



R.I. Relatório de Investimentos

AGOSTO/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

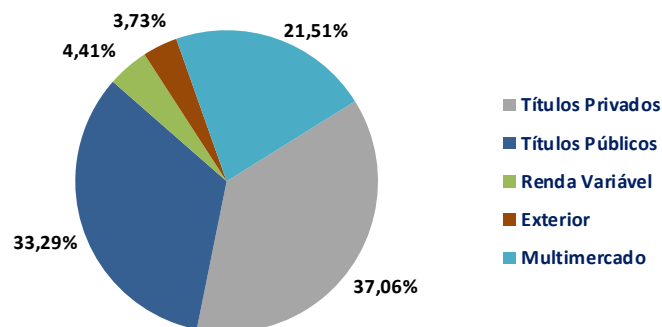
O objetivo do plano é proporcionar valorização superior ao INPC + 4,35% a.a. que é a meta atuarial. A aplicação dos recursos é realizada por meio de fundos de investimento que investem diretamente em títulos e/ou em fundo de renda fixa, renda variável, multimercado e estruturados. A alocação dos recursos 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	234.816.174,64	39,27%	Icatu Asset Management	1,05%	11,94%	24,08%	30,13%	36,49%	40,07%
SOMMA JUSPREV ATIVO FI MULT CRED PRIV ²	237.520.195,70	39,72%	Somma Investimentos S.A.	0,89%	11,31%	21,42%	29,88%	34,40%	37,68%
SOMMA JUSPREV ALM FI MULT	75.568.332,18	12,64%	Somma Investimentos S.A.	0,68%	10,11%	21,60%	40,36%	61,88%	75,75%
JUSPREV FIMULTIMERCADO CRED PRIV	50.074.569,01	8,37%	BTG Pactual Gestão de Recursos LTDA	-	-	-	-	-	-
TOTAL JUSPREV	597.979.271,53	100%		0,85%	10,56%	20,97%	30,26%	38,90%	43,43%

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.

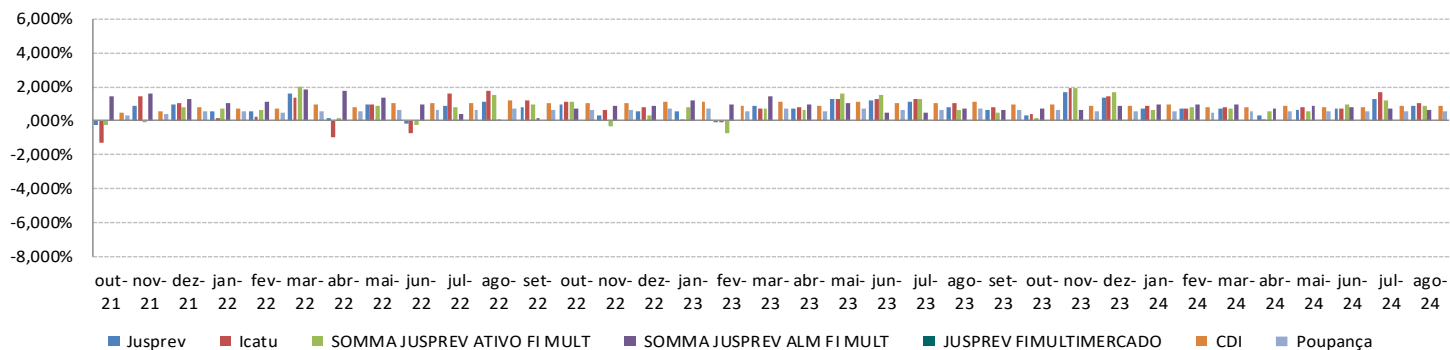
Composição



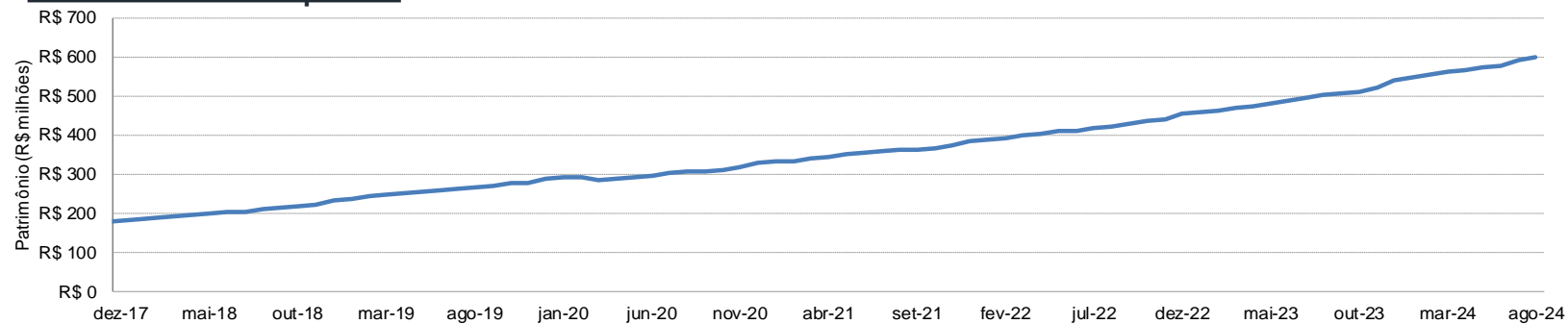
Rentabilidade Mensal Consolidada

%POUPANÇA	211,33%	127,94%	153,23%	130,99%	84,71%	173,80%	193,00%	147,22%	107,62%	220,77%	113,41%	128,64%	151,18%
2019	0,91%	0,47%	0,58%	0,76%	0,76%	0,62%	0,58%	0,32%	0,62%	0,61%	0,19%	0,93%	7,60%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,46%	0,48%	0,38%	0,37%	5,96%
%CDI	168,00%	94,56%	122,91%	147,28%	139,19%	132,62%	101,48%	63,31%	133,93%	127,73%	50,01%	248,56%	127,41%
POUPANÇA	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,34%	0,34%	0,32%	0,29%	0,29%	4,26%
%POUPANÇA	245,57%	125,63%	155,11%	205,48%	203,47%	167,36%	155,11%	92,84%	180,87%	194,15%	66,26%	324,40%	178,40%
2020	0,46%	-0,39%	-3,41%	1,05%	0,83%	0,87%	1,16%	0,38%	-0,44%	0,16%	1,57%	1,53%	3,74%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,23%	0,21%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	2,76%
%CDI	122,33%	-133,26%	-1006,90%	368,67%	392,49%	407,64%	599,25%	237,71%	-277,49%	103,71%	1053,37%	929,08%	135,70%
POUPANÇA	0,26%	0,26%	0,26%	0,22%	0,22%	0,17%	0,13%	0,13%	0,12%	0,12%	0,12%	0,12%	2,11%
%POUPANÇA	178,02%	-151,25%	-1316,48%	485,86%	424,69%	499,45%	893,77%	291,70%	-375,82%	140,46%	1358,67%	1318,29%	177,07%
2021	0,43%	-0,10%	0,88%	0,94%	0,89%	0,57%	-0,03%	-0,01%	-0,02%	-0,21%	0,91%	0,95%	5,33%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,31%	0,36%	0,43%	0,44%	0,49%	0,59%	0,77%	4,42%
%CDI	286,43%	-70,64%	437,15%	452,76%	330,82%	186,66%	-8,28%	-2,32%	-3,74%	-43,25%	155,72%	123,34%	120,53%
POUPANÇA	0,12%	0,12%	0,12%	0,16%	0,16%	0,20%	0,24%	0,24%	0,30%	0,36%	0,44%	0,56%	3,06%
%POUPANÇA	369,45%	-82,00%	758,46%	591,71%	562,43%	284,54%	-12,03%	-4,06%	-5,48%	-58,79%	207,09%	169,15%	174,32%
2022	0,54%	0,59%	1,65%	0,12%	0,99%	-0,14%	0,92%	1,13%	0,80%	0,97%	0,29%	0,60%	8,79%
CDI	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%	1,17%	1,07%	1,03%	1,02%	1,12%	12,40%
%CDI	74,03%	78,28%	177,69%	14,67%	95,82%	-14,11%	88,70%	97,01%	74,76%	94,22%	28,87%	53,30%	70,90%
POUPANÇA	0,56%	0,50%	0,60%	0,56%	0,65%	0,65%	0,66%	0,74%	0,68%	0,65%	0,65%	0,71%	7,90%
%POUPANÇA	96,67%	118,21%	275,65%	22,01%	152,73%	-22,07%	138,26%	152,86%	117,62%	149,28%	45,19%	84,29%	111,26%
2023	0,55%	-0,10%	0,85%	0,71%	1,30%	1,20%	1,10%	0,77%	0,61%	0,29%	1,69%	1,41%	10,86%
CDI	1,12%	0,92%	1,14%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,90%	13,01%
%CDI	49,32%	-11,33%	74,21%	77,39%	115,64%	112,18%	102,79%	67,46%	62,70%	28,87%	183,36%	156,80%	83,48%
POUPANÇA	0,71%	0,58%	0,74%	0,58%	0,72%	0,68%	0,66%	0,72%	0,61%	0,61%	0,58%	0,57%	8,04%
%POUPANÇA	77,91%	-17,83%	114,27%	122,23%	180,94%	176,64%	167,23%	107,18%	99,60%	47,51%	291,91%	246,87%	135,11%
2024	0,73%	0,75%	0,73%	0,32%	0,64%	0,76%	1,31%	0,85%					6,27%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%					7,10%
%CDI	75,80%	93,26%	88,09%	36,00%	76,92%	96,59%	144,60%	98,43%					88,28%
POUPANÇA	0,59%	0,51%	0,53%	0,60%	0,59%	0,54%	0,57%	0,57%					4,59%

Rentabilidade Mensal



Patrimônio Líquido



Histórico de Desempenho

Histórico de Desempenho

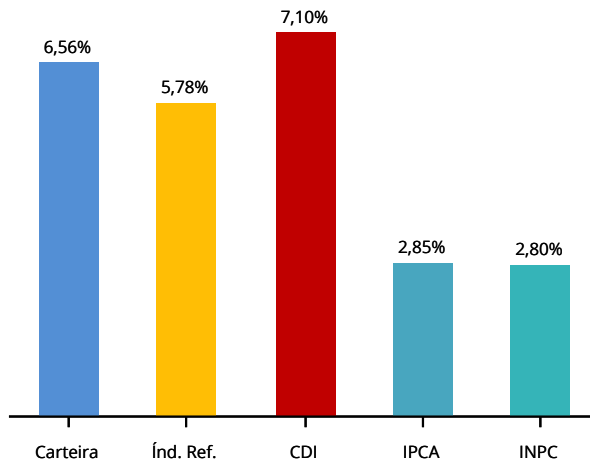
Início Período Considerado	6-ago-08	
	12 meses	Desde o Início
Melhor Mês da JUSPREV	1,69%	2,10%
Melhor Mês do INPC + 4,35%	1,13%	2,09%
Melhor Mês do INPC + 6%	1,25%	2,23%
Pior Mês da JUSPREV	0,29%	-3,41%
Pior Mês do INPC + 4,35%	0,23%	-0,25%
Pior Mês do INPC + 6%	0,37%	-0,12%
% de meses acima de INPC + 4,35%	61,54%	40,63%
% de meses acima de INPC + 6%	61,54%	35,94%
% de meses acima de CDI	23,08%	38,02%

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: No panorama global, o movimento dos mercados foi praticamente afetado pelos desdobramentos nos EUA. O país apresentou indicadores mais fracos do emprego que fizeram o mercado aumentar as chances de uma recessão. Essa dinâmica teve como consequência um movimento de aversão ao risco e provocou um fechamento da curva de juros. Todavia, as revisões no PIB e o crescimento forte do varejo mostraram que a economia segue resiliente. Nesse sentido, a desaceleração no mercado de trabalho passou a ser interpretada como uma moderação “saudável” e afastou os temores de uma recessão. O alívio no mercado de trabalho e a inflação em linha com o esperado permitiram o presidente do FED a deixar claro que o início do ciclo de cortes está próximo.

Economia Brasileira: O principal destaque foi a condução da política monetária. A ata da última reunião do Copom e, principalmente, a comunicação em tom exacerbado dos diretores da autarquia fizeram com que o mercado aumentasse a probabilidade de uma trajetória de forte alta da Selic. Aliado a isso, um IPCA não tão bom, as expectativas de inflação desancoradas e o câmbio estacionado em um patamar incômodo reforçaram as apostas de um ciclo de alta da Selic. Da nossa parte, seguimos esperando manutenção dos juros no patamar atual até o fim do ano. Encontramos valor em manter as taxas estáveis, dado que já estão restritivas. Por fim, também houve a indicação de Gabriel Galpôlo à presidência do BC.

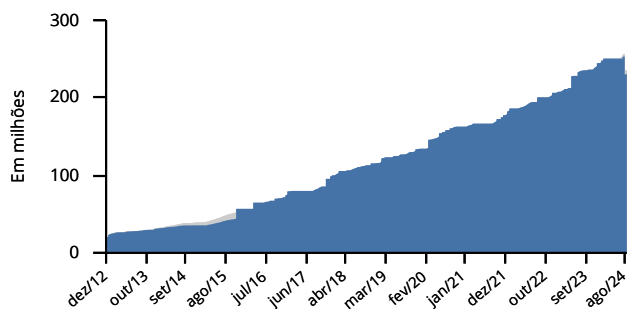
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



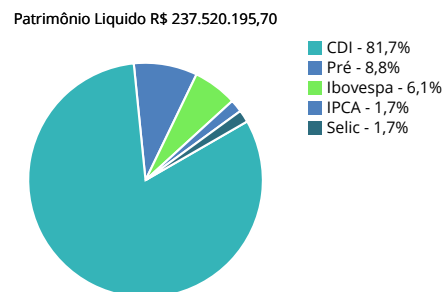
Mês	Set-23	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24	Fev-24	Mar-24	Abr-24	Mai-24	Jun-24	Jul-24	Ago-24	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev Ativo	0,52	0,18	1,97	1,72	0,67	0,82	0,71	0,54	0,58	0,93	1,24	0,89	6,56	11,31	21,42
Índ. Ref.	0,45	0,48	0,44	0,89	0,94	1,13	0,53	0,74	0,82	0,59	0,65	0,23	5,78	8,18	17,34
CDI	0,97	1,00	0,92	0,90	0,97	0,80	0,83	0,89	0,83	0,79	0,91	0,87	7,10	11,21	26,28
IPCA	0,26	0,24	0,28	0,56	0,42	0,83	0,16	0,38	0,46	0,21	0,38	(0,02)	2,85	4,24	9,04

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

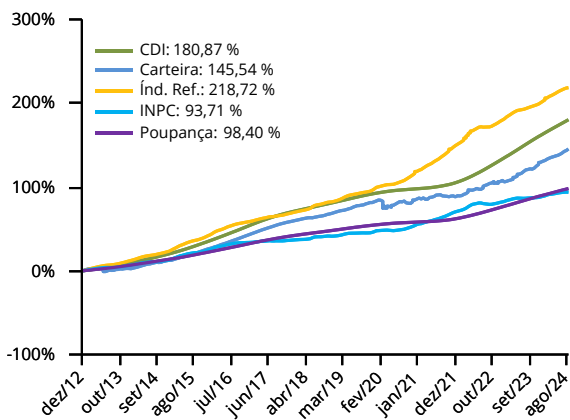
EVOLUÇÃO PATRIMONIAL



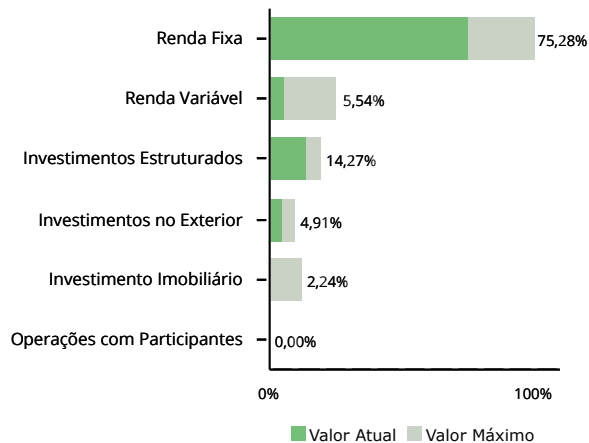
DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





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

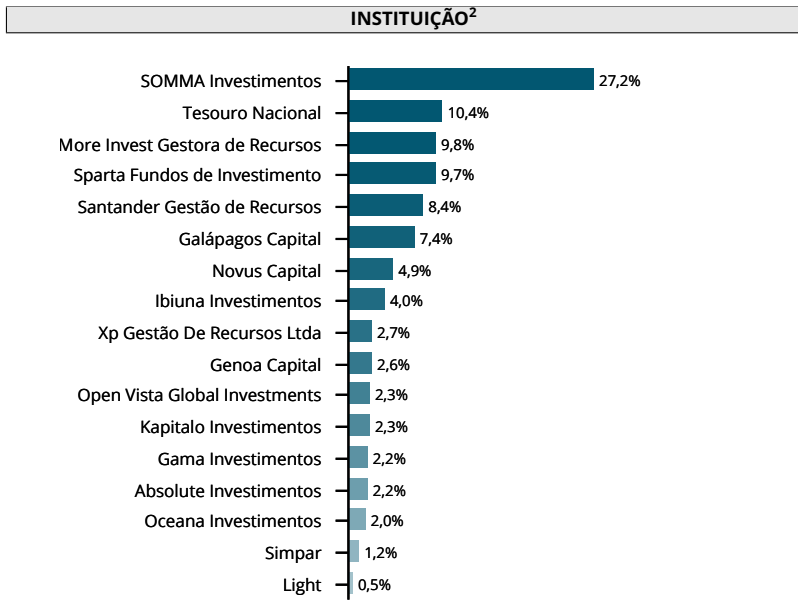
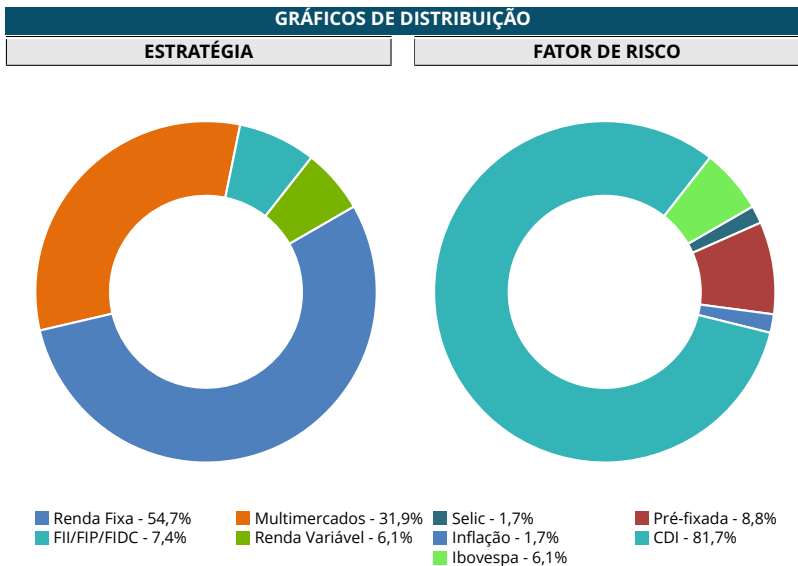


RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

Carteira Consolidada	3
Carteira Detalhada	5
Política de Investimento	6
Análise de Rentabilidade.....	7
Retorno da Carteira (R\$)	8
Rentabilidade da Carteira (%).....	10
Relatório de Movimentações	11

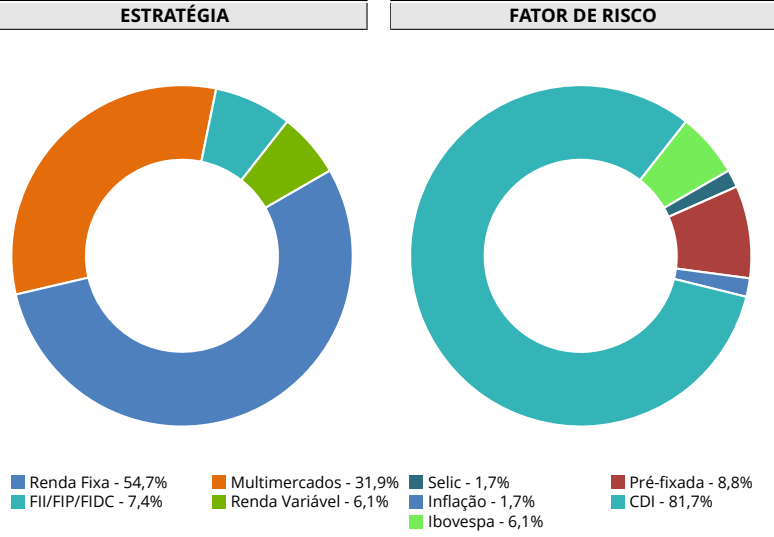


ATIVOS	AGOSTO-24	%	JULHO-24	%
RENDA FIXA	28.967.470,04	12,2%	83.318.712,69	32,5%
CDB - Banco BR Partners	-	0,0%	1.047.162,28	0,4%
Compromissada - Titulos Públicos	20.799.733,78	8,8%	24.426.351,21	9,5%
Debênture - JSL (JSMLB5)	2.866.942,36	1,2%	2.843.708,53	1,1%
Debênture - Light (LIGHD7)	1.289.340,00	0,5%	1.324.575,00	0,5%
Letra Financeira - Banco ABC	-	0,0%	2.112.734,87	0,8%
Letra Financeira - Banco Bradesco	-	0,0%	3.863.664,94	1,5%
Letra Financeira - Banco CNH	-	0,0%	492.669,79	0,2%
Letra Financeira - Banco Industrial	-	0,0%	1.972.383,11	0,8%
Letra Financeira - Banco NBC	-	0,0%	1.049.849,26	0,4%
Letra Financeira - Banco Panamericano	-	0,0%	2.114.187,52	0,8%
Letra Financeira - Banco Rodobens	-	0,0%	507.844,11	0,2%
Letra Financeira - Banco Sicredi	-	0,0%	1.038.852,96	0,4%
Letra Financeira - Banco XP	-	0,0%	2.352.306,30	0,9%
Letra Financeira - BTG Pactual	-	0,0%	4.515.915,79	1,8%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	-	0,0%	1.950.983,43	0,8%
Letra Financeira - Nubank	-	0,0%	2.120.128,06	0,8%
Letra Financeira - Paraná Banco	-	0,0%	2.078.927,63	0,8%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	4.011.453,90	1,7%	21.892.295,08	8,5%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	-	0,0%	5.614.172,82	2,2%
FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555	191.095.420,35	80,5%	173.263.288,90	67,6%
Absolute Vertex II FIC FIM	5.205.869,58	2,2%	3.543.533,49	1,4%
Galápagos Albatroz FI RF LP	-	0,0%	2.294.851,75	0,9%
Galápagos Dragon FIC FIM CP	-	0,0%	2.306.704,07	0,9%
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	6.251.131,01	2,6%	6.198.281,96	2,4%
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	4.790.271,32	2,0%	4.756.277,15	1,9%
IBIUNA LS FP FICM	4.787.536,21	2,0%	4.849.452,81	1,9%
Kapitalo K10 FIC FIM	5.447.807,11	2,3%	5.433.710,06	2,1%
MCA Institucional FIC FIM CP	23.173.580,90	9,8%	25.611.691,27	10,0%
Novus Institucional FI RF LP	11.722.971,45	4,9%	10.290.733,01	4,0%
OAKTREE Global Credit IE FIM	5.277.694,61	2,2%	5.203.327,54	2,0%
Oceana Valor 30 FIC FIA	4.762.728,12	2,0%	4.550.500,00	1,8%
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	5.579.237,93	2,3%	5.485.616,73	2,1%
Santander Bancos RF CP	20.031.394,52	8,4%	-	0,0%
SOMMA Firenze RF CP	23.089.537,01	9,7%	22.846.692,54	8,9%
SOMMA Fundamental FIA	3.280.948,50	1,4%	3.113.559,08	1,2%
SOMMA Institucional FIM	7.540.360,26	3,2%	7.479.093,58	2,9%
SOMMA Positano FIC FIM CP	2.116.812,18	0,9%	2.094.403,17	0,8%
SOMMA Real Estate FIC FIM	5.512.471,41	2,3%	5.513.969,83	2,2%
SOMMA Torino RF CP	23.075.576,91	9,7%	22.839.089,20	8,9%
Sparta Top Renda Fixa FICFI	23.053.979,62	9,7%	22.806.277,93	8,9%
XP Investor FIA	6.395.511,70	2,7%	6.045.523,73	2,4%
OUTROS FUNDOS DE INVESTIMENTO (FII/FIP/FIDC)	17.522.099,71	7,4%	-	0,0%

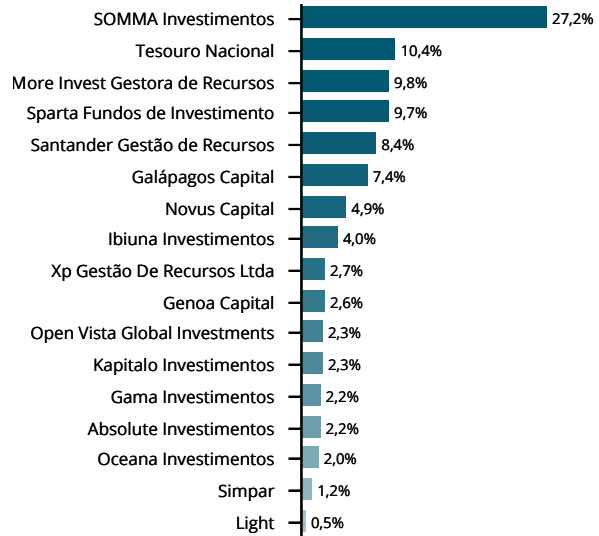


ATIVOS	AGOSTO-24	%	JULHO-24	%
Galapagos Sea Lion FIC FIDC	17.522.099,71	7,4%	-	0,0%
DERIVATIVOS	(12.309.966,36)	-5,2%	(13.760.410,20)	-5,4%
Futuros WIN ¹	(14.310.475,20)	-6,0%	(13.760.410,20)	-5,4%
Futuros WSP ¹	2.000.508,84	0,8%	-	0,0%
TESOURARIA	(64.794,40)	0,0%	(189.050,68)	-0,1%
Caixa	1.000,00	0,0%	1.000,00	0,0%
Valores a Pagar/Receber	(65.794,40)	0,0%	(190.050,68)	-0,1%
TOTAL DA CARTEIRA	237.520.195,70	100%	256.392.950,91	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	30/08/2024	02/09/2024	10,37% a.a.	20.799.733,78	20.799.733,78	-	20.799.733,78	8,76%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	18/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,42%	-	254.316,04	-	254.316,04	0,11%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	18/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,42%	-	923.073,02	-	923.073,02	0,39%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	11/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,62%	-	1.689.553,30	-	1.689.553,30	0,71%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 4,08%	-	39.520,00	-	39.520,00	0,02%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 4,08%	-	316.160,00	-	316.160,00	0,13%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 4,08%	-	484.120,00	-	484.120,00	0,20%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	16/03/2022	15/10/2026	IPCA + 4,29%	-	449.540,00	-	449.540,00	0,19%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	19/08/2024	01/03/2026	100% Selic	2.009.733,63	2.017.154,42	-	2.017.154,42	0,85%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	19/01/2024	01/03/2028	100% Selic	(2.827.521,15)	(3.014.284,71)	-	(3.014.284,71)	-1,27%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	19/01/2024	01/03/2028	100% Selic	(2.827.521,15)	(3.014.284,71)	-	(3.014.284,71)	-1,27%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	19/01/2024	01/03/2028	100% Selic	(2.827.521,15)	(3.014.284,71)	-	(3.014.284,71)	-1,27%
TOTAL						28.967.470,04	-	28.967.470,04	12,19 %

FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555									
Nome do Fundo	Gestor	Liquidez	Quantidade de Cotas	Valor da Cota	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL		
Absolute Vertex II FIC FIM	Absolute Investimentos	D+29	1.825.676,8429957	2,8514737	-	5.205.869,58	2,19%		
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	Genoa Capital	D+31	3.888.478,5895897	1,6076033	-	6.251.131,01	2,63%		
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	Ibiuna	D+31	35.831,2085761	133,6899175	-	4.790.271,32	2,02%		
IBIUNA LS FP FIC FIM	Ibiuna	D+31	42.956,1041367	111,4518251	-	4.787.536,21	2,02%		
Kapitalo K10 FIC FIM	Kapitalo Investimentos	D+30	2.609.841,1044542	2,0874095	-	5.447.807,11	2,29%		
MCA Institucional FIC FIM CP	More Invest Gestora de Recursos	D+90	19.905.874,3649330	1,1641579	-	23.173.580,90	9,76%		
Novus Institucional FI RF LP	Novus Capital	D+4	7.930.986,1488155	1,4781228	-	11.722.971,45	4,94%		
OAKTREE Global Credit IE FIM	Gama Investimentos	D+12	3.117.553,9475597	1,6928960	-	5.277.694,61	2,22%		
Oceana Valor 30 FIC FIA	Oceana Investimentos	D+30	724.021,6332701	6,5781572	-	4.762.728,12	2,00%		
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	SOMMA Investimentos	D+6	29.043,4841458	192,0994707	-	5.579.237,93	2,35%		
Santander Bancos RF CP	Santander Gestão de Recursos	D+31	1.885.783,1141040	10,6223215	-	20.031.394,52	8,43%		
SOMMA Firenze RF CP	SOMMA Investimentos	D+32	18.290.061,9672660	1,2624089	-	23.089.537,01	9,72%		
SOMMA Fundamental FIA	SOMMA Investimentos	D+5	21.784,5419010	150,6090197	-	3.280.948,50	1,38%		
SOMMA Institucional FIM	SOMMA Investimentos	D+5	2.224.635,1217532	3,3894818	-	7.540.360,26	3,17%		
SOMMA Positano FIC FIM CP	SOMMA Investimentos	D+360	1.332,3973746	1.588,7243674	-	2.116.812,18	0,89%		
SOMMA Real Estate FIC FIM	SOMMA Investimentos	D+60	4.166,9687837	1.322,8972165	-	5.512.471,41	2,32%		
SOMMA Torino RF CP	SOMMA Investimentos	D+1	14.316.970,0474360	1,6117640	-	23.075.576,91	9,71%		
Sparta Top Renda Fixa FICFI	Sparta Fundos de Investimento	D+32	6.942.833,5257248	3,3205433	-	23.053.979,62	9,71%		
XP Investor FIA	Xp Gestão De Recursos Ltda	D+3	450.411,0523329	14,1992779	-	6.395.511,70	2,69%		
TOTAL						191.095.420,35	80,45 %		

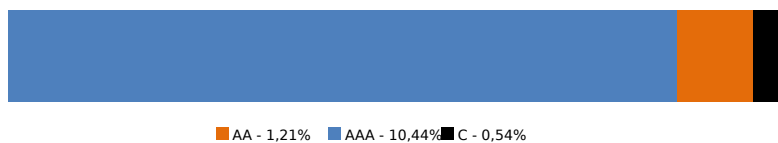
OUTROS FUNDOS DE INVESTIMENTO (FII/FIP/FIDC)									
Nome do Fundo	Gestor	Liquidez	Quantidade de Cotas	Valor da Cota	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL		
Galapagos Sea Lion FIC FIDC	Galápagos Capital	D+91	17.391.707,1290270	1,0074974	-	17.522.099,71	7,38%		
TOTAL						17.522.099,71	7,38 %		

LIMITE DE ALOCAÇÃO POR ATIVO E SEGMENTO - PI vigente para o ano			
SEGMENTO	MAXIMO	ATUAL	MARGEM
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	75,28%	24,72%
Títulos Públicos Federais	100,00%	28,45%	71,55%
CDI/CDBs	80,00%	0,66%	79,34%
Letras Financeiras de Inst. Financeira	80,00%	9,42%	70,58%
Debêntures	80,00%	17,10%	62,90%
DPGE	20,00%	0,29%	19,71%
FIDC	20,00%	19,11%	0,89%
Outros Ativos de Renda Fixa	20,00%	0,25%	19,75%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	25,00%	5,54%	19,46%
Ações de Companhias Abertas	25,00%	5,54%	19,46%
SPE	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20,00%	12,03%	7,97%
FIP - Fundo de Investimento em Participações	5,00%	0,00%	5,00%
FIM - Fundos de Investimento Multimercado	15,00%	12,03%	2,97%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	10,00%	4,91%	5,09%
FIE - Fundo de Investimento no Exterior	10,00%	4,91%	5,09%
INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	10,00%	2,24%	7,76%
CCI	10,00%	0,00%	10,00%
CRI	10,00%	0,00%	10,00%
FII - Fundo Investimento Imobiliário	10,00%	2,24%	7,76%
TOTAL EM OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0,00%	0,00%	0,00%
Operações com Participante	0,00%	0,00%	0,00%
Total		100,00%	

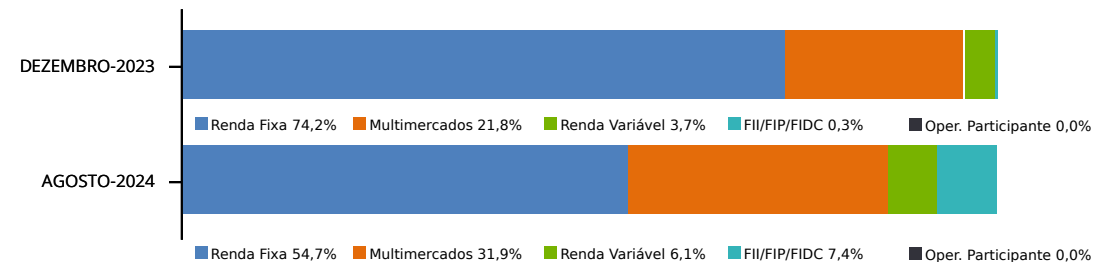
RATINGS ESCALA NACIONAL DE LONGO PRAZO ¹							
INSTITUIÇÃO/ATIVO		MÁXIMO	ATUAL	AGÊNCIAS DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO			
Segurança Máxima (AAA)		100,00%	10,44%	FITCH	MOODY'S	S&P	AUSTIN
Tesouro Nacional		100,00%	10,44%	-	-	brAAA	-
Alta Segurança (AA)		100,00%	1,21%	FITCH	MOODY'S	S&P	AUSTIN
Debênture - JSL (JSMLB5)		25,00%	1,21%	AAA(bra)	-	brAA	-
Risco Substancial (C)		0,00%	0,54%	FITCH	MOODY'S	S&P	AUSTIN
Debênture - Light (LIGHD7)		25,00%	0,54%	D(bra)	-	brD	-

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	0,87	373,1%	7,09	122,7%	-	-
Debênture - JSL (JSMLB5)	0,82	352,3%	4,76	82,4%	8,47	103,5%
Debênture - Light (LIGHD7)	-2,66	-	-19,24	-	-5,71	-
Letra Financeira do Tesouro Nacional	0,88	379,9%	-	-	-	-
Novus Institucional FI RF LP	1,23	531,7%	-	-	-	-
SOMMA Firenze RF CP	1,06	458,3%	8,53	147,6%	13,46	164,5%
SOMMA Torino RF CP	1,04	446,5%	8,38	145,0%	13,36	163,3%
Sparta Top Renda Fixa FICFI	1,09	468,3%	-	-	-	-

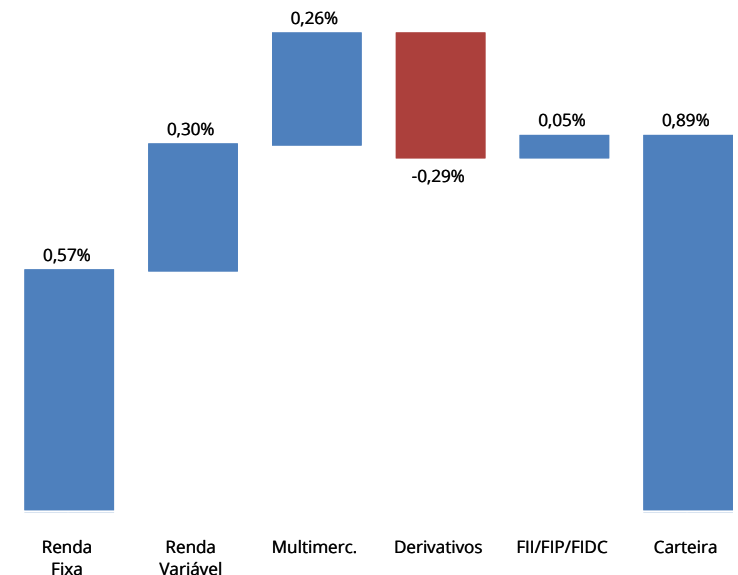
Multimercados	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
	Absolute Vertex II FIC FIM	1,21	294,5%	-	-	-
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	0,85	207,7%	-	-	-	-
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	0,71	174,1%	-1,89	-	2,55	24,5%
IBIUNA LS FP FICM	-1,28	-	2,54	35,1%	-	-
Kapitalo K10 FIC FIM	0,26	63,2%	2,99	41,3%	7,21	69,4%
MCA Institucional FIC FIM CP	1,04	252,8%	-	-	-	-
OAKTREE Global Credit IE FIM	1,43	348,2%	9,66	133,4%	16,68	160,5%
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	1,71	736,0%	26,01	450,0%	26,41	322,9%
SOMMA Institucional FIM	0,82	199,6%	1,57	21,7%	6,70	64,5%
SOMMA Positano FIC FIM CP	1,07	260,6%	9,06	125,1%	14,16	136,3%
SOMMA Real Estate FIC FIM	-0,03	-	4,18	72,3%	7,28	89,0%

Renda Variável	%	Dif. Bench	%	Dif. Bench	%	Dif. Bench
	Oceana Valor 30 FIC FIA	4,66	4,4	-1,50	-7,3	14,82
SOMMA Fundamental FIA	5,38	5,1	-6,93	-12,7	5,51	-2,7
XP Investor FIA	5,79	5,6	-	-	-	-

RENTABILIDADE INDICADORES	NO MÊS	NO ANO	EM 12 MESES
	%	%	%
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	0,23	5,78	8,18
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	0,23	5,78	8,18
Renda Variável (INPC + 4.35% a.a.)	0,23	5,78	8,18
Estruturados (INPC + 6.50% a.a.)	0,41	7,24	10,39
Op. com Participante (CDI)	0,87	7,10	11,21
CDI	0,87	7,10	11,21
IPCA	-0,02	2,85	4,24
INPC	-0,14	2,80	3,71
Ibovespa	6,54	1,36	17,51
Dólar	-0,10	16,83	14,92

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	0,93	6,83	11,06
Renda Variável	4,93	-4,92	6,42
Investimentos Estruturados	0,82	4,92	9,70
Investimentos no Exterior	0,00	0,00	0,00
Operação com participante	0,00	0,00	0,00

COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA

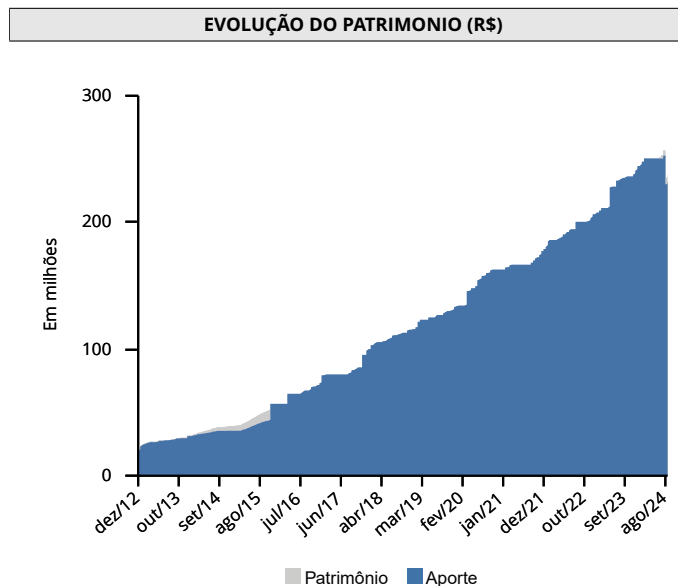
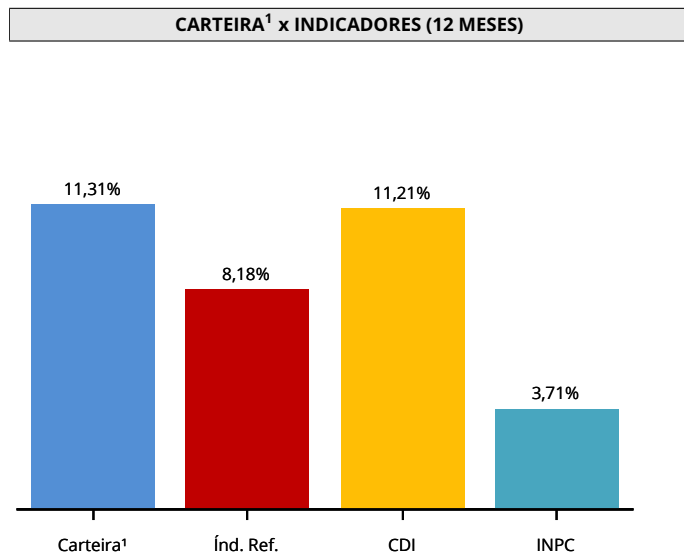
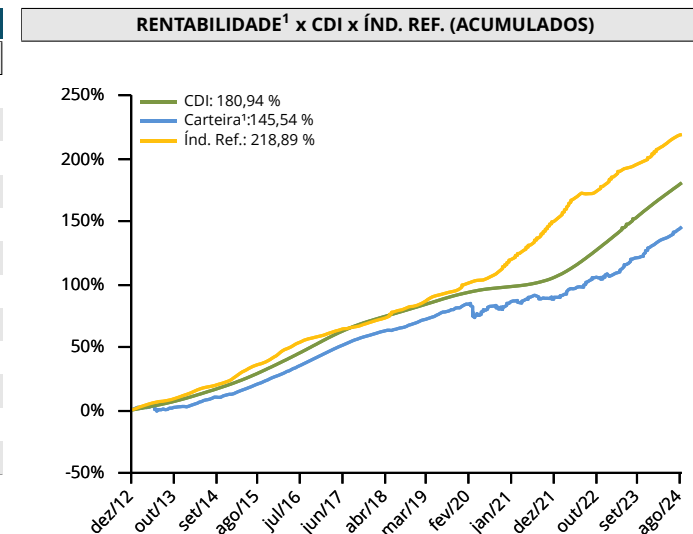


RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	1º SEM	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	NO ANO
RENDA FIXA	7.851.801,31	1.834.832,11	1.388.350,36	-	-	-	-	11.074.983,78
Augme Institucional FI RF CP	146.725,43	-	-	-	-	-	-	146.725,43
CDB - Banco BR Partners	36.351,56	10.810,72	10.805,33	-	-	-	-	57.967,61
Compromissada - Títulos Públicos	1.341.576,36	187.072,64	98.310,84	-	-	-	-	1.626.959,84
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	89.286,90	-	-	-	-	-	-	89.286,90
Debênture - Aegea Saneamento (AEGPA3)	5.347,05	-	-	-	-	-	-	5.347,05
Debênture - Assaí (ASAI14)	3.539,40	-	-	-	-	-	-	3.539,40
Debênture - CIA Siderúrgica (CSNAA1)	24.137,62	-	-	-	-	-	-	24.137,62
Debênture - CM Hospitalar (VVEO15)	2.468,99	-	-	-	-	-	-	2.468,99
Debênture - Cosan (CSAN33)	56.337,72	-	-	-	-	-	-	56.337,72
Debênture - JSL (JMLB5)	59.651,60	49.147,08	23.233,83	-	-	-	-	132.032,51
Debênture - Light (LIGHD7)	(348.110,74)	76.212,00	(35.235,00)	-	-	-	-	(307.133,74)
Debênture - Localiza (LORTA7)	51.447,14	-	-	-	-	-	-	51.447,14
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	60.867,00	-	-	-	-	-	-	60.867,00
Debênture - Qualicorp Saúde (QUAL16)	24.013,14	-	-	-	-	-	-	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)	21.245,03	-	-	-	-	-	-	21.245,03
Debênture - Vamos (VAMO34)	(2.880,59)	11.465,31	-	-	-	-	-	8.584,72
Debênture - Vix Logística (VIXL35)	6.136,89	-	-	-	-	-	-	6.136,89
Galápagos Albatroz FI RF LP	27.105,32	17.746,43	11.216,36	-	-	-	-	56.068,11
Letra Financeira - Banco ABC	87.690,98	25.043,89	17.223,85	-	-	-	-	129.958,72
Letra Financeira - Banco Bradesco	242.256,28	45.249,53	38.062,61	-	-	-	-	325.568,42
Letra Financeira - Banco CNH	18.270,75	4.742,14	4.982,69	-	-	-	-	27.995,58
Letra Financeira - Banco Industrial	64.225,90	22.730,45	20.938,75	-	-	-	-	107.895,10
Letra Financeira - Banco NBC	38.395,59	11.453,67	11.014,23	-	-	-	-	60.863,49
Letra Financeira - Banco Panamericano	88.265,19	25.922,33	19.471,65	-	-	-	-	133.659,17
Letra Financeira - Banco Rodobens	17.171,33	5.138,14	6.769,53	-	-	-	-	29.079,00
Letra Financeira - Banco Sicredi	28.435,71	10.417,25	10.100,61	-	-	-	-	48.953,57
Letra Financeira - Banco XP	105.713,26	22.612,95	23.459,25	-	-	-	-	151.785,46
Letra Financeira - BTG Pactual	310.450,68	119.734,03	50.048,62	-	-	-	-	480.233,33
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	121.705,27	38.226,58	16.592,43	-	-	-	-	176.524,28
Letra Financeira - Nubank	99.602,01	20.526,05	20.884,40	-	-	-	-	141.012,46
Letra Financeira - Paraná Banco	58.211,11	20.716,52	26.263,52	-	-	-	-	105.191,15
Letra Financeira do Tesouro Nacional	1.341.747,56	206.891,64	95.004,31	-	-	-	-	1.643.643,51
Notas do Tesouro Nacional - Série B	490.001,80	55.321,26	28.535,72	-	-	-	-	573.858,78
Novus Institucional FI RF LP	203.617,84	87.115,17	132.238,44	-	-	-	-	422.971,45
Santander Bancos RF CP	-	-	31.394,52	-	-	-	-	31.394,52
SOMMA Firenze RF CP	1.731.097,21	233.514,71	242.844,47	-	-	-	-	2.207.456,39
SOMMA Torino RF CP	1.108.265,40	248.098,77	236.487,71	-	-	-	-	1.592.851,88
Sparta Top Renda Fixa FICFI	27.355,08	278.922,85	247.701,69	-	-	-	-	553.979,62
Valora Horizon HY FIM CP	46.017,17	-	-	-	-	-	-	46.017,17
RENDA VARIÁVEL	(1.120.424,85)	502.194,26	729.605,51	-	-	-	-	111.374,92
Ibiúna Equities 30 FIC FIA	(70.009,91)	-	-	-	-	-	-	(70.009,91)
Oceana Valor 30 FIC FIA	(296.843,86)	114.761,70	212.228,12	-	-	-	-	30.145,96

RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	1º SEM	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	NO ANO
SOMMA Fundamental FIA	(501.861,40)	90.199,15	167.389,42	-	-	-	-	(244.272,83)
XP Investor FIA	(251.709,68)	297.233,41	349.987,97	-	-	-	-	395.511,70
MULTIMERCADOS	2.366.922,14	1.114.023,20	635.078,71	-	-	-	-	4.116.024,05
Absolute Vertex II FIC FIM	-	43.533,49	62.336,09	-	-	-	-	105.869,58
Galápagos Dragon FIC FIM CP	141.230,69	28.319,29	21.663,78	-	-	-	-	191.213,76
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	175.055,38	23.226,58	52.849,05	-	-	-	-	251.131,01
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	(150.657,17)	24.488,97	33.994,17	-	-	-	-	(92.174,03)
IBIUNA LS FP FICM	(177.477,33)	357.963,68	(61.916,60)	-	-	-	-	118.569,75
Kapitalo K10 FIC FIM	81.144,92	62.686,82	14.097,05	-	-	-	-	157.928,79
KP Crédito Privado FIC FIM	53.028,07	-	-	-	-	-	-	53.028,07
MCA Institucional FIC FIM CP	840.150,70	277.540,57	261.889,63	-	-	-	-	1.379.580,90
OAKTREE Global Credit IE FIM	293.968,19	96.407,86	74.367,07	-	-	-	-	464.743,12
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	714.449,61	104.969,09	93.621,20	-	-	-	-	913.039,90
SOMMA Institucional FIM	7.707,74	48.770,90	61.266,68	-	-	-	-	117.745,32
SOMMA Positano FIC FIM CP	127.158,21	26.269,82	22.409,01	-	-	-	-	175.837,04
SOMMA Real Estate FIC FIM	194.764,49	27.944,34	(1.498,42)	-	-	-	-	221.210,41
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	94.433,71	(8.098,21)	-	-	-	-	-	86.335,50
Vista Hedge Institucional FIC FIM	(28.035,07)	-	-	-	-	-	-	(28.035,07)
FII/FIP/FIDC	126.034,32	-	122.099,71	-	-	-	-	248.134,03
FIDC Credz Sênior 8	126.034,32	-	-	-	-	-	-	126.034,32
Galapagos Sea Lion FIC FIDC	-	-	122.099,71	-	-	-	-	122.099,71
DERIVATIVOS	1.379.122,42	(298.295,14)	(697.850,63)	-	-	-	-	382.976,65
Futuros DAP	730.929,69	(82.128,12)	-	-	-	-	-	648.801,57
Futuros WDO	(5.765,40)	29.315,40	(42.860,00)	-	-	-	-	(19.310,00)
Futuros WIN	660.794,23	(271.840,80)	(750.580,00)	-	-	-	-	(361.626,57)
Futuros WSP	(6.836,10)	26.358,38	95.589,37	-	-	-	-	115.111,65
TOTAL	10.603.455,34	3.152.754,43	2.177.283,66	-	-	-	-	15.933.493,43

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%
Mai	0,58	0,82	70,67%
Junho	0,93	0,59	157,85%
Julho	1,24	0,65	190,85%
Agosto	0,89	0,23	381,74%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Total	6,56	5,78	113,50%

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
0,83	0,46	0,46	(3,04)	1,35
0,79	0,21	0,25	1,48	6,05
0,91	0,38	0,26	3,02	1,86
0,87	(0,02)	(0,14)	6,54	(0,10)
7,10	2,85	2,80	1,36	16,83



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%
Mai	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
05/08/2024	15.400.000,00	Aplicação	Galapagos Sea Lion FIC FIDC
06/08/2024	1.600.000,00	Aplicação	Absolute Vertex II FIC FIM
13/08/2024	-19.985.579,12	Venda	Letra Financeira do Tesouro Nacional
14/08/2024	-2.306.068,11	Resgate	Galápagos Albatroz FI RF LP
15/08/2024	-5.642.708,54	Resgate	Notas do Tesouro Nacional - Série B
19/08/2024	2.009.733,63	Compra	Letra Financeira do Tesouro Nacional
19/08/2024	-345.505,95	Vencimento	Letra Financeira - BTG Pactual
20/08/2024	1.300.000,00	Aplicação	Novus Institucional FI RF LP
20/08/2024	2.000.000,00	Aplicação	Galapagos Sea Lion FIC FIDC
26/08/2024	-2.090.645,65	Venda	Letra Financeira - BTG Pactual
26/08/2024	-3.901.727,55	Venda	Letra Financeira - Banco Bradesco
26/08/2024	-2.141.012,46	Venda	Letra Financeira - Nubank
26/08/2024	-1.993.321,86	Venda	Letra Financeira - Banco Industrial
26/08/2024	-497.652,48	Venda	Letra Financeira - Banco CNH
26/08/2024	-1.048.953,57	Venda	Letra Financeira - Banco Sicredi
26/08/2024	-514.613,64	Venda	Letra Financeira - Banco Rodobens
26/08/2024	-2.129.958,72	Venda	Letra Financeira - Banco ABC
26/08/2024	-1.057.967,61	Venda	CDB - Banco BR Partners
27/08/2024	-2.105.191,15	Venda	Letra Financeira - Paraná Banco
27/08/2024	-2.700.000,00	Resgate	MCA Institucional FIC FIM CP
27/08/2024	20.000.000,00	Aplicação	Santander Bancos RF CP
28/08/2024	-1.967.575,86	Venda	Letra Financeira - Caixa Econômica Federal
28/08/2024	-2.133.659,17	Venda	Letra Financeira - Banco Panamericano
28/08/2024	-2.129.812,81	Venda	Letra Financeira - BTG Pactual
28/08/2024	-2.328.367,85	Resgate	Galápagos Dragon FIC FIM CP
30/08/2024	-2.375.765,55	Venda	Letra Financeira - Banco XP
30/08/2024	-1.060.863,49	Venda	Letra Financeira - Banco NBC

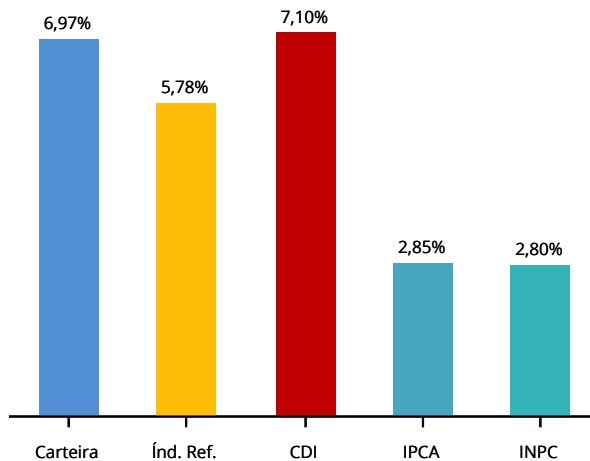
RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: No panorama global, o movimento dos mercados foi praticamente afetado pelos desdobramentos nos EUA. O país apresentou indicadores mais fracos do emprego que fizeram o mercado aumentar as chances de uma recessão. Essa dinâmica teve como consequência um movimento de aversão ao risco e provocou um fechamento da curva de juros. Todavia, as revisões no PIB e o crescimento forte do varejo mostraram que a economia segue resiliente. Nesse sentido, a desaceleração no mercado de trabalho passou a ser interpretada como uma moderação “saudável” e afastou os temores de uma recessão. O alívio no mercado de trabalho e a inflação em linha com o esperado permitiram o presidente do FED a deixar claro que o início do ciclo de cortes está próximo.

Economia Brasileira: O principal destaque foi a condução da política monetária. A ata da última reunião do Copom e, principalmente, a comunicação em tom exacerbado dos diretores da autarquia fizeram com que o mercado aumentasse a probabilidade de uma trajetória de forte alta da Selic. Aliado a isso, um IPCA não tão bom, as expectativas de inflação desancoradas e o câmbio estacionado em um patamar incômodo reforçaram as apostas de um ciclo de alta da Selic. Da nossa parte, seguimos esperando manutenção dos juros no patamar atual até o fim do ano. Encontramos valor em manter as taxas estáveis, dado que já estão restritivas. Por fim, também houve a indicação de Gabriel Galpôlo à presidência do BC.

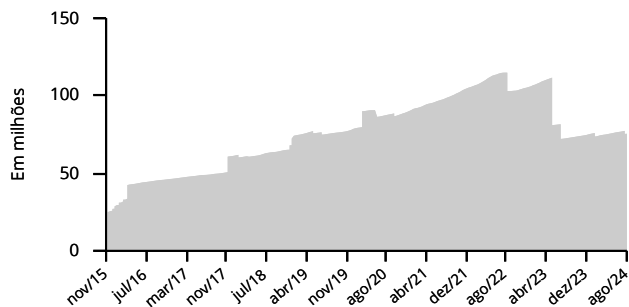
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



Mês	Set-23	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24	Fev-24	Mar-24	Abr-24	Mai-24	Jun-24	Jul-24	Ago-24	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev ALM CP	0,68	0,69	0,67	0,86	1,01	0,98	0,98	0,70	0,85	0,81	0,75	0,68	6,97	10,11	21,60
Índ. Ref.	0,45	0,48	0,44	0,89	0,94	1,13	0,53	0,74	0,82	0,59	0,65	0,23	5,78	8,18	17,45
CDI	0,97	1,00	0,92	0,90	0,97	0,80	0,83	0,89	0,83	0,79	0,91	0,87	7,10	11,21	26,28
IPCA	0,26	0,24	0,28	0,56	0,42	0,83	0,16	0,38	0,46	0,21	0,38	(0,02)	2,85	4,24	9,04

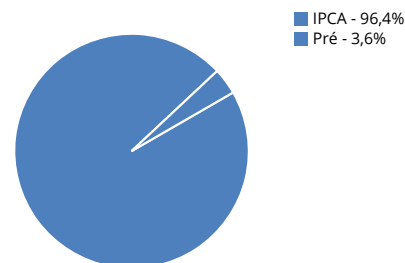
Índice de Referência INPC + 4.35% a.a.

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

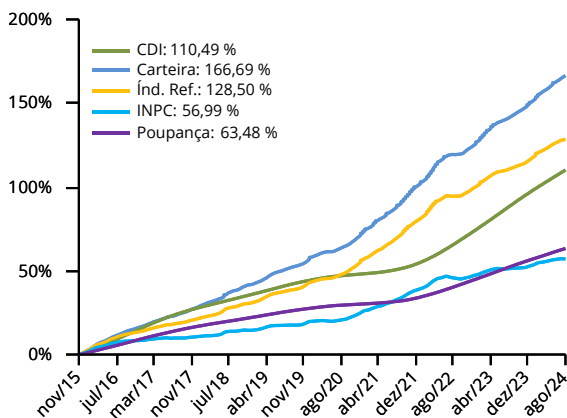


DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO

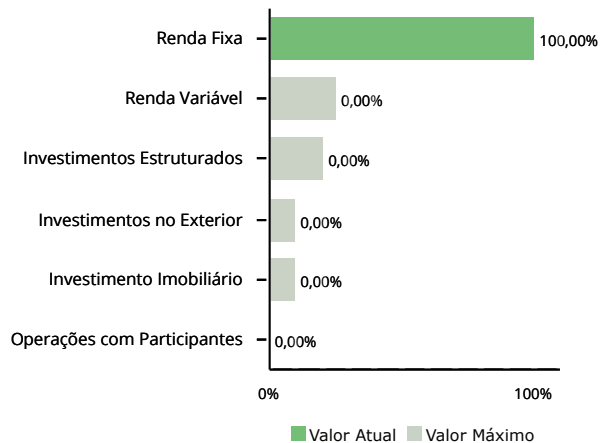
Patrimônio Líquido R\$ 75.568.332,18



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





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

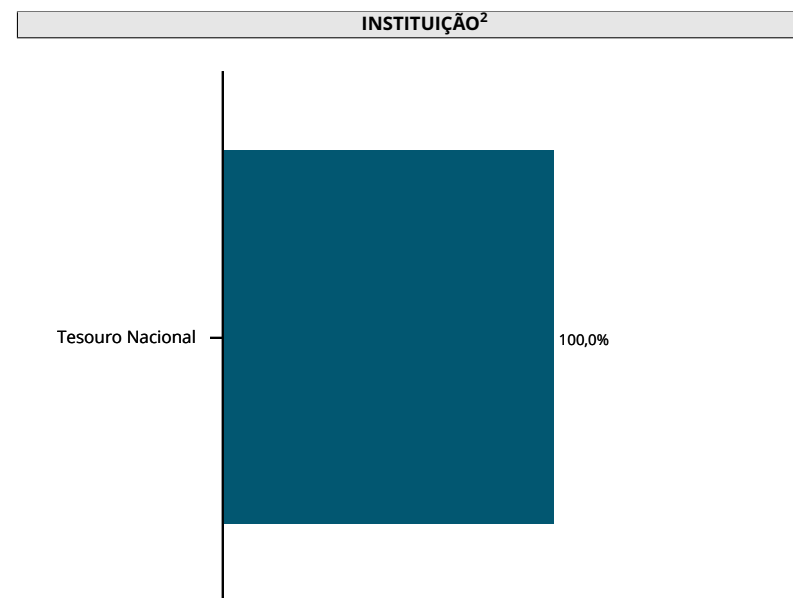
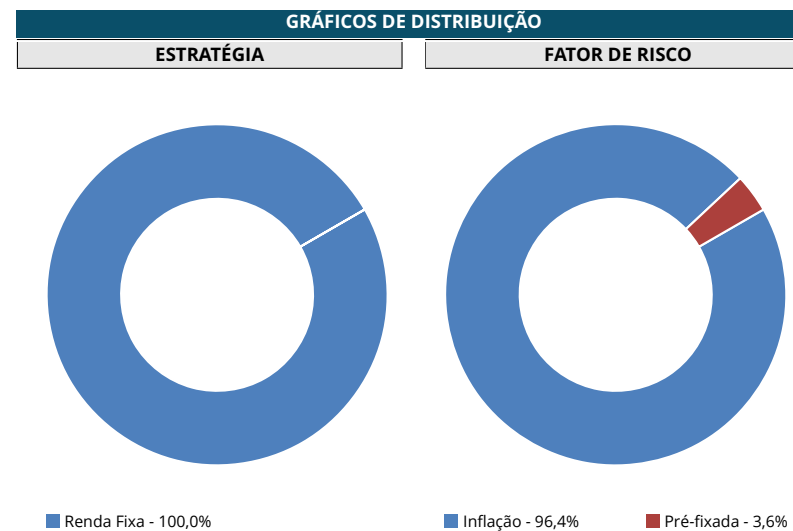


RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

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	AGOSTO-24	%	JULHO-24	%
RENDA FIXA	75.577.241,11	100,0%	77.055.377,07	100,0%
Compromissada - Títulos Públicos	2.749.338,35	3,6%	2.357.991,00	3,1%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	72.827.902,76	96,4%	74.697.386,07	96,9%
TESOURARIA	(8.908,92)	0,0%	(7.734,59)	0,0%
Caixa	1.000,00	0,0%	1.000,00	0,0%
Valores a Pagar/Receber	(9.908,92)	0,0%	(8.734,59)	0,0%
TOTAL DA CARTEIRA	75.568.332,19	100%	77.047.642,48	100%



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

²Não estão inclusas ações e opções

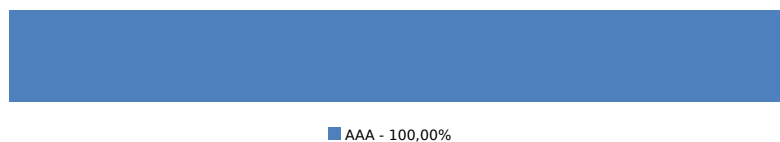
RENDA FIXA									
Ativo - Emissor	Marcação	Data Aplicação	Data Vencimento	Indexador	Valor Aplicado	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
Compromissada - Títulos Públicos	Mercado	30/08/2024	02/09/2024	10,37% a.a.	2.749.338,35	2.749.338,35	-	2.749.338,35	3,64%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/11/2017	15/05/2035	IPCA + 5,29%	9.842.760,14	13.931.981,68	-	13.931.981,68	18,44%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,45%	860.308,17	1.425.719,74	-	1.425.719,74	1,89%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/01/2019	15/05/2045	IPCA + 4,63%	1.922.501,16	2.587.477,29	-	2.587.477,29	3,42%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	02/01/2019	15/05/2045	IPCA + 4,99%	2.093.975,28	2.843.765,45	-	2.843.765,45	3,76%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	24/12/2018	15/05/2045	IPCA + 5,03%	1.340.943,59	1.824.824,11	-	1.824.824,11	2,41%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,29%	73.843,71	114.973,43	-	114.973,43	0,15%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	31/05/2017	15/08/2026	IPCA + 5,65%	1.493.159,87	2.081.400,29	-	2.081.400,29	2,75%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/11/2015	15/05/2035	IPCA + 7,01%	5.062.404,62	8.177.103,63	-	8.177.103,63	10,82%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,35%	121.192,13	199.474,25	-	199.474,25	0,26%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	13/01/2016	15/05/2035	IPCA + 7,35%	549.253,50	897.472,16	-	897.472,16	1,19%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	16/03/2016	15/08/2050	IPCA + 6,83%	1.153.894,05	1.765.035,32	-	1.765.035,32	2,34%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	14/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,32%	241.312,77	399.771,29	-	399.771,29	0,53%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/03/2016	15/05/2055	IPCA + 6,39%	4.095.944,22	6.203.831,69	-	6.203.831,69	8,21%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	28/08/2020	15/08/2050	IPCA + 4,01%	1.114.803,90	1.424.333,20	-	1.424.333,20	1,88%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/08/2020	15/08/2050	IPCA + 3,91%	1.130.879,32	1.445.071,73	-	1.445.071,73	1,91%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/01/2019	15/08/2050	IPCA + 4,61%	2.378.295,32	3.139.404,02	-	3.139.404,02	4,15%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,29%	1.058.426,68	1.647.952,79	-	1.647.952,79	2,18%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	30/12/2015	15/05/2045	IPCA + 7,33%	947.095,85	1.526.227,24	-	1.526.227,24	2,02%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	19/06/2018	15/05/2055	IPCA + 5,92%	1.261.769,06	1.783.246,17	-	1.783.246,17	2,36%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	22/08/2018	15/08/2030	IPCA + 5,65%	2.048.893,74	2.790.291,09	-	2.790.291,09	3,69%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,55%	474.768,52	786.314,43	-	786.314,43	1,04%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/02/2016	15/05/2035	IPCA + 7,41%	1.703.916,03	2.740.557,26	-	2.740.557,26	3,63%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	16/03/2020	15/08/2050	IPCA + 4,46%	10.007.893,59	12.823.403,13	-	12.823.403,13	16,97%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,29%	172.302,01	268.271,37	-	268.271,37	0,36%
TOTAL						75.577.241,11	-	75.577.241,11	100,01 %

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%	

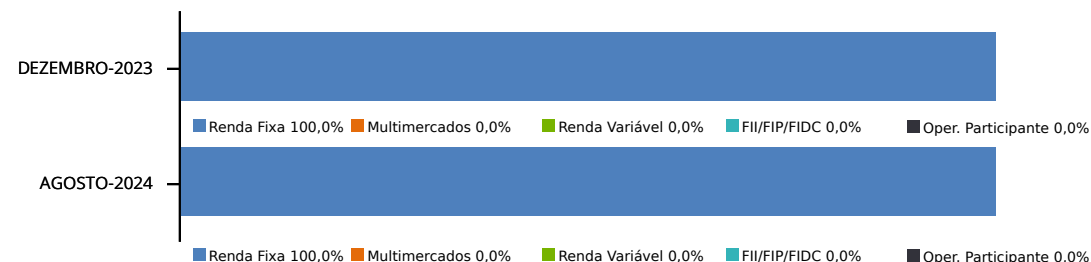
RATINGS ESCALA NACIONAL DE LONGO PRAZO ¹			
INSTITUIÇÃO/ATIVO	MÁXIMO	ATUAL	AGÊNCIAS DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO
Segurança Máxima (AAA)	100,00%	100,00%	FITCH MOODY'S S&P AUSTIN
Tesouro Nacional	100,00%	100,00%	- - brAAA -

LEGENDA
Nota elevada
Nota rebaixada

RATING DOS ATIVOS



MUTAÇÃO DE INVESTIMENTOS



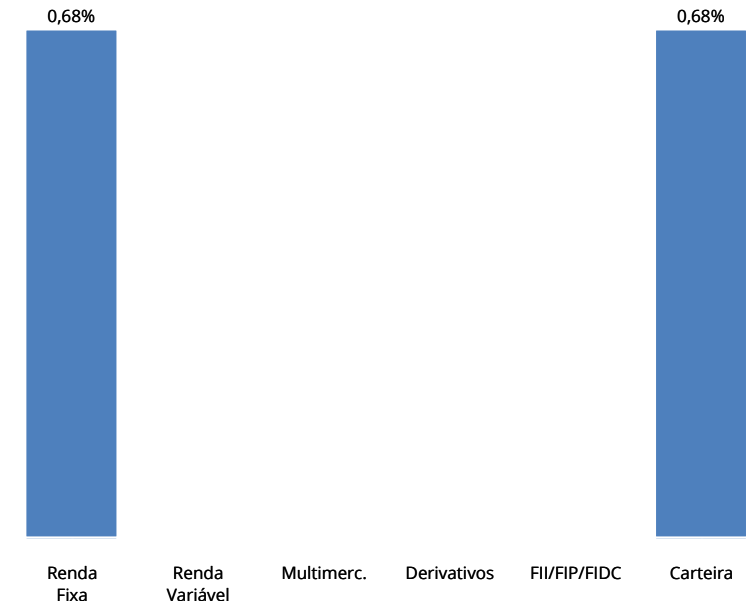
¹Engloba Tesouro Nacional, Bancos, FIDCs e Debêntures

RENTABILIDADE	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES	
	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Renda Fixa						
Compromissada - Títulos Públicos	0,87	373,1%	7,09	122,7%	11,20	136,9%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	0,69	297,2%	7,08	122,5%	10,25	125,3%

RENTABILIDADE INDICADORES	NO MÊS %	NO ANO %	EM 12 MESES %
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	0,23	5,78	8,18
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	0,23	5,78	8,18
Op. com Participante (0% CDI)	0,00	0,00	0,00
CDI	0,87	7,10	11,21
IPCA	-0,02	2,85	4,24
INPC	-0,14	2,80	3,71
Ibovespa	6,54	1,36	17,51
Dólar	-0,10	16,83	14,92

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	0,69	6,99	10,15
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

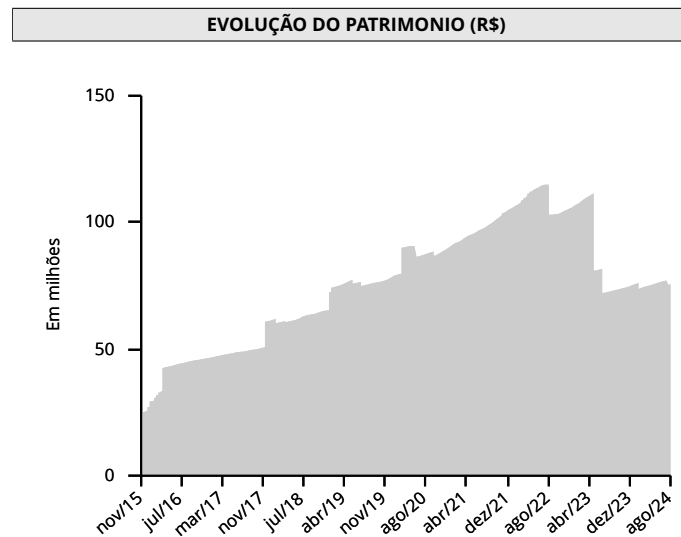
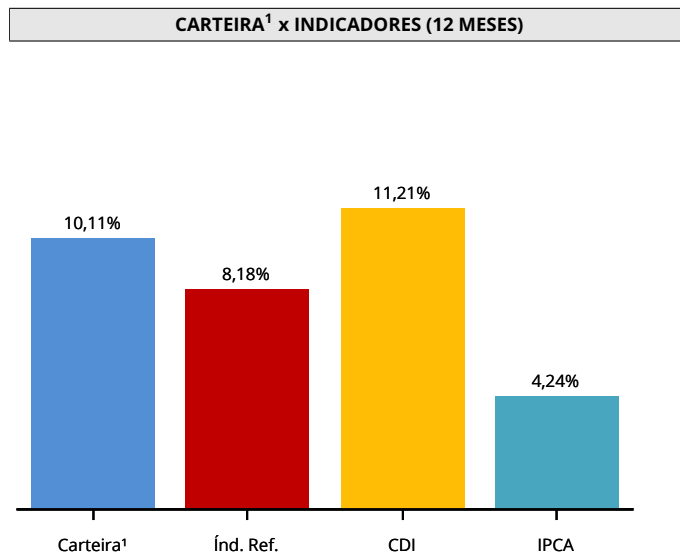
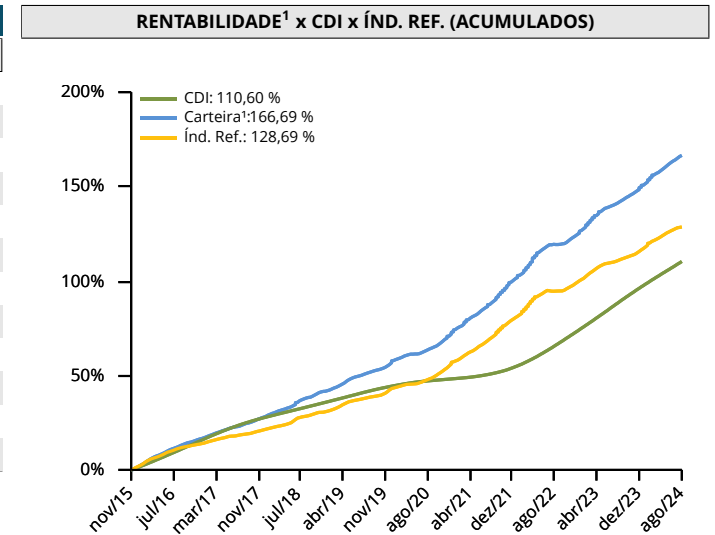
COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA



RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	1º SEM	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	NO ANO
RENDA FIXA	4.052.340,59	584.150,74	530.978,43	-	-	-	-	5.167.469,76
Compromissada - Títulos Públicos	95.342,76	21.203,86	21.983,52	-	-	-	-	138.530,14
Notas do Tesouro Nacional - Série B	3.956.997,83	562.946,88	508.994,91	-	-	-	-	5.028.939,62
TOTAL	4.052.340,59	584.150,74	530.978,43	-	-	-	-	5.167.469,76

RESULTADOS DE 2024			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	1,01	0,94	106,57%
Fevereiro	0,98	1,13	86,76%
Março	0,98	0,53	184,39%
Abril	0,70	0,74	94,68%
Mai	0,85	0,82	104,36%
Junho	0,81	0,59	137,22%
Julho	0,75	0,65	115,30%
Agosto	0,68	0,23	294,60%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Total	6,97	5,78	120,58%

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
0,83	0,46	0,46	(3,04)	1,35
0,79	0,21	0,25	1,48	6,05
0,91	0,38	0,26	3,02	1,86
0,87	(0,02)	(0,14)	6,54	(0,10)
7,10	2,85	2,80	1,36	16,83



RESULTADOS DE 2023			
Mês	Carteira ¹	Índ. Ref.	% do Índ.
Janeiro	1,20	0,83	144,42%
Fevereiro	1,00	1,08	92,83%
Março	1,46	1,03	141,72%
Abril	0,93	0,84	110,81%
Mai	1,03	0,73	140,24%
Junho	0,50	0,26	195,38%
Julho	0,48	0,27	180,58%
Agosto	0,72	0,59	121,37%
Setembro	0,68	0,45	150,75%
Outubro	0,69	0,48	145,45%
Novembro	0,67	0,44	152,79%
Dezembro	0,86	0,89	96,92%
Total	10,71	8,16	131,14%

¹A rentabilidade da carteira é baseado na cota Bruta

RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO
15/08/2024	-645.677,99	Juros	Notas do Tesouro Nacional - Série B
15/08/2024	-1.732.800,23	Resgate	Notas do Tesouro Nacional - Série B

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%

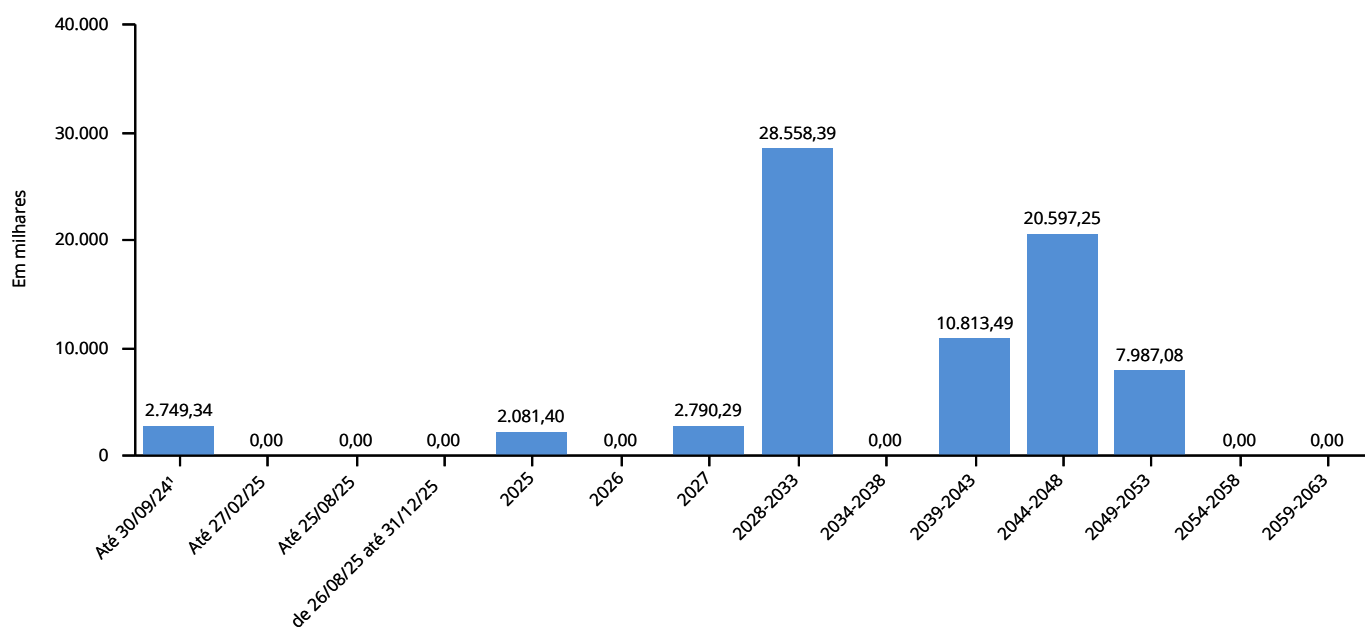
2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,30%	0,76%	1,67%	0,94%	0,98%	1,20%	1,15%	1,30%	1,58%	1,43%	1,63%	1,28%	16,33%
Rent. Líquida	1,30%	0,76%	1,67%	0,94%	0,98%	1,20%	1,15%	1,30%	1,58%	1,43%	1,63%	1,28%	16,33%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,30%	0,36%	0,42%	0,44%	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%	0,85%	0,81%	0,75%	0,68%					6,97%
Rent. Líquida	1,01%	0,98%	0,98%	0,70%	0,85%	0,81%	0,75%	0,68%					6,97%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%					7,10%
Índice Ref.	0,94%	1,13%	0,53%	0,74%	0,82%	0,59%	0,65%	0,23%					5,78%

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

Agosto 2024

Cenário

A comunicação é um dos principais instrumentos de política monetária. Por meio dela, bancos centrais passam mensagens capazes de afetar as expectativas de mercado e, por consequência, as condições financeiras, com o objetivo de cumprir as metas que perseguem. O uso de expressões específicas é uma das principais formas que os BCs têm de revelar ao público suas visões sobre o cenário e sobre a condução futura da política monetária. Graduações, inclusões e exclusões dessas expressões evidenciam mudanças ou progressos.

Em 2022 e 2023, a expressão mais importante utilizada pelo presidente do Fed no simpósio de Jackson Hole foi “We will keep at it until the job is done” (Tradução livre: Continuaremos assim até que o trabalho esteja concluído). A expressão faz alusão ao título da bibliografia “Keeping at it” do banqueiro central responsável por controlar o episódio inflacionário da década de 70 nos EUA, Paul Volcker. A ausência dessa expressão no discurso feito por Powell em agosto evidencia a proximidade de se cumprir a meta de inflação. E a presença da expressão “We will do everything we can to support a strong labor market” (Tradução livre: Faremos tudo o que pudermos para apoiar um mercado de trabalho forte) revela como o foco da autoridade monetária mudou para o mandato de máximo emprego.

A principal diferença do processo de desinflação atual para o da década de 70/80 nos EUA é que, ao menos até agora, o custo em termos de piora na atividade econômica tem sido nulo. O Fed deve iniciar o ciclo de cortes em setembro diante de uma economia pujante. A queda de juros tem como objetivo reduzir o grau de restrição da política monetária, a fim de manter o ritmo de crescimento e um forte mercado de trabalho. O possível êxito do Fed pode contribuir com ventos externos favoráveis para as economias emergentes.

O cenário externo mais benigno foi positivo para o comportamento dos ativos de risco no Brasil em boa parte de agosto. Mas, nos últimos 10 dias, a piora fiscal e a atividade mais aquecida foram a faísca para o aumento das discussões sobre alta de juros pelo Banco Central, em um ambiente de projeção de inflação do BC acima da meta e expectativas desancoradas.

A dúvida é se fatores idiossincráticos irão predominar sobre o ciclo de desinflação e queda de juros global. Além disso, apesar de ainda parecer distante, os dados recentes de desemprego nos EUA sugerem que a probabilidade de recessão é maior do que anteriormente, mesmo que ainda seja baixa.

Nesse sentido, será importante acompanhar em setembro os dados relacionados ao mercado de trabalho, especialmente o payroll e o desemprego. O mercado busca respostas sobre a natureza dos números piores na margem: se foram causados por questões específicas – como a paralisação de algumas plantas da indústria automobilística e um furacão que atingiu o Sul dos EUA – ou se de fato refletem uma piora acelerada do mercado de trabalho. A resposta pode afetar o ritmo do ciclo de cortes a ser iniciado pelo Fed.

No último mês, os fatores macro preponderaram sobre a dinâmica das eleições nos EUA. Com o primeiro debate presidencial entre Kamala Harris e Donald Trump, a política pode voltar ao foco. A vice-presidente tem superado Trump nas pesquisas e tem arrecadado grandes volumes de recurso para sua campanha, representando uma mudança drástica de cenário em relação à época em que Biden desistiu da corrida presidencial. Mas, suas principais ideias para economia ainda não são claras, o que pode ficar mais claro no debate.

Rentabilidade

	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%
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%

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2024
Fundo	0,85%	0,74%	0,82%	0,11%	0,78%	0,72%	1,71%	1,05%					6,98%
INPC + 4,35%	0,94%	1,13%	0,53%	0,74%	0,82%	0,59%	0,65%	0,23%					5,78%
Bench 2024	0,79%	0,94%	0,87%	0,78%	0,79%	1,05%	1,08%	1,21%					7,75%

	12m	24m	36m
Fundo	11,94%	24,08%	30,13%
INPC + 4,35%	8,18%	17,45%	33,37%
Bench 2024	12,61%	27,74%	39,17%

Performance Individuais

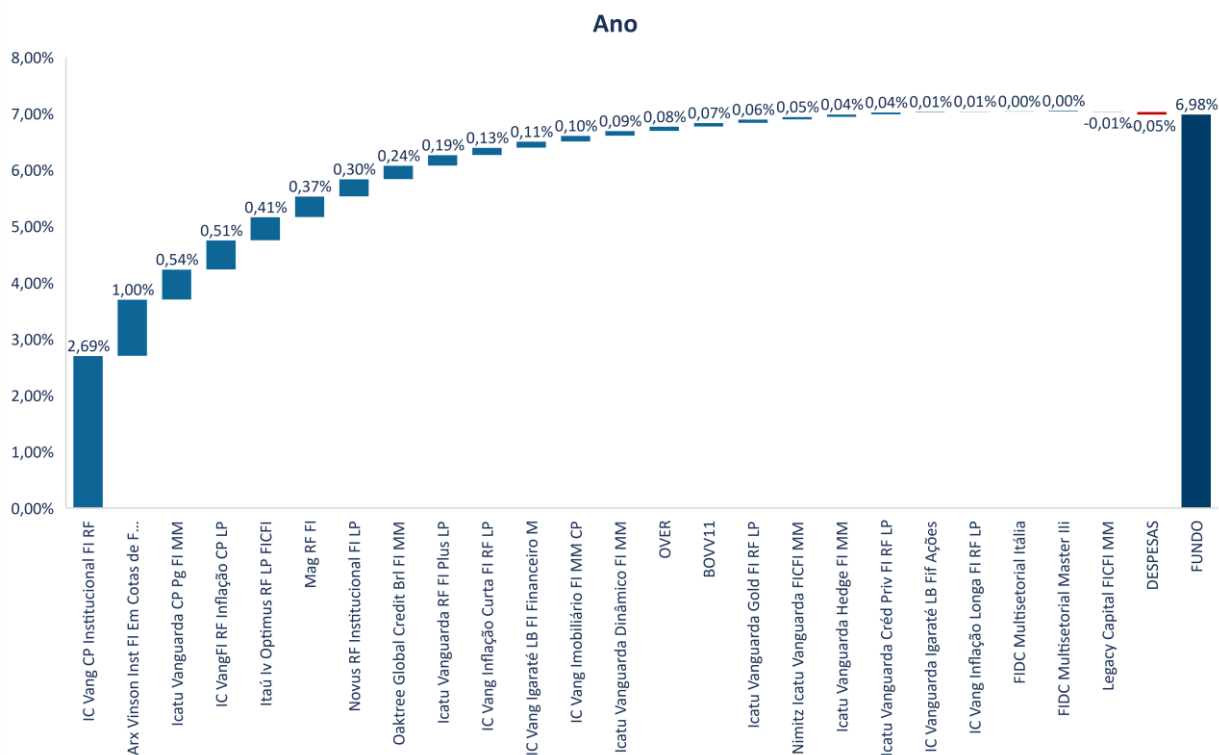
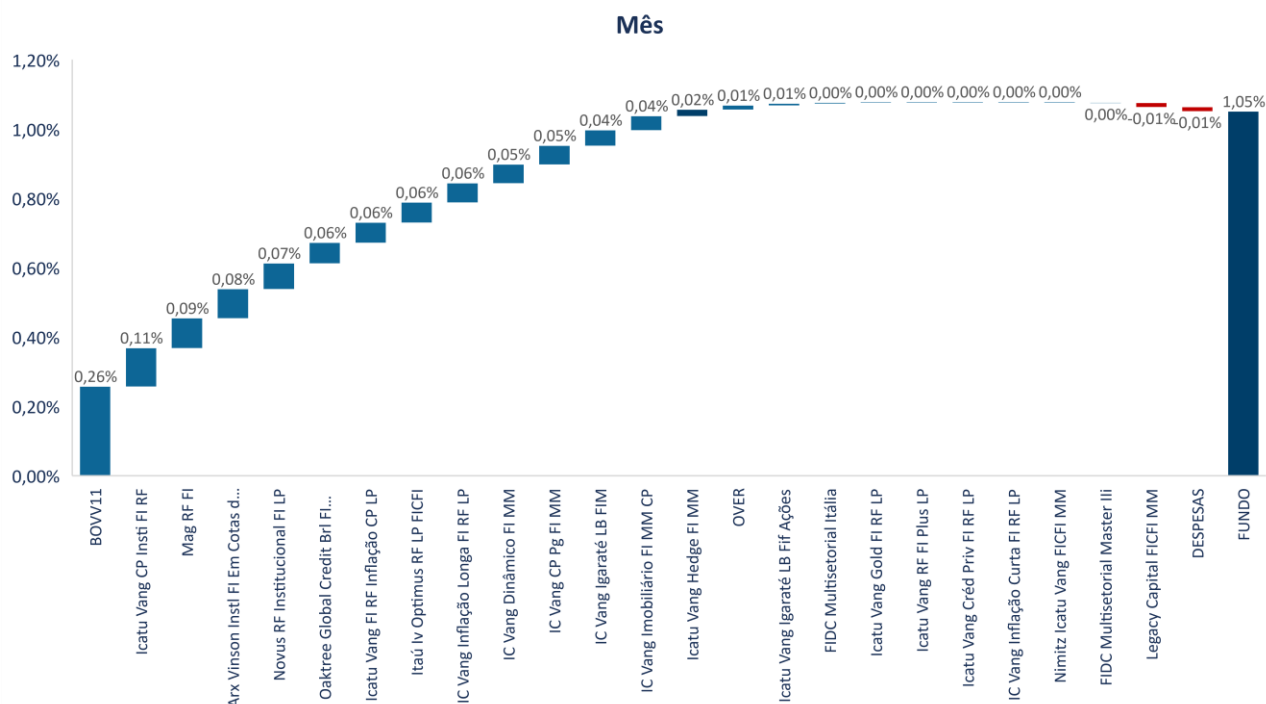
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2024
Mag Renda Fixa Fundo De Investimento	1,04%	0,85%	0,91%	0,71%	0,87%	0,83%	0,97%	0,87%	-	-	-	-	7,26%
Icatu Vanguarda CP Institucional FIRF	1,62%	1,10%	1,13%	1,06%	0,97%	0,98%	2,00%	0,54%	-	-	-	-	9,79%
Nc Red Institucional FIRF	0,67%	0,33%	0,63%	-0,33%	1,17%	0,85%	0,85%	1,23%	-	-	-	-	5,53%
Icatu Vanguarda PG FIM CP	1,78%	1,08%	1,17%	1,03%	0,93%	0,89%	1,66%	0,71%	-	-	-	-	9,63%
Arx Vinson FIC FIRF CP	1,23%	0,94%	1,16%	0,93%	0,90%	1,07%	1,22%	1,05%	-	-	-	-	8,82%
Itaú Iv Optimus RF LP Ficf	0,88%	0,68%	0,95%	0,99%	1,09%	1,16%	0,74%	0,96%	-	-	-	-	7,71%
Legacy Capital FICFI MM	0,46%	-0,40%	1,22%	-2,37%	0,45%	-0,29%	1,74%	-0,99%	-	-	-	-	-0,23%
Nimitz IV FIC FIM	0,32%	0,41%	1,31%	-1,02%	-0,40%	1,59%	2,42%	1,38%	-	-	-	-	6,12%
Icatu Vanguarda Hedge FIM	0,80%	-0,75%	0,11%	-1,43%	0,64%	0,64%	2,01%	1,44%	-	-	-	-	3,49%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	-	-	-	-	7,10%
Icatu Vanguarda Inflação CP FIRF LP	1,23%	0,89%	0,91%	-0,66%	1,20%	0,11%	1,93%	0,40%	-	-	-	-	6,14%
IMAB-5	0,68%	0,59%	0,77%	-0,20%	1,05%	0,39%	0,91%	0,59%	-	-	-	-	4,88%
Icatu Vanguarda Inflação Longa FIRF	-1,49%	0,47%	-0,57%	-2,94%	1,56%	-2,25%	3,20%	0,73%	-	-	-	-	-1,43%
IMAB-5+	-1,47%	0,51%	-0,55%	-2,91%	1,59%	-2,25%	3,24%	0,77%	-	-	-	-	-1,21%
Icatu Vanguarda Imobiliário FIM CP	1,02%	0,66%	0,53%	-0,19%	-1,33%	2,57%	0,38%	2,46%	-	-	-	-	6,21%
IFIX	0,66%	0,81%	1,43%	-0,79%	0,03%	-1,03%	0,51%	0,86%	-	-	-	-	2,48%
BOVV11	-4,80%	1,04%	-0,84%	-1,67%	-3,00%	1,55%	3,03%	6,66%	-	-	-	-	1,54%
Icatu Vanguarda Long Biased FIM	-0,96%	0,89%	1,32%	-1,51%	0,25%	1,25%	2,23%	2,19%	-	-	-	-	5,72%
IBOV	-4,79%	0,99%	-0,71%	-1,70%	-3,04%	1,48%	3,02%	6,54%	-	-	-	-	1,36%
IBX	-4,51%	0,96%	-0,73%	-1,34%	-3,18%	1,51%	2,90%	6,59%	-	-	-	-	1,79%
Oaktree Global Credit Brl FI MM Ie	1,13%	0,63%	1,25%	0,17%	1,37%	1,42%	1,89%	1,43%	-	-	-	-	9,66%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	-	-	-	-	7,10%

Alocação

ESTRATÉGIA	FUNDOS	% PL	
CDI	Nc Red Institucional FIRF	6,0%	
	Mag Renda Fixa Fundo De Investimento	9,9%	21,8%
	Itaú IV Optimus FICR	6,0%	
Inflação Longa	Icatu Vanguarda Inflação Longa FIRF	6,7%	6,7%
Crédito Privado	Icatu Vanguarda Crédito Privado Institucional FIRF	22,1%	
	Arx Vinson FIC FIRF CP	8,2%	38,1%
	Icatu Vanguarda PG FIM CP	7,8%	
Multimercado	ICATU VANGUARDA IPCA DINÂMICO FIM	17,5%	17,5%
Investimento Estruturado	Legacy Capital FICFI MM	1,3%	2,7%
	Icatu Vanguarda Hedge FIM	1,4%	
Imobiliário	Icatu Vanguarda Imobiliário FIM CP	2,1%	2,1%
Renda Variável	Icatu Vanguarda Igaraté LB FIM	2,2%	6,1%
	BOVV11	3,9%	
FIDC	FIDC Mult. Italia	0,1%	0,1%
Investimento Exterior	Oaktree Global Credit Brl FI MM Ie	3,9%	3,9%
Caixa	-	1,0%	1,0%

Alocação	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	jul/24	ago/24
CDI	17,2%	20,5%	14,7%	16,9%	18,0%	23,4%	24,8%	21,8%
Crédito Privado	42,8%	42,8%	42,6%	49,7%	48,6%	42,9%	42,5%	38,1%
Inflação Curta	17,3%	10,0%	9,9%	9,7%	10,0%	9,8%	9,8%	-
Inflação Longa	1,8%	3,0%	4,9%	6,7%	6,6%	6,7%	6,8%	6,7%
Multimercado	13,6%	13,5%	14,0%	6,5%	4,9%	3,8%	2,5%	20,3%
Renda Variável	5,0%	5,9%	6,0%	4,9%	5,0%	6,0%	6,0%	6,1%
FIDC's	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%	0,1%
Imobiliário	2,0%	2,0%	2,0%	1,9%	1,9%	1,9%	1,9%	2,1%
Exterior	-	-	2,7%	2,7%	4,0%	4,0%	3,9%	3,9%
Caixa	0,2%	2,2%	3,2%	0,9%	1,2%	1,5%	1,8%	1,0%

P&L



Movimentações

Fundo	Classe Fundo							Data	% Fin.	Data Cotização (Resgates)	Data Liquidação (Resgates)
	CDI	Crédito Privado	Inflação	Multimercado	Renda Variável	Invest. Exterior	Imobiliário				
Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF LP BOVV11			-247.500,00					09/08/2024	-R\$ 0,00	09/08/2024	12/08/2024
					-234.642,18			12/08/2024	-R\$ 0,00	12/08/2024	14/08/2024
Arx Vinson Institucional FI Em Cotas de FI RF Créd Priv BOVV11		-1.850.000,00						13/08/2024	-R\$ 0,01	12/09/2024	13/09/2024
								13/08/2024	-R\$ 0,01	13/08/2024	15/08/2024
Icatu Vanguarda Créd Priv Institucional FI RF		-7.000.000,00						13/08/2024	-R\$ 0,03	12/09/2024	13/09/2024
Icatu Vanguarda Créd Priv Pg FI MM		-1.762.000,00						13/08/2024	-R\$ 0,01	12/09/2024	13/09/2024
Icatu Vanguarda FI RF Inflação Créd Priv LP			-2.450.000,00					13/08/2024	-R\$ 0,01	20/08/2024	21/08/2024
Icatu Vanguarda Imobiliário FI MM Créd Priv							-478.000,00	13/08/2024	-R\$ 0,00	12/09/2024	16/09/2024
Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF LP			-1.715.000,00					13/08/2024	-R\$ 0,01	13/08/2024	14/08/2024
Itaú Iv Optimus RF LP FICFI	-1.280.000,00							13/08/2024	-R\$ 0,01	13/08/2024	14/08/2024
Mag RF FI	-25.000.000,00							13/08/2024	-R\$ 0,11	13/08/2024	13/08/2024
Nc RF Red Institucional FI LP	-1.235.000,00							13/08/2024	-R\$ 0,01	16/08/2024	19/08/2024
Icatu Vanguarda Igaratê Long Biased FIF Ações					5.155.000,00			14/08/2024	R\$ 0,02	-	-
Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF LP			-470.500,00					14/08/2024	-R\$ 0,00	14/08/2024	15/08/2024
Mag RF FI	2.345.000,00							15/08/2024	R\$ 0,01	-	-
Icatu Vanguarda Dinâmico FI MM				18.750.000,00				16/08/2024	R\$ 0,08	-	-
Icatu Vanguarda FI RF Inflação Créd Priv LP BOVV11		-22.840.241,22						16/08/2024	-R\$ 0,10	23/08/2024	26/08/2024
								19/08/2024	-R\$ 0,00	19/08/2024	21/08/2024
Oaktree Global Credit FI MM IE								19/08/2024	-R\$ 0,00	28/08/2024	02/09/2024
Mag RF FI	9.370.000,00							20/08/2024	R\$ 0,04	-	-
Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF LP			320.000,00					21/08/2024	R\$ 0,00	-	-
Mag RF FI	2.763.000,00							21/08/2024	R\$ 0,01	-	-
Icatu Vanguarda Dinâmico FI MM				22.280.000,00				26/08/2024	R\$ 0,09	-	-
Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF LP			228.000,00					29/08/2024	R\$ 0,00	-	-