



RI Relatório de Investimentos

ABRIL/2024

JUSPREV 

Apresentação

A Lâmina de Rentabilidade consolida as informações enviadas pelas Gestoras de Ativos ICATU - Icatu Asset Management e Somma Investimentos S.A. e é disponibilizada mensalmente no site da JUSPREV para que os participantes possam acompanhar o desempenho dos fundos de investimentos. É destinado exclusivamente aos recursos aplicados pela JUSPREV e atende às exigências da Política de Investimentos e da Resolução CMN 4661.

Objetivo

O objetivo do plano é proporcionar valorização superior ao INPC + 4,35% a.a. que é a meta atuarial. A aplicação dos recursos é realizada por meio de fundos de investimento que investem diretamente em títulos e/ou em fundo de renda fixa, renda variável, multimercado e estruturados. A alocação dos recursos respeita os critérios de composição e diversificação definidos na legislação em vigor e estabelecidos no regulamento de cada fundo.

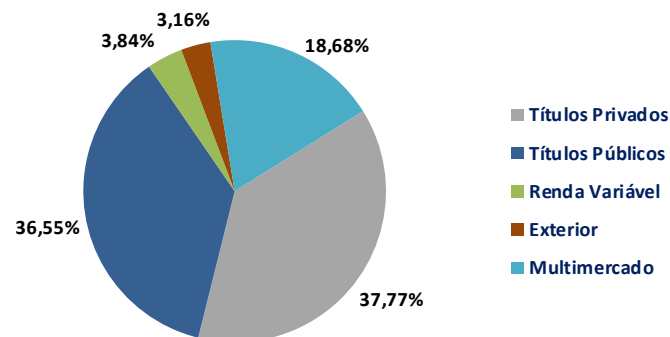
Performance dos Investimentos

Fundos de Investimentos	Patrimônio		Gestor	Rentabilidade					
				1M	12M	24M	36M	48M	60M
ICATU VANG FC FI MULT CRED PRIV JUSPREV ¹	243.230.464,95	43,02%	Icatu Asset Management	0,11%	12,72%	23,14%	25,36%	37,02%	37,43%
SOMMA JUSPREV ATIVO FI MULT CRED PRIV ²	247.001.668,41	43,68%	Somma Investimentos S.A.	0,54%	12,89%	20,77%	26,04%	34,55%	36,25%
SOMMA JUSPREV ALM FI MULT	75.219.229,56	13,30%	Somma Investimentos S.A.	0,70%	9,70%	21,20%	42,51%	60,32%	75,13%
TOTAL JUSPREV	565.451.362,92	100%		0,32%	11,44%	20,17%	27,52%	38,44%	41,60%

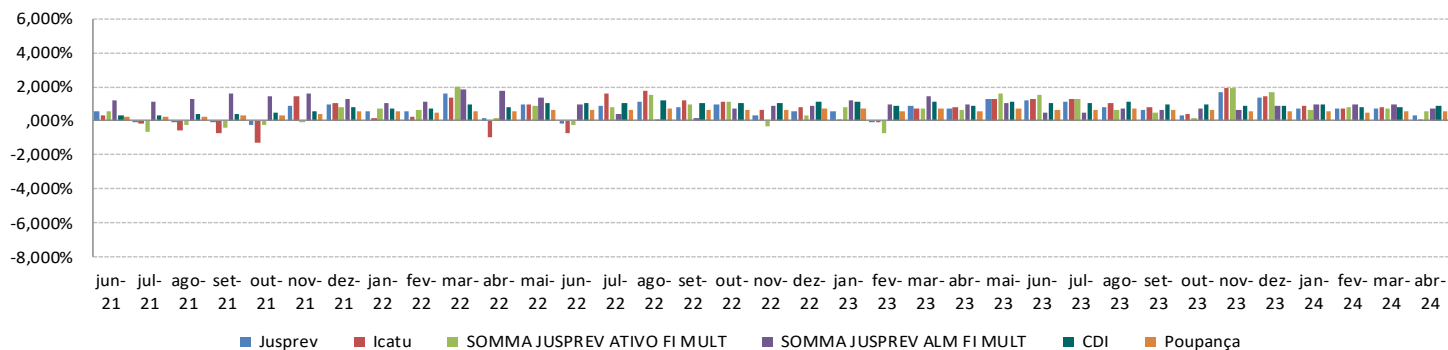
¹O Icatu Vanguarda assumiu a Gestão do Fundo a partir de 02/10/2017. Anterior a esta data, a Gestão do Fundo era de responsabilidade do Bradesco Asset Management.

²A Somma Investimentos S.A. assumiu a Gestão do Fundo a partir de 02/08/2021. Anterior a esta data, a Gestão do Fundo era de responsabilidade da Sul América Investimentos Gestora de Recursos S.A.

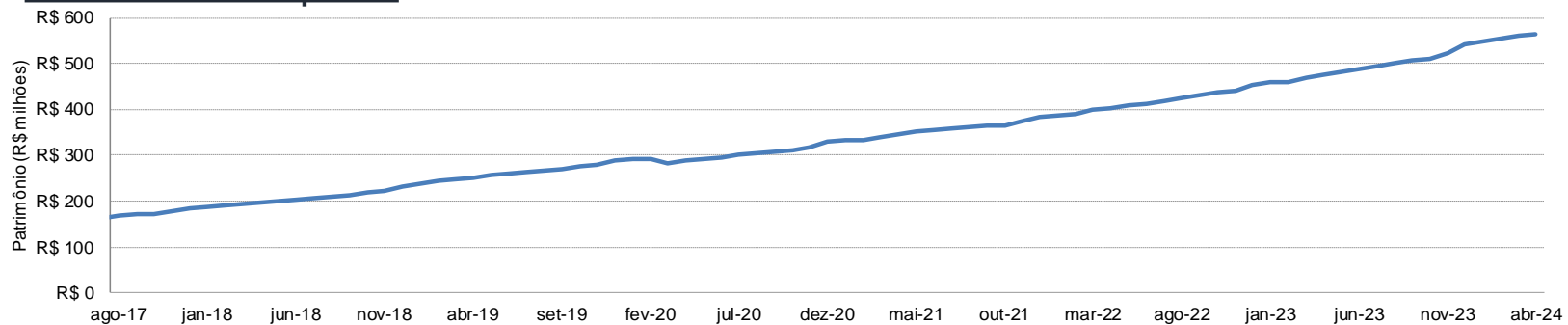
Composição



Rentabilidade Mensal



Patrimônio Líquido



Histórico de Desempenho

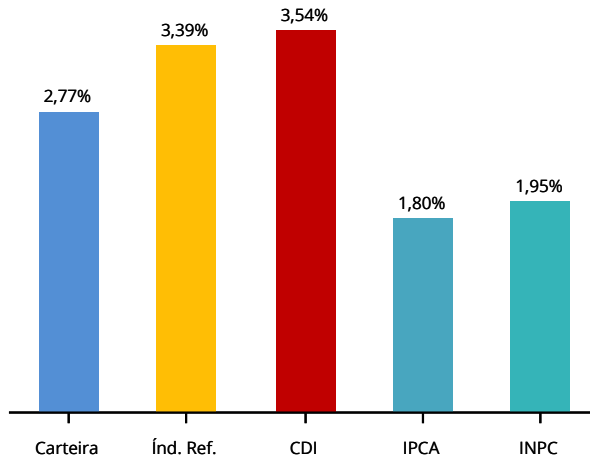
Início Período Considerado	6-ago-08	
	12 meses	Desde o início
Melhor Mês da JUSPREV	1,69%	2,10%
Melhor Mês do INPC + 4,35%	1,13%	2,09%
Melhor Mês do INPC + 6%	1,25%	2,23%
Pior Mês da JUSPREV	0,29%	-3,41%
Pior Mês do INPC + 4,35%	0,26%	-0,25%
Pior Mês do INPC + 6%	0,39%	-0,12%
% de meses acima de INPC + 4,35%	61,54%	39,89%
% de meses acima de INPC + 6%	61,54%	35,11%
% de meses acima de CDI	38,46%	38,30%
Volatilidade da JUSPREV (a.a.)	-0,11%	0,23%

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: A continuidade de divulgações de fortes dados dos EUA promoveu nova rodada de reprecificações quanto aos próximos passos do Fed, com os players novamente reduzindo as apostas de cortes da taxa de juros do país em 2024. Até mesmo membros considerados mais dovish do Fed efetivaram discursos duros. Assim, ressalta-se que as bolsas dos EUA, após 5 meses seguidos de ganhos, finalmente apresentaram quedas, seja por natural correção, seja pelos efeitos adversos trazidos pela arrancada dos yields das Treasuries. O cenário da China ficou em segundo plano, embora o agregado de notícias tenha sido positivo. Destaca-se que relevantes indicadores econômicos chineses superaram as estimativas, enquanto as sinalizações são de algum estancamento da crise do setor imobiliário.

Economia Brasileira: Destaque para a mudança das metas fiscais a partir de 2025, o que elevou o nível de desconfiança do mercado a respeito do compromisso do governo com a saúde das contas públicas. Diante dos intensos movimentos defensivos dos mercados domésticos, especialmente nos mercados de câmbio e de juros, diante do posicionamento cauteloso do Fed e da alteração das metas fiscais do Brasil, o presidente do BCB enviou importante recado aos agentes - praticamente eliminando o forward guidance adotado pelo Copom em sua reunião de março, o qual contratava nova redução de 0,50% na taxa Selic em maio. Revisamos nosso call de Selic tanto para 2024 (de 9,00% para 9,50%) quanto para 2025 (de 8,00% para 8,50%).

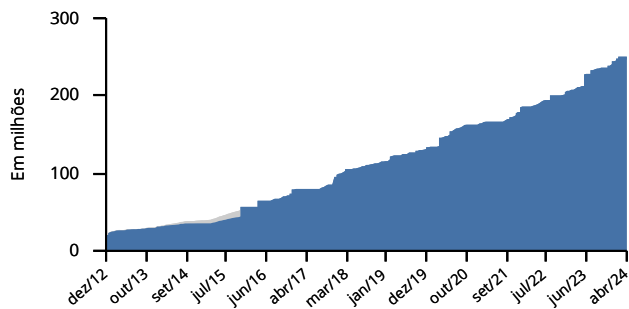
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



Mês	Mai-23	Jun-23	Jul-23	Ago-23	Set-23	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24	Fev-24	Mar-24	Abr-24	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev Ativo	1,60	1,54	1,25	0,67	0,52	0,18	1,97	1,72	0,67	0,82	0,71	0,54	2,77	12,89	20,77
Índ. Ref.	0,73	0,26	0,27	0,59	0,45	0,48	0,44	0,89	0,94	1,13	0,53	0,74	3,39	7,71	16,57
CDI	1,12	1,07	1,07	1,14	0,97	1,00	0,92	0,90	0,97	0,80	0,83	0,89	3,54	12,33	27,35
IPCA	0,23	(0,08)	0,12	0,23	0,26	0,24	0,28	0,56	0,42	0,83	0,16	0,38	1,80	3,69	8,03

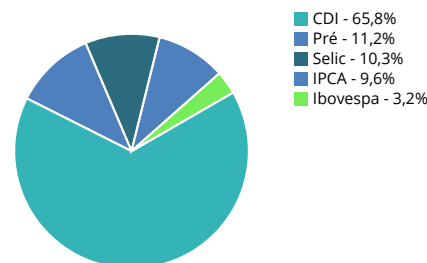
Índice de Referência INPC + 4,35% a.a.

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

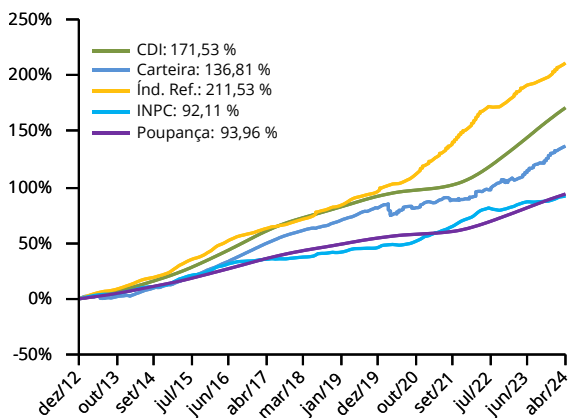


DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO

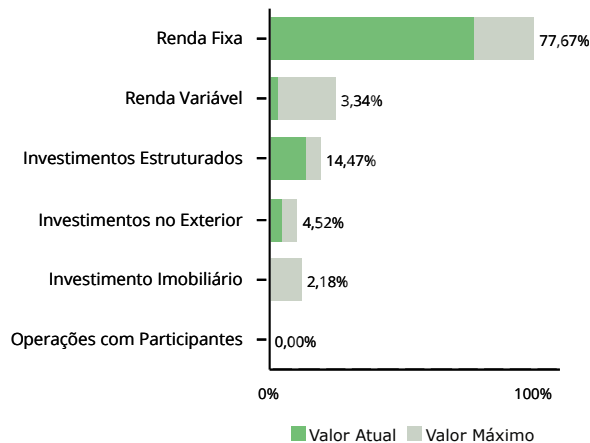
Patrimônio Líquido R\$ 247.001.668,41



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





SOMMA JUSPREV ATIVO FIM CRED PRIV
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
ABRIL DE 2024



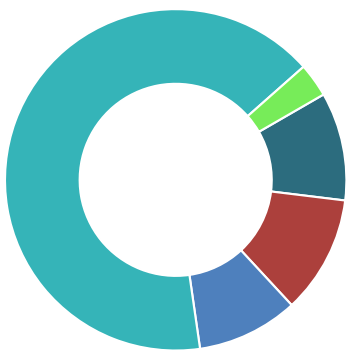
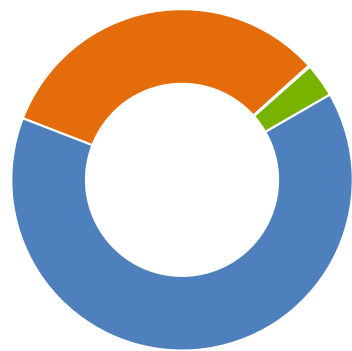
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

Carteira Consolidada	3
Carteira Detalhada	5
Política de Investimento	7
Análise de Rentabilidade	8
Retorno da Carteira (R\$)	9
Rentabilidade da Carteira (%)	11
Relatório de Movimentações	12



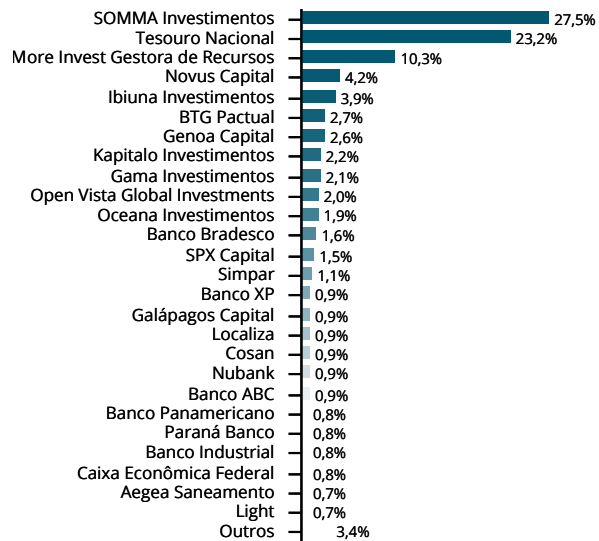
ATIVOS	ABRIL-24	%	MARÇO-24	%
RENDA FIXA	97.405.598,99	39,4%	119.594.438,10	48,7%
CDB - Banco BR Partners	1.017.019,40	0,4%	1.006.478,29	0,4%
Compromissada - Titulos Públicos	26.929.323,98	10,9%	15.320.552,55	6,2%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	1.637.092,30	0,7%	1.627.667,80	0,7%
Debênture - Cosan (CSAN33)	2.165.087,86	0,9%	2.190.509,85	0,9%
Debênture - JSL (JSMLB5)	2.756.175,29	1,1%	2.791.295,70	1,1%
Debênture - Light (LIGHD7)	1.624.350,04	0,7%	1.794.147,13	0,7%
Debênture - Localiza (LORTA7)	2.222.793,44	0,9%	2.244.032,78	0,9%
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	1.585.913,00	0,6%	1.600.119,75	0,7%
Debênture - Vamos (VAMO34)	1.051.057,82	0,4%	1.103.247,97	0,4%
Letra Financeira - Banco ABC	2.048.685,27	0,8%	2.022.807,31	0,8%
Letra Financeira - Banco Bradesco	3.741.484,20	1,5%	3.704.899,97	1,5%
Letra Financeira - Banco CNH	479.561,34	0,2%	472.864,57	0,2%
Letra Financeira - Banco Industrial	1.914.420,67	0,8%	1.000.806,89	0,4%
Letra Financeira - Banco NBC	1.018.207,56	0,4%	1.007.397,61	0,4%
Letra Financeira - Banco Panamericano	2.045.708,04	0,8%	2.025.481,99	0,8%
Letra Financeira - Banco Rodobens	493.608,89	0,2%	488.692,60	0,2%
Letra Financeira - Banco Sicredi	1.010.673,93	0,4%	1.000.903,69	0,4%
Letra Financeira - Banco XP	2.278.147,93	0,9%	2.255.811,97	0,9%
Letra Financeira - BTG Pactual	6.394.710,36	2,6%	6.360.065,78	2,6%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	1.873.173,06	0,8%	1.852.398,54	0,8%
Letra Financeira - Nubank	2.050.552,36	0,8%	2.031.084,79	0,8%
Letra Financeira - Paraná Banco	2.019.667,08	0,8%	2.000.000,00	0,8%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	21.338.610,31	8,6%	35.722.702,67	14,5%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	7.709.574,86	3,1%	27.970.467,90	11,4%
FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555	143.183.789,69	58,0%	125.298.171,02	51,0%
Augme Institucional FI RF CP	-	0,0%	4.597.105,75	1,9%
Galápagos Dragon FIC FIM CP	2.237.192,71	0,9%	2.212.416,18	0,9%
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	6.146.253,73	2,5%	6.029.968,66	2,5%
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	4.692.936,62	1,9%	4.877.321,47	2,0%
IBIUNA LS FP FICM	4.685.729,33	1,9%	4.601.200,27	1,9%
Kapitalo K10 FIC FIM	5.261.963,72	2,1%	5.441.108,70	2,2%
KP Crédito Privado FIC FIM	1.154.442,99	0,5%	1.142.482,05	0,5%
MCA Institucional FIC FIM CP	24.843.346,36	10,1%	12.310.085,44	5,0%
Novus Institucional FI RF LP	10.000.000,00	4,0%	-	0,0%
OAKTREE Global Credit IE FIM	4.967.541,60	2,0%	4.959.192,23	2,0%
Oceana Valor 30 FIC FIA	4.523.158,99	1,8%	4.665.540,52	1,9%
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	4.813.980,20	1,9%	4.750.064,25	1,9%
SOMMA Firenze RF CP	24.813.762,60	10,0%	24.582.919,21	10,0%
SOMMA Fundamental FIA	3.173.098,79	1,3%	3.316.993,87	1,4%
SOMMA Institucional FIM	8.367.049,77	3,4%	8.413.235,76	3,4%
SOMMA Positano FIC FIM CP	2.027.638,67	0,8%	2.005.488,49	0,8%
SOMMA Real Estate FIC FIM	5.520.083,75	2,2%	5.540.282,64	2,3%

GRÁFICOS DE DISTRIBUIÇÃO



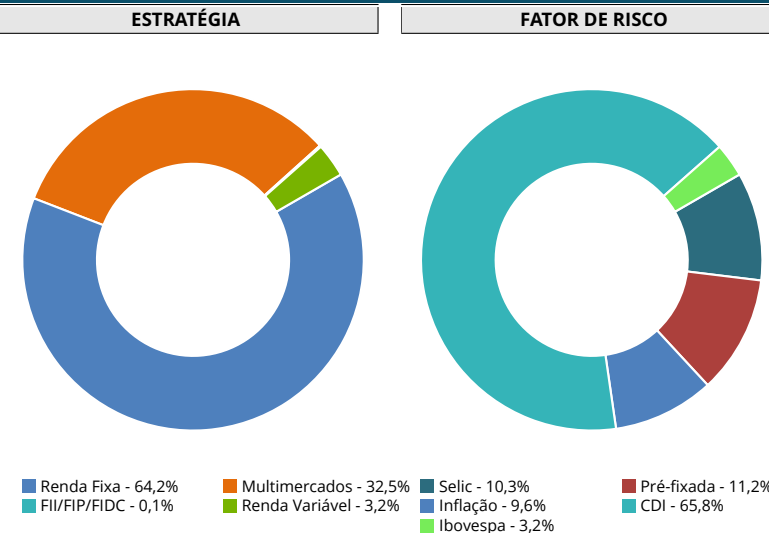
■ Renda Fixa - 64,2%
 ■ Multimercados - 32,5%
 ■ Selic - 10,3%
 ■ Pré-fixada - 11,2%
■ FII/FIP/FIDC - 0,1%
 ■ Renda Variável - 3,2%
■ Inflação - 9,6%
■ CDI - 65,8%
■ Ibovespa - 3,2%

INSTITUIÇÃO²

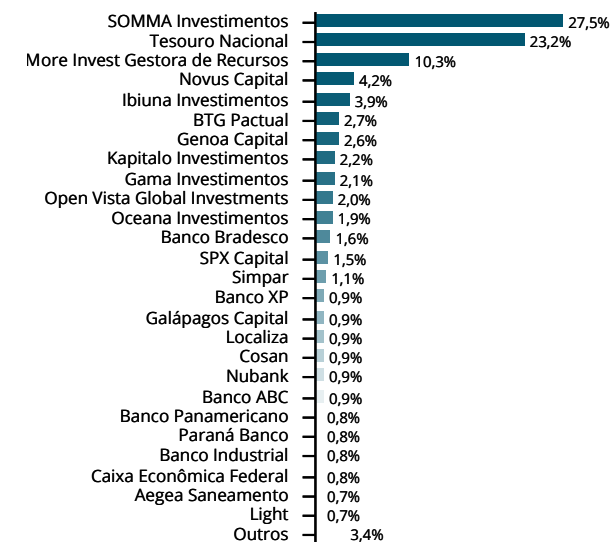


ATIVOS	ABRIL-24	%	MARÇO-24	%
SOMMA Torino RF CP	22.457.051,07	9,1%	22.319.845,65	9,1%
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	3.498.558,79	1,4%	3.532.919,88	1,4%
OUTROS FUNDOS DE INVESTIMENTO (FII/FIP/FIDC)	327.771,82	0,1%	854.553,95	0,3%
FIDC Credz Sênior 8	327.771,82	0,1%	854.553,95	0,3%
DERIVATIVOS	(22.683.103,27)	-9,2%	(48.882.133,37)	-19,9%
Futuros DAP ¹	(14.914.753,27)	-6,0%	(40.819.628,97)	-16,6%
Futuros WIN ¹	(7.768.350,00)	-3,1%	(8.062.504,40)	-3,3%
TESOURARIA	6.084.507,93	2,5%	(76.991,08)	0,0%
Caixa	999,90	0,0%	1.000,00	0,0%
Valores a Pagar/Receber	6.083.508,03	2,5%	(77.991,08)	0,0%
TOTAL DA CARTEIRA	247.001.668,43	100%	245.670.171,99	100%

GRÁFICOS DE DISTRIBUIÇÃO



INSTITUIÇÃO²



¹O saldo deste item não é considerado no somatório do PL.

²Não estão incluídas ações e opções

RENDA FIXA									
Ativo - Emissor	Marcação	Data Aplicação	Data Vencimento	Indexador	Valor Aplicado	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
CDB - Banco BR Partners	Mercado	01/03/2024	05/03/2025	CDI + 1,02%	1.000.000,00	1.017.019,40	-	1.017.019,40	0,41%
Compromissada - Títulos Públicos	Mercado	30/04/2024	02/05/2024	10,64% a.a.	26.929.323,98	26.929.323,98	-	26.929.323,98	10,91%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	Mercado	24/03/2022	15/07/2025	IPCA + 6,68%	-	112.902,92	-	112.902,92	0,05%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	Mercado	24/03/2022	15/07/2025	IPCA + 6,68%	-	14.112,86	-	14.112,86	0,01%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	Mercado	24/03/2022	15/07/2025	IPCA + 6,68%	-	1.510.076,52	-	1.510.076,52	0,61%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,99%	-	537.762,47	-	537.762,47	0,22%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,99%	-	344.470,34	-	344.470,34	0,14%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,99%	-	533.443,09	-	533.443,09	0,22%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,99%	-	749.411,96	-	749.411,96	0,30%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	18/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,42%	-	244.490,29	-	244.490,29	0,10%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	11/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,62%	-	1.624.275,79	-	1.624.275,79	0,66%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	18/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,42%	-	887.409,21	-	887.409,21	0,36%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,79%	-	398.308,05	-	398.308,05	0,16%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,79%	-	49.788,51	-	49.788,51	0,02%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,79%	-	609.909,21	-	609.909,21	0,25%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	16/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,99%	-	566.344,27	-	566.344,27	0,23%
Debênture - Localiza (LORTA7)	Mercado	11/03/2022	15/03/2031	IPCA + 7,52%	-	2.222.793,44	-	2.222.793,44	0,90%
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	Mercado	11/03/2022	15/09/2031	IPCA + 7,62%	-	1.585.913,00	-	1.585.913,00	0,64%
Debênture - Vamos (VAMO34)	Mercado	12/11/2021	15/10/2031	IPCA + 7,71%	-	1.051.057,82	-	1.051.057,82	0,43%
Letra Financeira - Banco ABC	Mercado	20/02/2024	20/02/2026	CDI + 0,80%	2.000.000,00	2.048.685,27	-	2.048.685,27	0,83%
Letra Financeira - Banco Bradesco	Mercado	14/11/2018	15/03/2025	100% Selic	1.500.000,00	1.522.707,05	-	1.522.707,05	0,62%
Letra Financeira - Banco Bradesco	Mercado	20/07/2023	23/12/2026	CDI + 1,09%	1.989.726,90	2.218.777,15	-	2.218.777,15	0,90%
Letra Financeira - Banco CNH	Mercado	29/02/2024	05/11/2025	CDI + 0,74%	469.656,91	479.561,34	-	479.561,34	0,19%
Letra Financeira - Banco Industrial	Mercado	10/04/2024	24/11/2025	CDI + 1,16%	895.719,66	901.409,46	-	901.409,46	0,37%
Letra Financeira - Banco Industrial	Mercado	23/02/2024	10/11/2025	CDI + 1,29%	989.707,11	1.013.011,21	-	1.013.011,21	0,41%
Letra Financeira - Banco NBC	Mercado	07/03/2024	09/03/2026	CDI + 1,90%	1.000.000,00	1.018.207,56	-	1.018.207,56	0,41%
Letra Financeira - Banco Panamericano	Mercado	20/02/2024	20/02/2026	CDI + 0,95%	2.000.000,00	2.045.708,04	-	2.045.708,04	0,83%
Letra Financeira - Banco Rodobens	Mercado	01/03/2024	18/08/2025	CDI + 0,94%	485.534,64	493.608,89	-	493.608,89	0,20%
Letra Financeira - Banco Sicredi	Mercado	27/03/2024	27/03/2026	CDI + 0,80%	1.000.000,00	1.010.673,93	-	1.010.673,93	0,41%
Letra Financeira - Banco XP	Mercado	21/02/2024	11/05/2026	CDI + 0,89%	2.223.980,09	2.278.147,93	-	2.278.147,93	0,92%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	22/07/2022	01/09/2027	CDI + 2,21%	1.500.000,00	1.952.447,99	-	1.952.447,99	0,79%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	20/02/2024	20/02/2026	CDI + 0,80%	2.000.000,00	2.049.088,19	-	2.049.088,19	0,83%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	29/10/2021	29/10/2026	IPCA + 7,50%	1.500.000,00	2.060.701,46	-	2.060.701,46	0,83%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	12/07/2022	19/08/2024	IPCA + 7,69%	273.654,04	332.472,72	-	332.472,72	0,13%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	Mercado	12/09/2019	30/11/2024	100% Selic	1.800.000,00	1.873.173,06	-	1.873.173,06	0,76%
Letra Financeira - Nubank	Mercado	20/02/2024	20/02/2026	CDI + 1,18%	2.000.000,00	2.050.552,36	-	2.050.552,36	0,83%
Letra Financeira - Paraná Banco	Mercado	28/03/2024	07/04/2026	CDI + 0,90%	2.000.000,00	2.019.667,08	-	2.019.667,08	0,82%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	19/01/2024	01/03/2028	100% Selic	2.827.521,15	2.911.815,88	-	2.911.815,88	1,18%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	19/01/2024	01/03/2028	100% Selic	2.827.521,15	2.911.815,88	-	2.911.815,88	1,18%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	19/01/2024	01/03/2028	100% Selic	2.827.521,15	2.911.815,88	-	2.911.815,88	1,18%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	19/01/2024	01/03/2028	100% Selic	2.827.521,15	2.911.815,88	-	2.911.815,88	1,18%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Mercado	18/04/2024	15/08/2024	IPCA + 7,58%	5.433.027,78	5.444.921,73	-	5.444.921,73	2,21%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Mercado	18/04/2024	15/08/2028	IPCA + 6,11%	2.271.734,63	2.264.653,13	-	2.264.653,13	0,92%
TOTAL						97.405.598,99	-	97.405.598,99	39,46 %

FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555

Nome do Fundo	Gestor	Liquidez	Quantidade de Cotas	Valor da Cota	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
Galápagos Dragon FIC FIM CP	Galápagos Capital	D+91	1.443.962,9321077	1,5493422	-	2.237.192,71	0,91%
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	Genoa Capital	D+31	3.888.478,5895897	1,5806320	-	6.146.253,73	2,49%
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	Ibiuna	D+31	35.831,2085762	130,9734392	-	4.692.936,62	1,90%
IBIUNA LS FP FICM	Ibiuna	D+31	42.956,1041367	109,0818040	-	4.685.729,33	1,90%
Kapitalo K10 FIC FIM	Kapitalo Investimentos	D+30	2.609.841,1044542	2,0162008	-	5.261.963,72	2,13%
KP Crédito Privado FIC FIM	KP Wealth	D+91	597.227,7444235	1,9330029	-	1.154.442,99	0,47%
MCA Institucional FIC FIM CP	More Invest Gestora de Recursos	D+90	22.229.565,1846160	1,1175813	-	24.843.346,36	10,06%
Novus Institucional FI RF LP			7.047.867,9917410	1,4188688	-	10.000.000,00	4,05%
OAKTREE Global Credit IE FIM	Gama Investimentos	D+12	3.117.553,9475597	1,5934100	-	4.967.541,60	2,01%
Oceana Valor 30 FIC FIA	Oceana Investimentos	D+30	724.021,6332702	6,2472705	-	4.523.158,99	1,83%
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	Open Vista Global Investments	D+6	29.043,4841458	165,7507818	-	4.813.980,20	1,95%
SOMMA Firenze RF CP	SOMMA Investimentos	D+32	20.434.585,8849790	1,2143022	-	24.813.762,60	10,05%
SOMMA Fundamental FIA	SOMMA Investimentos	D+5	21.784,5419011	145,6582750	-	3.173.098,79	1,29%
SOMMA Institucional FIM	SOMMA Investimentos	D+5	2.508.608,5860772	3,3353349	-	8.367.049,77	3,39%
SOMMA Positano FIC FIM CP	SOMMA Investimentos	D+360	1.332,3973746	1.521,7972564	-	2.027.638,67	0,82%
SOMMA Real Estate FIC FIM	SOMMA Investimentos	D+60	4.166,9687837	1.324,7240479	-	5.520.083,75	2,24%
SOMMA Torino RF CP	SOMMA Investimentos	D+1	14.493.020,4119250	1,5495080	-	22.457.051,07	9,10%
SpX Nimitz Estruturado Fic Multimercado	SPX Capital	D+60	1.463.725,1372990	2,3901747	-	3.498.558,79	1,42%
TOTAL					-	143.183.789,69	58,00 %

OUTROS FUNDOS DE INVESTIMENTO (FII/FIP/FIDC)

Nome do Fundo	Gestor	Liquidez	Quantidade de Cotas	Valor da Cota	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
FIDC Credz Sênior 8	Integral Investimentos	-	850.000,0000000	0,3856139	-	327.771,82	0,13%
TOTAL					-	327.771,82	0,13 %

LIMITE DE ALOCAÇÃO POR ATIVO E SEGMENTO - PI vigente para o ano			
SEGMENTO	MAXIMO	ATUAL	MARGEM
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	77,67%	22,33%
Títulos Públicos Federais	100,00%	35,57%	64,43%
CDI/CDBs	80,00%	0,54%	79,46%
Letras Financeiras de Inst. Financeira	80,00%	14,48%	65,52%
Debêntures	80,00%	16,41%	63,59%
DPGE	20,00%	0,00%	20,00%
FIDC	20,00%	10,60%	9,40%
Outros Ativos de Renda Fixa	20,00%	0,07%	19,93%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	25,00%	3,34%	21,66%
Ações de Companhias Abertas	25,00%	3,34%	21,66%
SPE	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20,00%	12,29%	7,71%
FIP - Fundo de Investimento em Participações	5,00%	0,00%	5,00%
FIM - Fundos de Investimento Multimercado	15,00%	12,29%	2,71%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	10,00%	4,52%	5,48%
FIE - Fundo de Investimento no Exterior	10,00%	4,52%	5,48%
INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	10,00%	2,18%	7,82%
CCI	10,00%	0,00%	10,00%
CRI	10,00%	0,00%	10,00%
FII - Fundo Investimento Imobiliário	10,00%	2,18%	7,82%
TOTAL EM OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0,00%	0,00%	0,00%
Operações com Participante	0,00%	0,00%	0,00%
Total		100,00%	

RATINGS ESCALA NACIONAL DE LONGO PRAZO ¹							
INSTITUIÇÃO/ATIVO	MÁXIMO	ATUAL	AGÊNCIAS DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO				
			FITCH	MOODY'S	S&P	AUSTIN	
Segurança Máxima (AAA)	100,00%	27,94%					
Banco Bradesco	25,00%	1,55%	AAA(bra)	AAA.br	brAAA	-	
Banco CNH	25,00%	0,20%	AAA(bra)	-	-	-	
Banco NBC	25,00%	0,42%	AAA(bra)	-	-	-	
Banco XP	25,00%	0,95%	AAA(bra)	-	brAAA	-	
Debênture - Localiza (LORTA7)	25,00%	0,92%	AAA(bra)	AAA.br	brAAA	-	
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	25,00%	0,66%	AAA(bra)	-	brAAA	-	
Tesouro Nacional	100,00%	23,24%	-	-	brAAA	-	
Alta Segurança (AA)	100,00%	11,14%					
Banco ABC	25,00%	0,85%	AA(bra)	AA+.br	brAAA	-	
Banco BR Partners	25,00%	0,42%	AA-(bra)	AA-.br	-	-	
Banco Industrial	25,00%	0,79%	-	AA-.br	-	-	
Banco Panamericano	25,00%	0,85%	AA(bra)	AAA.br	brAAA	-	
Banco Rodobens	25,00%	0,20%	AA+(bra)	-	-	-	
Banco Sicredi	25,00%	0,42%	AA+(bra)	AAA.br	brAAA	-	
BTG Pactual	25,00%	2,65%	AA(bra)	AAA.br	brAAA	-	
Caixa Econômica Federal	25,00%	0,78%	AA(bra)	AAA.br	brAAA	-	
Debênture - Cosan (CSAN33)	25,00%	0,90%	AAA(bra)	AA+.br	-	-	
Debênture - JSL (JSMLB5)	25,00%	1,14%	AAA(bra)	-	brAA	-	
Debênture - Vamos (VAMO34)	25,00%	0,44%	AAA(bra)	-	brAA+	-	
Nubank	25,00%	0,85%	-	-	brAA	-	
Paraná Banco	25,00%	0,84%	AA-(bra)	-	brAA+	-	
Segurança Média Alta (A)	50,00%	0,82%					
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	25,00%	0,68%	AA(bra)	A.br	brAA+	-	
FIDC Credz Sênior 8	25,00%	0,14%	A+(bra)	-	brAA-	-	
Risco Substancial (C)	0,00%	0,67%					
Debênture - Light (LIGHD7)	25,00%	0,67%	D(bra)	-	brD	-	

LEGENDA
Nota elevada
Nota rebaixada

RATING DOS ATIVOS


■ A - 0,82% ■ AA - 11,14% ■ AAA - 27,94% ■ C - 0,67%

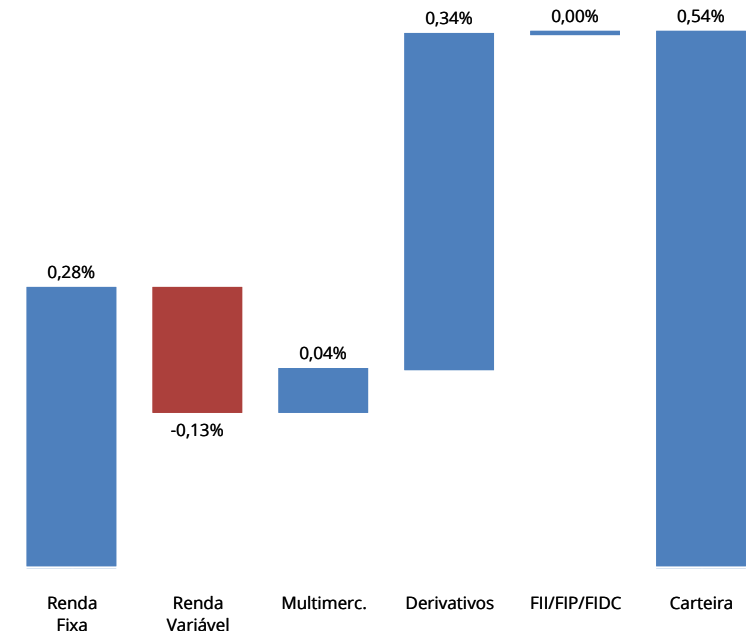
¹Engloba Tesouro Nacional, Bancos, FIDCs e Debêntures

RENTABILIDADE	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES	
	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Renda Fixa						
CDB - Banco BR Partners	1,05	140,8%	-	-	-	-
Compromissada - Títulos Públicos	0,89	119,2%	3,53	104,1%	-	-
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	0,58	77,8%	4,16	122,7%	12,78	165,8%
Debênture - Cosan (CSAN33)	-1,16	-	1,00	29,5%	14,01	181,7%
Debênture - JSL (JSMLB5)	-1,26	-	0,71	20,9%	11,27	146,2%
Debênture - Light (LIGHD7)	-9,46	-	1,75	51,6%	62,49	810,5%
Debênture - Localiza (LORTA7)	-0,95	-	0,62	18,3%	12,16	157,7%
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	-0,89	-	2,19	64,6%	13,54	175,6%
Debênture - Vamos (VAMO34)	-0,95	-	-1,10	-	10,46	135,7%
Letra Financeira - Banco ABC	1,28	172,0%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco Bradesco	0,99	132,8%	4,43	130,7%	16,33	211,8%
Letra Financeira - Banco CNH	1,42	190,4%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco Industrial	1,12	150,6%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco NBC	1,07	144,3%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco Panamericano	1,00	134,3%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco Rodobens	1,01	135,3%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco Sicredi	0,98	131,2%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco XP	0,99	133,1%	-	-	-	-
Letra Financeira - BTG Pactual	0,54	73,2%	3,78	111,5%	12,43	161,2%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	1,12	150,8%	4,59	135,4%	16,58	215,0%
Letra Financeira - Nubank	0,96	128,9%	-	-	-	-
Letra Financeira - Paraná Banco	0,98	132,2%	-	-	-	-
Letra Financeira do Tesouro Nacional	0,90	121,1%	-	-	-	-
Notas do Tesouro Nacional - Série B	-0,49	-	0,69	20,4%	8,42	109,2%
SOMMA Firenze RF CP	0,94	126,2%	4,39	129,5%	15,39	199,6%
SOMMA Torino RF CP	0,61	82,6%	4,19	123,6%	14,93	193,6%
Multimercados	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Galápagos Dragon FIC FIM CP	1,12	121,3%	4,68	114,4%	15,61	157,4%
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	1,93	208,9%	-	-	-	-
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	-3,78	-	-3,88	-	2,85	28,7%
IBIUNA LS FP FICM	1,84	199,0%	0,36	8,8%	-	-
Kapitalo K10 FIC FIM	-3,29	-	-0,53	-	6,71	67,6%
KP Crédito Privado FIC FIM	1,05	113,4%	4,15	101,5%	14,46	145,8%
MCA Institucional FIC FIM CP	1,06	114,5%	-	-	-	-
OAKTREE Global Credit IE FIM	0,17	18,2%	3,21	78,5%	15,74	158,7%
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	1,35	180,9%	8,73	257,5%	8,39	108,8%
SOMMA Institucional FIM	-0,55	-	-0,05	-	7,60	76,6%
SOMMA Positano FIC FIM CP	1,10	119,6%	4,46	109,0%	15,00	151,2%
SOMMA Real Estate FIC FIM	-0,36	-	4,32	127,4%	24,16	313,4%
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	-0,97	-	1,19	29,1%	-1,96	-
FII/FIP/FIDC	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
FIDC Credz Sênior 8	1,00	134,6%	16,62	490,3%	18,18	235,8%
Renda Variável	%	Dif. Bench	%	Dif. Bench	%	Dif. Bench
Oceana Valor 30 FIC FIA	-3,05	-3,8	-6,46	-9,9	24,29	16,6
SOMMA Fundamental FIA	-4,34	-5,1	-9,99	-13,4	9,64	1,9

RENTABILIDADE INDICADORES	NO MÊS %	NO ANO %	EM 12 MESES %
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	0,74	3,39	7,71
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	0,74	3,39	7,71
Renda Variável (INPC + 4.35% a.a.)	0,74	3,39	7,71
Estruturados (INPC + 6.50% a.a.)	0,92	4,09	9,92
Op. com Participante (CDI)	0,89	3,54	12,33
CDI	0,89	3,54	12,33
IPCA	0,38	1,80	3,69
INPC	0,37	1,95	3,23
Ibovespa	-1,70	-6,16	20,58
Dólar	3,51	6,83	3,42

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	0,37	3,18	13,22
Renda Variável	-3,79	-7,63	11,84
Investimentos Estruturados	0,09	1,44	8,37
Investimentos no Exterior	0,00	0,00	0,00
Operação com participante	0,00	0,00	0,00

COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA

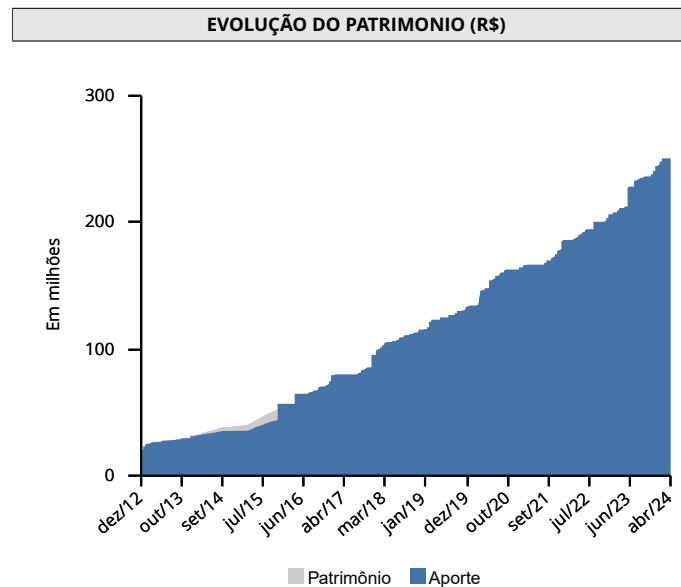
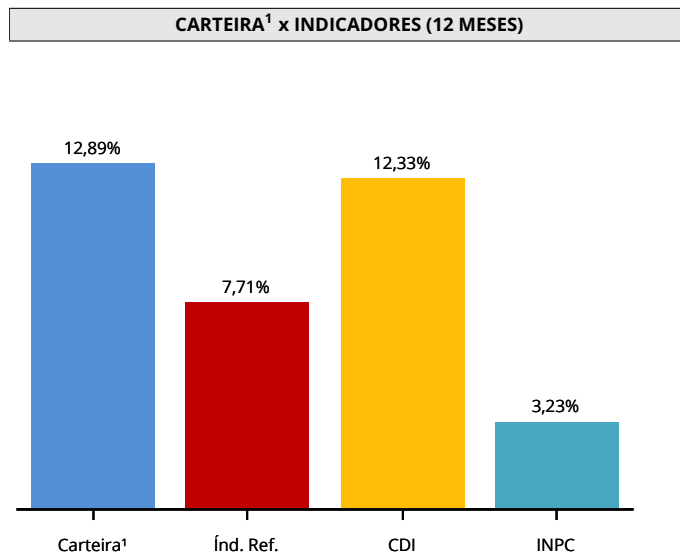
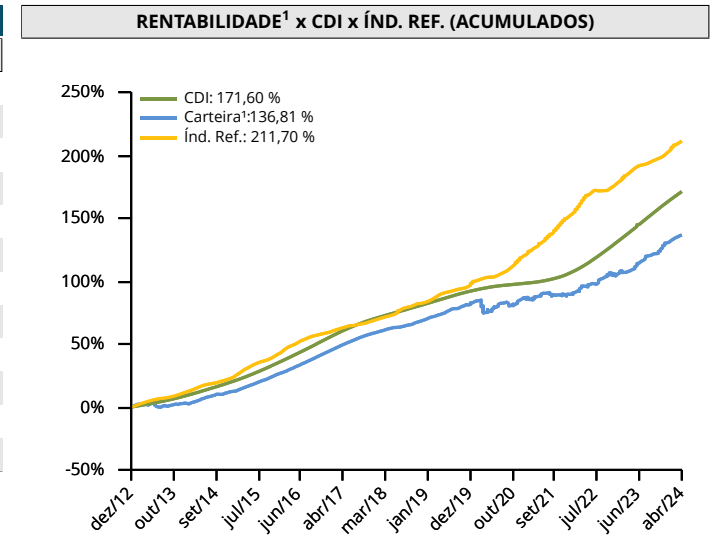


RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	NO ANO
RENDA FIXA	1.673.487,55	1.650.479,14	1.438.282,13	644.772,26	-	-	5.407.021,08
Augme Institucional FI RF CP	50.508,71	47.214,29	50.953,26	(1.950,83)	-	-	146.725,43
CDB - Banco BR Partners	-	-	6.478,29	10.541,11	-	-	17.019,40
Compromissada - Títulos Públicos	477.082,93	208.601,86	75.197,36	85.409,10	-	-	846.291,25
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	18.779,80	13.309,92	23.934,24	9.424,50	-	-	65.448,46
Debênture - Aegea Saneamento (AEGPA3)	5.347,05	-	-	-	-	-	5.347,05
Debênture - Assaf (ASAI14)	3.539,40	-	-	-	-	-	3.539,40
Debênture - CIA Siderúrgica (CSNAA1)	10.733,99	13.403,63	-	-	-	-	24.137,62
Debênture - CM Hospitalar (VVEO15)	2.468,99	-	-	-	-	-	2.468,99
Debênture - Cosan (CSAN33)	13.166,91	44.142,63	(9.008,09)	(25.421,99)	-	-	22.879,46
Debênture - JSL (JMLB5)	1.228,56	40.953,22	14.204,07	(35.120,41)	-	-	21.265,44
Debênture - Light (LIGHD7)	67.535,97	59.000,31	71.137,11	(169.797,09)	-	-	27.876,30
Debênture - Localiza (LORTA7)	(14.175,11)	28.029,32	22.459,22	(21.239,34)	-	-	15.074,09
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	7.994,90	26.196,66	15.671,54	(14.206,75)	-	-	35.656,35
Debênture - Qualicorp Saúde (QUAL16)	11.576,26	13.324,71	(887,83)	-	-	-	24.013,14
Debênture - Rede DOr (RDORD9)	8.161,87	-	-	-	-	-	8.161,87
Debênture - Stone (MNL11)	2.161,28	-	-	-	-	-	2.161,28
Debênture - TIM Telefonia (TBSP11)	7.736,22	-	-	-	-	-	7.736,22
Debênture - Vamos (VAMO24)	15.507,86	5.737,17	-	-	-	-	21.245,03
Debênture - Vamos (VAMO34)	(8.388,56)	15.843,54	(9.117,13)	(10.138,18)	-	-	(11.800,33)
Debênture - Vix Logística (VIXL35)	6.136,89	-	-	-	-	-	6.136,89
Letra Financeira - Banco ABC	-	4.340,00	18.467,31	25.877,96	-	-	48.685,27
Letra Financeira - Banco Bradesco	44.147,08	47.778,55	36.815,21	36.584,23	-	-	165.325,07
Letra Financeira - Banco CNH	-	(1.065,16)	4.272,83	6.696,77	-	-	9.904,44
Letra Financeira - Banco Industrial	-	(2.686,61)	13.786,39	17.894,13	-	-	28.993,91
Letra Financeira - Banco NBC	-	-	7.397,61	10.809,95	-	-	18.207,56
Letra Financeira - Banco Panamericano	-	3.600,82	21.881,17	20.226,05	-	-	45.708,04
Letra Financeira - Banco Rodobens	-	-	3.157,96	4.916,29	-	-	8.074,25
Letra Financeira - Banco Sicredi	-	-	903,69	9.770,24	-	-	10.673,93
Letra Financeira - Banco XP	-	11.050,82	20.781,06	22.335,96	-	-	54.167,84
Letra Financeira - BTG Pactual	61.191,56	33.231,50	66.890,67	34.644,58	-	-	195.958,31
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	22.553,29	18.869,08	19.924,59	20.774,52	-	-	82.121,48
Letra Financeira - Nubank	-	6.535,17	24.549,62	19.467,57	-	-	50.552,36
Letra Financeira - Paraná Banco	-	-	-	19.667,08	-	-	19.667,08
Letra Financeira do Tesouro Nacional	120.825,08	287.907,19	312.685,83	273.536,33	-	-	994.954,43
Notas do Tesouro Nacional - Série B	98.102,99	225.728,55	105.765,37	(73.978,33)	-	-	355.618,58
SOMMA Firenze RF CP	405.603,79	314.746,91	330.487,89	230.843,39	-	-	1.281.681,98
SOMMA Torino RF CP	212.128,01	163.057,02	186.935,59	137.205,42	-	-	699.326,04
Valora Horizon HY FIM CP	21.831,83	21.628,04	2.557,30	-	-	-	46.017,17
RENDA VARIÁVEL	(381.365,80)	110.352,09	(74.265,30)	(286.276,61)	-	-	(631.555,62)
Ibiúna Equities 30 FIC FIA	(85.324,77)	15.314,86	-	-	-	-	(70.009,91)
Oceana Valor 30 FIC FIA	(54.814,43)	37.651,88	(49.879,09)	(142.381,53)	-	-	(209.423,17)
SOMMA Fundamental FIA	(241.226,60)	57.385,35	(24.386,21)	(143.895,08)	-	-	(352.122,54)
MULTIMERCADOS	263.711,34	232.824,61	476.071,27	100.952,22	-	-	1.073.559,44
Galápagos Dragon FIC FIM CP	29.047,62	23.294,88	22.919,59	24.776,53	-	-	100.038,62
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	-	(9.947,43)	39.916,09	116.285,07	-	-	146.253,73

RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	NO ANO
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	(79.853,75)	37.078,79	37.651,08	(184.384,85)	-	-	(189.508,73)
IBIUNA LS FP FICM	65.482,44	(24.103,76)	(109.144,87)	84.529,06	-	-	16.762,87
Kapitalo K10 FIC FIM	73.820,14	815,58	76.594,66	(179.144,98)	-	-	(27.914,60)
KP Crédito Privado FIC FIM	12.446,00	10.505,31	11.042,83	11.960,94	-	-	45.955,08
MCA Institucional FIC FIM CP	-	16.638,46	99.446,98	233.260,92	-	-	349.346,36
OAKTREE Global Credit IE FIM	54.531,35	30.490,42	61.218,97	8.349,37	-	-	154.590,11
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	15.970,85	12.689,79	55.205,58	63.915,95	-	-	147.782,17
SOMMA Institucional FIM	(6.134,38)	26.389,06	20.366,14	(46.185,99)	-	-	(5.565,17)
SOMMA Positano FIC FIM CP	22.730,01	19.746,81	22.036,53	22.150,18	-	-	86.663,53
SOMMA Real Estate FIC FIM	86.763,01	70.777,51	91.481,12	(20.198,89)	-	-	228.822,75
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	16.943,12	18.449,19	47.336,57	(34.361,09)	-	-	48.367,79
Vista Hedge Institucional FIC FIM	(28.035,07)	-	-	-	-	-	(28.035,07)
FII/FIP/FIDC	54.349,57	9.887,65	53.008,35	7.901,48	-	-	125.147,05
FIDC Credz Sênior 8	54.349,57	9.887,65	53.008,35	7.901,48	-	-	125.147,05
DERIVATIVOS	-	-	(106.926,96)	941.943,19	-	-	835.016,23
Futuros DAP	-	-	(74.471,99)	709.490,62	-	-	635.018,63
Futuros WIN	-	-	(32.454,97)	232.452,57	-	-	199.997,60
TOTAL	1.610.182,66	2.003.543,49	1.786.169,49	1.409.292,54	-	-	6.809.188,18

RESULTADOS DE 2024			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	0,67	0,94	70,73%
Fevereiro	0,82	1,13	72,42%
Março	0,71	0,53	134,89%
Abril	0,54	0,74	72,87%
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Total	2,77	3,39	81,74%

INDICADORES DE MERCADO				
CDI	IPCA	INPC	Ibovespa	Dólar
0,97	0,42	0,57	(4,79)	2,32
0,80	0,83	0,81	0,99	0,60
0,83	0,16	0,19	(0,71)	0,26
0,89	0,38	0,37	(1,70)	3,51
3,54	1,80	1,95	(6,16)	6,83



RESULTADOS DE 2023			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	0,84	0,83	100,94%
Fevereiro	(0,69)	1,08	-
Março	0,74	1,03	72,06%
Abril	0,66	0,84	79,01%
Maio	1,60	0,73	217,76%
Junho	1,54	0,26	603,32%
Julho	1,25	0,27	472,62%
Agosto	0,67	0,59	113,39%
Setembro	0,52	0,45	116,51%
Outubro	0,18	0,48	38,12%
Novembro	1,97	0,44	449,26%
Dezembro	1,72	0,89	193,49%
Total	11,56	8,16	141,57%

¹A rentabilidade da carteira é baseado na cota Bruta

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES

DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO
01/04/2024	-4.595.154,92	Resgate	Augme Institucional FI RF CP
03/04/2024	12.300.000,00	Aplicação	MCA Institucional FIC FIM CP
10/04/2024	895.719,65	Compra	Letra Financeira - Banco Industrial
15/04/2024	-42.051,97	Juros	Debênture - Vamos (VAMO34)
15/04/2024	-10.077,80	Rendimentos	FIDC Credz Sênior 8
18/04/2024	-14.657.628,69	Venda	Letra Financeira do Tesouro Nacional
18/04/2024	13.221.234,78	Compra	Notas do Tesouro Nacional - Série B
19/04/2024	-375.011,94	Amortização	FIDC Credz Sênior 8
19/04/2024	-1.993,87	Rendimentos	FIDC Credz Sênior 8
26/04/2024	-147.600,00	Amortização	FIDC Credz Sênior 8
30/04/2024	-33.408.149,49	Venda	Notas do Tesouro Nacional - Série B
30/04/2024	10.000.000,00	Aplicação	Novus Institucional FI RF LP

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES

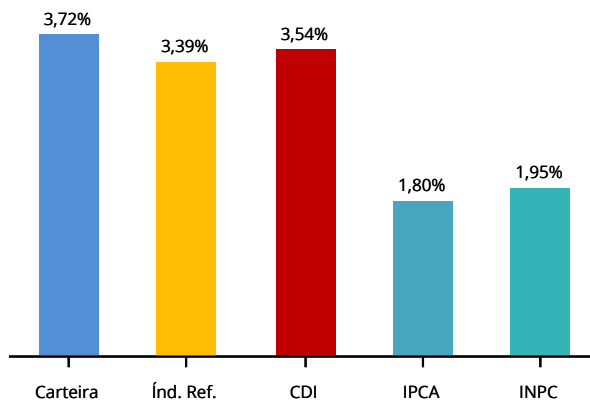
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO
------	-------	----------	-------

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: A continuidade de divulgações de fortes dados dos EUA promoveu nova rodada de reprecificações quanto aos próximos passos do Fed, com os players novamente reduzindo as apostas de cortes da taxa de juros do país em 2024. Até mesmo membros considerados mais dovish do Fed efetivaram discursos duros. Assim, ressalta-se que as bolsas dos EUA, após 5 meses seguidos de ganhos, finalmente apresentaram quedas, seja por natural correção, seja pelos efeitos adversos trazidos pela arrancada dos yields das Treasuries. O cenário da China ficou em segundo plano, embora o agregado de notícias tenha sido positivo. Destaca-se que relevantes indicadores econômicos chineses superaram as estimativas, enquanto as sinalizações são de algum estancamento da crise do setor imobiliário.

Economia Brasileira: Destaque para a mudança das metas fiscais a partir de 2025, o que elevou o nível de desconfiança do mercado a respeito do compromisso do governo com a saúde das contas públicas. Diante dos intensos movimentos defensivos dos mercados domésticos, especialmente nos mercados de câmbio e de juros, diante do posicionamento cauteloso do Fed e da alteração das metas fiscais do Brasil, o presidente do BCB enviou importante recado aos agentes - praticamente eliminando o forward guidance adotado pelo Copom em sua reunião de março, o qual contratava nova redução de 0,50% na taxa Selic em maio. Revisamos nosso call de Selic tanto para 2024 (de 9,00% para 9,50%) quanto para 2025 (de 8,00% para 8,50%).

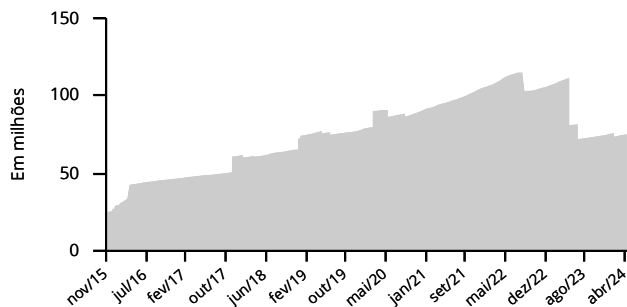
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



Mês	Mai-23	Jun-23	Jul-23	Ago-23	Set-23	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24	Fev-24	Mar-24	Abr-24	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev ALM CP	1,03	0,50	0,48	0,72	0,68	0,69	0,67	0,86	1,01	0,98	0,98	0,70	3,72	9,70	21,20
Índ. Ref.	0,73	0,26	0,27	0,59	0,45	0,48	0,44	0,89	0,94	1,13	0,53	0,74	3,39	7,71	16,68
CDI	1,12	1,07	1,07	1,14	0,97	1,00	0,92	0,90	0,97	0,80	0,83	0,89	3,54	12,33	27,35
IPCA	0,23	(0,08)	0,12	0,23	0,26	0,24	0,28	0,56	0,42	0,83	0,16	0,38	1,80	3,69	8,03

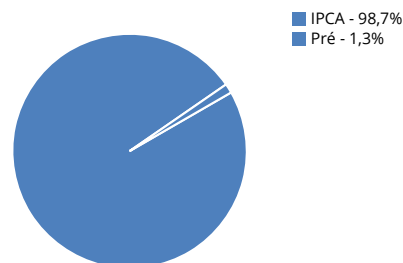
Índice de Referência INPC + 4,35% a.a.

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

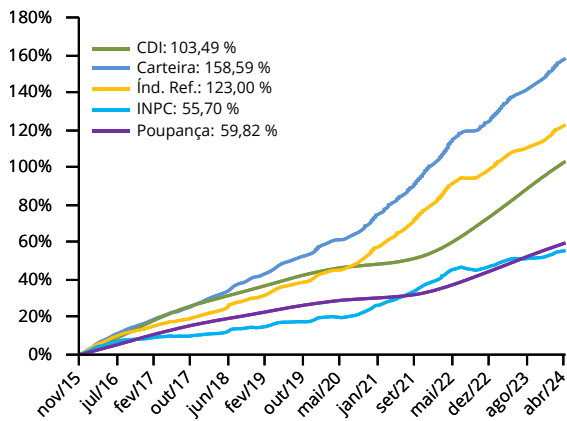


DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO

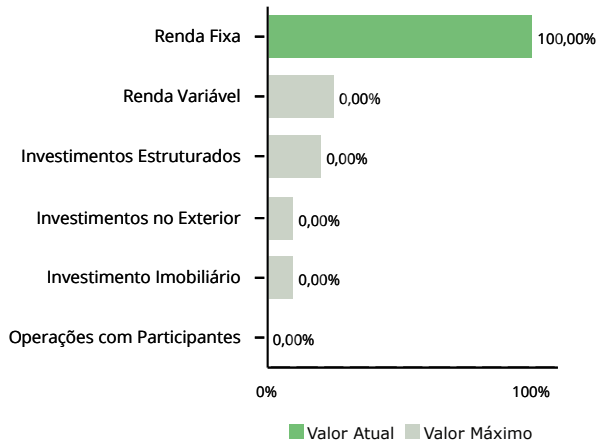
Patrimônio Líquido R\$ 75.219.229,56



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





SOMMA JUSPREV ALM CP
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
ABRIL DE 2024



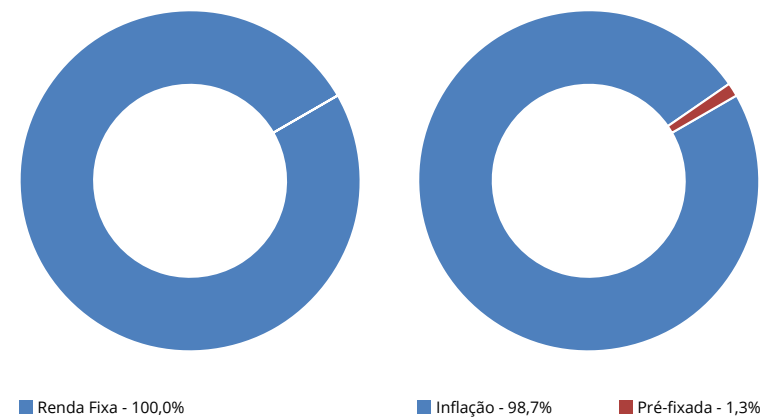
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

Carteira Consolidada	3
Carteira Detalhada	4
Política de Investimento	5
Análise de Rentabilidade.....	6
Retorno da Carteira (R\$)	7
Rentabilidade da Carteira (%).....	8
Relatório de Movimentações	9

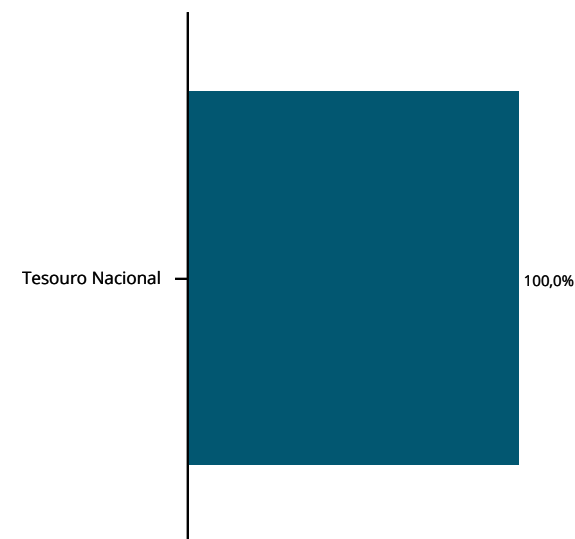


ATIVOS	ABRIL-24	%	MARÇO-24	%
RENDA FIXA	75.233.915,31	100,0%	74.705.818,15	100,0%
Compromissada - Títulos Públicos	968.276,09	1,3%	967.836,61	1,3%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	74.265.639,22	98,7%	73.737.981,54	98,7%
TESOURARIA	(14.685,75)	0,0%	(12.628,66)	0,0%
Caixa	1.000,00	0,0%	1.000,00	0,0%
Valores a Pagar/Receber	(15.685,75)	0,0%	(13.628,66)	0,0%
TOTAL DA CARTEIRA	75.219.229,56	100%	74.693.189,49	100%

GRÁFICOS DE DISTRIBUIÇÃO



INSTITUIÇÃO²



¹O saldo deste item não é considerado no somatório do PL.

²Não estão inclusas ações e opções

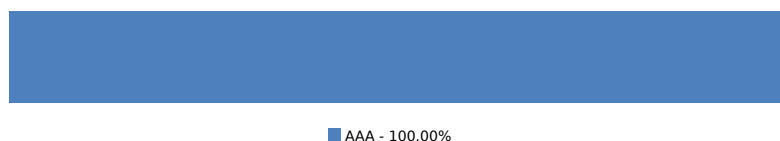
RENDA FIXA									
Ativo - Emissor	Marcação	Data Aplicação	Data Vencimento	Indexador	Valor Aplicado	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
Compromissada - Títulos Públicos	Mercado	30/04/2024	02/05/2024	10,64% a.a.	968.276,09	968.276,09	-	968.276,09	1,29%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	24/12/2018	15/08/2024	IPCA + 4,47%	1.348.172,69	1.689.145,88	-	1.689.145,88	2,25%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	22/08/2018	15/08/2030	IPCA + 5,65%	2.048.893,74	2.782.727,05	-	2.782.727,05	3,70%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,55%	474.768,52	782.585,95	-	782.585,95	1,04%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/02/2016	15/05/2035	IPCA + 7,41%	1.703.916,03	2.727.868,83	-	2.727.868,83	3,63%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	16/03/2020	15/08/2050	IPCA + 4,46%	10.007.893,59	12.774.872,47	-	12.774.872,47	16,98%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,29%	172.302,01	267.438,45	-	267.438,45	0,36%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/11/2017	15/05/2035	IPCA + 5,29%	9.842.760,14	13.895.478,17	-	13.895.478,17	18,47%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	14/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,32%	241.312,77	397.949,43	-	397.949,43	0,53%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/03/2016	15/05/2055	IPCA + 6,39%	4.095.944,22	6.184.376,01	-	6.184.376,01	8,22%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	28/08/2020	15/08/2050	IPCA + 4,01%	1.114.803,90	1.418.963,96	-	1.418.963,96	1,89%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/08/2020	15/08/2050	IPCA + 3,91%	1.130.879,32	1.439.640,27	-	1.439.640,27	1,91%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/01/2019	15/08/2050	IPCA + 4,61%	2.378.295,32	3.127.546,50	-	3.127.546,50	4,16%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,29%	1.058.426,68	1.642.836,27	-	1.642.836,27	2,18%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	30/12/2015	15/05/2045	IPCA + 7,33%	947.095,85	1.521.512,52	-	1.521.512,52	2,02%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	19/06/2018	15/05/2055	IPCA + 5,92%	1.261.769,06	1.777.049,57	-	1.777.049,57	2,36%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	31/05/2017	15/08/2026	IPCA + 5,65%	1.493.159,87	2.076.505,27	-	2.076.505,27	2,76%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/11/2015	15/05/2035	IPCA + 7,01%	5.062.404,62	8.141.954,03	-	8.141.954,03	10,82%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,35%	121.192,13	198.560,58	-	198.560,58	0,26%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	13/01/2016	15/05/2035	IPCA + 7,35%	549.253,50	893.359,58	-	893.359,58	1,19%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	16/03/2016	15/08/2050	IPCA + 6,83%	1.153.894,05	1.759.762,55	-	1.759.762,55	2,34%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,45%	860.308,17	1.419.073,13	-	1.419.073,13	1,89%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/01/2019	15/05/2045	IPCA + 4,63%	1.922.501,16	2.578.952,46	-	2.578.952,46	3,43%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	02/01/2019	15/05/2045	IPCA + 4,99%	2.093.975,28	2.834.192,74	-	2.834.192,74	3,77%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	24/12/2018	15/05/2045	IPCA + 5,03%	1.340.943,59	1.818.671,08	-	1.818.671,08	2,42%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,29%	73.843,71	114.616,47	-	114.616,47	0,15%
TOTAL						75.233.915,31	-	75.233.915,31	100,02 %

LIMITE DE ALOCAÇÃO POR ATIVO E SEGMENTO - PI vigente para o ano			
SEGMENTO	MAXIMO	ATUAL	MARGEM
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	100,00%	0,00%
Títulos Públicos Federais	100,00%	100,00%	0,00%
CDI/CDBs	80,00%	0,00%	80,00%
Letras Financeiras de Inst. Financeira	80,00%	0,00%	80,00%
Debêntures	20,00%	0,00%	20,00%
DPGE	20,00%	0,00%	20,00%
FIDC	20,00%	0,00%	20,00%
Outros Ativos de Renda Fixa	20,00%	0,00%	20,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	25,00%	0,00%	25,00%
Ações de Companhias Abertas	25,00%	0,00%	25,00%
SPE	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20,00%	0,00%	20,00%
FIP - Fundo de Investimento em Participações	5,00%	0,00%	5,00%
FIM - Fundos de Investimento Multimercado	15,00%	0,00%	15,00%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	10,00%	0,00%	10,00%
FIE - Fundo de Investimento no Exterior	10,00%	0,00%	10,00%
INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	10,00%	0,00%	10,00%
CCI	10,00%	0,00%	10,00%
CRI	10,00%	0,00%	10,00%
FII - Fundo Investimento Imobiliário	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL EM OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0,00%	0,00%	0,00%
Operações com Participante	0,00%	0,00%	0,00%
Total		100,00%	

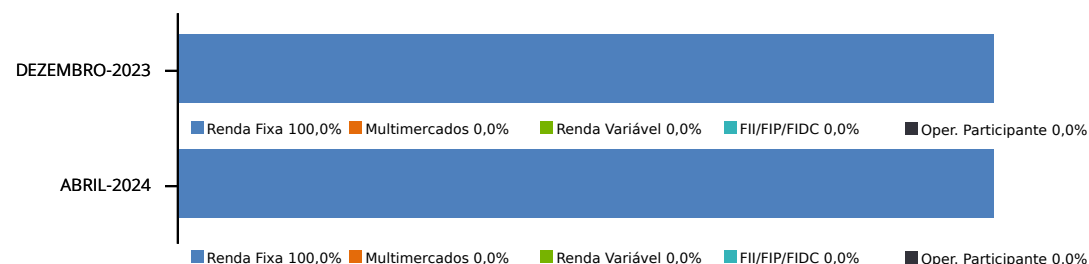
RATINGS ESCALA NACIONAL DE LONGO PRAZO ¹			
INSTITUIÇÃO/ATIVO	MÁXIMO	ATUAL	AGÊNCIAS DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO
Segurança Máxima (AAA)	100,00%	100,00%	FITCH MOODY'S S&P AUSTIN
Tesouro Nacional	100,00%	100,00%	- - brAAA -

LEGENDA
Nota elevada
Nota rebaixada

RATING DOS ATIVOS



MUTAÇÃO DE INVESTIMENTOS



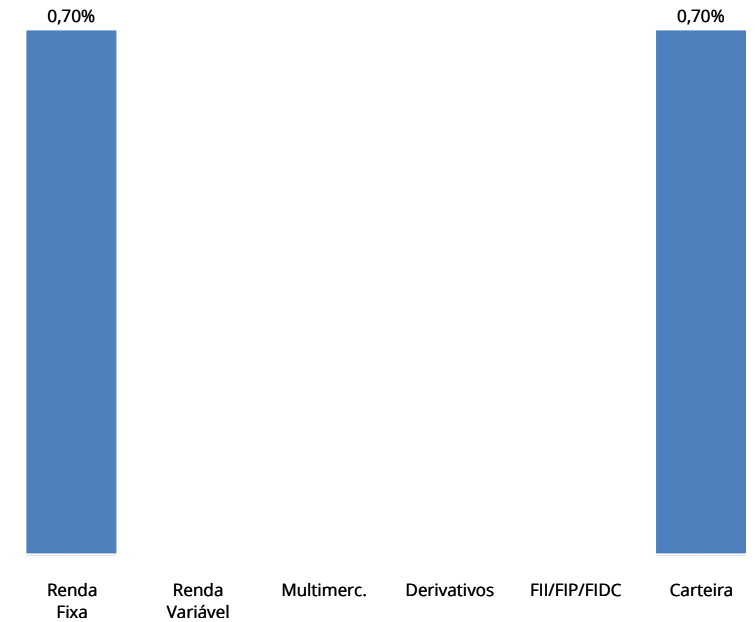
¹Engloba Tesouro Nacional, Bancos, FIDCs e Debêntures

RENTABILIDADE	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES	
	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Renda Fixa						
Compromissada - Títulos Públicos	0,89	119,2%	3,53	104,1%	12,32	159,8%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	0,72	96,2%	3,78	111,5%	9,76	126,6%

RENTABILIDADE INDICADORES	NO MÊS %	NO ANO %	EM 12 MESES %
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	0,74	3,39	7,71
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	0,74	3,39	7,71
Op. com Participante (0% CDI)	0,00	0,00	0,00
CDI	0,89	3,54	12,33
IPCA	0,38	1,80	3,69
INPC	0,37	1,95	3,23
Ibovespa	-1,70	-6,16	20,58
Dólar	3,51	6,83	3,42

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	0,71	3,73	9,88
Renda Variável	0,00	0,00	0,00
Investimentos Estruturados	0,00	0,00	0,00
Investimentos no Exterior	0,00	0,00	0,00
Operação com participante	0,00	0,00	0,00

COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA



RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	NO ANO
RENDA FIXA	764.914,68	745.454,28	731.279,11	536.195,15	-	-	2.777.843,22
Compromissada - Títulos Públicos	26.655,58	19.867,96	8.046,61	8.537,47	-	-	63.107,62
Notas do Tesouro Nacional - Série B	738.259,10	725.586,32	723.232,50	527.657,68	-	-	2.714.735,60
TOTAL	764.914,68	745.454,28	731.279,11	536.195,15	-	-	2.777.843,22

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	0,83%	0,77%	0,99%	1,27%	0,92%	0,45%	0,70%	0,67%	0,57%	0,54%	0,72%	1,33%	10,22%
Rent. Líquida	0,83%	0,77%	0,99%	1,27%	0,92%	0,45%	0,70%	0,67%	0,57%	0,54%	0,72%	1,33%	10,22%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,47%	0,48%	0,38%	0,38%	5,97%
Índice Ref.	0,73%	0,88%	1,09%	0,96%	0,52%	0,33%	0,49%	0,49%	0,31%	0,43%	0,88%	1,58%	9,04%

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,30%	0,53%	0,76%	0,37%	0,04%	0,47%	0,86%	0,75%	0,87%	1,29%	1,25%	1,64%	10,61%
Rent. Líquida	1,30%	0,53%	0,76%	0,37%	0,04%	0,47%	0,86%	0,75%	0,87%	1,29%	1,25%	1,64%	10,61%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,22%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,15%	0,16%	2,77%
Índice Ref.	0,56%	0,48%	0,55%	0,11%	0,09%	0,66%	0,83%	0,72%	1,23%	1,25%	1,29%	1,84%	10,02%

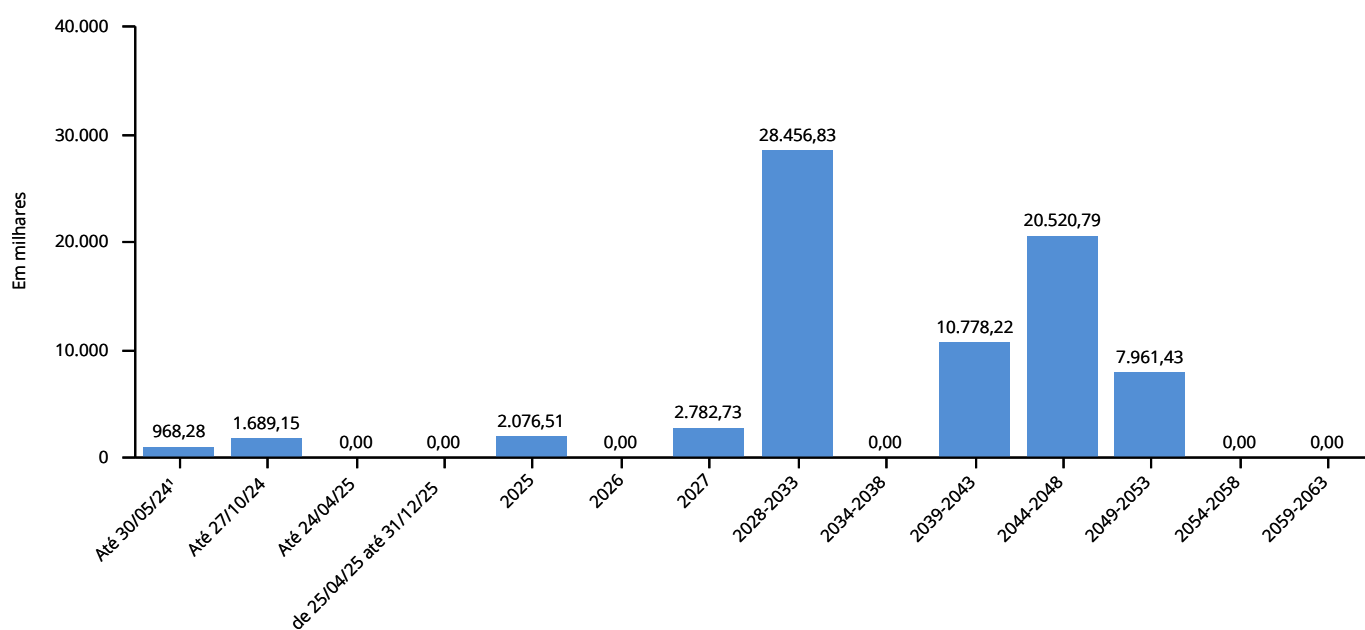
2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,30%	0,76%	1,67%	0,94%	0,98%	1,20%	1,15%	1,30%	1,58%	1,43%	1,63%	1,28%	16,33%
Rent. Líquida	1,30%	0,76%	1,67%	0,94%	0,98%	1,20%	1,15%	1,30%	1,58%	1,43%	1,63%	1,28%	16,33%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,30%	0,36%	0,42%	0,44%	0,48%	0,59%	0,76%	4,39%
Índice Ref.	0,61%	1,13%	1,25%	0,72%	1,32%	0,96%	1,40%	1,26%	1,56%	1,50%	1,18%	1,12%	14,93%

2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,06%	1,12%	1,83%	1,74%	1,41%	0,94%	0,42%	0,00%	0,16%	0,69%	0,92%	0,89%	11,75%
Rent. Líquida	1,06%	1,12%	1,83%	1,74%	1,41%	0,94%	0,42%	0,00%	0,16%	0,69%	0,92%	0,89%	11,75%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%	12,37%
Índice Ref.	1,03%	1,32%	2,09%	1,36%	0,82%	0,98%	-0,25%	0,08%	0,03%	0,81%	0,72%	1,06%	10,52%

2023	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,20%	1,00%	1,46%	0,93%	1,03%	0,50%	0,48%	0,72%	0,68%	0,69%	0,67%	0,86%	10,71%
Rent. Líquida	1,20%	1,00%	1,46%	0,93%	1,03%	0,50%	0,48%	0,72%	0,68%	0,69%	0,67%	0,86%	10,71%
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,90%	13,05%
Índice Ref.	0,83%	1,08%	1,03%	0,84%	0,73%	0,26%	0,27%	0,59%	0,45%	0,48%	0,44%	0,89%	8,16%

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,01%	0,98%	0,98%	0,70%									3,72%
Rent. Líquida	1,01%	0,98%	0,98%	0,70%									3,72%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%									3,54%
Índice Ref.	0,94%	1,13%	0,53%	0,74%									3,39%

MAPA DE VENCIMENTOS DOS ATIVOS DA CARTEIRA



¹ São considerados títulos e fundos categorizados como a negociação

² Dados de referência calculados com mês anterior

Relatório mensal

Icatu Vanguarda Jusprev FIC FIM CP

Abril 2024

Cenário

No mês de abril, os mercados reagiram a um conjunto de dados menos favoráveis para o início do ciclo de cortes de juros nos EUA. Os primeiros meses do ano foram marcados por maior força da atividade econômica e uma pior dinâmica inflacionária de curto prazo, ao se observar um aumento nas médias móveis trimestrais dos índices de inflação para níveis bem acima da meta.

Até março, o Fed justificava essa piora na dinâmica por fatores mais técnicos relacionados aos dados. Mas, depois de três meses, Powell reconheceu que, além de não ter notado um maior progresso na desinflação, deve levar mais tempo para se ter confiança de que a inflação está caminhando para a meta de 2%.

A combinação incomum de dados fortes de atividade e mais baixos de inflação que sustentou a narrativa de choque de oferta positivo no segundo semestre de 2023 tem sido questionada diante dos números recentes. A possibilidade de que as condições financeiras não estejam suficientemente restritivas para se alcançar o objetivo de inflação fez emergir a discussão sobre altas de juros.

Na última reunião do Fed, Powell debateu 3 possíveis cenários para trajetória de juros e em nenhum deles a prescrição seria de alta da Fed Funds. Os dados de inflação seguem como principal destaque e foco dos mercados e da autoridade monetária. No mês de maio, será importante observar se indicam persistência, reversão ou continuidade da desinflação.

Ainda que não haja aumento dos juros nos EUA, o cenário é bastante distinto do que se tinha no início do ano, quando o mercado precisava entre seis e sete cortes em 2024. Agora, a expectativa implícita pelos preços é entre um e dois cortes. Nesse sentido, uma piora do cenário externo poderia ser um empecilho para a continuidade do ciclo de cortes e para o juro terminal brasileiro.

Além da turbulência externa, não apenas pelos desenvolvimentos econômicos norte-americanos, mas também por conta do aumento das tensões geopolíticas envolvendo Israel e Irã, as questões domésticas brasileiras contribuíram para deterioração do cenário. O governo alterou a meta fiscal indicada para 2025 e tem se mostrado pouco disposto a cumprir o acionamento de gatilhos impostos pelo arcabouço fiscal.

A alteração substancial do cenário local, tendo o ambiente externo como principal vetor, levou a uma desvalorização do câmbio e revisão das expectativas de inflação. A reação do Banco Central foi de flexibilizar o forward guidance que previa corte de 50 pontos base na reunião de maio. A persistência da incerteza elevada – ainda que inferior aos piores momentos de abril – e a piora nas expectativas apontam o cenário de redução de apenas 25 pontos base da Selic na próxima reunião do COPOM.

A ausência de grandes eventos no âmbito fiscal doméstico – ao menos os programados – faz com que as atenções continuem nos EUA, em especial as indicações obtidas pelos dados de inflação, como principal fator de impacto no mercado local.

Rentabilidade

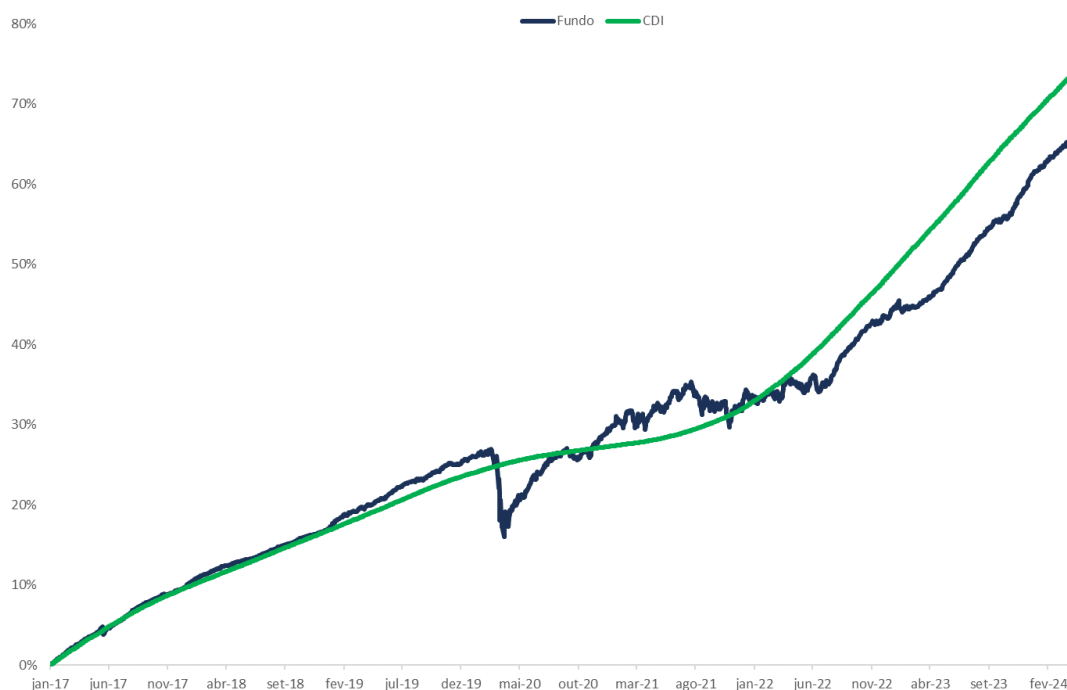
CDI	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2023
Fundo	0,03%	-0,04%	0,74%	0,79%	1,32%	1,29%	1,32%	1,03%	0,82%	0,39%	1,90%	1,45%	11,61%
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,90%	13,05%
INPC + 4,35%*	0,83%	1,08%	1,03%	0,84%	0,73%	0,26%	0,27%	0,59%	0,45%	0,48%	0,44%	0,89%	8,16%
Bench 2023	1,32%	0,51%	0,97%	0,97%	1,25%	1,43%	1,23%	0,90%	0,89%	0,73%	1,61%	1,20%	13,81%

CDI	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2024
Fundo	0,85%	0,74%	0,82%	0,11%									2,54%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%									3,54%
INPC + 4,35%	0,94%	1,13%	0,53%	0,74%									3,39%
Bench 2024	0,79%	0,94%	0,87%	0,78%									3,41%

	12m	24m	36m
Fundo	12,72%	23,14%	25,36%
CDI	12,33%	27,35%	36,36%
%CDI	103,19%	84,60%	69,73%

Rentabilidade acumulada

Rentabilidade Acumulada



Performance Individuais

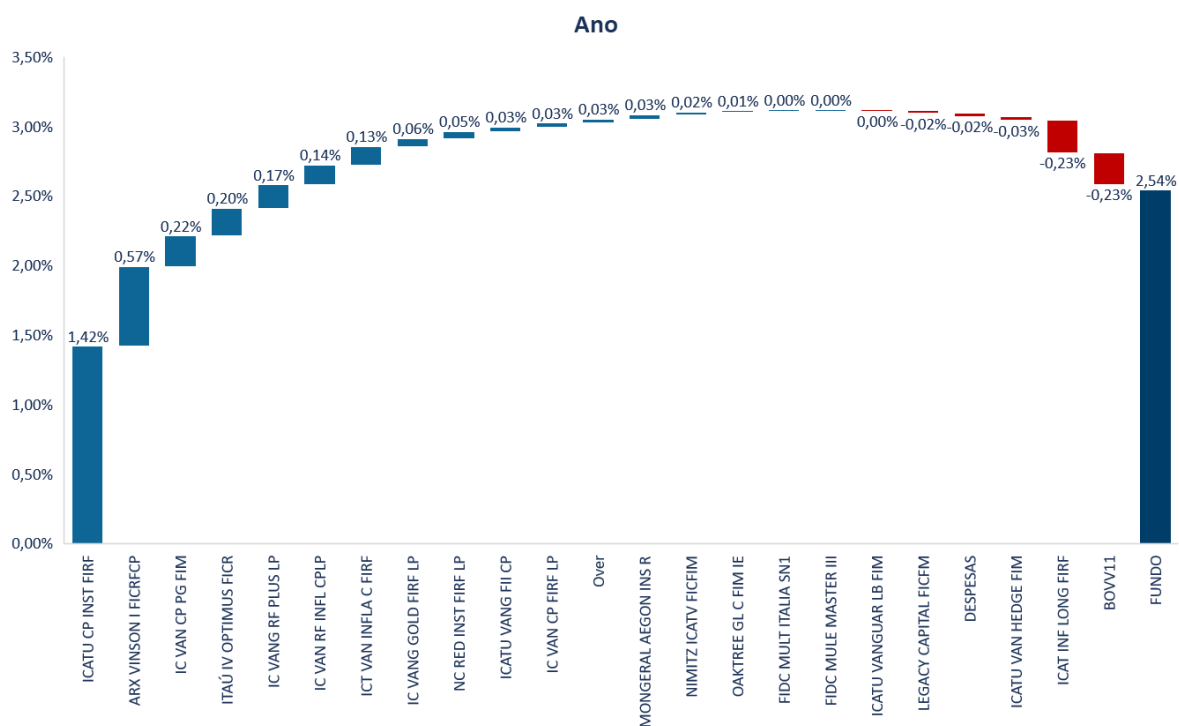
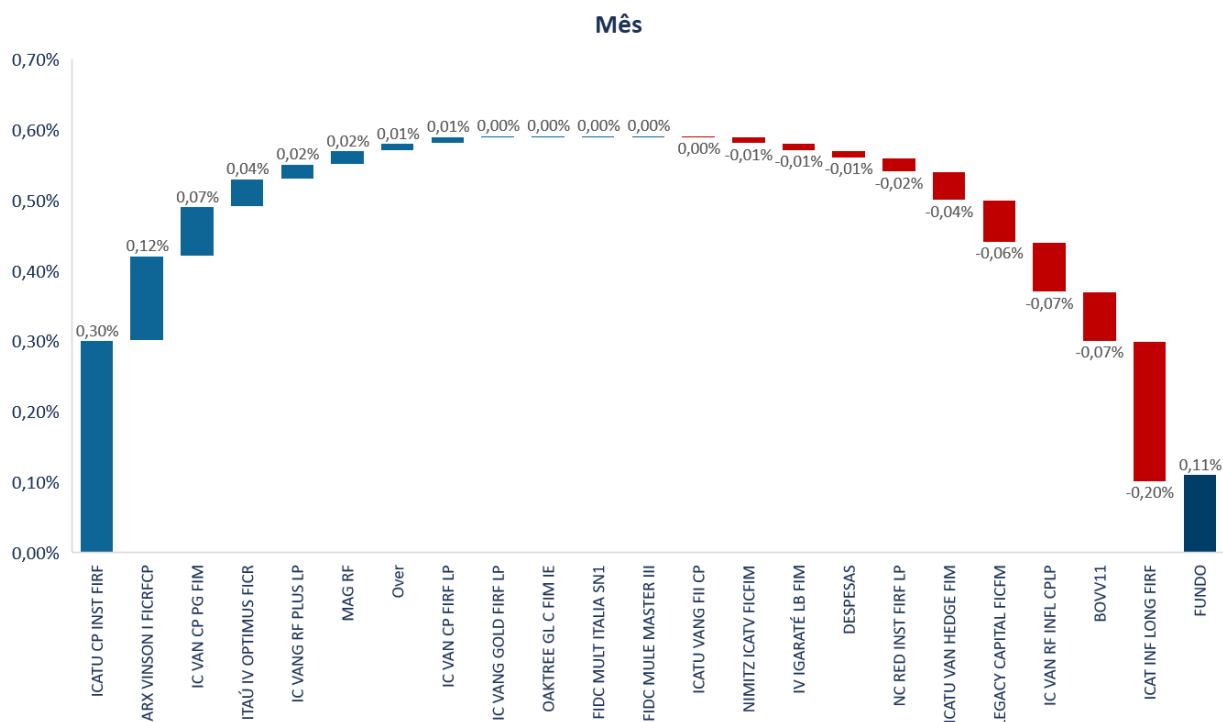
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2024
Icatu Vanguarda Renda Fixa Plus	1,17%	0,83%	0,90%	0,75%	-	-	-	-	-	-	-	-	3,69%
Icatu Vanguarda Crédito Privado FI RF LP	1,51%	0,86%	1,09%	1,01%	-	-	-	-	-	-	-	-	4,55%
Mag Renda Fixa Fundo De Investimento	1,04%	0,85%	0,91%	0,71%	-	-	-	-	-	-	-	-	3,56%
Icatu Vanguarda CP Institucional FIRF	1,62%	1,10%	1,13%	1,06%	-	-	-	-	-	-	-	-	5,00%
Nc Red Institucional FIRF	0,67%	0,33%	0,63%	-0,33%	-	-	-	-	-	-	-	-	1,30%
Icatu Vanguarda PG FIM CP	1,78%	1,08%	1,17%	1,03%	-	-	-	-	-	-	-	-	5,16%
Arx Vinson FIC FIRF CP	1,23%	0,94%	1,16%	0,93%	-	-	-	-	-	-	-	-	4,32%
Itaú Iv Optimus RF LP Ficf	0,88%	0,68%	0,95%	0,99%	-	-	-	-	-	-	-	-	3,55%
Legacy Capital FICFI MM	0,46%	-0,40%	1,22%	-2,37%	-	-	-	-	-	-	-	-	-1,11%
Nimitz IV FIC FIM	0,32%	0,41%	1,31%	-1,02%	-	-	-	-	-	-	-	-	1,01%
Icatu Vanguarda Hedge FIM	0,80%	-0,75%	0,11%	-1,43%	-	-	-	-	-	-	-	-	-1,27%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	-	-	-	-	-	-	-	-	3,54%
Icatu Vanguarda Inflação CP FIRF LP	1,23%	0,89%	0,91%	-0,66%	-	-	-	-	-	-	-	-	2,38%
IMAB-5	0,68%	0,59%	0,77%	-0,20%	-	-	-	-	-	-	-	-	1,85%
Icatu Vanguarda Inflação Longa FIRF	-1,49%	0,47%	-0,57%	-2,94%	-	-	-	-	-	-	-	-	-4,49%
IMAB-5+	-1,47%	0,51%	-0,55%	-2,91%	-	-	-	-	-	-	-	-	-4,38%
Icatu Vanguarda Imobiliário FIM CP	1,02%	0,66%	0,53%	-0,19%	-	-	-	-	-	-	-	-	2,03%
IFIX	0,66%	0,81%	1,43%	-0,79%	-	-	-	-	-	-	-	-	2,11%
BOVV11	-4,80%	1,04%	-0,84%	-1,67%	-	-	-	-	-	-	-	-	-6,20%
Icatu Vanguarda Long Biased FIM	-0,96%	0,89%	1,32%	-1,51%	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,30%
IBOV	-4,79%	0,99%	-0,71%	-1,70%	-	-	-	-	-	-	-	-	-6,16%
IBX	-4,51%	0,96%	-0,73%	-1,34%	-	-	-	-	-	-	-	-	-5,57%
Oaktree Global Credit Brl FI MM Ie	1,13%	0,63%	1,25%	0,17%	-	-	-	-	-	-	-	-	3,21%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	-	-	-	-	-	-	-	-	3,54%

Alocação

ESTRATÉGIA	FUNDOS	% PL	
CDI	Nc Red Institucional FIRF	5,8%	16,9%
	Mag Renda Fixa Fundo De Investimento	4,5%	
	Itaú IV Optimus FICR	4,1%	
	Icatu Vanguarda Renda Fixa Plus	2,5%	
Inflação Curta	Icatu Vanguarda Inflação CP FIRF LP	9,7%	9,7%
Inflação Longa	Icatu Vanguarda Inflação Longa FIRF	6,7%	6,7%
Crédito Privado	Icatu Vanguarda Crédito Privado Institucional FIRF	28,5%	49,7%
	Arx Vinson FIC FIRF CP	13,2%	
	Icatu Vanguarda PG FIM CP	7,2%	
Investimento Estruturado	Icatu Vanguarda Crédito Privado FI RF LP	0,8%	6,5%
	Legacy Capital FICFI MM	2,3%	
	Nimitz IV FIC FIM	1,3%	
Imobiliário	Icatu Vanguarda Hedge FIM	2,9%	1,9%
	Icatu Vanguarda Imobiliário FIM CP	1,9%	
Renda Variável	Icatu Vanguarda Igaratê LB FIM	0,9%	4,9%
	BOVV11	4,0%	
FIDC	FIDC Mult. Italia	0,1%	0,1%
	FIDC MULE MASTER III	0,0%	
Investimento Exterior	Oaktree Global Credit Brl FI MM Ie	2,7%	2,7%
Caixa	-	0,9%	0,9%

Alocação	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24
CDI	17,2%	20,5%	14,7%	16,9%
Crédito	42,8%	42,8%	42,6%	49,7%
Inflação Curta	17,3%	10,0%	9,9%	9,7%
Inflação Longa	1,8%	3,0%	4,9%	6,7%
Multimercado	13,6%	13,5%	14,0%	6,5%
Renda Variável	5,0%	5,9%	6,0%	4,9%
FIDC's	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%
Imobiliário	2,0%	2,0%	2,0%	1,9%
Exterior	-	-	2,7%	2,7%
Caixa	0,2%	2,2%	3,2%	0,9%

P&L



Movimentações

Fundo	CDI	Classe Fundo		Data	% Fin.	Data Cotização (Resgates)	Data Liquidação (Resgates)
		Inflação	Renda Variável				
Mag RF FI	7.200.000,00			01/04/2024	3,00%	-	-
BOVV11			-2.367.220,96	02/04/2024	-0,99%	02/04/2024	04/04/2024
Icatu Vanguarda Gold FI RF LP	-2.400.000,00			02/04/2024	-1,00%	02/04/2024	02/04/2024
Mag RF FI	-2.987.500,00			02/04/2024	-1,24%	02/04/2024	02/04/2024
Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF LP		4.730.000,00		02/04/2024	1,97%	-	-
BOVV11			-172.388,63	09/04/2024	-0,07%	09/04/2024	11/04/2024
BOVV11			306.130,39	15/04/2024	0,13%	-	-
Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF LP		332.000,00		17/04/2024	0,14%	-	-
Icatu Vanguarda Gold FI RF LP	-1.203.101,48			19/04/2024	-0,50%	19/04/2024	19/04/2024
Mag RF FI	4.830.000,00			19/04/2024	2,00%	-	-
BOVV11			214.029,23	25/04/2024	0,09%	-	-
BOVV11			-213.865,52	26/04/2024	-0,09%	26/04/2024	30/04/2024