-5,81	-0,88	-2,93
XP Trend Simples	CDI	1,18	195%	8,95	145%	13,72	150%	0,05	0,04	0,09	0,06	5,71	10,04	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	16,36	2712%	64,20	1042%	78,77	861%	-	-	-	-	-	-	-	-
Vila Rica FIDC Multisetorial Itália	Sem bench	0,33	55%	-13,01	-211%	-11,85	-129%	-	-	-	-	-	-	-	-
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIA Governança	IGC	-5,20	-862%	4,45	72%	2,46	27%	14,57	20,73	23,95	34,10	-22,35	-2,49	-6,14	-19,46
BB FIC FIA Bolsa Brasileira	Ibovespa	-5,09	-844%	5,08	83%	4,28	47%	14,04	20,48	23,08	33,69	-23,20	-2,01	-6,13	-18,36
BB FIC FIA Dividendos	Sem bench	-4,18	-692%	5,62	91%	3,21	35%	12,68	18,85	20,84	31,01	-22,62	-2,63	-5,22	-17,27
BB FIC FIA Seleção Fatorial	Ibovespa	-4,30	-712%	3,94	64%	0,45	5%	14,04	20,60	23,07	33,88	-19,03	-3,12	-5,59	-20,13
Bradesco FIA Dividendos	Sem bench	-5,09	-844%	4,73	77%	3,64	40%	13,53	18,89	22,23	31,08	-25,03	-2,48	-5,54	-16,96
Bradesco FIA MID Small Cap	IBrX	-10,28	-1703%	-3,77	-61%	-11,15	-122%	16,48	24,55	27,04	40,37	-43,32	-5,55	-10,28	-26,03
Bradesco FIA Plus Ibovespa	Ibovespa	-5,04	-836%	5,55	90%	4,93	54%	14,26	20,63	23,43	33,94	-22,51	-1,79	-6,12	-18,28
Bradesco FIA Selection	Ibovespa	-6,32	-1047%	1,51	25%	-1,12	-12%	14,06	20,18	23,09	33,19	-32,04	-3,72	-6,32	-19,49
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX	IBrX	-5,49	-911%	2,73	44%	1,59	17%	14,81	20,34	24,33	33,45	-23,66	-2,84	-6,36	-18,98
Caixa FIC FIA Valor Vinci Exp. Dividendos RPPS	IDIV	-3,45	-571%	9,23	150%	8,54	93%	12,49	18,49	20,53	30,43	-18,64	-0,99	-4,26	-14,99
Caixa FIC FIA Vinci Expert Valor RPPS	Ibovespa	-5,14	-852%	5,41	88%	1,36	15%	14,80	21,20	24,32	34,88	-22,56	-2,73	-5,70	-21,44
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	Ibovespa	-5,15	-853%	5,19	84%	3,95	43%	13,32	19,57	21,88	32,20	-25,86	-2,26	-5,82	-19,01
Occam FIC FIA	Sem bench	-5,77	-955%	1,34	22%	-1,14	-12%	14,65	19,04	24,06	31,32	-25,42	-4,02	-7,19	-19,29
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	Ibovespa	-7,30	-1209%	1,51	25%	-1,55	-17%	14,51	23,02	23,82	37,87	-37,03	-3,21	-7,30	-25,50
Vinci FIA Fatorial Dinâmico	Ibovespa	-4,93	-817%	5,61	91%	-1,82	-20%	14,88	21,26	24,45	34,97	-21,66	-3,67	-5,51	-21,41

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 %
Vinci FIA Gas Dividendos	Ibovespa	-4,24	-703%	5,85	95%	5,36	59%	13,68	19,44	22,49	31,98	-20,45	-1,85	-5,27	-18,12
Vinci FIA Selection Equities	Ibovespa	-5,22	-865%	5,10	83%	-1,23	-13%	13,25	20,08	21,77	33,03	-26,81	-3,77	-5,51	-21,38
Western Asset FIA Valuation	Ibovespa	-6,03	-999%	-0,03	0%	-5,05	-55%	13,05	21,07	21,43	34,66	-33,17	-4,71	-6,57	-21,98
Western Asset FIC FIA Alpha IBrX	IBrX	-4,86	-805%	3,65	59%	2,38	26%	13,33	19,68	21,90	32,38	-23,83	-2,73	-5,83	-18,23
XP FIC FIA Investor 30	Ibovespa	-4,23	-702%	8,60	140%	1,54	17%	11,33	19,64	18,61	32,31	-25,33	-3,00	-4,23	-19,55
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIA ESG BDR Nível I	Ibovespa	2,83	468%	13,17	214%	13,35	146%	15,05	20,75	24,78	34,14	7,94	0,56	-4,01	-10,27
BB FIA Globais Indexado Investimento no Exterior	Sem bench	2,27	376%	8,10	132%	10,69	117%	12,90	19,78	21,23	32,55	6,15	-0,22	-4,03	-9,17
BB Schroder Multimercado IE	Sem bench	2,79	462%	6,69	109%	9,93	109%	16,88	21,49	27,78	35,36	8,87	-0,29	-3,55	-9,58
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	Sem bench	1,81	299%	6,11	99%	7,85	86%	13,36	18,55	21,99	30,52	3,81	-1,20	-3,95	-9,71
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	Ibovespa	3,30	547%	11,42	186%	10,29	112%	15,07	20,50	24,81	33,72	9,73	-0,29	-3,93	-10,34
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	Sem bench	2,90	481%	20,35	330%	16,56	181%	17,21	22,75	28,33	37,43	7,50	1,41	-4,03	-11,71
Morgan Stanley FIC FIA Global Brands Advisory IE	Ibovespa	4,42	733%	5,72	93%	7,75	85%	14,02	22,61	23,08	37,21	12,81	-0,78	-3,60	-11,81
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	Sem bench	2,09	347%	4,97	81%	9,01	98%	12,10	18,37	19,92	30,22	5,88	-0,86	-3,68	-8,73
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	Sem bench	-1,02	-169%	-8,07	-131%	-4,81	-53%	13,50	13,88	22,20	22,82	-13,12	-7,60	-3,59	-17,11
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	Ibovespa	4,54	752%	-1,69	-28%	1,73	19%	11,01	13,80	18,13	22,70	19,20	-4,63	-2,55	-10,07
Wellington Ventura FIC FIA Dólar Advisory IE	Sem bench	2,37	393%	5,25	85%	6,67	73%	14,43	19,05	23,75	31,34	6,70	-1,50	-4,12	-8,53
Western Asset FIA BDR Nível I	Ibovespa	3,20	531%	24,50	398%	19,30	211%	17,51	24,35	28,83	40,07	8,21	2,01	-3,84	-15,30
Western Macro Opportunities Multimercado IE	Sem bench	0,94	156%	9,73	158%	8,90	97%	11,23	13,17	18,47	21,67	-13,42	-1,63	-5,02	-9,95
XP FIC FIA J China Equity Dolar Advisory IE	Sem bench	-1,98	-328%	-14,05	-228%	-11,60	-127%	19,87	21,22	32,68	34,89	-7,74	-6,79	-9,23	-23,02
XP FIC FIM Nordea Alfa 10 Advisory	Sem bench	3,07	509%	5,39	87%	10,72	117%	6,14	7,67	10,11	12,62	14,31	-1,90	-0,62	-5,00
XP FIC Moneda Latam Credit Advisory Mult. IE	Sem bench	0,18	29%	8,02	130%	9,65	105%	3,46	4,47	5,69	7,35	-7,96	-4,91	-0,93	-6,79
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	Ibovespa	1,35	223%	27,77	451%	20,11	220%	20,19	30,30	33,24	49,87	6,69	2,09	-4,52	-18,37
FUNDOS MULTIMERCADO	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIC Dinâmico Multimercado	CDI	-2,07	-343%	4,42	72%	7,86	86%	7,88	3,31	12,95	5,45	-22,41	-9,84	-2,22	-2,22
BB FIC Juros e Moedas Multimercado	CDI	0,96	159%	8,48	138%	12,90	141%	0,56	0,42	0,92	0,70	-22,92	-9,87	-0,04	-0,11
BB FIC Macro Multimercado	CDI	-0,14	-24%	6,15	100%	8,28	90%	2,33	1,86	3,84	3,06	-33,77	-16,33	-0,54	-1,11
Caixa Bolsa Americana Multimercado	SP 500	-0,92	-152%	23,40	380%	22,88	250%	11,77	18,26	19,35	30,04	-10,87	3,28	-4,25	-12,27
Itaú FIC Private Multimercado SP500	SP 500	-0,95	-157%	23,26	378%	22,81	249%	11,74	18,21	19,31	29,97	-11,26	3,25	-4,26	-12,25
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado	CDI	-0,45	-75%	6,48	105%	10,41	114%	3,66	3,33	6,02	5,49	-26,84	-5,37	-1,15	-1,33
Vinci Multiestratégia Multimercado	CDI	0,59	98%	8,87	144%	12,90	141%	0,94	0,84	1,55	1,38	-37,87	-4,95	-0,08	-0,11
Vinci Valorem Multimercado	IMA-B 5	0,49	82%	9,51	154%	11,87	130%	1,74	1,93	2,86	3,17	-22,42	-5,10	-0,31	-1,07
Western Long Short Multimercado	CDI	0,94	156%	6,42	104%	9,97	109%	1,47	1,95	2,42	3,21	-11,48	-10,57	-0,22	-0,74

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
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%	-2,39	-397%	-7,09	-115%	-	-	44,30	-	72,72	-	-14,36	-	-9,26	-
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II	IPCA + 15%	-2,48	-411%	-19,82	-322%	-24,53	-268%	0,53	22,32	0,86	36,66	-482,95	-21,19	-2,59	-48,04
BTG Pactual FIC FIP Principal Investments	Sem bench	-0,26	-43%	5,59	91%	-36,08	-394%	-	-	-	-	-	-	-	-
FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos Multiestratégia	IPCA + 9,5%	-0,02	-4%	51,82	842%	51,54	563%	0,00	46,63	0,01	76,79	-9.999,99	4,66	-0,02	-2,81
Kinea FIP Private Equity II	IPCA + 10%	0,95	158%	-2,10	-34%	0,19	2%	-	-	-	-	-	-	-	-
Kinea FIP Private Equity IV Feeder I Inst. Mult.	Sem bench	0,64	107%	-5,07	-82%	-7,00	-77%	-	-	-	-	-	-	-	-
Kinea FIP Private Equity V Feeder Inst. I Mult.	Sem bench	-0,65	-108%	-6,77	-110%	-7,66	-84%	-	-	-	-	-	-	-	-
Pátria FIC FIP Brasil Infraestrutura III	Sem bench	-0,20	-33%	3,32	54%	18,05	197%	0,04	66,59	0,07	109,34	-2.281,78	-7,77	-0,20	-72,44
INDICADORES		RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
Carteira		-0,06	-9%	8,95	145%	11,02	120%	1,99	2,79	3,28	4,59	-41,14	-5,02	-0,54	-1,50
IPCA		0,23	38%	3,23	52%	4,61	50%	-	-	-	-	-	-	-	-
INPC		0,20	33%	2,80	45%	4,06	44%	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI		1,14	189%	8,87	144%	13,55	148%	0,01	0,01	-	-	-	-	-	-
IRF-M		0,76	126%	11,43	186%	14,96	163%	2,16	3,29	3,55	5,41	-11,90	2,48	-0,43	-2,43
IRF-M 1		1,15	190%	9,05	147%	13,74	150%	0,37	0,37	0,60	0,61	1,15	2,88	0,00	-0,04
IRF-M 1+		0,59	98%	12,99	211%	16,04	175%	3,04	4,90	5,00	8,06	-12,22	2,95	-0,73	-3,80
IMA-B		-0,38	-62%	11,84	192%	13,76	150%	3,57	4,91	5,88	8,08	-29,05	0,39	-1,50	-3,08
IMA-B 5		0,61	101%	8,75	142%	11,97	131%	1,95	2,25	3,20	3,70	-18,50	-3,88	-0,31	-1,31
IMA-B 5+		-1,27	-210%	14,28	232%	15,00	164%	5,48	7,59	9,00	12,49	-30,16	1,30	-2,60	-5,32
IMA Geral		0,63	105%	10,39	169%	13,72	150%	1,53	2,28	2,52	3,75	-22,69	0,48	-0,24	-1,30
IDkA 2A		0,77	127%	8,66	141%	11,80	129%	2,13	2,62	3,51	4,30	-11,92	-3,68	-0,24	-1,77
IDkA 20A		-3,05	-505%	19,50	317%	18,37	201%	9,71	13,52	15,96	22,25	-29,75	2,37	-4,97	-10,92
IGCT		-4,99	-826%	5,75	93%	4,82	53%	13,29	20,77	21,84	34,17	-31,99	-1,78	-6,10	-19,14
IBrX 50		-4,76	-788%	3,66	59%	4,56	50%	13,34	20,75	21,91	34,13	-30,62	-1,86	-6,18	-18,97
Ibovespa		-5,09	-843%	5,47	89%	5,68	62%	13,15	20,61	21,60	33,91	-32,89	-1,56	-6,16	-18,35
META ATUARIAL - INPC + 4,94% A.A.		0,60		6,16		9,15									

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 2,7914% 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 3,29% no mesmo período. Já o IMA-B, que habitualmente manifesta alta volatilidade, ficou com 4,91% 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 4,5927%. No mesmo período, o IRF-M detém um VaR de 5,41%, e o IMA-B de 8,08%.

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 1,4992%. Já os índices IRF-M e IMA-B sofreram quedas de 2,43% e 3,08%, 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 11,2477% 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 0,1768% e -0,1768% 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 uma rentabilidade 5,0195% menor que aquela realizada 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 uma rentabilidade 0,0785% menor que a do mercado.

Alfa de Jensen

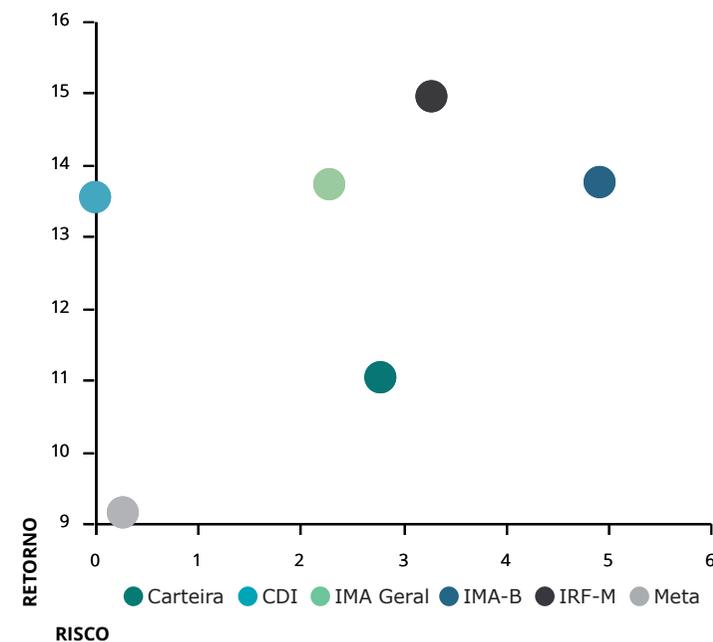
É uma medida do desempenho da Carteira, indicando uma boa performance caso o coeficiente seja significativamente positivo. Valores próximos de zero (tanto positivos quanto negativos) são neutros, devendo ser desconsiderados. Um coeficiente significativamente negativo aponta que o risco da Carteira não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

MEDIDAS DE RISCO E DESEMPENHO DA CARTEIRA (%)

MEDIDA	NO MÊS	3 MESES	12 MESES
Volatilidade Anualizada	1,9934	2,1089	2,7914
VaR (95%)	3,2788	3,4697	4,5927
Draw-Down	-0,5352	-0,5352	-1,4992
Beta	12,1646	10,8474	11,2477
Tracking Error	0,1256	0,1344	0,1768
Sharpe	-41,1410	-5,1209	-5,0195
Treynor	-0,4247	-0,0627	-0,0785
Alfa de Jensen	-0,0185	-0,0129	-0,0066

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.

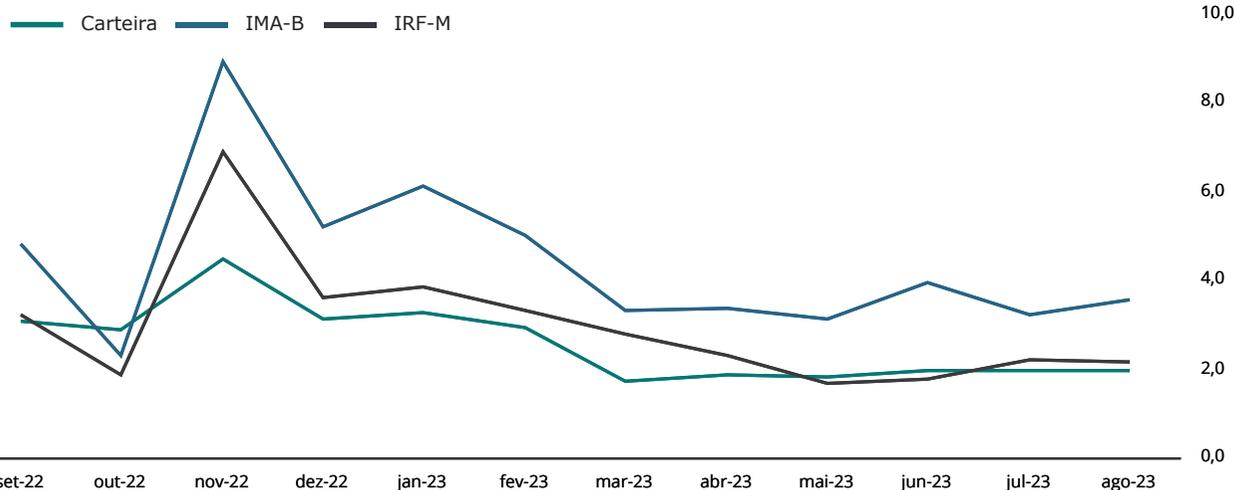
No mês atual, a maior exposição da Carteira é em IMA-B, com 69,42% de participação. Dado o cenário de estresse, haveria uma perda de R\$30.766.267,77 nos ativos atrelados a este índice.

No cenário como um todo, o Instituto perderia R\$81.427.545,97, equivalente a uma queda de 2,26% 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 (%)



STRESS TEST (24 MESES)

FATORES DE RISCO	EXPOSIÇÃO	RESULTADOS DO CENÁRIO	
IRF-M	1,25%	-411.037,43	-0,01%
IRF-M	0,17%	-40.348,66	-0,00%
IRF-M 1	0,00%	0,00	0,00%
IRF-M 1+	0,00%	0,00	0,00%
Carência Pré	1,09%	-370.688,78	-0,01%
IMA-B	69,42%	-30.766.267,77	-0,85%
IMA-B	11,45%	-10.826.250,50	-0,30%
IMA-B 5	5,34%	-2.316.424,64	-0,06%
IMA-B 5+	8,06%	-11.423.641,79	-0,32%
Carência Pós	44,57%	-6.199.950,83	-0,17%
IMA GERAL	1,72%	-759.525,37	-0,02%
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	0,02%	-135.615,42	-0,00%
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	0,00%	0,00	0,00%
FUNDOS PARTICIPAÇÕES	1,61%	-3.302.542,51	-0,09%
FUNDOS DI	15,17%	-4.261.674,81	-0,12%
F. Crédito Privado	0,19%	-96.929,01	-0,00%
Fundos RF e Ref. DI	12,10%	2.014.782,86	0,06%
Multimercado	2,88%	-6.179.528,66	-0,17%
OUTROS RF	0,00%	0,00	0,00%
RENDA VARIÁVEL	10,80%	-41.790.882,66	-1,16%
Ibov., IBrX e IBrX-50	6,19%	-25.181.621,87	-0,70%
Governança Corp. (IGC)	0,00%	0,00	0,00%
Dividendos	2,05%	-7.044.959,52	-0,20%
Small Caps	0,09%	-468.387,46	-0,01%
Setorial	0,00%	0,00	0,00%
Outros RV	2,48%	-9.095.913,80	-0,25%
TOTAL	100,00%	-81.427.545,97	-2,26%

FUNDO	CNPJ	INVESTIDOR	RESGATE		OUTROS DADOS		
			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
FUNDOS DE RENDA FIXA							
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 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
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
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

FUNDO	CNPJ	INVESTIDOR	RESGATE		OUTROS DADOS		
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 Bolsa Brasileira	09.005.823/0001-84	Geral	D+0	D+2	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 Dividendos	06.916.384/0001-73	Geral	D+1	D+3	1,50	Não há	Não há
Bradesco FIA MID Small Cap	06.988.623/0001-09	Geral	D+1	D+3	1,50	Não há	Não há
Bradesco FIA Plus Ibovespa	03.394.711/0001-86	Geral	D+0	D+2	0,50	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
Morgan Stanley FIC FIA Global Brands Advisory IE	37.331.214/0001-50	Qualificado	D+1	D+6	0,80	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
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

FUNDO	CNPJ	INVESTIDOR	RESGATE		OUTROS DADOS		
			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR							
Wellington Ventura FIC FIA Dólar Advisory IE	35.578.709/0001-53	Qualificado	D+1	D+6	0,00	Não há	Não há
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 FIA J China Equity Dolar Advisory IE	38.421.502/0001-69	Qualificado	D+1	D+6	0,80	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							
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							
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: 67,08% até 90 dias; 31,33% superior a 180 dias; os 1,58% restantes possuem regras mais específicas, ou não puderam ser medidos na data de publicação desse relatório.

APLICAÇÕES

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
01/08/2023	148,68	Aplicação	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
01/08/2023	131.968,08	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
04/08/2023	4.206,85	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
07/08/2023	1.484.804,66	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
07/08/2023	1.100.000,00	Aplicação	Western Asset Soberano II Referenciado Selic
08/08/2023	5.318,20	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
10/08/2023	127.300,13	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
11/08/2023	8.958,34	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
11/08/2023	290.000,00	Aplicação	Western Asset Soberano II Referenciado Selic
14/08/2023	3.750,51	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
15/08/2023	47.306.973,01	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
15/08/2023	4.668.298,20	Aplicação	BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B
15/08/2023	500.822,19	Aplicação	Caixa FIC Brasil Disponibilidades
15/08/2023	1.472.738,52	Compra	NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2023)
16/08/2023	24.774.000,00	Aplicação	Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa
16/08/2023	944.435,46	Aplicação	Caixa FIC Brasil Disponibilidades
17/08/2023	940.000,00	Aplicação	Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+
17/08/2023	3.102.178,98	Compra	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2023) 005ECCD
17/08/2023	3.097.897,75	Compra	NTN-F 01/01/2027 (Compra em 17/08/2023) 0046601
17/08/2023	1.708,14	Aplicação	Trend Cash FIC Simples
21/08/2023	908,79	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
22/08/2023	16.500.000,00	Aplicação	Itaú FIC Institucional IMA-B
23/08/2023	5.692,42	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
24/08/2023	3.181,86	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
25/08/2023	44.575,49	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo
25/08/2023	216.242,09	Aplicação	BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B
25/08/2023	10.347.948,75	Compra	NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/08/2023) 005EFE6

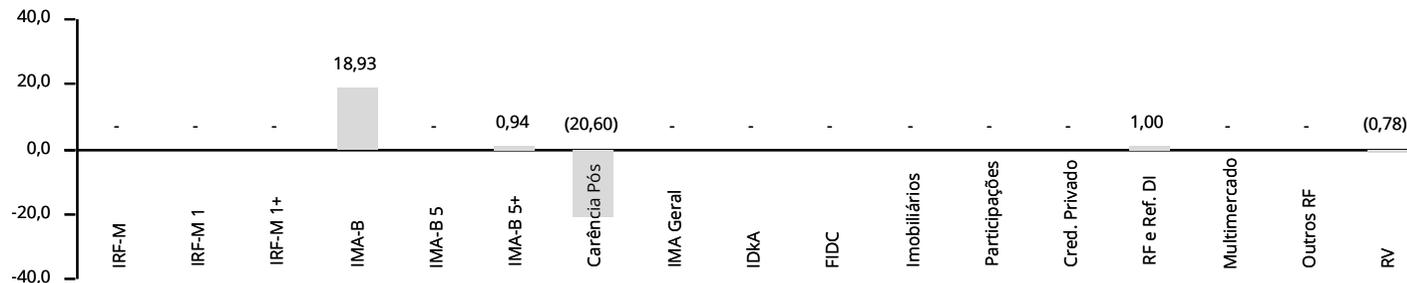
RESGATES

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
01/08/2023	480.000,00	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
01/08/2023	37.405,16	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
02/08/2023	58.688,24	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
03/08/2023	15.920,09	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
04/08/2023	928.925,03	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
04/08/2023	800.000,00	Resgate	Western Asset Ativo IMA-B
04/08/2023	300.000,00	Resgate	Western Ativo Max
07/08/2023	13.126,40	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
08/08/2023	9.039,75	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
10/08/2023	250.000,00	Resgate	BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa
10/08/2023	1.289.568,23	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
10/08/2023	290.000,00	Resgate	Western Ativo Max
11/08/2023	642,45	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
14/08/2023	4.899,04	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
15/08/2023	110.937,23	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
15/08/2023	190.142,17	Resgate	BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B
15/08/2023	82.879,57	Resgate	BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III
15/08/2023	427.305,05	Pagamento	NTN-B 15/08/2024 (Compra em 01/02/2022) 334348
15/08/2023	37.602,85	Pagamento	NTN-B 15/08/2024 (Compra em 04/01/2022)
15/08/2023	17.824,72	Pagamento	NTN-B 15/08/2024 (Compra em 16/05/2019)
15/08/2023	439.513,81	Pagamento	NTN-B 15/08/2024 (Compra em 20/01/2022) 333549
15/08/2023	26.004,56	Pagamento	NTN-B 15/08/2024 (Compra em 22/02/2022)
15/08/2023	9.889,05	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 03/07/2018)
15/08/2023	103.774,09	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 07/03/2022) 336701
15/08/2023	122.087,17	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 09/08/2017) 244294
15/08/2023	106.215,83	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 10/03/2022) 337480
15/08/2023	91.565,37	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 13/07/2022) 349261

TOTALIZAÇÃO DAS MOVIMENTAÇÕES

Aplicações	118.153.718,71
Resgates	115.556.402,94
Saldo	2.597.315,77

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



APLICAÇÕES

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
29/08/2023	1.000.000,00	Aplicação	Western Asset Soberano II Referenciado Selic
31/08/2023	69.661,61	Aplicação	BB FIC Previdenciário Fluxo

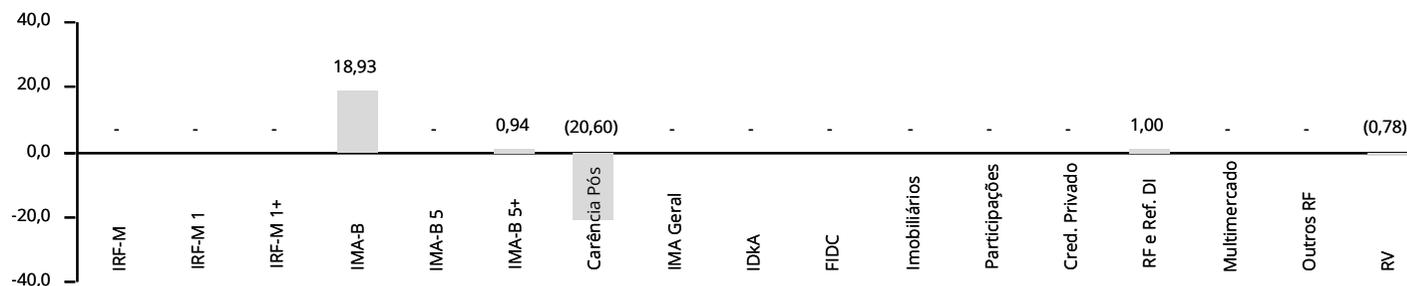
RESGATES

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
15/08/2023	91.565,37	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/07/2022) 349480
15/08/2023	103.774,07	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 15/12/2022) 00593A4
15/08/2023	172.753,34	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/05/2023)
15/08/2023	244.174,34	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 16/09/2021) 321107
15/08/2023	122.087,17	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 17/08/2021) 318118
15/08/2023	21.975,69	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/02/2018)
15/08/2023	5.371,84	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 19/03/2018)
15/08/2023	122.087,17	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 22/11/2022) 0058918
15/08/2023	12.208,70	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 27/10/2021) 325234
15/08/2023	13.429,59	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 29/06/2021)
15/08/2023	122.087,17	Pagamento	NTN-B 15/08/2026 (Compra em 30/11/2022) 0058C49
15/08/2023	146.504,60	Pagamento	NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/09/2021) 320543
15/08/2023	54.939,21	Pagamento	NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323671
15/08/2023	244.174,34	Pagamento	NTN-B 15/08/2028 (Compra em 13/10/2021) 323677
15/08/2023	34.916,94	Pagamento	NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/02/2019)
15/08/2023	26.126,65	Pagamento	NTN-B 15/08/2028 (Compra em 15/08/2022)
15/08/2023	244.174,32	Pagamento	NTN-B 15/08/2028 (Compra em 17/05/2018)
15/08/2023	146.504,59	Pagamento	NTN-B 15/08/2028 (Compra em 19/03/2018)
15/08/2023	244.174,34	Pagamento	NTN-B 15/08/2028 (Compra em 21/10/2021) 324819
15/08/2023	24.417,41	Pagamento	NTN-B 15/08/2028 (Compra em 25/10/2021) 325075
15/08/2023	358.570,00	Pagamento	NTN-B 15/08/2030 (Compra em 05/07/2023)
15/08/2023	244.174,34	Pagamento	NTN-B 15/08/2030 (Compra em 08/11/2018) 265743
15/08/2023	183.130,75	Pagamento	NTN-B 15/08/2030 (Compra em 16/02/2022) 335567
15/08/2023	103.774,07	Pagamento	NTN-B 15/08/2030 (Compra em 20/07/2022) 349906
15/08/2023	201.443,82	Pagamento	NTN-B 15/08/2030 (Compra em 24/03/2022) 338960
15/08/2023	488.348,61	Pagamento	NTN-B 15/08/2032 (Compra em 20/09/2022) 0056DF3
15/08/2023	610.435,84	Pagamento	NTN-B 15/08/2032 (Compra em 26/08/2022) 00562E2

TOTALIZAÇÃO DAS MOVIMENTAÇÕES

Aplicações	118.153.718,71
Resgates	115.556.402,94
Saldo	2.597.315,77

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



APLICAÇÕES

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

RESGATES

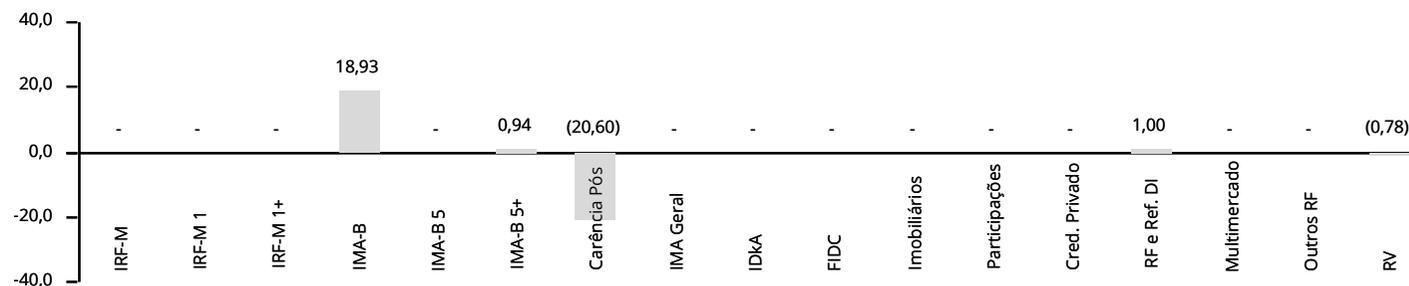
DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
------	-------	-----------	-------

15/08/2023	610.435,84	Pagamento	NTN-B 15/08/2032 (Compra em 30/08/2022) 00563E2
15/08/2023	91.565,37	Pagamento	NTN-B 15/08/2040 (Compra em 25/03/2022) 339157
15/08/2023	24.417,40	Pagamento	NTN-B 15/08/2050 (Compra em 04/06/2021) 313399
15/08/2023	79.356,63	Pagamento	NTN-B 15/08/2050 (Compra em 05/10/2022) 00575E0
15/08/2023	683.688,17	Pagamento	NTN-B 15/08/2050 (Compra em 15/06/2018) 260982
15/08/2023	14.406,29	Pagamento	NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) i
15/08/2023	219.756,89	Pagamento	NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/12/2019) ii
15/08/2023	3.052,18	Pagamento	NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) i
15/08/2023	122.087,16	Pagamento	NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/03/2019) ii
15/08/2023	1.498.253,68	Pagamento	NTN-B XP 2028-08 (Compra 14/07/22 Tx 6.1310)
15/08/2023	452.699,20	Pagamento	NTN-B XP 2028-08 (Compra 19/07/22 Tx 6.2780)
15/08/2023	821.402,44	Pagamento	NTN-B XP 2030-08 (Compra 14/11/22 Tx 6.0750)
15/08/2023	568.193,66	Pagamento	NTN-B XP 2030-08 (Compra 23/05/23 Tx 5.5625)
15/08/2023	612.877,56	Pagamento	NTN-B XP 2030-08 (Compra 24/11/22 Tx 6.2550)
15/08/2023	910.159,80	Pagamento	NTN-B XP 2032-08 (Compra 21/07/22 Tx 6.2610)
15/08/2023	1.467.609,80	Pagamento	NTN-B XP 2040-08 (Compra 14/06/22 Tx 5.7600)
15/08/2023	1.554.657,94	Pagamento	NTN-B XP 2040-08 (Compra 15/12/22 Tx 6.3520)
15/08/2023	146.626,68	Pagamento	NTN-B XP 2040-08 (Compra 17/05/22 Tx 5.6700)
15/08/2023	1.080.959,75	Pagamento	NTN-B XP 2040-08 (Compra 30/01/23 Tx 6.4500)
15/08/2023	1.494.468,97	Pagamento	NTN-B XP 2050-08 (Compra 09/05/22 Tx 5.8420)
15/08/2023	1.499.962,90	Pagamento	NTN-B XP 2050-08 (Compra 11/05/22 Tx 5.8810)
15/08/2023	1.483.359,04	Pagamento	NTN-B XP 2050-08 (Compra 24/06/22 Tx 5.9201)
15/08/2023	1.495.567,76	Pagamento	NTN-B XP 2050-08 (Compra 26/04/22 Tx 5.7950)
15/08/2023	1.496.544,45	Pagamento	NTN-B XP 2050-08 (Compra 29/04/22 Tx 5.8200)
16/08/2023	24.593.516,18	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
16/08/2023	944.435,46	Amortização	Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 I
17/08/2023	6.214.523,75	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo

TOTALIZAÇÃO DAS MOVIMENTAÇÕES

Aplicações	118.153.718,71
Resgates	115.556.402,94
Saldo	2.597.315,77

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



APLICAÇÕES

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

RESGATES

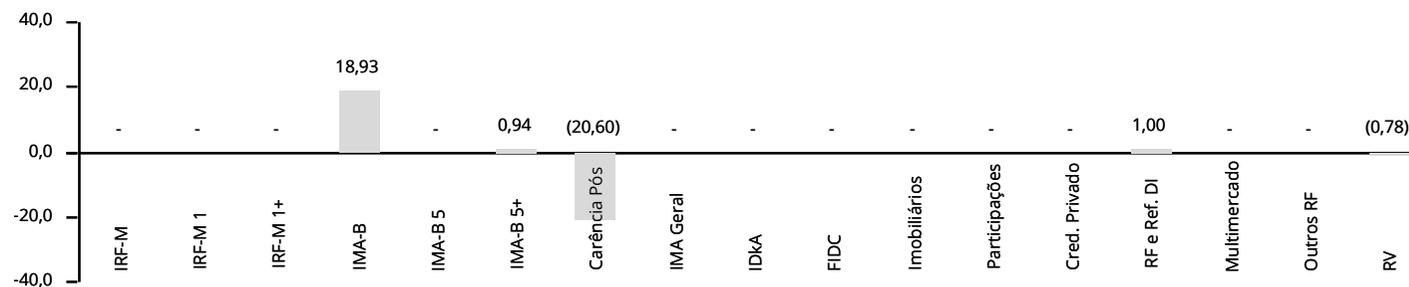
DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVO
------	-------	-----------	-------

17/08/2023	940.000,00	Resgate	Caixa FIC Brasil Disponibilidades
18/08/2023	48.358,48	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
21/08/2023	9.808,57	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
22/08/2023	16.504.747,34	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
22/08/2023	481.822,19	Resgate	Caixa FIC Brasil Disponibilidades
23/08/2023	19.770,16	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
24/08/2023	2.720,74	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
24/08/2023	61.562,71	Resgate	BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B
25/08/2023	772.204,01	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
25/08/2023	10.291.601,79	Venda	NTN-B 15/08/2024 (Compra em 20/01/2022) 333549
25/08/2023	0,00	Rg. Total	Pátria FIC FIP Special Opportunities I
28/08/2023	8.130,65	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
28/08/2023	1.000.000,00	Resgate	Western Asset Ativo IMA-B
30/08/2023	16.534,77	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
30/08/2023	400.000,00	Resgate	BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B
31/08/2023	21.222,50	Resgate	BB FIC Previdenciário Fluxo
31/08/2023	780.000,00	Resgate	Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX
31/08/2023	23.363.411,30	Resgate	Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa
31/08/2023	18.642,64	Resgate	Caixa FIC Brasil Disponibilidades

TOTALIZAÇÃO DAS MOVIMENTAÇÕES

Aplicações	118.153.718,71
Resgates	115.556.402,94
Saldo	2.597.315,77

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	1.491.383.393.921,20	0,05	✓
BRAM	62.375.134/0001-44	Sim	615.214.718.147,92	0,05	✓
BRPP Estruturados	22.119.959/0001-83	Não	57.169.958.907,05	0,00	✓
BRZ Investimentos	02.888.152/0001-06	Não	2.567.666.792,71	0,09	✓
BTG Pactual Gestora	09.631.542/0001-37	Não	323.685.733.857,26	0,00	✓
Caixa DTVM	42.040.639/0001-40	Não	500.470.902.220,71	0,04	✓
Itaú DTVM	33.311.713/0001-25	Sim	840.986.717.032,36	0,01	✓
Itaú Unibanco	60.701.190/0001-04	Sim	840.986.717.032,36	0,01	✓
Itaú Unibanco Asset	40.430.971/0001-96	Não	840.986.717.032,36	0,01	✓
Kinea Private Equity	04.661.817/0001-61	Não	92.686.675.180,90	0,05	✓
Occam Brasil Gestão	27.916.161/0001-86	Não	6.254.055.186,82	0,17	✓
Pátria Investimentos	12.461.756/0001-17	Não	47.243.377.979,33	0,01	✓
Santander Asset	10.231.177/0001-52	Não	311.865.111.968,70	0,01	✓
Truxt Investimentos	23.890.968/0001-36	Não	10.679.937.485,42	0,01	✓
Vila Rica Capital	14.751.574/0001-06	Não	506.283.410,07	0,17	✓
Vinci Equities	10.917.835/0001-64	Não	48.802.009.885,55	0,02	✓
Vinci Soluções	13.421.810/0001-63	Não	48.802.009.885,55	0,09	✓
Vinci Gestora	11.077.576/0001-73	Não	48.802.009.885,55	0,06	✓
Western Asset	07.437.241/0001-41	Não	35.514.752.827,59	0,48	✓
XP Allocation Asset Management	37.918.829/0001-88	Não	155.994.149.056,16	0,04	✓
XP Gestão	07.625.200/0001-89	Não	155.994.149.056,16	0,00	✓
XP Vista	16.789.525/0001-98	Não	155.994.149.056,16	0,01	✓

Obs.: Patrimônio em 07/2023, 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	22,60%
BRAM - 62.375.134/0001-44	8,93%
Caixa DTVM - 42.040.639/0001-40	5,38%
Western Asset - 07.437.241/0001-41	4,73%
Itaú Unibanco Asset - 40.430.971/0001-96	3,32%
XP Allocation Asset Management - 37.918.829/0001-88	1,74%
Vinci Soluções - 13.421.810/0001-63	1,72%
Itaú DTVM - 33.311.713/0001-25	1,52%
Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	1,46%
Kinea Private Equity - 04.661.817/0001-61	1,36%
Vinci Gestora - 11.077.576/0001-73	0,88%
Santander Asset - 10.231.177/0001-52	0,58%
XP Vista - 16.789.525/0001-98	0,34%
Occam Brasil Gestão - 27.916.161/0001-86	0,29%
Vinci Equities - 10.917.835/0001-64	0,24%
Pátria Investimentos - 12.461.756/0001-17	0,16%
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	0,03%
Vila Rica Capital - 14.751.574/0001-06	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	22,60%
Banco Bradesco - 60.746.948/0001-12	7,47%
Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	6,29%
BNP Paribas Banco - 01.522.368/0001-82	5,58%
Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-04	5,38%
BEM DTVM - 00.066.670/0001-00	4,35%
Lions Trust - 15.675.095/0001-10	1,31%
XP Investimentos - 02.332.886/0001-04	0,89%
Banco Santander - 90.400.888/0001-42	0,58%
Santander Caceis - 62.318.407/0001-19	0,35%
BTG Pactual SF DTVM - 59.281.253/0001-23	0,28%
BRL Trust Investimentos - 23.025.053/0001-62	0,16%
Intrag DTVM - 62.418.140/0001-31	0,09%
Daycoval Banco - 62.232.889/0001-90	0,06%
BRL Trust - 13.486.793/0001-42	0,02%
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	14.734.335.445,36	3,09	0,76	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC Previdenciário Fluxo	13.077.415/0001-05	7, III, a	3.554.344.878,79	0,48	0,49	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	5.437.581.646,17	1,21	0,80	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	5.260.991.740,78	8,48	5,81	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	1.858.783.140,34	5,28	10,25	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	186.423.704,08	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	10.508.951.085,13	2,04	0,70	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	183.949.721,27	0,62	12,25	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	556.482.801,29	0,73	4,76	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	980.045.918,76	0,88	3,24	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	148.401.947,12	0,41	10,03	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	605.702.521,03	0,17	0,99	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	559.442.765,97	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	9.013.672.474,30	2,16	0,86	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	225.557.887,64	0,19	3,07	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	7, III, a	14.797.589.893,96	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	483.298.972,99	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	5.279.029.725,18	1,09	0,75	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	1.532.125.808,15	0,89	2,09	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	7, III, a	875.310.436,12	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	2.203.872.085,49	1,09	1,79	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	32.972.942/0001-28	7, III, a	2.919.877.676,62	0,57	0,71	Sim	60.701.190/0001-04	60.701.190/0001-04	✓
Itaú FIC IMA-B 5+	14.437.684/0001-06	7, I, b	374.155.027,20	1,48	14,29	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Itaú FIC Institucional IMA-B	10.474.513/0001-98	7, I, b	255.486.055,82	0,46	6,43	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	1.404.174.563,62	0,43	1,10	Sim	60.701.190/0001-04	60.701.190/0001-04	✓
Trend Cash FIC Simples	45.823.918/0001-79	7, III, a	586.090.038,45	0,00	0,00	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
Western Asset Ativo IMA-B	09.087.301/0001-79	7, I, b	176.629.282,64	0,69	14,16	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	460.238.353,70	1,79	14,05	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	375.680.745,19	1,32	12,72	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
Western Ativo Max	04.192.419/0001-43	7, I, b	58.227.402,04	0,24	14,67	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
XP FIC Trend Pós-Fixado Simples	26.559.284/0001-44	7, I, b	9.056.038.144,25	0,01	0,00	Sim	37.918.829/0001-88	02.332.886/0001-04	✓
XP Inflação Referenciado IPCA	14.146.491/0001-98	7, III, a	319.000.388,50	0,34	3,87	Sim	16.789.525/0001-98	62.318.407/0001-19	✓
XP Trend Simples	32.893.503/0001-20	7, I, b	4.633.918.266,70	0,88	0,69	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	425.043,24	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	19.400.107,45	0,02	4,49	Não	14.751.574/0001-06	13.486.793/0001-42	✓

FUNDOS	CNPJ	ENQ.	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	ART. 18	ART. 19	ART. 21	GESTOR	ADMINISTRADOR	STATUS
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL									
BB FIA Governança	10.418.335/0001-88	8, I	758.125.877,46	0,07	0,35	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC FIA Bolsa Brasileira	09.005.823/0001-84	8, I	232.716.128,42	0,54	8,38	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC FIA Dividendos	05.100.191/0001-87	8, I	562.805.403,27	1,08	6,89	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC FIA Seleção Fatorial	07.882.792/0001-14	8, I	1.338.682.696,87	0,17	0,45	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
Bradesco FIA Dividendos	06.916.384/0001-73	8, I	573.674.597,27	0,58	3,62	Sim	62.375.134/0001-44	00.066.670/0001-00	✓
Bradesco FIA MID Small Cap	06.988.623/0001-09	8, I	681.339.924,33	0,09	0,45	Sim	62.375.134/0001-44	00.066.670/0001-00	✓
Bradesco FIA Plus Ibovespa	03.394.711/0001-86	8, I	279.061.397,98	0,28	3,67	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco FIA Selection	03.660.879/0001-96	8, I	452.902.777,24	0,05	0,36	Sim	62.375.134/0001-44	00.066.670/0001-00	✓
Bradesco FIC FIA Alpha Institucional IBrX	14.099.976/0001-78	8, I	376.614.658,11	0,76	7,29	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	936.636.791,99	0,33	1,26	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	675.035.615,55	0,33	1,77	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Itaú FIC FIA RPI Ativo Ibovespa	08.817.414/0001-10	8, I	444.136.742,58	1,52	12,34	Sim	33.311.713/0001-25	60.701.190/0001-04	✓
Occam FIC FIA	11.628.883/0001-03	8, I	823.703.571,61	0,29	1,26	Sim	27.916.161/0001-86	00.066.670/0001-00	✓
Truxt FIC FIA I Valor Institucional	26.277.595/0001-10	8, I	728.238.113,46	0,04	0,19	Sim	23.890.968/0001-36	62.418.140/0001-31	✓
Vinci FIA Fatorial Dinâmico	23.875.817/0001-09	8, I	149.263.798,37	0,17	4,14	Sim	10.917.835/0001-64	00.066.670/0001-00	✓
Vinci FIA Gas Dividendos	07.488.106/0001-25	8, I	496.147.519,95	0,07	0,53	Sim	10.917.835/0001-64	00.066.670/0001-00	✓
Vinci FIA Selection Equities	15.603.945/0001-75	8, I	538.649.866,95	0,53	3,52	Sim	13.421.810/0001-63	00.066.670/0001-00	✓
Western Asset FIA Valuation	09.087.523/0001-91	8, I	53.791.819,92	0,08	5,45	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
Western Asset FIC FIA Alpha IBrX	16.703.203/0001-84	8, I	30.998.674,57	0,06	6,91	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
XP FIC FIA Investor 30	26.718.169/0001-75	8, I	199.606.600,76	0,01	0,14	Sim	07.625.200/0001-89	62.318.407/0001-19	✓
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR									
BB FIA ESG BDR Nível I	21.470.644/0001-13	9, III	1.329.667.917,72	0,48	1,29	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	292.362.346,55	0,72	8,85	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Schroder Multimercado IE	17.431.816/0001-72	9, II	480.874.034,59	0,10	0,75	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
Bradesco FIA Global Investimento no Exterior	18.085.924/0001-01	9, II	326.648.645,79	0,05	0,52	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Bradesco FIA Institucional BDR Nível I	21.321.454/0001-34	9, III	118.766.126,13	0,12	3,79	Sim	62.375.134/0001-44	60.746.948/0001-12	✓
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	17.502.937/0001-68	9, III	2.114.296.555,90	0,58	0,99	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Morgan Stanley FIC FIA Global Brands Advisory IE	37.331.214/0001-50	9, II	71.614.950,13	0,04	2,23	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
Santander FIC Global Equities Master Mult. IE	17.804.792/0001-50	9, II	630.406.686,67	0,58	3,35	Sim	10.231.177/0001-52	90.400.888/0001-42	✓
Systematica FIC Blue Trend Advisory Mult IE	39.723.347/0001-06	9, II	194.005.202,46	0,12	2,28	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
Vinci FIC Internacional Multimercado IE	19.587.174/0001-20	9, II	107.300.327,71	0,08	2,77	Sim	13.421.810/0001-63	59.281.253/0001-23	✓
Wellington Ventura FIC FIA Dólar Advisory IE	35.578.709/0001-53	9, II	107.563.357,28	0,01	0,45	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
Western Asset FIA BDR Nível I	19.831.126/0001-36	9, III	1.481.298.362,51	0,29	0,70	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
Western Macro Opportunities Multimercado IE	22.282.992/0001-20	9, II	181.432.566,04	0,24	4,73	Sim	07.437.241/0001-41	01.522.368/0001-82	✓
XP FIC FIA J China Equity Dolar Advisory IE	38.421.502/0001-69	9, II	65.719.736,87	0,01	0,34	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
XP FIC FIM Nordea Alfa 10 Advisory	39.818.102/0001-54	9, II	23.608.702.500,00	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	512.419.009,00	0,07	0,52	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓

FUNDOS	CNPJ	ENQ.	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	ART. 18	ART. 19	ART. 21	GESTOR	ADMINISTRADOR	STATUS
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR									
XP MS FIC FIA Global Opportunities Advisory IE	33.913.562/0001-85	9, II	665.927.943,70	0,48	2,58	Sim	37.918.829/0001-88	01.522.368/0001-82	✓
FUNDOS MULTIMERCADO									
BB FIC Dinâmico Multimercado	13.079.634/0001-23	10, I	325.400.168,41	0,05	0,56	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC Juros e Moedas Multimercado	06.015.368/0001-00	10, I	16.607.871.823,22	0,74	0,16	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC Macro Multimercado	05.962.491/0001-75	10, I	2.292.835.639,98	0,05	0,08	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
Caixa Bolsa Americana Multimercado	30.036.235/0001-02	10, I	1.616.038.532,30	0,93	2,08	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Itaú FIC Private Multimercado SP500	26.269.692/0001-61	10, I	1.203.059.018,22	0,74	2,23	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Vinci FIC Auguri Synchrony Multimercado	35.002.795/0001-51	10, I	60.397.330,74	0,17	10,39	Sim	11.077.576/0001-73	59.281.253/0001-23	✓
Vinci Multiestratégia Multimercado	12.440.825/0001-06	10, I	364.572.610,85	0,70	6,97	Sim	11.077.576/0001-73	00.066.670/0001-00	✓
Vinci Valorem Multimercado	13.396.703/0001-22	10, I	1.631.201.213,84	1,12	2,47	Sim	13.421.810/0001-63	00.066.670/0001-00	✓
Western Long Short Multimercado	07.672.392/0001-84	10, I	9.193.384,06	0,01	4,55	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	120.928.944,37	0,02	0,57	Sim	09.631.542/0001-37	59.281.253/0001-23	✓
BTG Pactual FIC FIP Infraestrutura II	14.584.094/0001-06	10, II	23.607.377,51	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	4.941.989,65	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	260.577.511,63	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	147.113.920,71	0,05	1,34	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	360.376.474,66	1,25	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	107.892.917,70	0,05	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	140.072.073,26	0,16	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	2.546.000.693,99	70,57	100,0	✓	100,0	✓
7, I, a	1.608.213.041,15	44,58	100,0	✓	100,0	✓
7, I, b	937.787.652,84	25,99	100,0	✓	100,0	✓
7, I, c	-	0,00	100,0	✓	100,0	✓
7, II	-	0,00	5,0	✓	5,0	✓
7, III	431.513.428,97	11,96	75,0	✓	70,0	✓
7, III, a	431.513.428,97	11,96	75,0	✓	70,0	✓
7, III, b	-	0,00	75,0	✓	70,0	✓
7, IV	-	0,00	20,0	✓	20,0	✓
7, V	7.822.049,21	0,22	30,0	✓	25,0	✓
7, V, a	886.664,21	0,02	15,0	✓	10,0	✓
7, V, b	6.935.385,00	0,19	15,0	✓	10,0	✓
7, V, c	-	0,00	15,0	✓	10,0	✓
ART. 7	2.985.336.172,17	82,75	100,0	✓	100,0	✓
8, I	253.581.799,46	7,03	45,0	✓	40,0	✓
8, II	-	0,00	45,0	✓	40,0	✓
ART. 8	253.581.799,46	7,03	45,0	✓	40,0	✓
9, I	-	0,00	10,0	✓	10,0	✓
9, II	94.494.037,27	2,62	10,0	✓	10,0	✓
9, III	53.080.614,10	1,47	10,0	✓	10,0	✓
ART. 9	147.574.651,37	4,09	10,0	✓	10,0	✓
10, I	162.996.538,17	4,52	15,0	✓	10,0	✓
10, II	58.230.004,38	1,61	10,0	✓	5,0	✓
10, III	-	0,00	10,0	✓	5,0	✓
ART. 10	221.226.542,55	6,13	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	474.808.342,01	13,16	50,0	✓	40,0	✓
PATRIMÔNIO INVESTIDO	3.607.719.165,55					

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 mês de agosto registrou um maior nível de incertezas a respeito do cenário econômico e das políticas fiscais e monetárias. Nesse sentido, ocorreu um expressivo movimento para renda fixa, devido à abertura dos juros longos ao redor do mundo, em especial nos Estados Unidos (EUA). Ademais, os EUA continuam crescendo, enquanto Europa e China permanecem evidenciando economias mais fragilizadas.

Nos Estados Unidos, o destaque foi a repercussão negativa da ata do Federal Reserve (Fed). O texto mostrou os riscos significativos de alta para a inflação, mesmo que os preços estejam em uma tendência de moderação. A diretoria do Fed continua empenhada em alcançar e manter uma orientação de política monetária que seja suficientemente restritiva para reduzir a inflação ao longo do tempo.

Os dados de atividade econômica não indicam a possibilidade de recessão para esse ano, com a segunda preliminar do Produto Interno Bruto (PIB) indicando um crescimento de 2,1% no segundo trimestre. Observa-se um movimento de desaceleração na economia, que, conseqüentemente, trouxe um alívio nas expectativas para manutenção dos juros entre 5,25% e 5,50% na reunião do Fed em setembro.

Os dados do mercado de trabalho apresentaram melhoras no mês, uma vez que foi detectado um crescimento da taxa de desemprego e uma redução na variação salarial, o que sugere uma tendência de equilíbrio entre oferta e demanda. Existem sinais conflitantes em que a inflação apresenta tendência de queda, mas sem muito custo para a economia. Essa conjuntura pode ser considerada positiva, mas é preciso cautela. Não se deve descartar a possibilidade de que a política monetária não esteja restritiva o suficiente para concluir o propósito da meta de inflação.

Sobre a questão fiscal americana, identificou-se uma deterioração orçamentária do governo com o aumento crescente das despesas e redução do padrão adequado de governança, dada a aprovação da elevação do teto da dívida. Por essa razão, a agência de classificação de risco Fitch rebaixou o rating de longo prazo dos Estados Unidos de "AAA" para "AA+". Os investidores utilizam as classificações de crédito para avaliar o perfil de risco do governo e de empresas que obtêm financiamento nos mercados de capitais, dessa maneira, a notícia de rebaixamento comprometeu os preços dos títulos da dívida americana.

Na Zona do Euro, a conjuntura econômica iniciou o segundo semestre com piores resultados em seus dados. O Índice de Gerente de Compras (PMI) de serviços aponta um arrefecimento, similar ao movimento de desaceleração do ritmo do

PMI industrial, justificado pelo endividamento dos consumidores. Por essa razão, o mercado está novamente em alerta com a maior possibilidade de recessão.

A preliminar da inflação de agosto subiu mais do que era esperado, mas o núcleo da inflação ficou dentro das expectativas. Esse quadro misto de resultados dificulta a decisão do Banco Central Europeu (BCE) ao avaliar o movimento de juros. Parte da preocupação da autoridade monetária é referente à desaceleração intensa da economia, que pode atingir uma recessão sem sinais de recuperação. Existe a interpretação de que essa forte desaceleração seria desejável, uma vez que o mercado de trabalho segue apertado, provocando pressão salarial e inflação de serviços. No entanto, os economistas seguem inclinados para uma pausa dos juros na próxima reunião.

A perspectiva para a economia da China segue desfavorável. Os indicadores de varejo, indústria e investimento crescem a um ritmo mais lento do que era esperado, evidenciando um enfraquecimento das empresas e do consumo. Além disso, surgem problemas financeiros em incorporadoras do mercado imobiliário, consideradas como uma das principais atividades econômicas do país. Por isso, os investidores entendem que há uma pressão cada vez maior sobre o governo em promover suporte à economia e que o enfraquecimento chinês possa penalizar os preços das commodities e os países emergentes.

Em consonância, o CPI chinês apresentou uma deflação de 0,3% em julho na avaliação anual. Associado a queda dos preços no portão das fábricas, a segunda maior economia do mundo enfrenta dificuldades com a demanda interna e externa enfraquecida.

Como medida de estímulo, o Banco Popular da China (PBOC) cortou sua taxa principal de juros de um ano para 3,45% e manteve inalterada a taxa de cinco anos no patamar de 4,20%. O PBOC tem pouco espaço para reduzir os juros, uma vez que existe um movimento de enfraquecimento da moeda chinesa e isto poderia desencadear uma fuga massiva de capital. Nesse ambiente, a China tenderá a crescer abaixo do potencial, apesar das medidas de estímulo que vêm sendo anunciadas.

No Brasil, a narrativa que trouxe uma deterioração dos mercados de ativos foi a questão fiscal. O resultado consolidado do Governo Central registrou um déficit e amplia as dúvidas sobre a capacidade de o governo cumprir a meta fiscal. Para corroborar com o pessimismo, o Banco Central divulgou um déficit acumulado do governo com alta de 73,6% para 74,1% em julho.

O mercado se mantém receoso com a postura do governo frente a apresentação do Projeto de Lei Orçamentária Anual (PLOA) de 2024 associado às metas do arcabouço fiscal. O atual governo não prevê cortes nas despesas e não esconde a pressão por mais gastos. Outra pauta de preocupação foi a sanção da nova âncora fiscal com vetos pelo presidente Lula. Essa atitude fragilizou a regra, pois volta a permitir descontos de despesas no resultado fiscal, além de promover um contingenciamento de investimentos.

Apesar das novas estimativas de receita extra com as medidas tributárias que estão sendo preparadas pelo Ministério da Fazenda, a fim de zerar o déficit em 2024, os investidores não se animaram.

No campo monetário, o Copom iniciou o ciclo de corte de juros, alterando o patamar da taxa Selic para 13,25%, após uma queda de 0,50 ponto percentual. A surpresa foi a sinalização de próximos cortes de mesma magnitude para as próximas reuniões, caso o cenário de desinflação permaneça. Ainda assim, o comunicado expressou um cuidado sobre o processo lento da queda de inflação e a reancoragem parcial das expectativas, o que demandaria mais moderação e serenidade.

Sobre os dados econômicos, o PIB do segundo trimestre cresceu 0,9%, acima do esperado. Essa alta é explicada pelo bom desempenho da indústria e dos serviços. Como a atividade de serviços responde por cerca de 70% da economia do país, o resultado do setor influencia ainda mais a expansão do PIB. O consumo das famílias aumentou, derivado dos bons resultados do mercado de trabalho e dos reajustes nos programas de transferência de renda. Em contrapartida, a agricultura recuou, principalmente quando levamos em consideração a base de comparação do forte crescimento do primeiro trimestre. Esse resultado deve trazer bastante otimismo em relação a capacidade de crescimento do país, mas o mercado deve continuar apreensivo com as questões fiscais.

Por fim, o relatório do Novo Caged mostrou a expansão de mais de 142 mil postos de trabalho em julho, evidenciando uma resiliência da economia. Ademais, a taxa de desocupação recuou para 7,9% devido a expansão do número de pessoas trabalhando. Essas apurações mostram o menor custo da política monetária contracionista sobre a economia real, mas a perspectiva permanece com viés de desaceleração econômica nos próximos meses.

Após 4 meses consecutivos de ganhos, o Ibovespa encerrou o mês em queda e a curva de juros voltou a abrir. Por trás destes movimentos, os fatores responsáveis foram a preocupação fiscal no âmbito local e externo, a situação da economia chinesa e norte americana.