



R.I. Relatório de Investimentos

MARÇO/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.

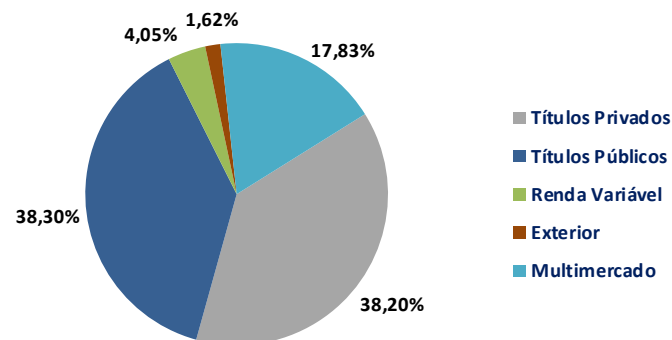
Performance dos Investimentos

Fundos de Investimentos	Patrimônio		Gestor	Rentabilidade					
				1M	12M	24M	36M	48M	60M
ICATU VANG FC FI MULT CRED PRIV JUSPREV ¹	240.139.880,66	42,84%	Icatu Asset Management	0,82%	13,49%	21,78%	26,52%	39,98%	38,19%
SOMMA JUSPREV ATIVO FI MULT CRED PRIV ²	245.670.171,96	43,83%	Somma Investimentos S.A.	0,71%	13,02%	20,29%	26,62%	34,55%	36,37%
SOMMA JUSPREV ALM FI MULT	74.693.189,49	13,33%	Somma Investimentos S.A.	0,98%	9,94%	22,45%	42,85%	59,79%	76,12%
TOTAL JUSPREV	560.503.242,11	100%		0,73%	11,88%	19,93%	28,31%	39,45%	42,23%

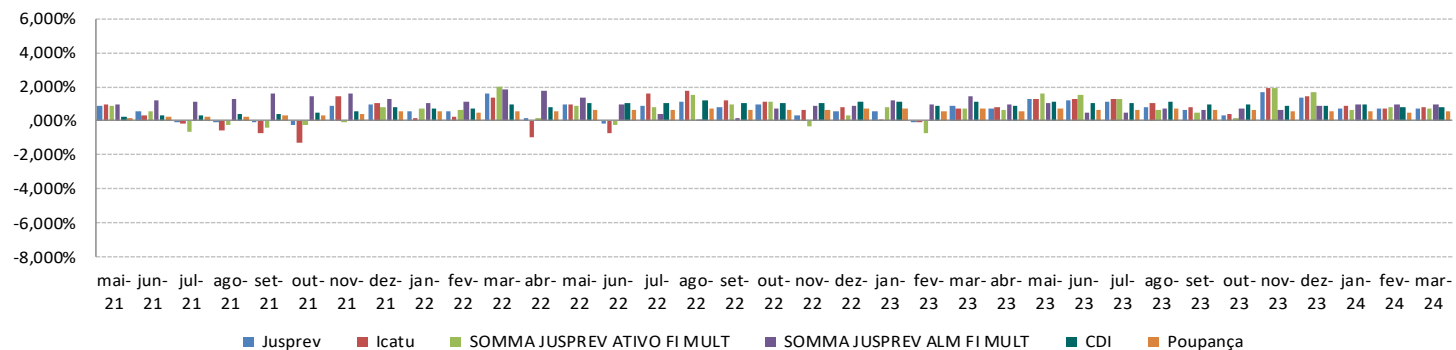
¹O Icatu Vanguarda assumiu a Gestão do Fundo a partir de 02/10/2017. Anterior a esta data, a Gestão do Fundo era de responsabilidade do Bradesco Asset Management.

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.

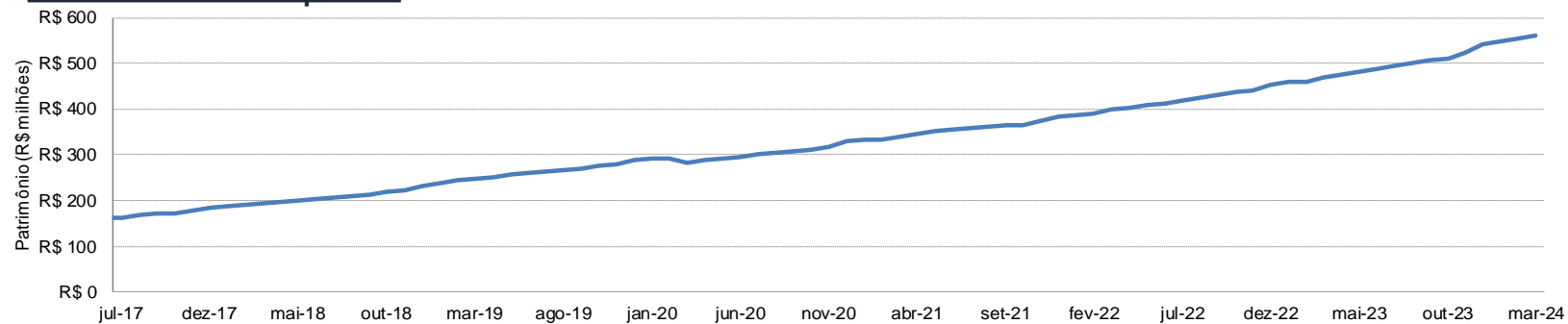
Composição



Rentabilidade Mensal



Patrimônio Líquido



Histórico de Desempenho

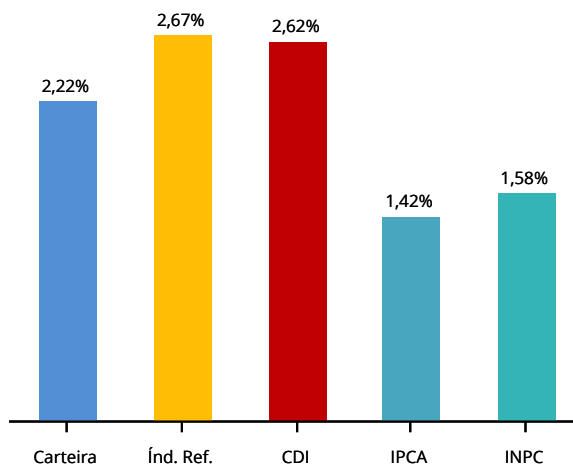
Início Período Considerado	6-ago-08	
	12 meses	Desde o início
Melhor Mês da JUSPREV	1,69%	2,10%
Melhor Mês do INPC + 4,35%	1,13%	2,09%
Melhor Mês do INPC + 6%	1,25%	2,23%
Pior Mês da JUSPREV	-0,10%	-3,41%
Pior Mês do INPC + 4,35%	0,26%	-0,25%
Pior Mês do INPC + 6%	0,39%	-0,12%
% de meses acima de INPC + 4,35%	66,67%	40,11%
% de meses acima de INPC + 6%	66,67%	35,29%
% de meses acima de CDI	38,46%	38,50%
Volatilidade da JUSPREV (a.a.)	-0,11%	0,23%

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: Ainda que março tenha trazido como fator positivo alguma virada de chave para a condução da política monetária dos BCs da Europa, com BCE e BoE adotando posições mais moderadas, as conjunturas de EUA e China prevaleceram para o mercado doméstico. Nos EUA, a reprecificação dos cortes de juros esperados pelo mercado, agora alinhada à projeção do Fed de apenas 3 reduções em 2024, aliada à continuidade de favorecimento dos ativos ligados à tese da Inteligência Artificial adiaram qualquer tentativa de retorno do capital externo ao Brasil. Na China, apesar da leitura de dados de atividade mais positivos, os temores envolvendo o setor imobiliário do país reapareceram, punindo o minério de ferro, commodity essencial da pauta exportadora brasileira.

Economia Brasileira: Destaca-se a atitude do Copom de alterar seu forward guidance, algo avaliado como conservador pelo mercado. Diante das incertezas sobre como o Fed realizará seus cortes de juros e o desconforto com a dinâmica da inflação de serviços doméstica, o Copom optou por adquirir grau adicional de liberdade para a condução de sua política monetária. Ademais, embora o agregado de notícias macroeconômicas tenha sido, grosso modo, mais favorável, pesou negativamente a influência do governo na dinâmica de empresas estatais, a exemplo do noticiário em torno da Petrobras. Aliás, a própria melhora da arrecadação poderá fomentar pressões por alta dos gastos públicos, em meio à queda da popularidade do presidente da República.

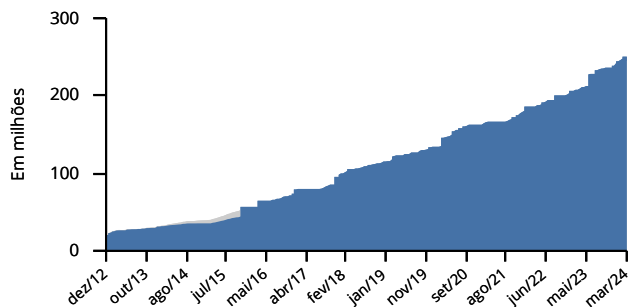
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



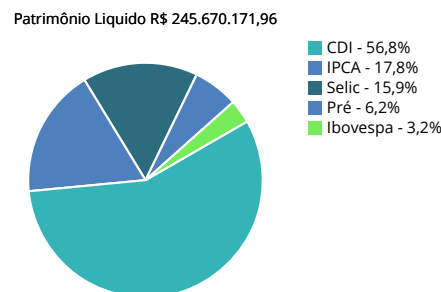
Mês	Abr-23	Mai-23	Jun-23	Jul-23	Ago-23	Set-23	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24	Fev-24	Mar-24	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev Ativo	0,66	1,60	1,54	1,25	0,67	0,52	0,18	1,97	1,72	0,67	0,82	0,71	2,22	13,02	20,29
Índ. Ref.	0,84	0,73	0,26	0,27	0,59	0,45	0,48	0,44	0,89	0,94	1,13	0,57	2,67	7,85	17,33
CDI	0,92	1,12	1,07	1,07	1,14	0,97	1,00	0,92	0,90	0,97	0,80	0,83	2,62	12,36	27,28
IPCA	0,61	0,23	(0,08)	0,12	0,23	0,26	0,24	0,28	0,56	0,42	0,83	0,16	1,42	3,93	8,76

Índice de Referência INPC + 4.35% a.a.

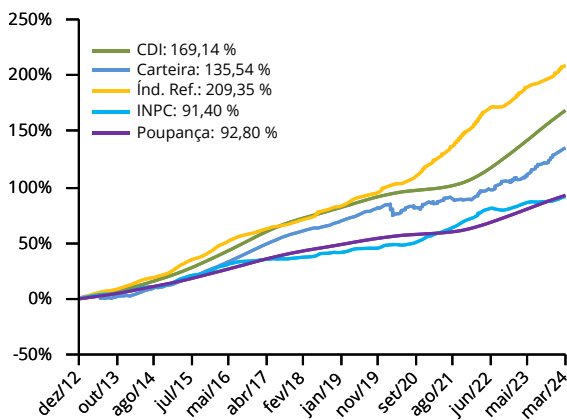
EVOLUÇÃO PATRIMONIAL



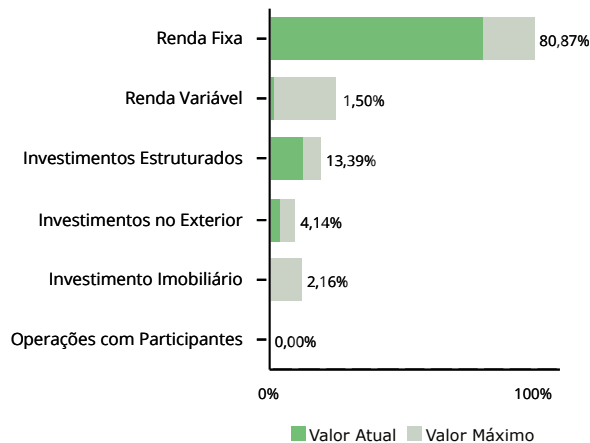
DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





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



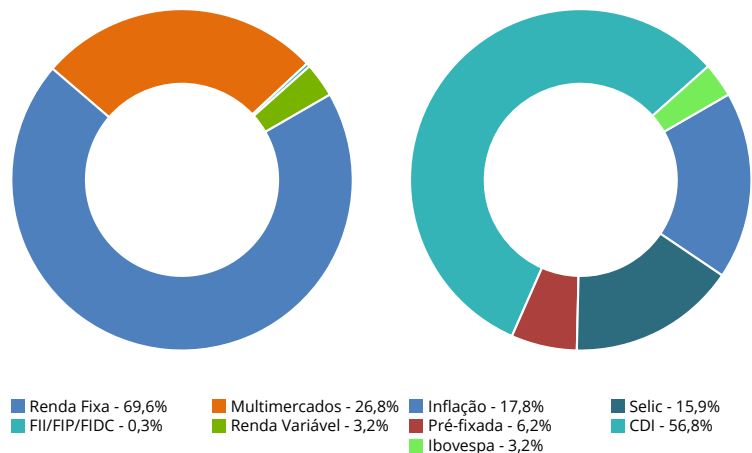
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

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

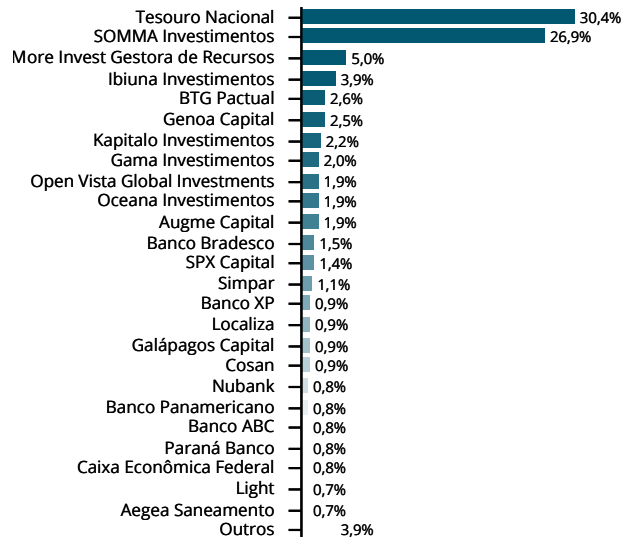


ATIVOS	MARÇO-24	%	FEVEREIRO-24	%
RENDA FIXA	119.594.438,10	48,7%	122.063.712,67	50,0%
CDB - Banco BR Partners	1.006.478,29	0,4%	-	0,0%
Compromissada - Titulos Públicos	15.320.552,55	6,2%	12.882.627,01	5,3%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	1.627.667,80	0,7%	1.603.733,56	0,7%
Debênture - Cosan (CSAN33)	2.190.509,85	0,9%	2.199.517,94	0,9%
Debênture - JSL (JSMLB5)	2.791.295,70	1,1%	2.884.795,93	1,2%
Debênture - Light (LIGHD7)	1.794.147,13	0,7%	1.723.010,02	0,7%
Debênture - Localiza (LORTA7)	2.244.032,78	0,9%	2.288.581,79	0,9%
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	1.600.119,75	0,7%	1.638.287,37	0,7%
Debênture - Qualicorp Saúde (QUAL16)	-	0,0%	989.415,70	0,4%
Debênture - Vamos (VAMO34)	1.103.247,97	0,4%	1.112.365,10	0,5%
Letra Financeira - Banco ABC	2.022.807,31	0,8%	2.004.340,00	0,8%
Letra Financeira - Banco Bradesco	3.704.899,97	1,5%	3.898.248,81	1,6%
Letra Financeira - Banco CNH	472.864,57	0,2%	468.591,74	0,2%
Letra Financeira - Banco Industrial	1.000.806,89	0,4%	987.020,50	0,4%
Letra Financeira - Banco NBC	1.007.397,61	0,4%	-	0,0%
Letra Financeira - Banco Panamericano	2.025.481,99	0,8%	2.003.600,82	0,8%
Letra Financeira - Banco Rodobens	488.692,60	0,2%	-	0,0%
Letra Financeira - Banco Sicredi	1.000.903,69	0,4%	-	0,0%
Letra Financeira - Banco XP	2.255.811,97	0,9%	2.235.030,91	0,9%
Letra Financeira - BTG Pactual	6.360.065,78	2,6%	6.293.175,11	2,6%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	1.852.398,54	0,8%	1.832.473,95	0,8%
Letra Financeira - Nubank	2.031.084,79	0,8%	2.006.535,17	0,8%
Letra Financeira - Paraná Banco	2.000.000,00	0,8%	-	0,0%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	35.722.702,67	14,5%	35.410.016,84	14,5%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	27.970.467,90	11,4%	37.602.344,40	15,4%
FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555	125.298.171,02	51,0%	121.095.692,31	49,6%
Augme Institucional FI RF CP	4.597.105,75	1,9%	4.546.152,49	1,9%
Galápagos Dragon FIC FIM CP	2.212.416,18	0,9%	2.189.496,59	0,9%
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	6.029.968,66	2,5%	5.990.052,57	2,5%
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	4.877.321,47	2,0%	4.839.670,39	2,0%
IBIUNA LS FP FICM	4.601.200,27	1,9%	4.710.345,14	1,9%
Kapitalo K10 FIC FIM	5.441.108,70	2,2%	5.364.514,04	2,2%
KP Crédito Privado FIC FIM	1.142.482,05	0,5%	1.131.439,22	0,5%
MCA Institucional FIC FIM CP	12.310.085,44	5,0%	8.016.638,46	3,3%
OAKTREE Global Credit IE FIM	4.959.192,23	2,0%	4.897.973,26	2,0%
Oceana Valor 30 FIC FIA	4.665.540,52	1,9%	4.715.419,61	1,9%
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	4.750.064,25	1,9%	694.858,67	0,3%
SOMMA Firenze RF CP	24.582.919,21	10,0%	32.052.431,32	13,1%
SOMMA Fundamental FIA	3.316.993,87	1,4%	3.341.380,08	1,4%
SOMMA Institucional FIM	8.413.235,76	3,4%	8.392.869,62	3,4%
SOMMA Positano FIC FIM CP	2.005.488,49	0,8%	1.983.451,96	0,8%
SOMMA Real Estate FIC FIM	5.540.282,64	2,3%	5.448.801,52	2,2%

GRÁFICOS DE DISTRIBUIÇÃO

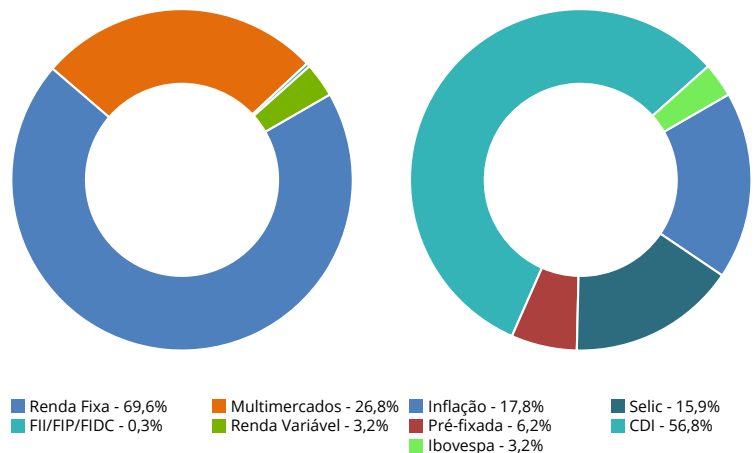


INSTITUIÇÃO²

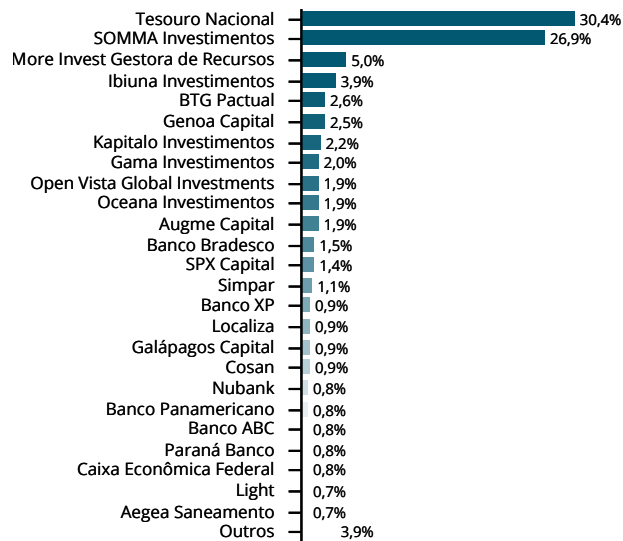


ATIVOS	MARÇO-24	%	FEVEREIRO-24	%
SOMMA Torino RF CP	22.319.845,65	9,1%	17.132.910,06	7,0%
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	3.532.919,88	1,4%	3.485.583,31	1,4%
Valora Horizon HY FIM CP	-	0,0%	2.161.704,00	0,9%
OUTROS FUNDOS DE INVESTIMENTO (FII/FIP/FIDC)	854.553,95	0,3%	812.389,12	0,3%
FIDC Credz Sênior 8	854.553,95	0,3%	812.389,12	0,3%
DERIVATIVOS	(48.882.133,37)	-19,9%	-	0,0%
Futuros DAP ¹	(40.819.628,97)	-16,6%	-	0,0%
Futuros WIN ¹	(8.062.504,40)	-3,3%	-	0,0%
TESOURARIA	(76.991,08)	0,0%	(42.793,07)	0,0%
Caixa	1.000,00	0,0%	1.000,00	0,0%
Valores a Pagar/Receber	(77.991,08)	0,0%	(43.793,07)	0,0%
TOTAL DA CARTEIRA	245.670.171,99	100%	243.929.001,03	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	1.006.478,29	-	1.006.478,29	0,41%
Compromissada - Títulos Públicos	Mercado	28/03/2024	01/04/2024	10,64% a.a.	15.320.552,55	15.320.552,55	-	15.320.552,55	6,24%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	Mercado	24/03/2022	15/07/2025	IPCA + 6,68%	-	112.252,95	-	112.252,95	0,05%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	Mercado	24/03/2022	15/07/2025	IPCA + 6,68%	-	14.031,62	-	14.031,62	0,01%
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	Mercado	24/03/2022	15/07/2025	IPCA + 6,68%	-	1.501.383,23	-	1.501.383,23	0,61%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,99%	-	544.076,76	-	544.076,76	0,22%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,99%	-	758.211,39	-	758.211,39	0,31%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,99%	-	539.706,67	-	539.706,67	0,22%
Debênture - Cosan (CSAN33)	Mercado	24/03/2022	15/08/2031	IPCA + 6,99%	-	348.515,03	-	348.515,03	0,14%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	18/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,42%	-	247.605,70	-	247.605,70	0,10%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	18/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,42%	-	898.716,97	-	898.716,97	0,37%
Debênture - JSL (JSMLB5)	Mercado	11/03/2022	15/09/2031	IPCA + 8,62%	-	1.644.973,03	-	1.644.973,03	0,67%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,79%	-	439.944,12	-	439.944,12	0,18%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,79%	-	54.993,02	-	54.993,02	0,02%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	16/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,99%	-	625.545,55	-	625.545,55	0,25%
Debênture - Light (LIGHD7)	Mercado	24/03/2022	15/10/2026	IPCA + 6,79%	-	673.664,44	-	673.664,44	0,27%
Debênture - Localiza (LORTA7)	Mercado	11/03/2022	15/03/2031	IPCA + 7,52%	-	2.244.032,78	-	2.244.032,78	0,91%
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	Mercado	11/03/2022	15/09/2031	IPCA + 7,62%	-	1.600.119,75	-	1.600.119,75	0,65%
Debênture - Vamos (VAMO34)	Mercado	12/11/2021	15/10/2031	IPCA + 7,71%	-	1.103.247,97	-	1.103.247,97	0,45%
Letra Financeira - Banco ABC	Mercado	20/02/2024	20/02/2026	CDI + 0,80%	2.000.000,00	2.022.807,31	-	2.022.807,31	0,82%
Letra Financeira - Banco Bradesco	Mercado	14/11/2018	15/03/2025	100% Selic	1.500.000,00	1.506.649,07	-	1.506.649,07	0,61%
Letra Financeira - Banco Bradesco	Mercado	20/07/2023	23/12/2026	CDI + 1,09%	1.989.726,90	2.198.250,90	-	2.198.250,90	0,89%
Letra Financeira - Banco CNH	Mercado	29/02/2024	05/11/2025	CDI + 0,74%	469.656,91	472.864,57	-	472.864,57	0,19%
Letra Financeira - Banco Industrial	Mercado	23/02/2024	10/11/2025	CDI + 1,29%	989.707,11	1.000.806,89	-	1.000.806,89	0,41%
Letra Financeira - Banco NBC	Mercado	07/03/2024	09/03/2026	CDI + 1,90%	1.000.000,00	1.007.397,61	-	1.007.397,61	0,41%
Letra Financeira - Banco Panamericano	Mercado	20/02/2024	20/02/2026	CDI + 0,95%	2.000.000,00	2.025.481,99	-	2.025.481,99	0,82%
Letra Financeira - Banco Rodobens	Mercado	01/03/2024	18/08/2025	CDI + 0,94%	485.534,64	488.692,60	-	488.692,60	0,20%
Letra Financeira - Banco Sicredi	Mercado	27/03/2024	27/03/2026	CDI + 0,80%	1.000.000,00	1.000.903,69	-	1.000.903,69	0,41%
Letra Financeira - Banco XP	Mercado	21/02/2024	11/05/2026	CDI + 0,89%	2.223.980,09	2.255.811,97	-	2.255.811,97	0,92%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	29/10/2021	29/10/2026	IPCA + 7,50%	1.500.000,00	2.071.857,98	-	2.071.857,98	0,84%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	20/02/2024	20/02/2026	CDI + 0,80%	2.000.000,00	2.026.605,71	-	2.026.605,71	0,82%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	12/07/2022	19/08/2024	IPCA + 7,69%	273.654,04	329.749,94	-	329.749,94	0,13%
Letra Financeira - BTG Pactual	Mercado	22/07/2022	01/09/2027	CDI + 2,21%	1.500.000,00	1.931.852,15	-	1.931.852,15	0,79%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	Mercado	12/09/2019	30/11/2024	100% Selic	1.800.000,00	1.852.398,54	-	1.852.398,54	0,75%
Letra Financeira - Nubank	Mercado	20/02/2024	20/02/2026	CDI + 1,18%	2.000.000,00	2.031.084,79	-	2.031.084,79	0,83%
Letra Financeira - Paraná Banco	Mercado	28/03/2024	07/04/2026	CDI + 0,90%	2.000.000,00	2.000.000,00	-	2.000.000,00	0,81%
Letra Financeira do Tesouro Nacional	Mercado	19/01/2024	01/03/2028	100% Selic	35.001.284,57	35.722.702,67	-	35.722.702,67	14,54%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Mercado	05/07/2022	15/05/2025	IPCA + 5,99%	201.233,16	217.397,32	-	217.397,32	0,09%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Mercado	23/06/2022	15/05/2025	IPCA + 5,80%	3.003.819,22	3.243.568,09	-	3.243.568,09	1,32%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Mercado	29/06/2022	15/05/2025	IPCA + 5,90%	1.006.366,48	1.086.986,62	-	1.086.986,62	0,44%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Mercado	04/07/2022	15/05/2025	IPCA + 5,99%	301.675,52	326.095,99	-	326.095,99	0,13%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Mercado	24/11/2022	15/05/2027	IPCA + 6,43%	10.024.957,93	11.211.928,59	-	11.211.928,59	4,56%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Mercado	15/03/2022	15/05/2025	IPCA + 5,80%	355.473,03	391.315,18	-	391.315,18	0,16%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Mercado	14/03/2022	15/05/2025	IPCA + 5,81%	651.014,31	717.411,17	-	717.411,17	0,29%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Mercado	11/11/2022	15/05/2027	IPCA + 6,09%	7.999.678,79	8.611.743,35	-	8.611.743,35	3,51%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Mercado	23/01/2024	15/08/2028	IPCA + 5,50%	2.196.965,29	2.164.021,59	-	2.164.021,59	0,88%
TOTAL						119.594.438,10	-	119.594.438,10	48,68 %

FUNDOS DE INVESTIMENTO CVM 555							
Nome do Fundo	Gestor	Liquidez	Quantidade de Cotas	Valor da Cota	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
Augme Institucional FI RF CP	Augme Capital	D+30	3.022.705,1403428	1,5208582	-	4.597.105,75	1,87%
Galápagos Dragon FIC FIM CP	Galápagos Capital	D+91	1.443.962,9321077	1,5321835	-	2.212.416,18	0,90%
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	Genoa Capital	D+31	3.888.478,5895897	1,5507270	-	6.029.968,66	2,45%
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	Ibiuna	D+31	35.831,2085762	136,1193682	-	4.877.321,47	1,99%
IBIUNA LS FP FICM	Ibiuna	D+31	42.956,1041367	107,1140030	-	4.601.200,27	1,87%
Kapitalo K10 FIC FIM	Kapitalo Investimentos	D+30	2.609.841,1044542	2,0848429	-	5.441.108,70	2,21%
KP Crédito Privado FIC FIM	KP Wealth	D+91	597.227,7444235	1,9129755	-	1.142.482,05	0,46%
MCA Institucional FIC FIM CP	More Invest Gestora de Recursos	D+90	11.133.310,1482750	1,1056986	-	12.310.085,44	5,01%
OAKTREE Global Credit IE FIM	Gama Investimentos	D+12	3.117.553,9475597	1,5907318	-	4.959.192,23	2,02%
Oceana Valor 30 FIC FIA	Oceana Investimentos	D+30	724.021,6332702	6,4439242	-	4.665.540,52	1,90%
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	Open Vista Global Investments	D+6	29.043,4841458	163,5500833	-	4.750.064,25	1,93%
SOMMA Firenze RF CP	SOMMA Investimentos	D+32	20.434.585,8849790	1,2030055	-	24.582.919,21	10,01%
SOMMA Fundamental FIA	SOMMA Investimentos	D+5	21.784,5419011	152,2636503	-	3.316.993,87	1,35%
SOMMA Institucional FIM	SOMMA Investimentos	D+5	2.508.608,5860772	3,3537459	-	8.413.235,76	3,42%
SOMMA Positano FIC FIM CP	SOMMA Investimentos	D+360	1.332,3973746	1.505,1729498	-	2.005.488,49	0,82%
SOMMA Real Estate FIC FIM	SOMMA Investimentos	D+60	4.166,9687837	1.329,5714282	-	5.540.282,64	2,25%
SOMMA Torino RF CP	SOMMA Investimentos	D+1	14.493.020,4119250	1,5400410	-	22.319.845,65	9,08%
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	SPX Capital	D+60	1.463.725,1372990	2,4136498	-	3.532.919,88	1,44%
TOTAL					-	125.298.171,02	51,00 %

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	1,0053576	-	854.553,95	0,35%
TOTAL					-	854.553,95	0,35 %

LIMITE DE ALOCAÇÃO POR ATIVO E SEGMENTO - PI vigente para o ano			
SEGMENTO	MAXIMO	ATUAL	MARGEM
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	80,87%	19,13%
Títulos Públicos Federais	100,00%	46,45%	53,55%
CDI/CDBs	80,00%	0,50%	79,50%
Letras Financeiras de Inst. Financeira	80,00%	13,73%	66,27%
Debêntures	80,00%	17,29%	62,71%
DPGE	20,00%	0,00%	20,00%
FIDC	20,00%	2,81%	17,19%
Outros Ativos de Renda Fixa	20,00%	0,09%	19,91%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	25,00%	1,50%	23,50%
Ações de Companhias Abertas	25,00%	1,50%	23,50%
SPE	10,00%	0,00%	10,00%
TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20,00%	11,33%	8,67%
FIP - Fundo de Investimento em Participações	5,00%	0,00%	5,00%
FIM - Fundos de Investimento Multimercado	15,00%	11,33%	3,67%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	10,00%	4,14%	5,86%
FIE - Fundo de Investimento no Exterior	10,00%	4,14%	5,86%
INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	10,00%	2,16%	7,84%
CCI	10,00%	0,00%	10,00%
CRI	10,00%	0,10%	9,90%
FII - Fundo Investimento Imobiliário	10,00%	2,06%	7,94%
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%	34,98%					
Banco Bradesco	25,00%	1,51%	AAA(bra)	AAA.br	brAAA	-	
Banco CNH	25,00%	0,19%	AAA(bra)	-	-	-	
Banco NBC	25,00%	0,41%	AAA(bra)	-	-	-	
Banco XP	25,00%	0,92%	AAA(bra)	-	-	-	
Debênture - Localiza (LORTA7)	25,00%	0,91%	AAA(bra)	AAA.br	brAAA	-	
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	25,00%	0,65%	AAA(bra)	-	brAAA	-	
Tesouro Nacional	100,00%	30,39%	-	-	brAAA	-	
Alta Segurança (AA)	100,00%	10,12%					
Banco ABC	25,00%	0,82%	AAA(bra)	AA+.br	brAAA	-	
Banco BR Partners	25,00%	0,41%	AA-(bra)	AA-.br	-	-	
Banco Panamericano	25,00%	0,82%	AA(bra)	-	-	-	
Banco Rodobens	25,00%	0,20%	AA+(bra)	-	-	-	
Banco Sicredi	25,00%	0,41%	AA+(bra)	AAA.br	brAAA	-	
BTG Pactual	25,00%	2,59%	AA(bra)	AAA.br	brAAA	-	
Caixa Econômica Federal	25,00%	0,75%	AA(bra)	AAA.br	brAAA	-	
Debênture - Cosan (CSAN33)	25,00%	0,89%	AAA(bra)	AA+.br	-	-	
Debênture - JSL (JSMLB5)	25,00%	1,14%	AAA(bra)	-	brAA	-	
Debênture - Vamos (VAMO34)	25,00%	0,45%	AAA(bra)	-	brAA+	-	
Nubank	25,00%	0,83%	-	-	brAA	-	
Paraná Banco	25,00%	0,81%	AA-(bra)	-	brAA+	-	
Segurança Média Alta (A)	50,00%	1,07%					
Banco Industrial	25,00%	0,41%	-	A+.br	-	-	
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	25,00%	0,66%	AA(bra)	A.br	brAA+	-	
Risco Substancial (C)	0,00%	0,73%					
Debênture - Light (LIGHD7)	25,00%	0,73%	D(bra)	-	brD	-	

LEGENDA
Nota elevada
Nota rebaixada

RATING DOS ATIVOS


■ A - 1,07% ■ AA - 10,12% ■ AAA - 34,98% ■ C - 0,73%

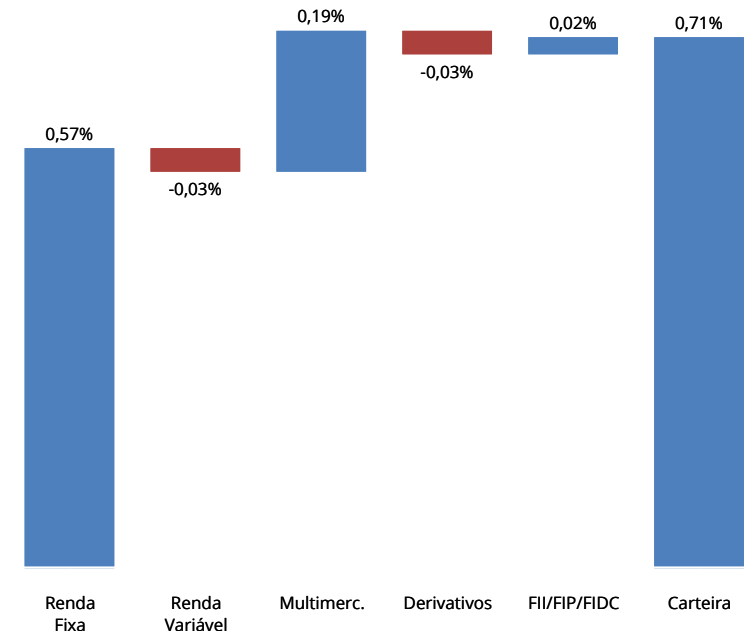
¹Engloba Tesouro Nacional, Bancos, FIDCs e Debêntures

RENTABILIDADE	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES	
	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Renda Fixa						
Augme Institucional FI RF CP	1,12	211,8%	3,34	127,0%	13,55	173,7%
Compromissada - Títulos Públicos	0,83	157,4%	2,62	99,6%	-	-
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	1,49	282,0%	3,56	135,4%	12,07	154,7%
Debênture - Cosan (CSAN33)	-0,41	-	2,19	83,3%	17,38	222,8%
Debênture - JSL (JSMLB5)	0,50	95,2%	2,00	76,0%	15,11	193,7%
Debênture - Light (LIGHD7)	4,13	780,2%	12,38	470,7%	11,38	145,9%
Debênture - Localiza (LORTA7)	0,97	183,2%	1,58	60,1%	15,00	192,3%
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	0,96	181,0%	3,11	118,3%	16,63	213,2%
Debênture - Vamos (VAMO34)	-0,82	-	-0,15	-	13,72	175,9%
Letra Financeira - Banco ABC	0,92	174,1%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco Bradesco	0,97	183,1%	3,41	129,7%	16,55	212,2%
Letra Financeira - Banco CNH	0,91	172,3%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco Industrial	1,40	263,9%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco Panamericano	1,09	206,4%	-	-	-	-
Letra Financeira - Banco XP	0,93	175,7%	-	-	-	-
Letra Financeira - BTG Pactual	1,06	200,9%	3,21	122,1%	13,16	168,7%
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	1,09	205,5%	3,43	130,4%	16,64	213,3%
Letra Financeira - Nubank	1,22	231,2%	-	-	-	-
Letra Financeira do Tesouro Nacional	0,88	166,9%	-	-	-	-
Notas do Tesouro Nacional - Série B	0,31	58,2%	1,18	44,9%	10,52	134,9%
SOMMA Firenze RF CP	1,05	197,9%	3,42	130,0%	14,95	191,7%
SOMMA Torino RF CP	1,08	203,5%	3,56	135,4%	14,98	192,1%
Multimercados						
Galápagos Dragon FIC FIM CP	1,05	151,3%	3,52	112,1%	15,51	155,4%
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	0,67	96,3%	-	-	-	-
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	0,78	112,4%	-0,10	-	8,25	82,7%
IBIUNA LS FP FICM	-2,32	-	-1,45	-	-	-
Kapitalo K10 FIC FIM	1,43	206,3%	2,86	91,1%	11,31	113,3%
KP Crédito Privado FIC FIM	0,98	141,0%	3,07	97,8%	14,48	145,1%
MCA Institucional FIC FIM CP	1,01	145,4%	-	-	-	-
OAKTREE Global Credit IE FIM	1,25	180,6%	3,04	96,8%	17,36	173,9%
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	2,86	539,9%	7,28	276,8%	-	-
SOMMA Institucional FIM	0,24	35,1%	0,50	15,9%	8,77	87,9%
SOMMA Positano FIC FIM CP	1,11	160,5%	3,32	105,7%	15,10	151,3%
SOMMA Real Estate FIC FIM	1,68	317,3%	4,71	179,1%	28,11	360,4%
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	1,36	196,3%	2,19	69,7%	-0,57	-
FII/FIP/FIDC						
FIDC Credz Sênior 8	6,53	1.234,3%	15,46	587,8%	-	-
Renda Variável						
Oceana Valor 30 FIC FIA	-1,06	-1,6	-3,51	-6,1	31,68	23,9
SOMMA Fundamental FIA	-0,73	-1,3	-5,91	-8,5	13,85	6,1

RENTABILIDADE INDICADORES	NO MÊS	NO ANO	EM 12 MESES
	%	%	%
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	0,53	2,63	7,80
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	0,53	2,63	7,80
Renda Variável (INPC + 4.35% a.a.)	0,53	2,63	7,80
Estruturados (INPC + 6.50% a.a.)	0,69	3,14	9,98
Op. com Participante (CDI)	0,83	2,62	12,36
CDI	0,83	2,62	12,36
IPCA	0,16	1,42	3,93
INPC	0,19	1,58	3,40
Ibovespa	-0,71	-4,53	25,74
Dólar	0,26	3,20	-1,66

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	0,87	2,80	13,54
Renda Variável	-0,93	-3,99	17,54
Investimentos Estruturados	0,61	1,34	8,93
Investimentos no Exterior	0,00	0,00	0,00
Operação com participante	0,00	0,00	0,00

COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA

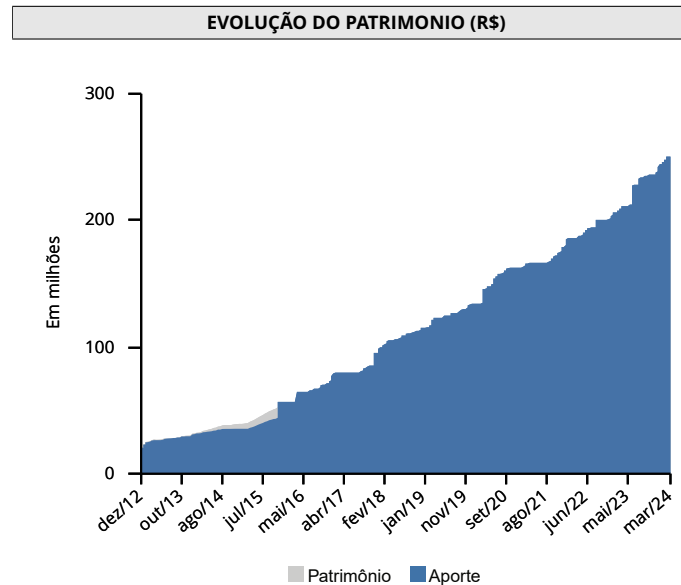
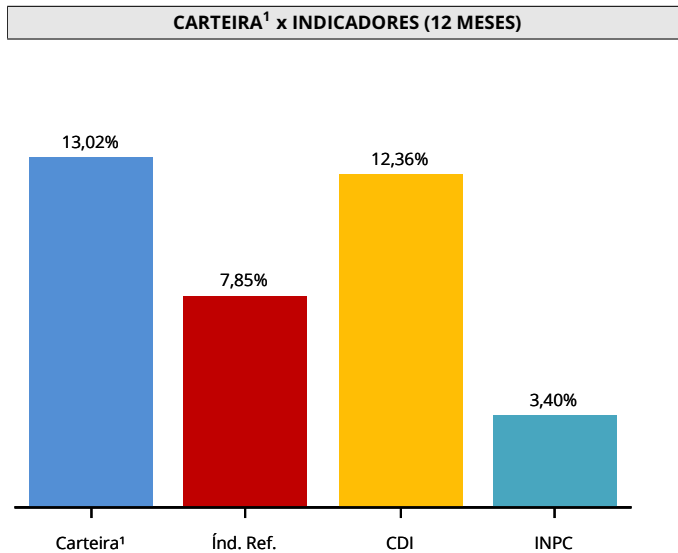
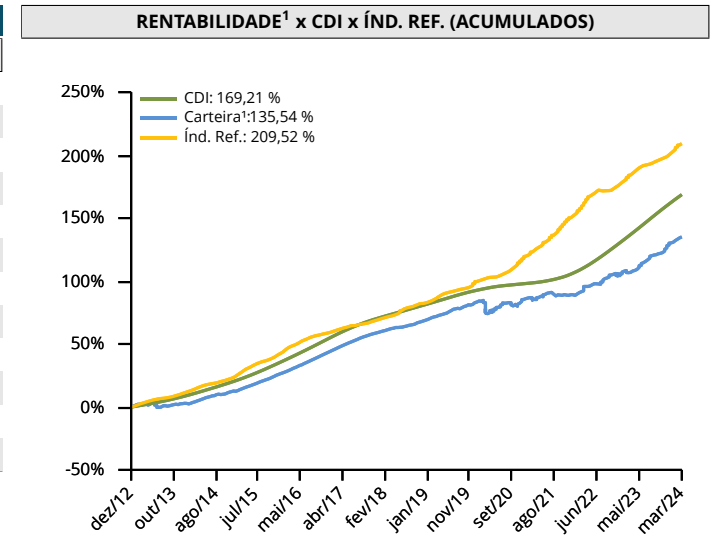


RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	NO ANO
RENTA FIXA	1.673.487,55	1.650.479,14	1.438.282,13	-	-	-	4.762.248,82
Augme Institucional FI RF CP	50.508,71	47.214,29	50.953,26	-	-	-	148.676,26
CDB - Banco BR Partners	-	-	6.478,29	-	-	-	6.478,29
Compromissada - Títulos Públicos	477.082,93	208.601,86	75.197,36	-	-	-	760.882,15
Debênture - Aegea Saneamento (AEGP23)	18.779,80	13.309,92	23.934,24	-	-	-	56.023,96
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)	-	-	-	48.301,45
Debênture - JSL (JMLB5)	1.228,56	40.953,22	14.204,07	-	-	-	56.385,85
Debênture - Light (LIGHD7)	67.535,97	59.000,31	71.137,11	-	-	-	197.673,39
Debênture - Localiza (LORTA7)	(14.175,11)	28.029,32	22.459,22	-	-	-	36.313,43
Debênture - Locamerica (LCAMD1)	7.994,90	26.196,66	15.671,54	-	-	-	49.863,10
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)	-	-	-	(1.662,15)
Debênture - Vix Logística (VIXL35)	6.136,89	-	-	-	-	-	6.136,89
Letra Financeira - Banco ABC	-	4.340,00	18.467,31	-	-	-	22.807,31
Letra Financeira - Banco Bradesco	44.147,08	47.778,55	36.815,21	-	-	-	128.740,84
Letra Financeira - Banco CNH	-	(1.065,16)	4.272,83	-	-	-	3.207,67
Letra Financeira - Banco Industrial	-	(2.686,61)	13.786,39	-	-	-	11.099,78
Letra Financeira - Banco NBC	-	-	7.397,61	-	-	-	7.397,61
Letra Financeira - Banco Panamericano	-	3.600,82	21.881,17	-	-	-	25.481,99
Letra Financeira - Banco Rodobens	-	-	3.157,96	-	-	-	3.157,96
Letra Financeira - Banco Sicredi	-	-	903,69	-	-	-	903,69
Letra Financeira - Banco XP	-	11.050,82	20.781,06	-	-	-	31.831,88
Letra Financeira - BTG Pactual	61.191,56	33.231,50	66.890,67	-	-	-	161.313,73
Letra Financeira - Caixa Econômica Federal	22.553,29	18.869,08	19.924,59	-	-	-	61.346,96
Letra Financeira - Nubank	-	6.535,17	24.549,62	-	-	-	31.084,79
Letra Financeira do Tesouro Nacional	120.825,08	287.907,19	312.685,83	-	-	-	721.418,10
Notas do Tesouro Nacional - Série B	98.102,99	225.728,55	105.765,37	-	-	-	429.596,91
SOMMA Firenze RF CP	405.603,79	314.746,91	330.487,89	-	-	-	1.050.838,59
SOMMA Torino RF CP	212.128,01	163.057,02	186.935,59	-	-	-	562.120,62
Valora Horizon HY FIM CP	21.831,83	21.628,04	2.557,30	-	-	-	46.017,17
RENTA VARIÁVEL	(381.365,80)	110.352,09	(74.265,30)	-	-	-	(345.279,01)
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)	-	-	-	(67.041,64)
SOMMA Fundamental FIA	(241.226,60)	57.385,35	(24.386,21)	-	-	-	(208.227,46)
MULTIMERCADOS	263.711,34	232.824,61	476.071,27	-	-	-	972.607,22
Galápagos Dragon FIC FIM CP	29.047,62	23.294,88	22.919,59	-	-	-	75.262,09
Genoa Capital Radar FIC Multimercado	-	(9.947,43)	39.916,09	-	-	-	29.968,66
IBIUNA Hedge ST FP FIC FIM	(79.853,75)	37.078,79	37.651,08	-	-	-	(5.123,88)

RESULTADOS EM REAIS POR ATIVO NO ANO	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	NO ANO
IBIUNA LS FP FICM	65.482,44	(24.103,76)	(109.144,87)	-	-	-	(67.766,19)
Kapitalo K10 FIC FIM	73.820,14	815,58	76.594,66	-	-	-	151.230,38
KP Crédito Privado FIC FIM	12.446,00	10.505,31	11.042,83	-	-	-	33.994,14
MCA Institucional FIC FIM CP	-	16.638,46	99.446,98	-	-	-	116.085,44
OAKTREE Global Credit IE FIM	54.531,35	30.490,42	61.218,97	-	-	-	146.240,74
Open Vista Patrimônio Global IE FIM	15.970,85	12.689,79	55.205,58	-	-	-	83.866,22
SOMMA Institucional FIM	(6.134,38)	26.389,06	20.366,14	-	-	-	40.620,82
SOMMA Positano FIC FIM CP	22.730,01	19.746,81	22.036,53	-	-	-	64.513,35
SOMMA Real Estate FIC FIM	86.763,01	70.777,51	91.481,12	-	-	-	249.021,64
Spx Nimitz Estruturado Fic Multimercado	16.943,12	18.449,19	47.336,57	-	-	-	82.728,88
Vista Hedge Institucional FIC FIM	(28.035,07)	-	-	-	-	-	(28.035,07)
FII/FIP/FIDC	54.349,57	9.887,65	53.008,35	-	-	-	117.245,57
FIDC Credz Sênior 8	54.349,57	9.887,65	53.008,35	-	-	-	117.245,57
DERIVATIVOS	-	-	(106.926,96)	-	-	-	(106.926,96)
Futuros DAP	-	-	(74.471,99)	-	-	-	(74.471,99)
Futuros WIN	-	-	(32.454,97)	-	-	-	(32.454,97)
TOTAL	1.610.182,66	2.003.543,49	1.786.169,49	-	-	-	5.399.895,64

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	0,57	125,38%
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Total	2,22	2,67	83,11%

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
2,62	1,42	1,58	(4,53)	3,20



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
01/03/2024	1.000.000,00	Compra	CDB - Banco BR Partners
01/03/2024	485.534,64	Compra	Letra Financeira - Banco Rodobens
05/03/2024	-2.164.261,30	Resgate	Valora Horizon HY FIM CP
06/03/2024	-988.527,87	Venda	Debênture - Qualicorp Saúde (QUAL16)
06/03/2024	2.085.271,96	Compra	Notas do Tesouro Nacional - Série B
07/03/2024	1.000.000,00	Compra	Letra Financeira - Banco NBC
15/03/2024	-10.843,52	Rendimentos	FIDC Credz Sênior 8
15/03/2024	-107.704,30	Juros	Debênture - JSL (JSMLB5)
15/03/2024	-53.839,16	Juros	Debênture - Locamérica (LCAMD1)
15/03/2024	-67.008,23	Juros	Debênture - Localiza (LORTA7)
15/03/2024	-230.164,05	Correção Monetária	Letra Financeira - Banco Bradesco
15/03/2024	4.194.000,00	Aplicação	MCA Institucional FIC FIM CP
18/03/2024	4.000.000,00	Aplicação	Open Vista Patrimônio Global IE FIM
26/03/2024	5.000.000,00	Aplicação	SOMMA Torino RF CP
26/03/2024	-7.800.000,00	Resgate	SOMMA Firenze RF CP
27/03/2024	-11.822.913,83	Venda	Notas do Tesouro Nacional - Série B
27/03/2024	1.000.000,00	Compra	Letra Financeira - Banco Sicredi
28/03/2024	2.000.000,00	Compra	Letra Financeira - Paraná Banco

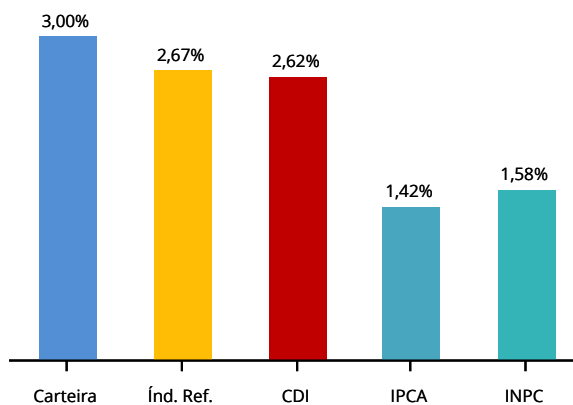
RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES			
DATA	VALOR	OPERAÇÃO	ATIVO

CENÁRIO ECONÔMICO

Economia Internacional: Ainda que março tenha trazido como fator positivo alguma virada de chave para a condução da política monetária dos BCs da Europa, com BCE e BoE adotando posições mais moderadas, as conjunturas de EUA e China prevaleceram para o mercado doméstico. Nos EUA, a reprecificação dos cortes de juros esperados pelo mercado, agora alinhada à projeção do Fed de apenas 3 reduções em 2024, aliada à continuidade de favorecimento dos ativos ligados à tese da Inteligência Artificial adiaram qualquer tentativa de retorno do capital externo ao Brasil. Na China, apesar da leitura de dados de atividade mais positivos, os temores envolvendo o setor imobiliário do país reapareceram, punindo o minério de ferro, commodity essencial da pauta exportadora brasileira.

Economia Brasileira: Destaca-se a atitude do Copom de alterar seu forward guidance, algo avaliado como conservador pelo mercado. Diante das incertezas sobre como o Fed realizará seus cortes de juros e o desconforto com a dinâmica da inflação de serviços doméstica, o Copom optou por adquirir grau adicional de liberdade para a condução de sua política monetária. Ademais, embora o agregado de notícias macroeconômicas tenha sido, grosso modo, mais favorável, pesou negativamente a influência do governo na dinâmica de empresas estatais, a exemplo do noticiário em torno da Petrobras. Aliás, a própria melhora da arrecadação poderá fomentar pressões por alta dos gastos públicos, em meio à queda da popularidade do presidente da República.

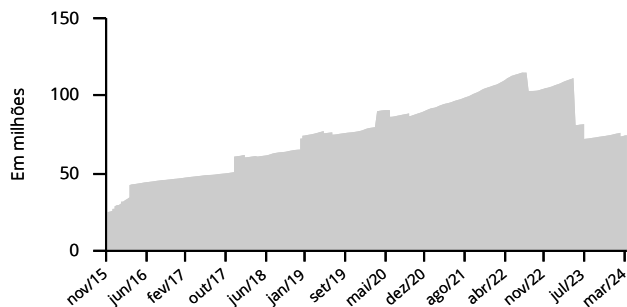
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE NO ANO



Mês	Abr-23	Mai-23	Jun-23	Jul-23	Ago-23	Set-23	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24	Fev-24	Mar-24	ANO	12 Meses	24 Meses
SOMMA Jusprev ALM CP	0,93	1,03	0,50	0,48	0,72	0,68	0,69	0,67	0,86	1,01	0,98	0,98	3,00	9,94	22,45
Índ. Ref.	0,84	0,73	0,26	0,27	0,59	0,45	0,48	0,44	0,89	0,94	1,13	0,57	2,67	7,85	17,45
CDI	0,92	1,12	1,07	1,07	1,14	0,97	1,00	0,92	0,90	0,97	0,80	0,83	2,62	12,36	27,28
IPCA	0,61	0,23	(0,08)	0,12	0,23	0,26	0,24	0,28	0,56	0,42	0,83	0,16	1,42	3,93	8,76

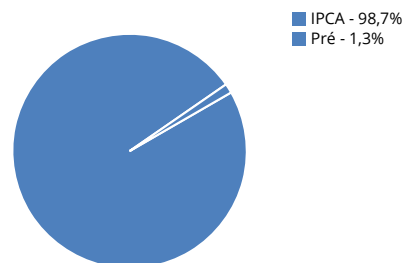
Índice de Referência INPC + 4.35% a.a.

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

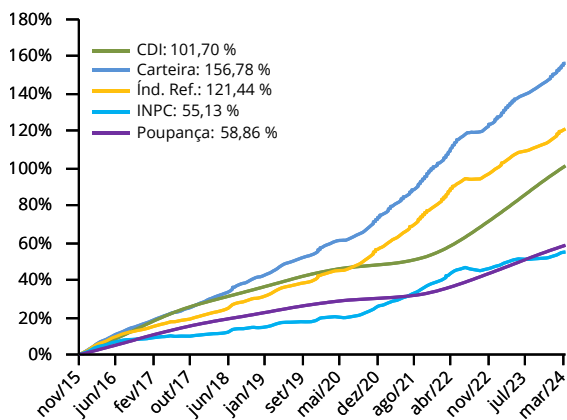


DISTRIBUIÇÃO POR FATOR DE RISCO

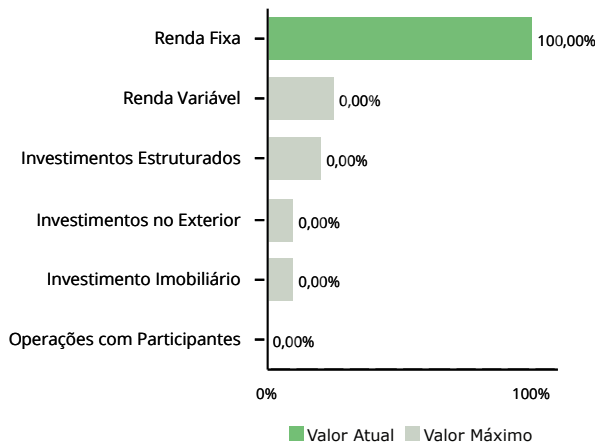
Patrimônio Líquido R\$ 74.693.189,49



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE ACUMULADA



POLÍTICA DE INVESTIMENTO





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



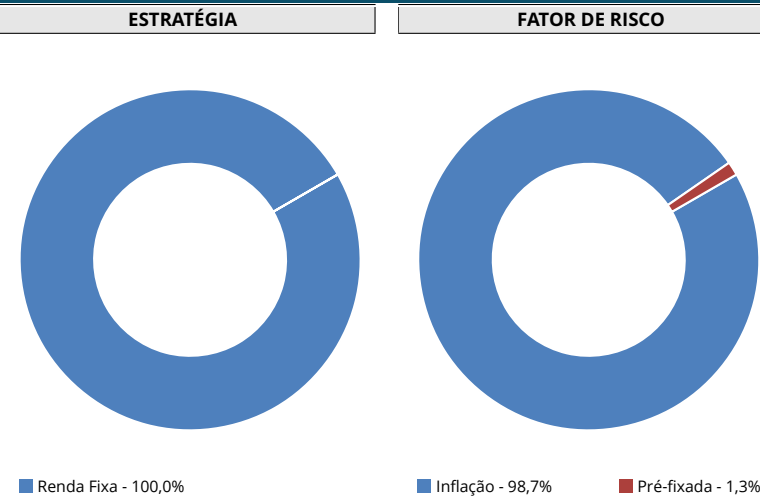
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

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

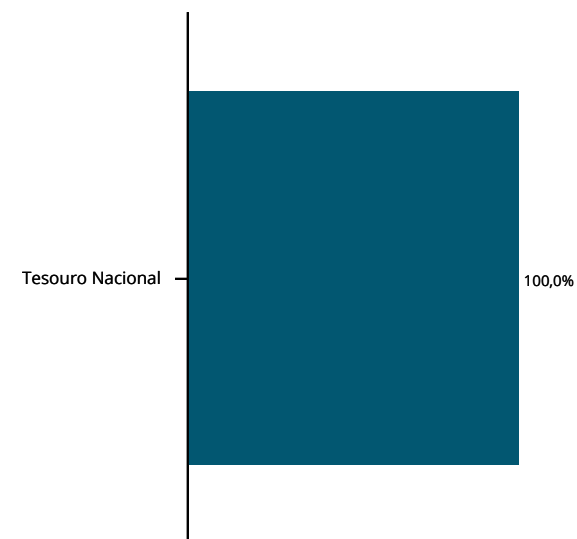


ATIVOS	MARÇO-24	%	FEVEREIRO-24	%
RENDA FIXA	74.705.818,15	100,0%	73.988.212,51	100,0%
Compromissada - Títulos Públicos	967.836,61	1,3%	973.463,47	1,3%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	73.737.981,54	98,7%	73.014.749,04	98,7%
TESOURARIA	(12.628,66)	0,0%	(16.769,12)	0,0%
Caixa	1.000,00	0,0%	1.000,00	0,0%
Valores a Pagar/Receber	(13.628,66)	0,0%	(17.769,12)	0,0%
TOTAL DA CARTEIRA	74.693.189,49	100%	73.971.443,39	100%

GRÁFICOS DE DISTRIBUIÇÃO



INSTITUIÇÃO²



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

²Não estão inclusas ações e opções

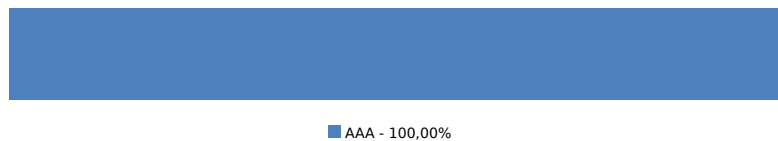
RENDA FIXA									
Ativo - Emissor	Marcação	Data Aplicação	Data Vencimento	Indexador	Valor Aplicado	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% s/ PL
Compromissada - Títulos Públicos	Mercado	28/03/2024	01/04/2024	10,64% a.a.	967.836,61	967.836,61	-	967.836,61	1,30%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,29%	1.058.426,68	1.628.959,44	-	1.628.959,44	2,18%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,29%	172.302,01	265.179,43	-	265.179,43	0,36%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	30/12/2015	15/05/2045	IPCA + 7,33%	947.095,85	1.508.608,91	-	1.508.608,91	2,02%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/11/2017	15/05/2035	IPCA + 5,29%	9.842.760,14	13.800.693,66	-	13.800.693,66	18,48%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	19/06/2018	15/05/2055	IPCA + 5,92%	1.261.769,06	1.764.007,26	-	1.764.007,26	2,36%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	24/12/2018	15/08/2024	IPCA + 4,47%	1.348.172,69	1.678.769,98	-	1.678.769,98	2,25%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	31/05/2017	15/08/2026	IPCA + 5,65%	1.493.159,87	2.061.730,55	-	2.061.730,55	2,76%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	22/08/2018	15/08/2030	IPCA + 5,65%	2.048.893,74	2.762.918,48	-	2.762.918,48	3,70%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/11/2015	15/05/2035	IPCA + 7,01%	5.062.404,62	8.075.014,39	-	8.075.014,39	10,81%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	14/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,32%	241.312,77	394.577,87	-	394.577,87	0,53%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,45%	860.308,17	1.406.900,95	-	1.406.900,95	1,88%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,35%	121.192,13	196.873,73	-	196.873,73	0,26%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/12/2015	15/05/2035	IPCA + 7,55%	474.768,52	775.809,28	-	775.809,28	1,04%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	13/01/2016	15/05/2035	IPCA + 7,35%	549.253,50	885.768,33	-	885.768,33	1,19%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	11/02/2016	15/05/2035	IPCA + 7,41%	1.703.916,03	2.704.558,95	-	2.704.558,95	3,62%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	29/03/2016	15/05/2055	IPCA + 6,39%	4.095.944,22	6.136.638,03	-	6.136.638,03	8,22%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	28/08/2020	15/08/2050	IPCA + 4,01%	1.114.803,90	1.410.794,05	-	1.410.794,05	1,89%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	21/08/2020	15/08/2050	IPCA + 3,91%	1.130.879,32	1.431.471,02	-	1.431.471,02	1,92%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	16/03/2020	15/08/2050	IPCA + 4,46%	10.007.893,59	12.696.534,19	-	12.696.534,19	17,00%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/01/2019	15/08/2050	IPCA + 4,61%	2.378.295,32	3.107.979,44	-	3.107.979,44	4,16%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	16/03/2016	15/08/2050	IPCA + 6,83%	1.153.894,05	1.745.547,93	-	1.745.547,93	2,34%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	15/01/2019	15/05/2045	IPCA + 4,63%	1.922.501,16	2.562.775,95	-	2.562.775,95	3,43%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	02/01/2019	15/05/2045	IPCA + 4,99%	2.093.975,28	2.815.562,41	-	2.815.562,41	3,77%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	24/12/2018	15/05/2045	IPCA + 5,03%	1.340.943,59	1.806.658,99	-	1.806.658,99	2,42%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	Curva	01/03/2016	15/05/2045	IPCA + 7,29%	73.843,71	113.648,32	-	113.648,32	0,15%
TOTAL						74.705.818,15	-	74.705.818,15	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%	

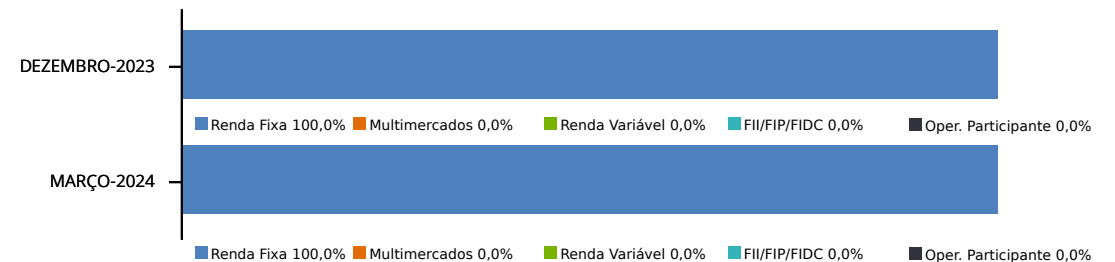
RATINGS ESCALA NACIONAL DE LONGO PRAZO ¹			
INSTITUIÇÃO/ATIVO	MÁXIMO	ATUAL	AGÊNCIAS DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO
Segurança Máxima (AAA)	100,00%	100,00%	FITCH MOODY'S S&P AUSTIN
Tesouro Nacional	100,00%	100,00%	- - brAAA -

LEGENDA
Nota elevada
Nota rebaixada

RATING DOS ATIVOS



MUTAÇÃO DE INVESTIMENTOS



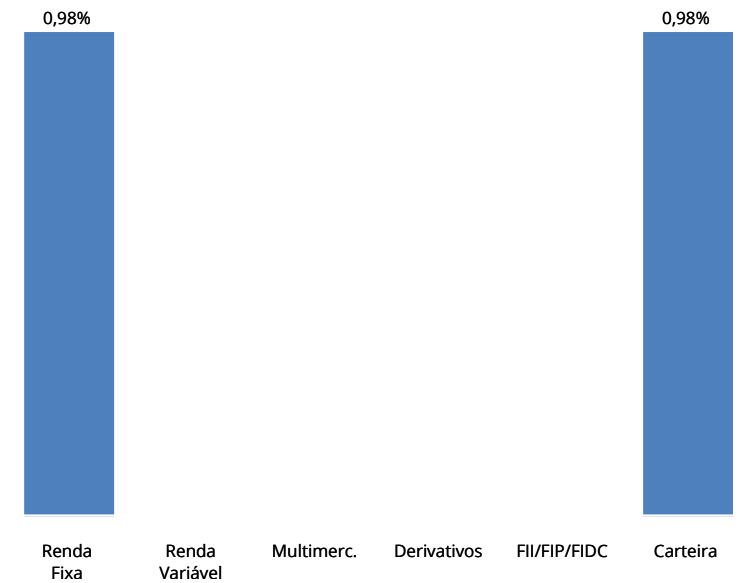
¹Engloba Tesouro Nacional, Bancos, FIDCs e Debêntures

RENTABILIDADE	NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES	
	%	% Bench	%	% Bench	%	% Bench
Renda Fixa						
Compromissada - Títulos Públicos	0,83	157,4%	2,62	99,6%	12,35	158,3%
Notas do Tesouro Nacional - Série B	0,99	187,2%	3,04	115,6%	10,01	128,3%

RENTABILIDADE INDICADORES	NO MÊS %	NO ANO %	EM 12 MESES %
Índ. Ref. (INPC + 4.35% a.a.)	0,53	2,63	7,80
Renda Fixa (INPC + 4.35% a.a.)	0,53	2,63	7,80
Op. com Participante (0% CDI)	0,00	0,00	0,00
CDI	0,83	2,62	12,36
IPCA	0,16	1,42	3,93
INPC	0,19	1,58	3,40
Ibovespa	-0,71	-4,53	25,74
Dólar	0,26	3,20	-1,66

SEGMENTO	%	%	%
Renda Fixa	0,97	2,99	10,12
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

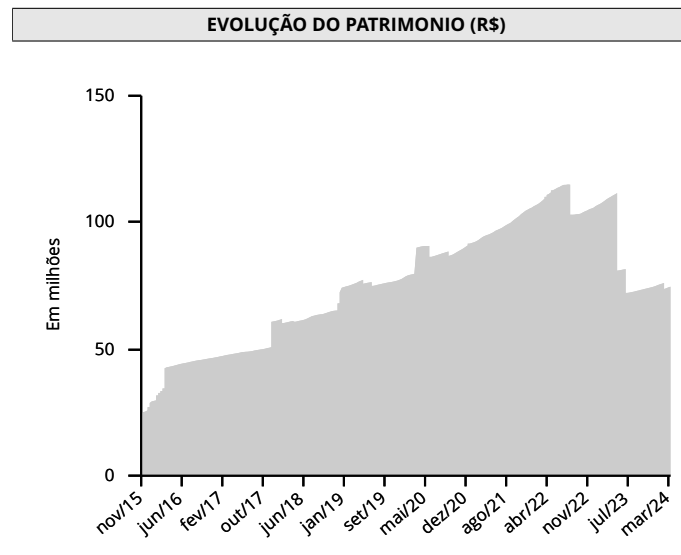
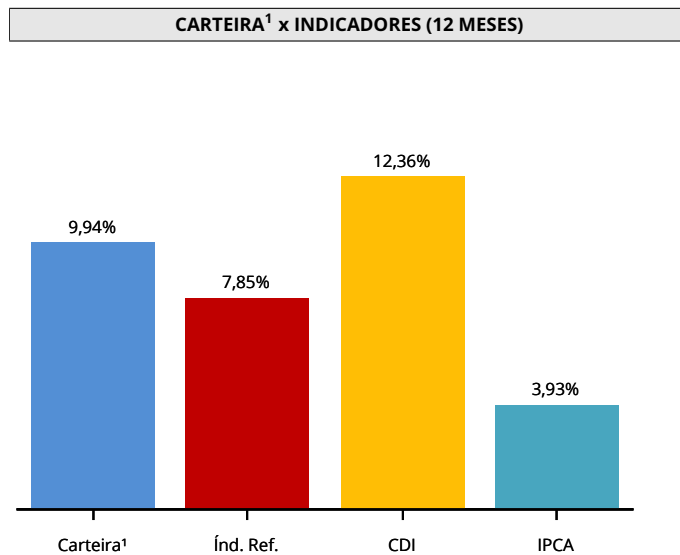
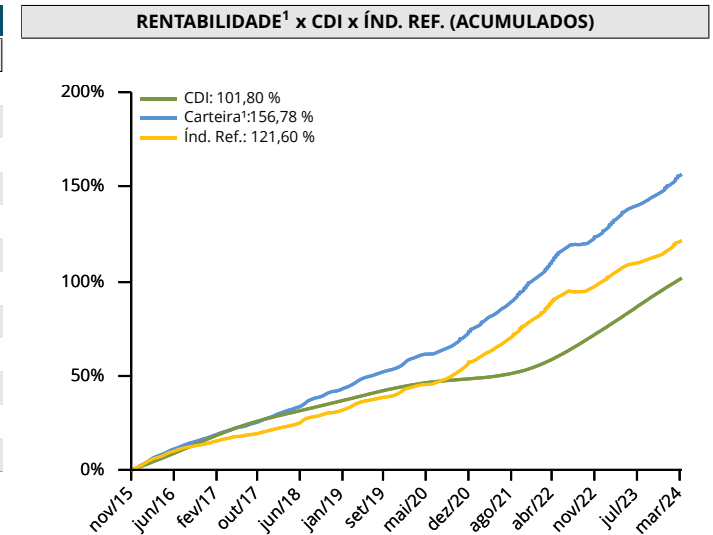
COMPOSIÇÃO DA RENTABILIDADE POR ESTRATÉGIA



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	-	-	-	2.241.648,07
Compromissada - Títulos Públicos	26.655,58	19.867,96	8.046,61	-	-	-	54.570,15
Notas do Tesouro Nacional - Série B	738.259,10	725.586,32	723.232,50	-	-	-	2.187.077,92
TOTAL	764.914,68	745.454,28	731.279,11	-	-	-	2.241.648,07

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	0,57	171,39%
Abril			
Mai			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Total	3,00	2,67	112,17%

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
2,62	1,42	1,58	(4,53)	3,20



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

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%

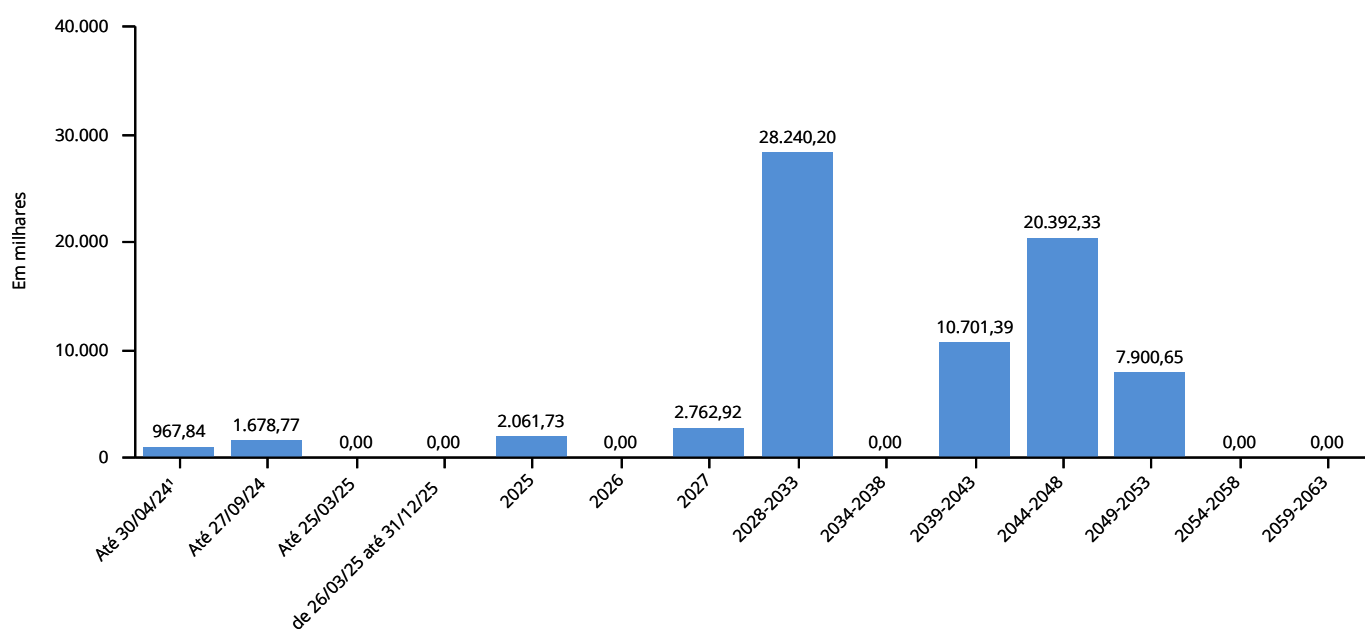
2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Acumulado
Rent. Bruta	1,30%	0,76%	1,67%	0,94%	0,98%	1,20%	1,15%	1,30%	1,58%	1,43%	1,63%	1,28%	16,33%
Rent. Líquida	1,30%	0,76%	1,67%	0,94%	0,98%	1,20%	1,15%	1,30%	1,58%	1,43%	1,63%	1,28%	16,33%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,30%	0,36%	0,42%	0,44%	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%										3,00%
Rent. Líquida	1,01%	0,98%	0,98%										3,00%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%										2,62%
Índice Ref.	0,94%	1,13%	0,53%										2,63%

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

Março 2024

Cenário

Quando o Fed irá iniciar o ciclo de corte de juros foi o questionamento que ditou o comportamento do mercado no primeiro trimestre de 2024. As leituras finais de inflação nos EUA foram superiores às feitas no segundo semestre de 2023 e incondizentes com uma postura mais frouxa por parte do banco central norte-americano. Entretanto, uma análise mais profunda dos dados releva que é possível que tenham sido apenas ruídos no cenário geral de desinflação, com questões técnicas dificultando a interpretação econômica.

Na visão do Fed, os dados de janeiro e fevereiro não adicionaram confiança no cenário construído ao fim do ano passado, mas também não a reduziram. Será necessário mais tempo e novas leituras de inflação para confirmar se a trajetória de desinflação seguirá ou será revertida. No momento atual do ciclo, as sinalizações têm sido reduzidas e há uma maior dependência dos dados para as próximas decisões.

Nesse sentido, a atenção dos mercados no mês de abril se voltará para os dados dos Índices de Preços ao Consumidor e ao Produtor. Quanto à atividade econômica, o Fed parece mais disposto a adotar a tese do choque de oferta positivo, que permite a continuidade da resiliência econômica concomitante ao rebalanceamento do mercado de trabalho e à queda da inflação.

No Brasil, o cenário base do Banco Central não mudou, mas a incerteza aumentou. Além da dinâmica pior de inflação na margem, a atividade econômica continua surpreendendo positivamente. As expectativas de PIB dos agentes de mercado medidas pelo Focus subiu de 1,5% no início do ano para 1,9% atualmente. Diferente do Fed, o BC se preocupa com os impactos da abertura do hiato sobre a inflação.

Diante do cenário mais incerto, a autoridade monetária aumentou seu grau de flexibilidade ao indicar a magnitude da redução de juros apenas para reunião seguinte e não para as próximas duas, como vinha fazendo. A preocupação com a inflação de serviços, especialmente os mais intensivos em trabalho, e a postergação do início de cortes nos EUA são os principais empecilhos para continuidade do ciclo pelo Banco Central.

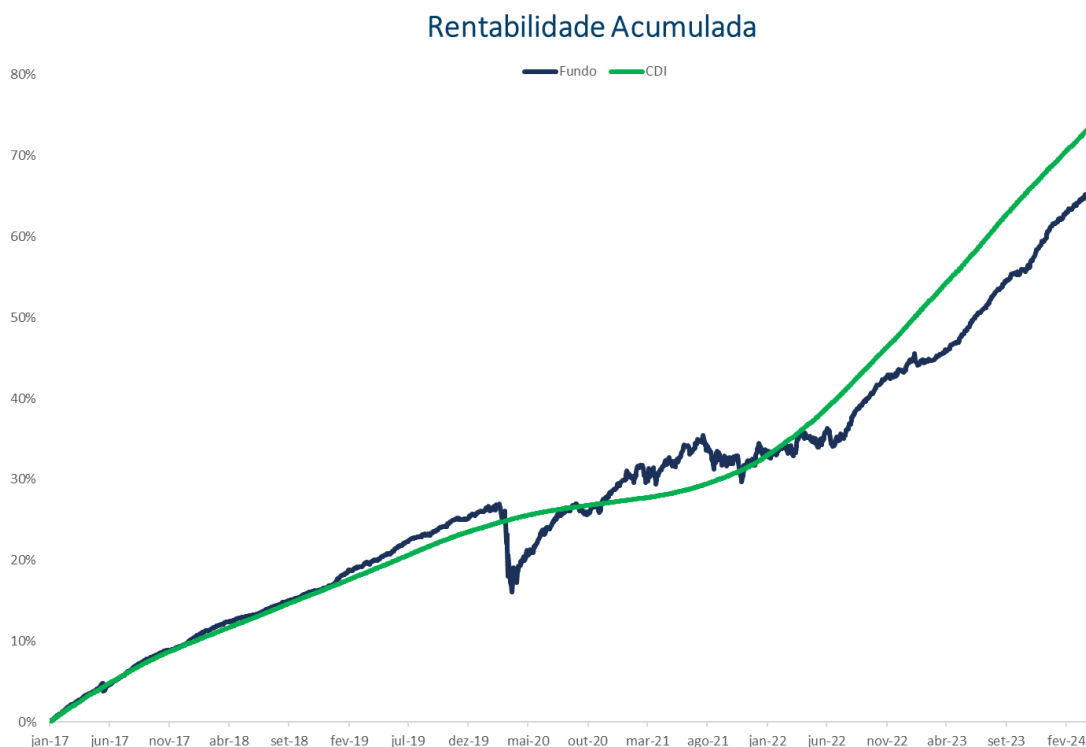
Na China, a meta de crescimento foi definida em 5% para 2024 em um dos eventos mais esperados do ano. O Congresso Nacional do Povo trouxe surpresas marginalmente positivas, com medidas para melhorar o financiamento dos governos locais diante da escassez de recursos angariados com a venda de terrenos. A trajetória de desalavancagem da segunda maior economia do mundo continua, sem sinais por parte do governo de mudanças de direcionamento no setor imobiliário, principal motor econômico do país. A falta de demanda do setor tem afetado a demanda por aço e, conseqüentemente, minério de ferro, levando a uma forte depreciação da commodity no ano.

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%										2,43%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%										2,62%
INPC + 4,35%	0,94%	1,13%	0,53%										2,63%
Bench 2024	0,79%	0,94%	0,87%										2,61%

Rentabilidade acumulada



Performance Individuais

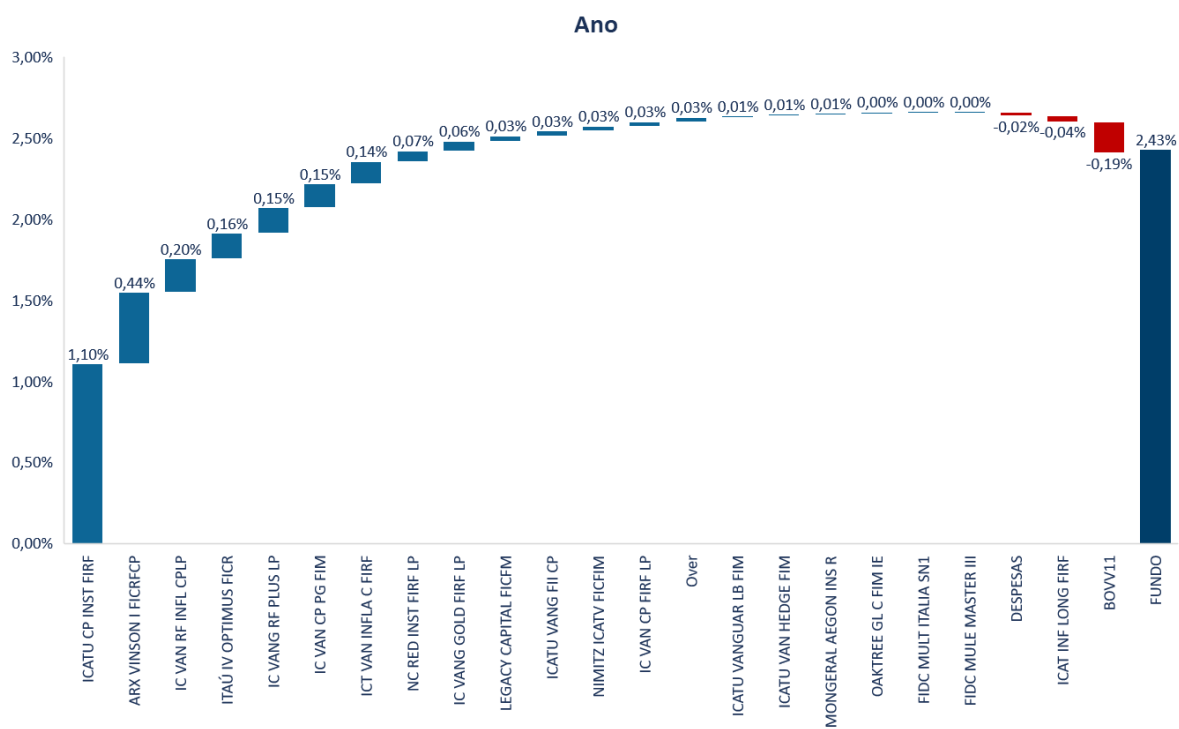
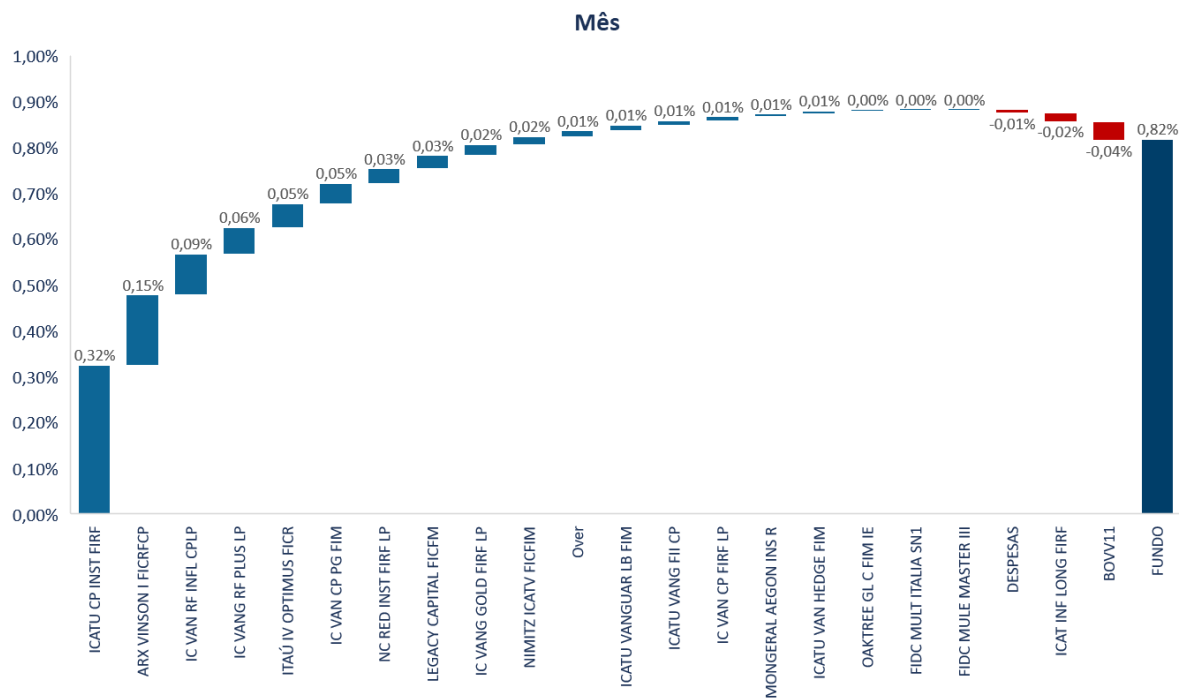
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2024
Icatu Vanguarda Gold FI RF LP	0,99%	0,81%	0,86%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,69%
Icatu Vanguarda Renda Fixa Plus	1,17%	0,83%	0,90%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,92%
Icatu Vanguarda Crédito Privado FI RF LP	1,51%	0,86%	1,09%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,51%
Mag Renda Fixa Fundo De Investimento	1,04%	0,85%	0,91%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,83%
Icatu Vanguarda CP Institucional FIRF	1,62%	1,10%	1,13%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,90%
Nc Red Institucional FIRF	0,67%	0,33%	0,63%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,64%
Icatu Vanguarda PG FIM CP	1,78%	1,08%	1,17%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4,09%
Arx Vinson FIC FIRF CP	1,23%	0,94%	1,16%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,37%
Itaú Iv Optimus RF LP Ficf	0,88%	0,68%	0,95%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,53%
Legacy Capital FICFI MM	0,46%	-0,40%	1,22%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,28%
Nimitz IV FIC FIM	0,32%	0,41%	1,31%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,05%
Icatu Vanguarda Hedge FIM	0,80%	-0,75%	0,11%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,16%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,62%
Icatu Vanguarda Inflação CP FIRF LP	1,23%	0,89%	0,91%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,06%
IMAB-5	0,68%	0,59%	0,77%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,06%
Icatu Vanguarda Inflação Longa FIRF	-1,49%	0,47%	-0,57%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-1,60%
IMAB-5+	-1,47%	0,51%	-0,55%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-1,51%
Icatu Vanguarda Imobiliário FIM CP	1,02%	0,66%	0,53%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,23%
IFIX	0,66%	0,81%	1,43%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,93%
BOVV11	-4,80%	1,04%	-0,84%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-4,61%
Icatu Vanguarda Long Biased FIM	-0,96%	0,89%	1,32%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,24%
IBOV	-4,79%	0,99%	-0,71%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-4,53%
IBX	-4,51%	0,96%	-0,73%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-4,29%
Oaktree Global Credit Brl FI MM Ie	1,13%	0,63%	1,25%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,04%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,62%

Alocação

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

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

P&L



Movimentações

Fundo	Classe Fundo			Data	% Fin.	Data Cotização (Resgates)	Data Liquidação (Resgates)
	CDI	Inflação	Estruturado				
BOVV11			243.622,90	05/03/2024	0,32%	-	-
BOVV11			192.449,87	11/03/2024	0,08%	-	-
BOVV11			-105.105,00	12/03/2024	-0,04%	12/03/2024	14/03/2024
Itaú Iv Optimus RF LP FICFI	-6.265.000,00			15/03/2024	-2,62%	15/03/2024	18/03/2024
Icatu Vanguarda Gold FI RF LP	-6.515.000,00			15/03/2024	-2,73%	15/03/2024	15/03/2024
Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF LP		4.785.000,00		15/03/2024	2,00%	-	-
Nc RF Red Institucional FI LP	5.330.000,00			15/03/2024	2,23%	-	-
Icatu Vanguarda Gold FI RF LP	6.515.000,00			18/03/2024	2,72%	-	-
Nc RF Red Institucional FI LP	935.000,00			18/03/2024	0,39%	-	-
Icatu Vanguarda RF FI Plus LP	-8.765.000,00			21/03/2024	-3,66%	21/03/2024	22/03/2024
BOVV11			165.500,89	22/03/2024	0,07%	-	-
Mag RF FI	8.972.500,00			22/03/2024	3,75%	-	-
Icatu Vanguarda RF FI Plus LP	-3.015.000,00			25/03/2024	-1,26%	25/03/2024	26/03/2024
Oaktree Global Credit FI MM IE			6.460.000,00	25/03/2024	2,70%	-	-
Icatu Vanguarda Gold FI RF LP	-4.954.000,00			25/03/2024	-2,07%	25/03/2024	25/03/2024
Icatu Vanguarda Gold FI RF LP	2.640.000,00			26/03/2024	1,10%	-	-
Icatu Vanguarda Hedge FI MM			-6.585.000,00	27/03/2024	-2,74%	28/03/2024	01/04/2024
Icatu Vanguarda Gold FI RF LP	-1.200.000,00			28/03/2024	-0,50%	28/03/2024	28/03/2024
Mag RF FI	-7.200.000,00			28/03/2024	-3,00%	28/03/2024	28/03/2024
Icatu Vanguarda Créd Priv Pg FI MM			8.160.000,00	28/03/2024	3,40%	-	-