



**Instituto de Previdência dos
Servidores Municipais de São Vicente**

**RELATÓRIO MENSAL DE
INVESTIMENTOS
(COORD. DE INVESTIMENTOS)
MAIO DE 2024**



Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de São Vicente



1. Introdução

Sempre visando a transparência para os beneficiários/segurados do RPPS, a Coordenadoria de Investimentos do Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de São Vicente, apresenta o relatório dos investimentos referente ao mês de **maio de 2024**, onde constam as movimentações financeiras realizadas por esta Coordenadoria, com base nas deliberações do Comitê de Investimentos que são fiscalizadas pelo Conselho Fiscal e aprovadas pelo Conselho de Administração. Todas essas deliberações foram registradas em atas, a fim de garantir transparência e publicidade de todos os atos que envolvem os recursos dos segurados.

Além disso, visamos a busca pela rentabilidade dos recursos investidos, acompanhando a meta atuarial estipulada e consequentemente podermos cumprir com a obrigação de pagamento dos benefícios.

Neste relatório serão demonstrados os resultados das aplicações no fechamento do mês de **maio de 2024**.

2. Cenário Econômico

Relatório da LDB Assessoria em Investimentos anexo.



Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de São Vicente



3. Relatório Analítico dos Investimentos

No mês de **maio**, os ativos de renda fixa do art. 7º da Resolução CMN nº 4.963/2021, apresentaram rentabilidade total de 0,91%, onde alguns fundos 100% Títulos Públicos mais uma vez tiveram retorno negativo, em especial os fundos IMA que estão sofrendo bastante neste primeiro semestre.

Na renda variável (“Fundo de Ações”), art. 8º, confirmando a expectativa de que o FED manteria a taxa de juros elevada e a contínua alta do dólar, o IBOVESPA confirmou a antiga expressão “Sell in May and go away” e voltou a amargar grande perda, encerrando o mês com um recuo de 3,04%. Nossos fundos acompanharam o desempenho do índice, e encerraram o mês com um retorno negativo de 3,69%.

Com relação aos fundos de “investimentos no exterior e BDR Nível I”, que correspondem ao Art. 9º da nova resolução, tenho a dizer que voltaram a subir, após um mês de abril bem ruim, finalizando o mês com rendimento discreto de 0,54%.

Os fundos inseridos ao Art. 10º da Resolução nº 4963/2021, “Investimentos Estruturados”, apresentaram uma boa recuperação em relação ao mês anterior em fechou o período com uma alta de 3,61% no mês.

Sendo assim, no consolidado da carteira, o retorno total foi de 0,68%, performando melhor do que em abril, porém, 0,21% abaixo da meta atuarial mensal que fechou maio em 0,89%.



Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de São Vicente

Diante desses dados, os investimentos totais somam **R\$ 350.920.411,97 (trezentos e cinquenta milhões, novecentos e vinte mil, quatrocentos e onze reais e noventa e sete centavos)**, sendo **77,00%** alocados em renda fixa (art. 7º), **9,59%** em renda variável (art. 8º), **4,17%** em investimentos no exterior e ações BDR nível I (art. 9º) e **9,24%** em investimentos estruturados (art. 10º).

4. Movimentações nos Fundos de Investimentos na Competência (APRs)

No mês de **maio**, além das movimentações cotidianas de aplicação de taxa de administração e resgates para os pagamentos mensais, a Prefeitura solicitou o resgate no valor de R\$ 4.081.363,63 do Fundo e Oscilação de Risco (FOR) ou Itaú Institucional Renda Fixa DI, para pagamento da folha.

5. Títulos Públicos adquiridos na competência:

ATIVO	Intermediário	Custodiante	Valor	Taxa	Vencimento
Não houve.					

6. Rentabilidade da carteira no mês:

Mês	Maio
Rentabilidade	0,68%
Meta Atuarial (5,26%)	0,89%
Diferença	-0,21%



Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de São Vicente



7. Análise de Risco da Carteira (Value-At-Risk “VaR”)

Horizonte 21 dias/Nível de Confiança 95%:

TIPO DE ATIVO	RISCO
Renda Fixa	0,25%
Renda Variável	6,15%
Investimentos no Exterior	6,88%
Investimentos Estruturados e BDR Nível I	4,64%
Consolidado	1,00%

De acordo com o previsto na Política de Investimentos, os limites de risco com base no VaR (indicador de risco que considera a perda máxima em um período de tempo e intervalo de confiança definido) são de 5% (cinco por cento) para a renda fixa e 20% (vinte por cento) para a renda variável, portanto, o nível de exposição a riscos da carteira do IPRESV está enquadrado ao limite aceitável.

8. Análise de Liquidez da Carteira:

PERÍODO	VALOR	(%)
De 0 a 30 dias	R\$ 186.644.323,14	53,19
De 31 a 365 dias	R\$ 57.092.009,72	16,27
Acima de 365 dias	R\$ 107.184.079,11	30,54
Total	R\$ 356.967.543,94	100,00



Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de São Vicente

Estão disponibilizados em nosso site (www.ipresv.sp.gov.br) o relatório dos investimentos e a avaliação e monitoramento de risco da carteira do IPRESV.

Todas as movimentações financeiras dos recursos do IPRESV aqui descritas, tanto as aplicações como os resgates foram aprovadas pelo Comitê de investimentos, com base na Política de Investimentos previamente aprovada pelo Conselho de Administração.

São Vicente, 08/07/2024.

Paolo Brigido da Fonseca

Coordenador de Investimentos

CGINVIII/DIRIGIII



LDB
EMPRESAS

SÃO VICENTE - CONSOLIDADO
MAIO 2024



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.05.2024.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

77,00%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,771000%)	0,47	0,04	0,88	4,79	10.773.922,81	3,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,310000%)	0,25	0,04	0,92	4,96	3.256.923,89	0,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,422000%)	0,39	0,04	0,93	5,00	11.020.616,04	3,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,775000%)	0,25	0,04	0,96	5,14	3.045.352,70	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,830000%)	0,25	0,04	0,96	5,17	7.753.715,91	2,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,133000%)	0,25	0,05	0,99	5,29	3.277.592,73	0,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,591200%)	0,54	0,05	1,02	5,54	5.248.030,82	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,190000%)	0,46	0,04	0,83	4,56	10.965.701,16	3,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,400000%)	0,50	0,04	0,85	4,64	11.022.786,47	3,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,323000%)	0,44	0,04	0,92	4,96	5.370.672,30	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,428000%)	0,41	0,04	0,93	5,06	5.215.459,99	1,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,852000%)	0,50	0,04	0,88	4,83	12.441.070,11	3,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,062000%)	0,51	0,04	0,90	4,91	4.280.075,57	1,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,513000%)	0,53	0,04	0,94	5,10	5.200.143,20	1,48
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,36	0,04	0,91	4,92	98.872.063,70	28,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,80	0,08	0,72	3,44	4.798.973,29	1,37	6.634.026.168,29	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,87	0,24	1,31	-0,24	5.234.407,73	1,49	4.952.904.793,10	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	3,95	0,19	1,38	-0,11	1.942.862,09	0,55	1.010.421.816,77	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,68	0,12	1,03	2,75	14.459.085,62	4,12	4.696.964.699,86	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,93	0,36	1,56	-2,90	4.771.464,06	1,36	1.292.001.205,56	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,85	0,24	1,30	-0,23	7.322.375,65	2,09	4.414.746.482,17	0,17
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,65	0,21	0,75	2,11	19.506.276,70	5,56	2.239.801.280,64	0,87
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,07	0,04	0,82	4,36	8.110.141,43	2,31	41.098.695.768,75	0,02
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	6,00	0,36	1,57	-2,93	1.181.532,60	0,34	432.880.328,17	0,27
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,51	0,18	1,03	1,51	67.327.119,17	19,19		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	0,88	4,81	6.552.103,80	1,87	11.765.933.444,23	0,06
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,74	0,10	1,03	2,78	12.546.123,86	3,58	859.846.340,10	1,46
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,04	0,86	4,63	22.670.148,86	6,46	5.878.240.284,89	0,39
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,28	0,26	1,30	-1,35	3.760.935,92	1,07	397.568.884,35	0,95
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,44	0,08	0,94	3,77	45.529.312,44	12,97		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
XP	XP	CDB - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	3,07	0,92	0,92	4,93	12.033.828,87	3,43		
XP	XP	CDB - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 6,35% a.a	3,11	0,94	0,94	4,99	635.317,05	0,18		
BRADESCO	BRADESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,010% a.a	2,75	0,82	0,82	4,86	4.169.395,54	1,19		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRDESCO	BRDESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	2,82	0,90	0,90	4,98	3.621.937,87	1,03		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,20% a.a	3,28	0,14	0,14	5,19	2.571.614,87	0,73		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,76% a.a	5,58	0,15	0,15	5,34	672.459,87	0,19		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BRB BANCO DE BRASILIA SA 7,80% a.a	3,20	1,05	1,05	5,58	9.951.617,01	2,84		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BRB BANCO DE BRASILIA SA 7,90% a.a	3,60	1,02	1,02	5,65	13.069.074,46	3,72		
ITAU	ITAU	LETRA FINANCEIRA - ITUB - ITAU UNIBANCO HOLDING SA 6,30% a.a	2,70	0,00	0,00	4,11	0,00	0,00		
SICOOB	SICOOB	RECIBO DE DEPÓSITO COOPERATIVO - SICOOB 11,15 % a.a	2,84	0,83	0,83	3,31	1.446.342,25	0,41		
SICOOB	SICOOB	RECIBO DE DEPÓSITO COOPERATIVO - SICOOB 13,21 % a.a	3,15	0,81	0,81	4,26	2.573.720,43	0,73		
Sub-total Artigo 7º IV			2,97	0,78	0,78	5,06	50.745.308,22	14,46		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,07	0,04	0,85	4,55	7.752.383,96	2,21	17.303.967.902,17	0,04
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,07	0,04	0,85	4,55	7.752.383,96	2,21		
Renda Fixa			1,10	0,24	0,91	3,95	270.226.187,49	77,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

9,59%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	15,71	-0,24	-3,86	-7,18	900.815,33	0,26	184.113.831,21	0,49
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	14,06	-0,74	-3,85	-12,94	4.026.652,27	1,15	108.438.852,22	3,71
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	18,35	-1,32	-4,69	-14,21	6.579.148,65	1,87	164.897.802,42	3,99
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIA DIVIDENDOS	13,67	-0,58	-3,74	-9,67	3.853.855,59	1,10	489.323.342,99	0,79
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15,64	-0,54	-3,92	-11,63	5.028.477,14	1,43	1.162.832.876,92	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	20,84	-1,43	-2,35	-15,07	1.174.509,02	0,33	100.137.979,79	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,56	-0,72	-3,37	-14,74	1.276.854,40	0,36	602.943.730,12	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	14,44	-0,67	-3,81	-10,05	2.767.504,40	0,79	711.095.279,01	0,39
MONGERAL	BEM	MAG BRASIL FIA	15,25	-0,44	-3,23	-9,75	3.145.088,81	0,90	285.854.110,04	1,10
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	13,94	-0,36	-3,15	-9,63	511.814,93	0,15	814.344.532,62	0,06
MOS	BEM	QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	19,14	-0,71	-0,52	-9,48	1.004.423,85	0,29	86.473.468,80	1,16
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	14,02	-0,67	-3,97	-11,65	1.471.146,85	0,42	198.655.150,74	0,74
SPX	INTRAG	SPX APACHE FIC FIA	14,51	-0,93	-2,14	-4,75	1.905.047,57	0,54	510.897.453,92	0,37
Sub-total Artigo 8º I			15,18	-0,79	-3,69	-11,65	33.645.338,81	9,59		
Renda Variável			15,18	-0,79	-3,69	-11,65	33.645.338,81	9,59		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,17%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
MIRAE ASSET	SANTANDER	BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD FIC FIA IE	19,21	0,24	2,63	15,96	1.111.306,71	0,32	19.153.306,22	5,80
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	12,52	0,39	1,74	7,83	7.620.611,34	2,17	59.790.225,47	12,75
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	26,98	-0,58	-3,10	0,29	4.657.601,80	1,33	123.940.652,72	3,76
Sub-total Artigo 9º II			14,80	0,04	0,07	5,68	13.389.519,85	3,82		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	12,22	0,20	5,86	15,95	1.247.998,16	0,36	733.091.092,91	0,17
Sub-total Artigo 9º III			12,22	0,20	5,86	15,95	1.247.998,16	0,36		

Investimentos no Exterior			14,10	0,05	0,54	6,48	14.637.518,01	4,17		
----------------------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	-------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,24%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	9,41	-0,50	-3,25	-6,52	3.543.073,29	1,01	187.882.893,53	1,89
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5,22	-0,16	0,25	0,49	3.014.825,71	0,86	421.794.694,84	0,71
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	12,95	0,16	5,01	12,08	19.760.078,13	5,63	748.765.584,43	2,64
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	11,34	0,17	5,11	12,53	6.093.390,53	1,74	316.839.202,25	1,92
Sub-total Artigo 10º I			10,15	0,06	3,61	8,76	32.411.367,66	9,24		
Investimentos Estruturados			10,15	0,06	3,61	8,76	32.411.367,66	9,24		
Total			2,58	0,12	0,68	2,83	350.920.411,97	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	98.872.063,70	28,18	0,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	67.327.119,17	19,19	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	45.529.312,44	12,97	0,00	15,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	50.745.308,22	14,46	0,00	16,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	7.752.383,96	2,21	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	270.226.187,49	77,00					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	33.645.338,81	9,59	0,00	12,00	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	33.645.338,81	9,59					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	13.389.519,85	3,82	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.247.998,16	0,36	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	14.637.518,01	4,17					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	32.411.367,66	9,24	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	32.411.367,66	9,24					15,00
Total		350.920.411,97	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,91 108,76	4,92 111,94	2,72 105,42	5,85 109,75	10,09 84,01	892.283,44	4.708.948,39
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,03 123,12	1,51 34,27	0,76 29,54	3,47 65,02	8,50 70,81	646.626,25	927.783,19
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,94 112,50	3,77 85,64	2,16 83,66	5,04 94,46	10,03 83,55	458.037,49	1.906.840,75
Artigo 7º IV % do CDI	0,78 93,33	5,06 114,99	2,86 110,99	5,93 111,25	10,72 89,29	454.378,17	2.819.374,17
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,85 102,33	4,55 103,37	2,67 103,64	5,51 103,36	12,45 103,70	65.550,08	317.846,04
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,69 -0,65	-11,65 -2,64	-8,48 -3,12	-6,59 -2,48	2,73 -9,98	-1.287.461,19	-4.274.130,17
Artigo 9º II % do CDI	0,07 8,75	5,68 129,12	-1,12 -43,65	11,78 220,91	14,81 123,34	9.751,39	719.534,59
Artigo 9º III % do CDI	5,86 703,08	15,95 362,66	7,97 309,24	18,86 353,53	26,60 221,59	69.073,45	171.680,69
Artigo 10º I % do CDI	3,61 432,69	8,76 199,07	2,85 110,60	13,62 255,33	27,41 228,34	1.128.002,39	2.605.848,15
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total)						2.436.241,47	9.903.725,80

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (6,323000%)	5.482.536,27	0,00	0,00	161.598,63	5.370.672,30	49.734,66	260.752,57
NTN-B 150535 (6,428000%)	5.324.909,93	0,00	0,00	158.189,91	5.215.459,99	48.739,97	258.248,48
NTN-B 150545 (5,852000%)	12.689.102,24	0,00	0,00	358.546,96	12.441.070,11	110.514,83	587.963,03
NTN-B 150545 (6,062000%)	4.367.701,64	0,00	0,00	126.375,18	4.280.075,57	38.749,11	205.829,82
NTN-B 150545 (6,513000%)	5.312.785,45	0,00	0,00	161.598,63	5.200.143,20	48.956,38	259.332,28
NTN-B 150824 (5,771000%)	10.680.215,04	0,00	0,00	0,00	10.773.922,81	93.707,77	497.523,12
NTN-B 150824 (6,310000%)	3.227.229,54	0,00	0,00	0,00	3.256.923,89	29.694,35	155.164,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150824 (6,422000%)	10.919.174,47	0,00	0,00	0,00	11.020.616,04	101.441,57	529.647,87
NTN-B 150824 (6,775000%)	3.016.488,38	0,00	0,00	0,00	3.045.352,70	28.864,32	150.352,91
NTN-B 150824 (6,830000%)	7.679.900,84	0,00	0,00	0,00	7.753.715,91	73.815,07	384.393,38
NTN-B 150824 (7,133000%)	3.245.623,12	0,00	0,00	0,00	3.277.592,73	31.969,61	166.162,18
NTN-B 150824 (7,591200%)	5.194.993,83	0,00	0,00	0,00	5.248.030,82	53.036,99	277.806,52
NTN-B 150826 (5,190000%)	10.875.321,85	0,00	0,00	0,00	10.965.701,16	90.379,31	482.286,51
NTN-B 150830 (5,400000%)	10.930.106,97	0,00	0,00	0,00	11.022.786,47	92.679,50	493.484,92
	98.946.089,57	0,00	0,00	966.309,31	98.872.063,70	892.283,44	

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	4.764.599,63	0,00	0,00	0,00	4.798.973,29	34.373,66	159.640,88
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5.166.953,36	0,00	0,00	0,00	5.234.407,73	67.454,37	-12.728,35
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	1.916.322,59	0,00	0,00	0,00	1.942.862,09	26.539,50	-2.182,70
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.319.789,03	0,00	-7.691,82	0,00	14.459.085,62	146.988,41	411.762,53
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.698.229,99	0,00	0,00	0,00	4.771.464,06	73.234,07	-142.364,23
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.228.405,28	0,00	0,00	0,00	7.322.375,65	93.970,37	-17.594,40
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	17.244.742,99	2.129.766,65	0,00	0,00	19.506.276,70	131.767,06	350.967,11
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	5.482.687,22	4.053.431,80	-1.479.978,45	0,00	8.110.141,43	54.000,86	215.965,98
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	1.163.234,65	0,00	0,00	0,00	1.181.532,60	18.297,95	-35.683,63
	61.984.964,74	6.183.198,45	-1.487.670,27	0,00	67.327.119,17	646.626,25	

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	6.494.925,46	0,00	0,00	0,00	6.552.103,80	57.178,34	300.739,07
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	12.418.735,22	0,00	0,00	0,00	12.546.123,86	127.388,64	339.518,31
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	26.526.319,40	0,00	-4.081.363,63	0,00	22.670.148,86	225.193,09	1.318.153,45
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	3.712.658,50	0,00	0,00	0,00	3.760.935,92	48.277,42	-51.570,08
	49.152.638,58	0,00	-4.081.363,63	0,00	45.529.312,44	458.037,49	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CDB - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	11.923.723,16	0,00	0,00	0,00	12.033.828,87	110.105,71	565.167,06
CDB - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 6,35% a.a	629.430,06	0,00	0,00	0,00	635.317,05	5.886,99	30.190,16
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,010% a.a	4.135.459,64	0,00	0,00	0,00	4.169.395,54	33.935,90	193.312,20
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	3.589.685,34	0,00	0,00	0,00	3.621.937,87	32.252,53	171.758,46
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,20% a.a	2.568.024,54	0,00	0,00	0,00	2.571.614,87	3.590,33	126.794,99
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,76% a.a	671.479,45	0,00	0,00	0,00	672.459,87	980,42	35.294,02
LETRA FINANCEIRA - BRB BANCO DE BRASILIA SA 7,80% a.a	9.848.283,08	0,00	0,00	0,00	9.951.617,01	103.333,93	525.726,15
LETRA FINANCEIRA - BRB BANCO DE BRASILIA SA 7,90% a.a	12.937.370,87	0,00	0,00	0,00	13.069.074,46	131.703,59	698.702,03
LETRA FINANCEIRA - ITUB - ITAU UNIBANCO HOLDING SA 6,30% a.a	8.131.228,68	0,00	-8.131.228,68	0,00	0,00	0,00	320.841,83
RECIBO DE DEPÓSITO COOPERATIVO - SICOOB 11,15 % a.a	1.434.388,81	0,00	0,00	0,00	1.446.342,25	11.953,44	46.342,25
RECIBO DE DEPÓSITO COOPERATIVO - SICOOB 13,21 % a.a	2.553.085,10	0,00	0,00	0,00	2.573.720,43	20.635,33	105.245,02
	58.422.158,73	0,00	-8.131.228,68	0,00	50.745.308,22	454.378,17	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	7.686.833,88	0,00	0,00	0,00	7.752.383,96	65.550,08	317.846,04
	7.686.833,88	0,00	0,00	0,00	7.752.383,96	65.550,08	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	936.953,55	0,00	0,00	0,00	900.815,33	-36.138,22	-69.710,01
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4.187.726,05	0,00	0,00	0,00	4.026.652,27	-161.073,78	-598.399,83
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	6.902.692,69	0,00	0,00	0,00	6.579.148,65	-323.544,04	-1.089.948,30
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	4.003.533,54	0,00	0,00	0,00	3.853.855,59	-149.677,95	-412.335,65
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.233.826,07	0,00	0,00	0,00	5.028.477,14	-205.348,93	-662.020,40
FIA CAIXA CONSUMO	1.202.820,44	0,00	0,00	0,00	1.174.509,02	-28.311,42	-208.367,41
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.321.349,10	0,00	0,00	0,00	1.276.854,40	-44.494,70	-220.693,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	2.877.060,29	0,00	0,00	0,00	2.767.504,40	-109.555,89	-309.336,64
MAG BRASIL FIA	3.250.045,86	0,00	0,00	0,00	3.145.088,81	-104.957,05	-234.810,39
OCCAM FIC FIA	528.450,43	0,00	0,00	0,00	511.814,93	-16.635,50	-54.538,08
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	1.009.721,06	0,00	0,00	0,00	1.004.423,85	-5.297,21	-105.158,33
SICREDI SCHRODERS IBOVSPA - FIA	1.531.962,85	0,00	0,00	0,00	1.471.146,85	-60.816,00	-193.900,22
SPX APACHE FIC FIA	1.946.658,07	0,00	0,00	0,00	1.905.047,57	-41.610,50	-94.952,43
	34.932.800,00	0,00	0,00	0,00	33.645.338,81	-1.287.461,19	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD FIC FIA IE	1.082.826,62	0,00	0,00	0,00	1.111.306,71	28.480,09	152.922,25
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	7.490.245,19	0,00	0,00	0,00	7.620.611,34	130.366,15	553.133,27
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	4.806.696,65	0,00	0,00	0,00	4.657.601,80	-149.094,85	13.479,07
	13.379.768,46	0,00	0,00	0,00	13.389.519,85	9.751,39	

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	1.178.924,71	0,00	0,00	0,00	1.247.998,16	69.073,45	171.680,69
	1.178.924,71	0,00	0,00	0,00	1.247.998,16	69.073,45	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	3.662.058,75	0,00	0,00	0,00	3.543.073,29	-118.985,46	-247.268,68
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	3.007.247,74	0,00	0,00	0,00	3.014.825,71	7.577,97	14.825,71
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	18.817.148,64	0,00	0,00	0,00	19.760.078,13	942.929,49	2.130.254,04
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	5.796.910,14	0,00	0,00	0,00	6.093.390,53	296.480,39	678.286,03
	31.283.365,27	0,00	0,00	0,00	32.411.367,66	1.128.002,39	

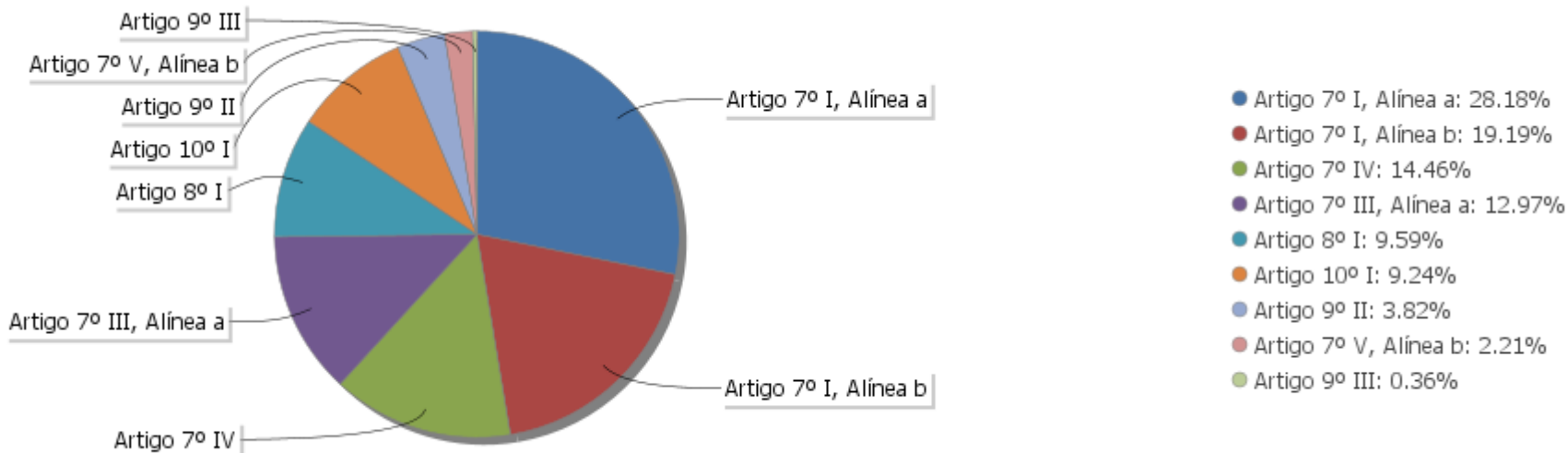
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

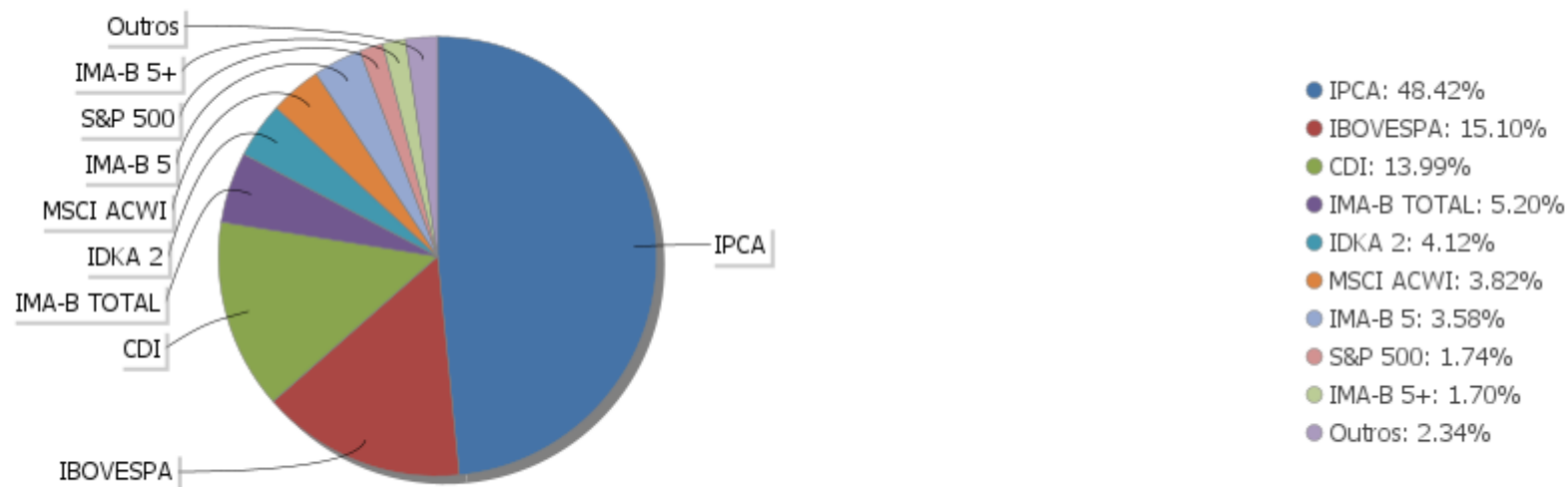
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	186.644.323,14	53,19	50,00	186.644.323,14	53,19	50,00
de 31 dias a 365 dias	57.092.009,72	16,27		243.736.332,86	69,46	50,00
acima de 365 dias	107.184.079,11	30,54		350.920.411,97	100,00	50,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

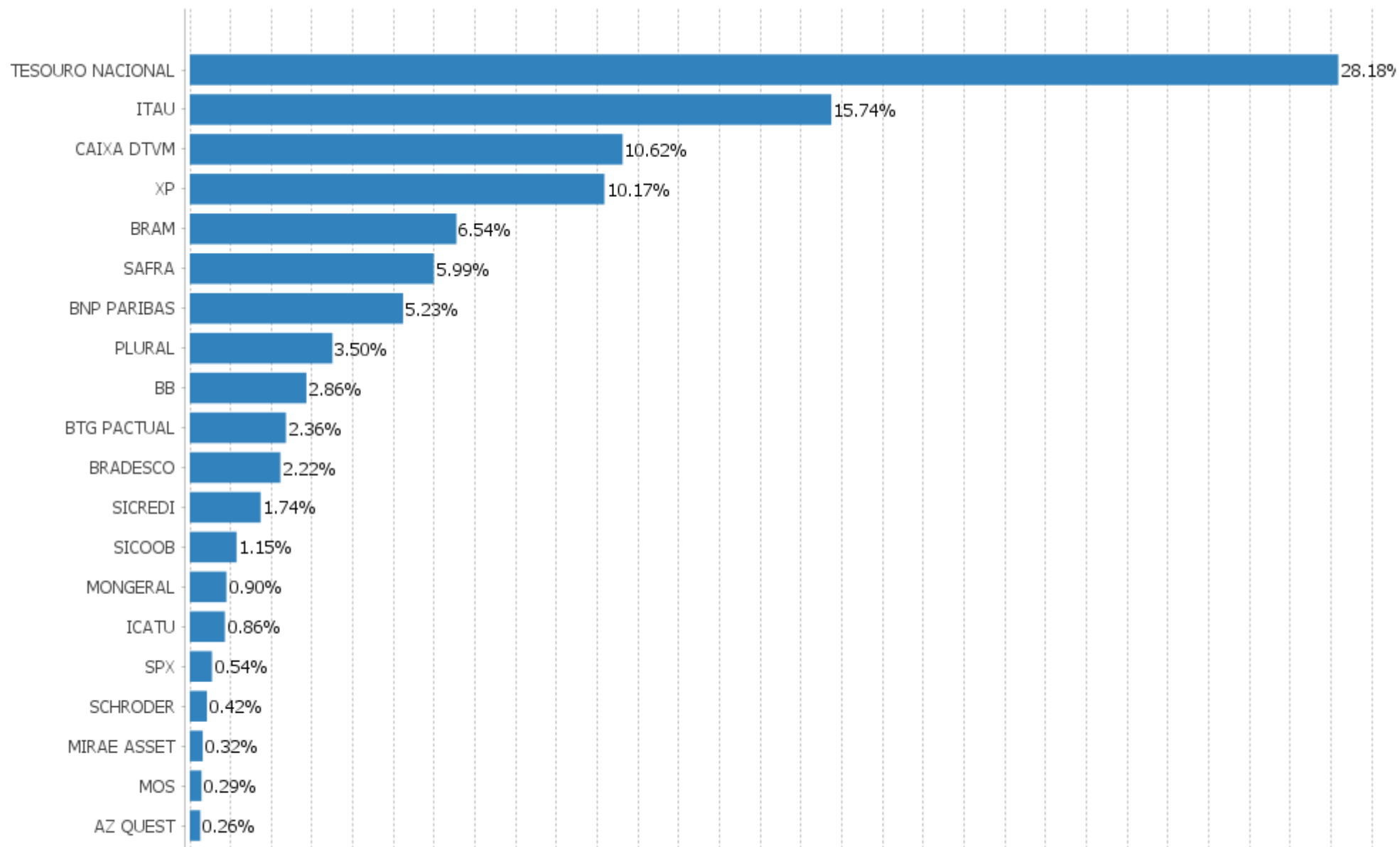


Alocação Por Estratégia

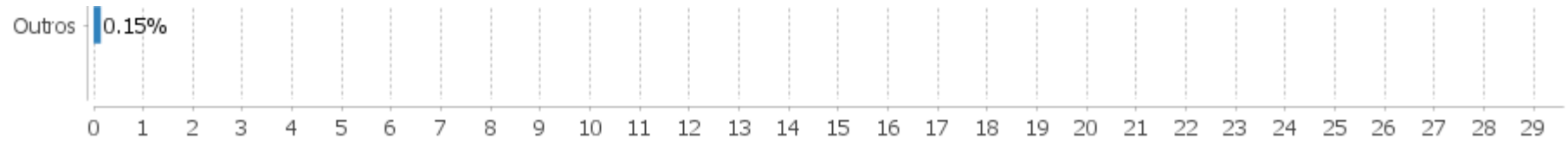


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,36	1,39	0,96	-0,58	0,68								2,83
INPC + 5,26%	1,02	1,20	0,60	0,82	0,89								4,61
p.p. indexador	-0,66	0,19	0,36	-1,40	-0,21								-1,79
2023	1,72	0,02	1,23	1,07	1,91	2,10	1,15	-0,12	-0,22	-0,48	3,04	2,06	14,27
INPC + 5,26%	0,91	1,14	1,11	0,90	0,81	0,33	0,34	0,67	0,52	0,55	0,51	0,96	9,10
p.p. indexador	0,81	-1,12	0,12	0,17	1,10	1,77	0,82	-0,79	-0,74	-1,03	2,53	1,10	5,18
2022	-1,59	-0,07	2,54	-1,44	0,23	-1,72	1,96	0,64	-0,46	1,75	-0,20	-0,18	1,37
INPC + 5,04%	1,08	1,38	2,15	1,42	0,88	1,03	-0,19	0,14	0,09	0,86	0,77	1,12	11,25
p.p. indexador	-2,67	-1,45	0,40	-2,86	-0,65	-2,76	2,15	0,50	-0,55	0,88	-0,97	-1,30	-9,88
2021	-0,80	-1,08	0,50	1,25	1,35	0,53	-0,83	-0,87	-1,44	-1,75	1,28	0,72	-1,20
INPC + 5,47%	0,69	1,20	1,35	0,81	1,41	1,05	1,49	1,35	1,65	1,59	1,27	1,22	16,16
p.p. indexador	-1,50	-2,29	-0,85	0,44	-0,06	-0,51	-2,32	-2,22	-3,09	-3,34	0,01	-0,50	-17,36
2020	0,37	-1,02	-8,71	2,51	2,16	2,34	3,92	-0,89	-1,68	-0,23	3,36	3,94	5,49
INPC + 6,00%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. indexador	-0,34	-1,61	-9,40	2,27	1,94	1,55	2,94	-1,74	-3,04	-1,62	1,94	1,96	-6,26
2019	3,68	0,35	0,43	1,28	2,33	2,92	1,33	-0,10	2,15	2,38	-1,05	2,74	19,95
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	2,81	-0,66	-0,78	0,19	1,67	2,47	0,69	-0,73	1,72	1,81	-2,06	1,03	9,17
2018	1,94	0,51	0,85	0,19	-2,24	-0,23	1,89	-0,53	0,08	5,08	0,90	1,26	9,96
INPC + 6,00%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	1,20	-0,08	0,29	-0,51	-3,16	-2,15	1,13	-1,07	-0,66	4,16	0,69	0,66	0,37
2017	1,43	2,24	1,15	0,15	-0,53	0,43	2,86	1,21	1,36	0,03	-0,23	0,89	11,50
INPC + 6,00%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. indexador	0,50	1,58	0,29	-0,34	-1,40	0,24	2,21	0,71	0,91	-0,83	-0,88	0,16	3,39

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	44	49,44
Meses abaixo - Meta Atuarial	45	50,56
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,08	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-8,71	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,06	2,33	-1,27	2,34
06 meses	4,94	5,62	-0,67	2,22
12 meses	10,77	8,73	2,04	2,58
24 meses	19,56	18,56	1,01	3,29
36 meses	16,29	39,69	-23,40	4,37
48 meses	30,72	60,88	-30,15	4,75
60 meses	37,52	73,99	-36,46	6,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

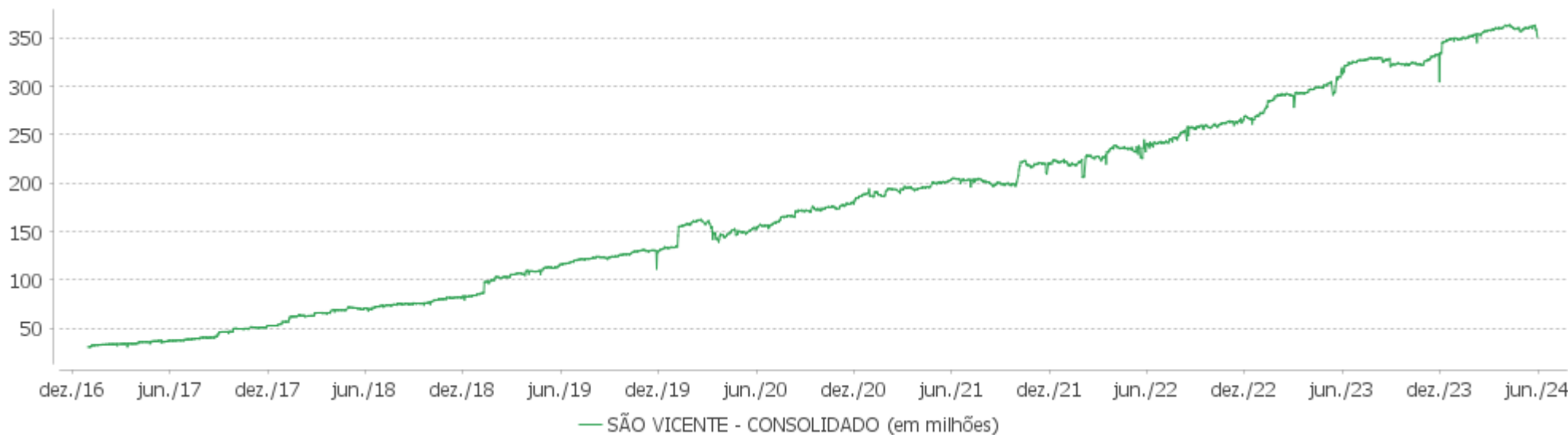
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	82,57	116,32	-33,74	6,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

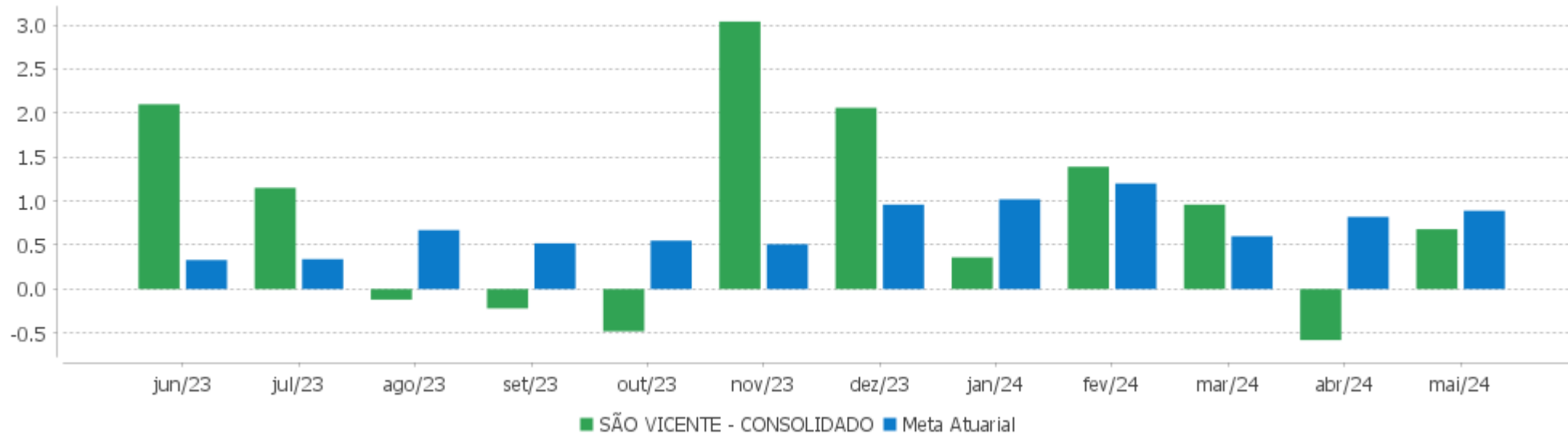


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,76% a.a Var. IPCA p.p.	0,15 -0,31	5,34 3,07	2,89 1,89	6,20 3,36	11,14 7,22	23,40 15,38	
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	4,98 2,71	2,93 1,93	5,77 2,93	10,09 6,17		
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,010% a.a Var. IPCA p.p.	0,82 0,36	4,86 2,59	2,88 1,88	5,62 2,78	9,93 6,00		
LETRA FINANCEIRA - BRB BANCO DE BRASILIA SA 7,90% a.a Var. IPCA p.p.	1,02 0,56	5,65 3,38	3,32 2,32	6,57 3,73	11,79 7,87	25,62 17,61	
RECIBO DE DEPÓSITO COOPERATIVO - SICOOB 11,15 % a.a % do CDI	0,83 100,00	3,31 100,00	2,58 100,00				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,20% a.a Var. IPCA p.p.	0,14 -0,32	5,19 2,92	2,83 1,82	5,99 3,15	10,80 6,87	23,35 15,33	
CDB - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 6,35% a.a Var. IPCA p.p.	0,94 0,48	4,99 2,72	2,81 1,81	5,87 3,03	10,24 6,32	21,99 13,97	
LETRA FINANCEIRA - BRB BANCO DE BRASILIA SA 7,80% a.a Var. IPCA p.p.	1,05 0,59	5,58 3,31	3,16 2,15	6,58 3,74	11,73 7,80	25,32 17,30	
CDB - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	0,92 0,46	4,93 2,66	2,77 1,77	5,80 2,96	10,09 6,16	21,65 13,63	
LETRA FINANCEIRA - ITUB - ITAU UNIBANCO HOLDING SA 6,30% a.a Var. IPCA p.p.	0,00 -0,46	4,11 1,84	2,02 1,02	4,88 2,04	9,21 5,28	20,89 12,88	20,89 0,20
RECIBO DE DEPÓSITO COOPERATIVO - SICOOB 13,21 % a.a % do CDI	0,81 96,99	4,26 96,94	2,50 96,96	5,17 96,92	11,69 97,35		
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,85 102,33	4,55 103,37	2,67 103,64	5,51 103,36	12,45 103,70	28,04 103,46	40,11 108,02
NTN-B 150545 (5,852000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,83 2,56	2,65 1,64	5,85 3,00	9,93 6,01	14,36 6,35	
NTN-B 150824 (6,830000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,50	5,17 2,90	2,88 1,88	6,12 3,27	10,72 6,80	19,50 11,48	34,81 14,12
NTN-B 150535 (6,428000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,47	5,06 2,79	2,79 1,78	6,07 3,23	10,47 6,54	18,71 10,69	
NTN-B 150824 (7,591200%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,56	5,54 3,27	3,07 2,06	6,49 3,65	11,50 7,58	17,60 9,58	
NTN-B 150830 (5,400000%)	0,85	4,64	2,54	5,51	9,35	19,93	37,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,39	2,37	1,53	2,66	5,42	11,91	17,06
NTN-B 150824 (7,133000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,53	5,29 3,02	2,96 1,95	6,26 3,42	11,03 7,11	20,15 12,14	
NTN-B 150535 (6,323000%) Var. IPCA p.p.	0,92 0,46	4,96 2,69	2,76 1,76	6,02 3,18	10,36 6,43	18,50 10,49	
NTN-B 150545 (6,513000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,48	5,10 2,83	2,81 1,80	6,19 3,35	10,63 6,71	18,89 10,88	
NTN-B 150824 (6,775000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,50	5,14 2,88	2,87 1,87	6,09 3,25	10,66 6,74	19,38 11,36	34,62 13,93
NTN-B 150824 (5,771000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,79 2,53	2,63 1,62	5,60 2,75	9,63 5,71	20,67 12,65	34,98 14,29
NTN-B 150824 (6,422000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,47	5,00 2,73	2,78 1,78	5,92 3,07	10,30 6,38	18,62 10,60	33,38 12,70
NTN-B 150545 (6,062000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	4,91 2,64	2,70 1,69	5,95 3,11	10,16 6,23	21,57 13,56	36,28 15,59
NTN-B 150826 (5,190000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,37	4,56 2,29	2,49 1,48	5,35 2,51	9,08 5,15	19,40 11,38	36,84 16,15
NTN-B 150824 (6,310000%) Var. IPCA p.p.	0,92 0,46	4,96 2,69	2,76 1,75	5,86 3,02	10,19 6,26	18,37 10,36	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,03	-0,23 -0,10	-0,30 -0,07	2,49 -0,13	6,35 -0,21	17,30 -0,42	22,38 -0,75
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,38 0,06	-0,11 0,02	-0,36 -0,13	2,20 -0,42	5,52 -1,04	16,80 -0,92	23,15 0,03
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,03 -0,04	2,75 -0,27	1,56 -0,21	4,20 -0,33	8,99 -0,24	18,09 -0,69	28,84 -0,91
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,31 -0,02	-0,24 -0,11	-0,29 -0,06	2,49 -0,12	6,25 -0,31	17,16 -0,56	22,13 -1,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,72 0,26	3,44 1,17	1,78 0,78	4,42 1,58	11,34 7,41	25,22 17,21	31,28 10,59
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	1,56 -0,03	-2,90 -0,04	-1,95 -0,04	0,92 -0,06	4,18 -0,06	15,43 -0,59	14,55 -1,19
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,82 98,64	4,36 99,19	2,55 99,05	5,29 99,23	11,92 99,25	26,92 99,33	37,03 99,72
ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	1,57 -0,02	-2,93 -0,08	-1,96 -0,05	0,87 -0,11	4,01 -0,22	15,49 -0,52	14,92 -0,81
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,75	2,11	1,07	3,76	9,65	22,11	32,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,29	-0,15	0,06	0,92	5,72	14,09	11,69
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,86 103,32	4,63 105,20	2,70 104,63	5,62 105,37	12,92 107,62	28,34 104,56	39,75 107,06
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	2,78 -0,14	1,54 -0,08	4,26 -0,16	8,60 -0,34	18,50 -0,73	29,18 -1,43
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,88 105,64	4,81 109,38	2,76 107,27	5,79 108,62	13,05 108,74	28,67 105,80	39,70 106,91
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,03	-1,35 -1,22	-1,06 -0,83	1,45 -1,17	4,73 -1,83	14,16 -3,55	19,53 -3,60
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-3,81 -0,77	-10,05 -1,05	-7,13 -1,77	-4,78 -0,67	9,47 -3,23	3,71 -5,95	-9,17 -5,91
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-0,52 2,51	-9,48 -0,47	-7,76 -2,40	-4,38 -0,27	11,87 -0,83	20,76 11,11	-5,35 -2,09
MAG BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,23 -0,19	-9,75 -0,74	-5,86 -0,49	-4,73 -0,62	8,26 -4,45	-2,84 -12,49	-16,57 -13,31
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,74 -2,75	-9,67 -4,37	-7,12 -4,39	-4,69 -5,93	9,99 -9,57	7,89 -10,65	3,15 -18,25
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,92 -0,89	-11,63 -2,63	-10,72 -5,36	-7,36 -3,25	4,96 -7,74	0,34 -9,31	-35,48 -32,22
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-2,35 -0,10	-15,07 -0,44	-7,22 -0,27	-10,00 -0,48	-8,71 -1,02	-24,21 -1,93	-52,80 -1,87
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-3,85 -0,81	-12,94 -3,93	-8,49 -3,12	-8,31 -4,20	0,49 -12,21	-6,66 -16,32	-16,48 -13,22
SPX APACHE FIC FIA Var. IBRX 100 p.p.	-2,14 1,04	-9,59 -1,02	-6,47 -1,30	-4,90 -1,34	9,40 -3,84	21,70 13,51	2,70 7,96
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,86 -0,82	-7,18 1,83	-7,29 -1,92	-2,13 1,98	12,44 -0,26	2,29 -7,36	-16,00 -12,74
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	-3,37 0,02	-14,74 -0,22	-9,07 -0,11	-8,83 -0,33	-5,11 -0,72	-12,61 -1,20	-36,81 -1,59
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,97 -0,93	-11,65 -2,64	-7,39 -2,02	-6,25 -2,14	6,34 -6,36	4,96 -4,70	-5,16 -1,89
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,15 -0,11	-9,63 -0,62	-7,14 -1,77	-5,21 -1,10	10,19 -2,52	3,74 -5,91	-9,26 -5,99
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-4,69 -1,65	-14,21 -5,20	-10,54 -5,18	-8,62 -4,51	-5,67 -18,38	-14,81 -24,46	-33,82 -30,56
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5,86	15,95	7,97	18,86	26,60	36,89	14,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	8,90	24,96	13,33	22,97	13,90	27,24	17,85
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	2,63 -2,59	15,96 -1,03	5,15 -3,38	24,03 3,89	15,58 -9,43	39,40 6,03	-13,96 -24,57
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,74 -3,48	7,83 -9,16	0,83 -7,71	10,08 -10,06	13,36 -11,65	20,69 -12,68	7,94 -2,68
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-3,10 -8,33	0,29 -16,70	-5,47 -14,00	11,97 -8,17	17,07 -7,93	26,88 -6,50	-45,31 -55,92
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP Var. IBOVESPA p.p.	-3,25 -0,21	-6,52 2,48	-5,49 -0,13	-3,47 0,64	10,67 -2,04		
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,25 3,29	-0,05 8,96	0,04 5,40	3,81 7,92	11,81 -0,90	27,63 17,98	26,78 30,04
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP Var. S&P 500 p.p.	5,11 -1,10	12,53 -7,27	4,66 -4,26	18,42 -4,29	33,85 3,98	48,50 6,94	56,13 30,37
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	5,01 8,05	12,08 21,09	4,39 9,76	17,87 21,98	32,77 20,07	46,52 36,87	53,57 56,83
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO Var. INPC + 5,26% p.p.	0,68 -0,21	2,83 -1,79	1,06 -1,27	4,94 -0,67	10,77 2,04	19,56 0,86	16,29 -23,53
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST ACOES FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+1 du	D+0	D+27	D+29	20% s/ 100 IBOVSPA	2,00
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+1 du	D+0	D+5 du	D+7 du	Cobrança semestral, no último dia útil de dezembro e junho ou no resgate total ou parcial das cotas, o que ocorrer primeiro	2,00
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	D+0	D+0	D+0	D+0		0,35
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD FIC FIA IE	D+1	D+1	D+1 du	D+5 du		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA CONSUMO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,60
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+2		
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		1,72
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	D+1	D+1	D+1	D+5		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+30	D+32	-	2,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,18
MAG BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	-	3,00
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D+1 du	D+0	D+10	D+13	-	2,00
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du		1,00
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	D+0	D+0	D+0	D+1		
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA - FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
SPX APACHE FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+60 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+62 (isento de taxa de resgate)	O GESTOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					VARIAÇÃO DO IBRX 100, APURADO PELA B4	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,78	3,85	2,21	4,80	11,56	26,65	34,79	37,63	46,34
IRF-M 1+	0,60	0,94	-0,00	2,69	10,22	27,67	26,53	26,17	43,40
IRF-M TOTAL	0,66	1,81	0,67	3,32	10,51	26,78	28,81	29,73	44,40
IMA-B 5	1,05	2,92	1,62	4,42	8,94	19,23	30,62	40,27	53,54
IMA-B 5+	1,59	-2,85	-1,91	0,98	4,24	16,02	15,73	28,10	33,44
IMA-B TOTAL	1,33	-0,13	-0,23	2,62	6,56	17,72	23,13	34,41	43,39
IMA-GERAL TOTAL	0,95	2,37	1,25	4,04	10,06	23,87	30,39	35,87	46,18
IDKA 2	1,07	3,03	1,78	4,53	9,23	18,78	29,76	40,74	53,45
IDKA 20	2,01	-7,44	-4,45	-1,34	1,87	15,01	3,51	19,85	17,13
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13	40,12	46,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26	39,70	25,83
IBRX 100	-3,18	-8,57	-5,17	-3,56	13,24	8,19	-5,26	39,86	27,37
IBRX 50	-3,11	-7,63	-4,50	-2,72	14,94	9,84	-3,24	44,50	28,06
SMALL CAP	-3,38	-14,52	-8,96	-8,50	-4,39	-11,41	-35,21	2,20	0,47
Índice Consumo - ICON	-2,26	-14,63	-6,94	-9,52	-7,70	-22,28	-50,93	-37,26	-32,43
Índice Dividendos - IDIV	-0,99	-5,29	-2,73	1,24	19,55	18,54	21,40	67,35	58,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	6,22	19,79	8,92	22,70	29,87	41,57	25,76	67,46	155,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,02	2,14	0,66	6,48	12,24	19,92	20,09	27,27	32,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	5,22	16,99	8,53	20,14	25,00	33,38	10,61	48,94	112,32

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,46	2,27	1,00	2,84	3,93	8,02	20,69	30,41	32,86
INPC	0,46	2,42	1,02	2,99	3,34	7,20	19,96	30,63	33,31
IGPM	0,89	0,28	0,73	1,02	-0,34	-4,79	5,42	44,47	53,87
SELIC	0,83	4,40	2,58	5,33	12,00	27,10	37,13	40,12	46,96

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,79	3,94	2,00	4,85	8,05	16,78	35,69	52,47	61,52
IPCA + 5,00%	0,87	4,35	2,24	5,34	9,08	19,02	39,63	58,39	69,40
IPCA + 5,50%	0,91	4,55	2,36	5,59	9,60	20,15	41,63	61,42	73,46
IPCA + 5,89%	0,94	4,71	2,46	5,78	10,00	21,03	43,20	63,81	76,67
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64	64,49	77,59
INPC + 4,00%	0,79	4,09	2,02	4,99	7,44	15,90	34,87	52,72	62,06
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77	64,76	78,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (6,323000%)	5.370.672,30	6,323000	5.429.494,51	6,180600	58.822,21
NTN-B 150535 (6,428000%)	5.215.459,99	6,428000	5.314.966,11	6,180600	99.506,12
NTN-B 150545 (5,852000%)	12.441.070,11	5,852000	11.996.462,32	6,168300	-444.607,79
NTN-B 150545 (6,062000%)	4.280.075,57	6,062000	4.228.330,56	6,168300	-51.745,01
NTN-B 150545 (6,513000%)	5.200.143,20	6,513000	5.406.856,26	6,168300	206.713,06
NTN-B 150824 (5,771000%)	10.773.922,81	5,771000	10.707.082,13	8,887900	-66.840,68
NTN-B 150824 (6,310000%)	3.256.923,89	6,310000	3.240.244,25	8,887900	-16.679,64
NTN-B 150824 (6,422000%)	11.020.616,04	6,422000	10.966.647,76	8,887900	-53.968,28
NTN-B 150824 (6,775000%)	3.045.352,70	6,775000	3.032.591,75	8,887900	-12.760,95
NTN-B 150824 (6,830000%)	7.753.715,91	6,830000	7.722.077,41	8,887900	-31.638,50
NTN-B 150824 (7,133000%)	3.277.592,73	7,133000	3.266.200,81	8,887900	-11.391,92
NTN-B 150824 (7,591200%)	5.248.030,82	7,591200	5.234.573,48	8,887900	-13.457,34
NTN-B 150826 (5,190000%)	10.965.701,16	5,190000	10.751.932,83	6,194200	-213.768,33
NTN-B 150830 (5,400000%)	11.022.786,47	5,400000	10.633.870,79	6,133600	-388.915,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
59	03/05/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	129.481,54	0,00	1.933,79807359	66,9571150000
60	08/05/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	1.000.000,00	0,00	14.917,09414708	67,0371850000
61	09/05/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	50.000,00	0,00	745,55298149	67,0643150000
62	10/05/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	30.000,00	447,15595843	67,0906860000
56	10/05/2024	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.890,34	603,34801110	3,1330840000
63	15/05/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	20.000,00	297,75878599	67,1684630000
64	16/05/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	8.822,14	131,29264953	67,1944700000
68	16/05/2024	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	161.926,15	0,00	6.734,53025857	24,0441640000
65	17/05/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	6.536,31	97,23686061	67,2204960000
69	17/05/2024	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	804.710,69	0,00	33.506,95579672	24,0162280000
66	21/05/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	1.414.620,00	21.028,19023468	67,2725510000
57	22/05/2024	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.801,48	1.847,90346722	3,1394930000
70	22/05/2024	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	681.464,91	0,00	28.414,86547172	23,9826900000
67	23/05/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	2.873.950,26	0,00	42.689,04048794	67,3229060000
58	28/05/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	4.081.363,63	906,55666814	4.502,0502010000
71	29/05/2024	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	481.664,90	0,00	20.082,85144737	23,9838900000
Total			6.183.198,45	5.569.033,90		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 3.517.020,03 Value-At-Risk: 1,00%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,13	0,25	5,00	0,11	0,07	0,92	270.226.187,49	77,00
Artigo 8º	12,67	6,15	20,00	0,48	-0,36	-3,69	33.645.338,81	9,59
Artigo 9º	11,24	6,88	20,00	0,07	-0,02	0,57	14.637.518,01	4,17
Artigo 10º	15,75	4,64	20,00	0,35	0,18	3,61	32.411.367,66	9,24
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO		1,00		1,00			350.920.411,97	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,25%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,771000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,32	0,88	10.773.922,81	3,07
NTN-B 150824 (6,310000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,63	0,92	3.256.923,89	0,93
NTN-B 150824 (6,422000%)	0,14	0,13	0,00	0,17	0,70	0,93	11.020.616,04	3,14
NTN-B 150824 (6,775000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,90	0,96	3.045.352,70	0,87
NTN-B 150824 (6,830000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,93	0,96	7.753.715,91	2,21
NTN-B 150824 (7,133000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	1,11	0,99	3.277.592,73	0,93
NTN-B 150824 (7,591200%)	0,14	0,08	0,00	0,12	1,37	1,02	5.248.030,82	1,50
NTN-B 150826 (5,190000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	-0,02	0,83	10.965.701,16	3,12
NTN-B 150830 (5,400000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,11	0,85	11.022.786,47	3,14
NTN-B 150535 (6,323000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,64	0,92	5.370.672,30	1,53
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,70	0,93	5.215.459,99	1,49
NTN-B 150545 (5,852000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,37	0,88	12.441.070,11	3,55
NTN-B 150545 (6,062000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,49	0,90	4.280.075,57	1,22
NTN-B 150545 (6,513000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,75	0,94	5.200.143,20	1,48
Sub-total	0,14	0,10	0,00		0,53	0,91	98.872.063,70	28,18

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,74	0,34	0,00	0,35	-0,15	0,72	4.798.973,29	1,37
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,70	1,18	0,01	0,02	0,17	1,31	5.234.407,73	1,49
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	2,82	1,23	0,00	0,39	0,20	1,38	1.942.862,09	0,55
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,39	0,64	0,01	0,12	0,14	1,03	14.459.085,62	4,12
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,32	1,88	0,01	0,02	0,17	1,56	4.771.464,06	1,36
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	1,18	0,01	0,01	0,17	1,30	7.322.375,65	2,09
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,49	0,87	0,03	0,87	-0,03	0,75	19.506.276,70	5,56
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,01	0,01	0,00	0,00	-0,82	0,82	8.110.141,43	2,31
ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI	4,36	1,89	0,00	0,01	0,17	1,57	1.181.532,60	0,34
Sub-total	1,95	0,78	0,09		0,10	1,03	67.327.119,17	19,19

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,07	0,00	0,07	0,65	0,88	6.552.103,80	1,87
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,15	0,57	0,01	0,01	0,17	1,03	12.546.123,86	3,58
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,06	0,04	0,00	0,03	0,49	0,86	22.670.148,86	6,46
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2,92	1,34	0,01	0,28	0,16	1,30	3.760.935,92	1,07
Sub-total	0,51	0,26	0,02		0,20	0,94	45.529.312,44	12,97

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CDB - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	3,18	0,22	-0,00	0,24	0,03	0,92	12.033.828,87	3,43
CDB - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 6,35% a.a	3,22	0,22	-0,00	0,24	0,03	0,94	635.317,05	0,18
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,010% a.a	2,83	0,22	-0,00	0,24	-0,00	0,82	4.169.395,54	1,19
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	3,10	0,22	-0,00	0,25	0,02	0,90	3.621.937,87	1,03
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,20% a.a	0,48	0,23	-0,00	0,25	-1,43	0,14	2.571.614,87	0,73
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,76% a.a	0,51	0,24	-0,00	0,26	-1,36	0,15	672.459,87	0,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BRB BANCO DE BRASILIA SA 7,80% a.a	3,62	0,25	-0,00	0,27	0,06	1,05	9.951.617,01	2,84
LETRA FINANCEIRA - BRB BANCO DE BRASILIA SA 7,90% a.a	3,51	0,25	-0,00	0,27	0,05	1,02	13.069.074,46	3,72
LETRA FINANCEIRA - ITUB - ITAU UNIBANCO HOLDING SA 6,30% a.a	0,00	NaN	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00
RECIBO DE DEPÓSITO COOPERATIVO - SICOOB 11,15 % a.a	2,87	0,19	-0,00	0,19	0,00	0,83	1.446.342,25	0,41
RECIBO DE DEPÓSITO COOPERATIVO - SICOOB 13,21 % a.a	2,79	0,19	-0,00	0,19	-0,01	0,81	2.573.720,43	0,73
Sub-total	2,68	0,22	-0,00		-0,02	0,78	50.745.308,22	14,46

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,03	0,02	-0,00	0,01	0,76	0,85	7.752.383,96	2,21
Sub-total	0,03	0,02	-0,00		0,76	0,85	7.752.383,96	2,21

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,15%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA	10,70	5,57	0,01	2,92	-0,44	-3,86	900.815,33	0,26
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	10,71	6,33	0,05	2,10	-0,44	-3,85	4.026.652,27	1,15
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	17,87	7,93	0,12	4,90	-0,31	-4,69	6.579.148,65	1,87
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	10,09	5,80	0,05	2,74	-0,45	-3,74	3.853.855,59	1,10
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15,17	6,23	0,07	4,28	-0,31	-3,92	5.028.477,14	1,43
FIA CAIXA CONSUMO	18,12	8,85	0,02	0,11	-0,18	-2,35	1.174.509,02	0,33
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	15,15	8,22	0,02	0,09	-0,28	-3,37	1.276.854,40	0,36
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	11,02	6,27	0,04	1,38	-0,42	-3,81	2.767.504,40	0,79
MAG BRASIL FIA	9,83	6,16	0,03	5,13	-0,41	-3,23	3.145.088,81	0,90
OCCAM FIC FIA	9,00	5,98	0,01	1,43	-0,44	-3,15	511.814,93	0,15
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	17,42	7,76	0,02	4,94	-0,08	-0,52	1.004.423,85	0,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	12,14	6,58	0,02	2,14	-0,40	-3,97	1.471.146,85	0,42
SPX APACHE FIC FIA	14,92	6,70	0,03	3,60	-0,20	-2,14	1.905.047,57	0,54
Sub-total	12,67	6,15	0,48		-0,36	-3,69	33.645.338,81	9,59

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,64%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	9,84	5,21	0,04	1,27	-0,41	-3,25	3.543.073,29	1,01
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5,76	2,28	0,02	4,42	-0,10	0,25	3.014.825,71	0,86
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	23,97	5,85	0,23	7,79	0,17	5,01	19.760.078,13	5,63
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	8,53	5,14	0,06	3,87	0,50	5,11	6.093.390,53	1,74
Sub-total	15,75	4,64	0,35		0,18	3,61	32.411.367,66	9,24

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,88%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD FIC FIA IE	7,96	7,06	0,00	5,46	0,23	2,63	1.111.306,71	0,32
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	12,91	5,67	0,00	5,12	0,07	1,74	7.620.611,34	2,17
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	18,26	13,85	0,06	12,96	-0,22	-3,10	4.657.601,80	1,33
Sub-total	11,45	7,25	0,06		-0,07	0,07	13.389.519,85	3,82

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	9,04	5,54	0,01	9,11	0,56	5,86	1.247.998,16	0,36
Sub-total	9,04	5,54	0,01		0,56	5,86	1.247.998,16	0,36

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
- (3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
- (4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
- (5) Limite Política de Investimentos (%)