

CERTIFICADO DE APROVAÇÃO

PROFISSIONAL CERTIFICADO PELO INSTITUTO TOTUM

O Instituto Totum de Desenvolvimento e Gestão Empresarial Ltda. certifica que

THAYNARA MARCONDES COVRE

foi aprovado na Certificação Profissional da Secretaria da Previdência - SPREV, tendo seguido integralmente todos os requisitos presentes no Edital da Certificação.

Tipo de Certificação:

Certificação do responsável pela gestão dos recursos e membros do comitê de investimentos do RPPS

Nível: Básico (CP RPPS CGINV I)

Modalidade de Certificação: Aprovação prévia em exame por prova e títulos

Data de Aprovação: 03/01/2024

Número da Certificação: 293137113042801

Data de Validade: 03/01/2028

Data de Conclusão: 28/12/2023



CARACTERÍSTICAS

O PLURAL DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES, doravante denominado FUNDO, constituído sob a forma de condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração, regido pelo presente regulamento, pela Instrução CVM nº 555, de 06 de novembro de 2018 (ICVM 555/14), suas posteriores alterações e demais disposições legais e regulamentares que lhe forem aplicáveis.

OBJETIVO DO FUNDO

O objetivo do FUNDO é, a longo prazo, buscar a valorização dos capitais investidos pelos cotistas, observadas as regras legais e regulamentares em vigor, mediante de aplicação de recursos em carteira diversificada de títulos e valores mobiliários, predominantemente em ações de companhias com grande potencial de pagamento de dividendos e/ou crescimento a médio e longo prazos, dentro de sua atividade principal, as quais possuem gestão confiável, selecionadas através de análise fundamentalista.

PÚBLICO ALVO

O FUNDO é destinado a investidores em geral, assim definidos na regulamentação em vigor da Comissão de Valores Mobiliários (CVM), doravante denominados Cotista, que busquem o objetivo de investimento, conheçam e aceitem assumir os riscos, descritos no Regulamento. A GESTORA observará as vedações descritas na legislação nacional vigente que regulamenta os investimentos das Entidades Fechadas de Previdência Complementar ("EFPC") e os Regimes Próprios de Previdência Social ("RPPS"), cabendo ao Cotista o controle e consolidação dos limites de alocação e concentração das posições consolidadas dos recursos dos planos previdenciários por ele instituídos aos limites estabelecidos pela regulamentação aplicável ao Cotista.

POLÍTICA DE INVESTIMENTO

De acordo com seu objetivo de investimento, o FUNDO possui compromisso de concentração em renda variável índices de ações, podendo incorrer também os seguintes fatores de risco: taxa de juros pós-fixadas, taxa de juros pré-fixadas, índices de preço, variação cambial e derivativos.

CLASSIFICAÇÃO ANBIMA

Ações Dividendos.

ADMINISTRADOR

BEM - Distribuidora de Título e Valores Mobiliários LTDA.

GESTOR

Plural Investimentos Gestão de Recursos LTDA.

CUSTODIANTE

Banco Bradesco S.A.

AUDITOR

KPMG Auditores Independentes.

MOVIMENTAÇÕES

Aplicação: Aquisição D+0 e conversão no primeiro dia, subsequente (D+1).
Aplicação Inicial: R\$ 100,00.
Movimentação Mínima: R\$ 100,00.
Saldo Mínimo: R\$ 100,00.
Horário: 9:00 às 14:00.

RESGATES

Cotização D+1 e pagamento em D+2 da cotização.

CONVERSÃO DE COTAS

Na aplicação, o número de cotas compradas será calculado de acordo com o valor das cotas no fechamento do próximo dia útil contado da data da aplicação, observado o horário para aplicação.

No resgate, o número de cotas canceladas será calculado de acordo com o valor das cotas no fechamento do próximo dia útil contado da data do pedido de resgate, observado o horário para resgate.

DADOS PARA APLICAÇÃO

Banco Bradesco S.A. - 237.
Agência: 2856 / Conta: 27587-5.
Favorecido: Plural Dividendos Fundo de Investimento em Ações.
CNPJ: 11.898.280/0001-13.

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

2,00% do Patrimônio Líquido ao ano.

TAXA DE CUSTÓDIA

Máximo de 0,065% do Patrimônio Líquido ao ano.

TAXA DE ENTRADA

Não há.

TAXA DE SAÍDA

Não há.

TAXA DE PERFORMANCE

20% do que exceder 100% da variação do Ibovespa a.a., paga semestralmente.

TRIBUTAÇÃO

Os cotistas do FUNDO serão tributados pelo imposto de renda na fonte à alíquota de 15% (quinze por cento) quando do resgate das cotas, nos termos da legislação em vigor. O disposto acima não se aplica aos Cotistas sujeitos a regras de tributação específicas, na forma da legislação em vigor.

RENTABILIDADES (%)

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.*
2023	Fundo	3,83%	-5,52%	-1,48%	2,79%	2,85%	7,69%	1,67%	-3,11%	0,84%	-1,90%	10,94%	4,21%	23,96%	191,83%
	Ibov	3,37%	-7,49%	-2,91%	2,50%	3,74%	9,00%	3,27%	-5,09%	0,71%	-2,94%	12,54%	5,38%	22,28%	91,07%
2022	Fundo	8,23%	1,80%	5,24%	-5,50%	4,69%	-6,84%	4,60%	5,55%	0,47%	5,87%	-3,49%	-1,85%	18,87%	135,43%
	Ibov	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%	6,16%	0,47%	5,45%	-3,06%	-2,45%	4,69%	56,25%
2021	Fundo	-3,85%	-5,15%	6,93%	1,45%	5,07%	-1,63%	-4,14%	-1,49%	-5,51%	-2,74%	-0,07%	2,02%	-9,53%	98,06%
	Ibov	-3,32%	-4,37%	6,00%	1,94%	6,16%	0,46%	-3,94%	-2,48%	-6,57%	-6,74%	-1,53%	2,85%	-11,93%	49,26%
2020	Fundo	-0,35%	-7,41%	-26,93%	6,09%	6,45%	7,11%	7,57%	-6,51%	-4,69%	-0,94%	14,65%	8,83%	-3,38%	118,92%
	Ibov	-1,63%	-8,43%	-29,90%	10,25%	8,57%	8,76%	8,27%	-3,44%	-4,80%	-0,69%	15,90%	9,30%	2,92%	69,47%
2019	Fundo	11,04%	-1,25%	-0,04%	2,67%	3,35%	3,57%	0,84%	0,50%	0,27%	2,03%	0,48%	8,08%	35,64%	126,58%
	Ibov	10,82%	-1,86%	-0,18%	0,98%	0,70%	4,06%	0,84%	-0,67%	3,57%	2,36%	0,95%	6,85%	31,58%	64,67%
2018	Fundo	5,37%	1,82%	-1,76%	-1,96%	-9,61%	-3,14%	4,81%	-5,10%	3,30%	10,16%	3,04%	0,92%	6,48%	67,05%
	Ibov	11,14%	0,52%	0,01%	0,88%	-10,87%	-5,20%	8,88%	-3,21%	3,48%	10,19%	2,38%	-1,81%	15,03%	25,14%
2017	Fundo	4,08%	0,45%	-0,44%	-1,00%	-5,51%	1,44%	3,78%	2,49%	2,38%	0,96%	-7,47%	2,81%	3,29%	56,88%
	Ibov	7,38%	3,08%	-2,52%	0,64%	-4,12%	0,30%	4,80%	7,46%	4,88%	0,02%	-3,15%	6,16%	26,86%	8,79%
2016	Fundo	-7,02%	2,20%	-5,27%	3,23%	-7,83%	6,21%	11,01%	2,95%	0,88%	10,36%	-10,79%	5,13%	8,56%	51,87%
	Ibov	-6,79%	5,91%	16,97%	7,70%	-10,09%	6,30%	11,22%	1,03%	0,80%	11,23%	-4,65%	-2,71%	38,94%	-14,24%
2015	Fundo	-10,79%	2,35%	3,02%	6,89%	-4,06%	1,93%	1,49%	-6,47%	2,86%	-0,08%	3,01%	-0,32%	-1,52%	39,90%
	Ibov	-6,20%	9,97%	-0,84%	9,93%	-6,17%	0,61%	-4,17%	-8,33%	-3,36%	1,80%	-1,63%	-3,93%	-13,31%	-38,27%
2014	Fundo	-7,43%	1,75%	5,80%	0,40%	6,09%	5,84%	0,68%	2,82%	-6,32%	-0,32%	2,67%	-4,89%	6,03%	42,06%
	Ibov	-7,51%	-1,14%	7,05%	2,40%	-0,75%	3,76%	5,00%	9,78%	-11,70%	0,95%	0,18%	-8,62%	-2,91%	-28,79%
2013	Fundo	-2,44%	-1,23%	0,25%	-1,72%	1,23%	-5,49%	2,48%	3,14%	3,07%	4,66%	6,06%	-0,24%	9,57%	33,98%
	Ibov	-1,95%	-3,91%	-1,87%	-0,78%	-4,30%	-11,31%	1,64%	3,68%	4,65%	3,66%	-3,27%	-1,86%	-15,50%	-26,66%
2012	Fundo	5,98%	7,50%	-1,20%	-2,07%	-8,01%	-4,03%	2,65%	6,74%	4,76%	2,14%	6,29%	5,16%	27,51%	22,28%
	Ibov	11,13%	4,34%	-1,98%	-4,17%	-11,86%	-0,25%	3,21%	1,72%	3,70%	-3,56%	0,71%	6,05%	7,40%	-13,21%
2011	Fundo	-3,79%	-2,23%	1,75%	1,60%	1,19%	-1,50%	-6,36%	-3,40%	-0,49%	8,97%	-3,05%	1,74%	-6,22%	-4,10%
	Ibov	-3,94%	1,22%	1,79%	-3,58%	-2,29%	-3,43%	-5,74%	-3,96%	-7,38%	11,49%	-2,51%	-0,21%	-18,11%	-19,19%
2010	Fundo										1,87%	0,31%	0,07%	2,26%	2,26%
	Ibov										0,63%	-4,20%	2,36%	-1,32%	-1,32%

* Data de início do fundo: 01/10/2010

PERFORMANCE ACUMULADA

	Fundo	Ibovespa	IBRX
No Mês	4,21%	5,38%	5,48%
No Ano	23,96%	22,28%	21,27%
12 Meses	23,96%	22,28%	21,27%

	Mês	Ano	Início
Excesso de Retorno	-1,18%	1,67%	100,76%

CONCENTRAÇÃO DA CARTEIRA

	# Posições	Top 5	Top 10	Top 15
No Mês	20	17,81%	46,73%	78,70%

RISCO

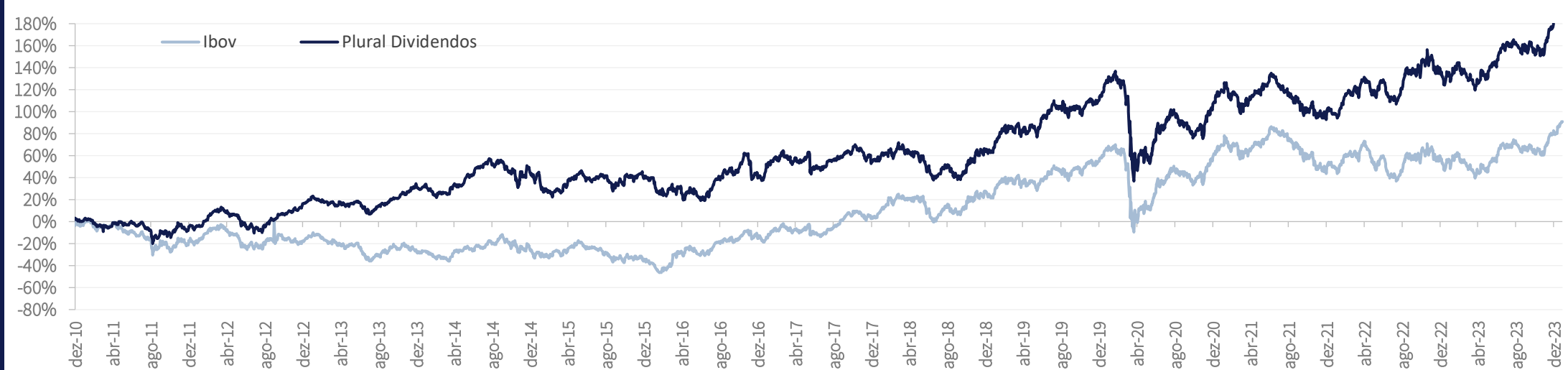
	Mês
Stress Test	-8,66%
Var (97,5%)	1,77%
Beta (Ibov)	0,71

ESTATÍSTICAS

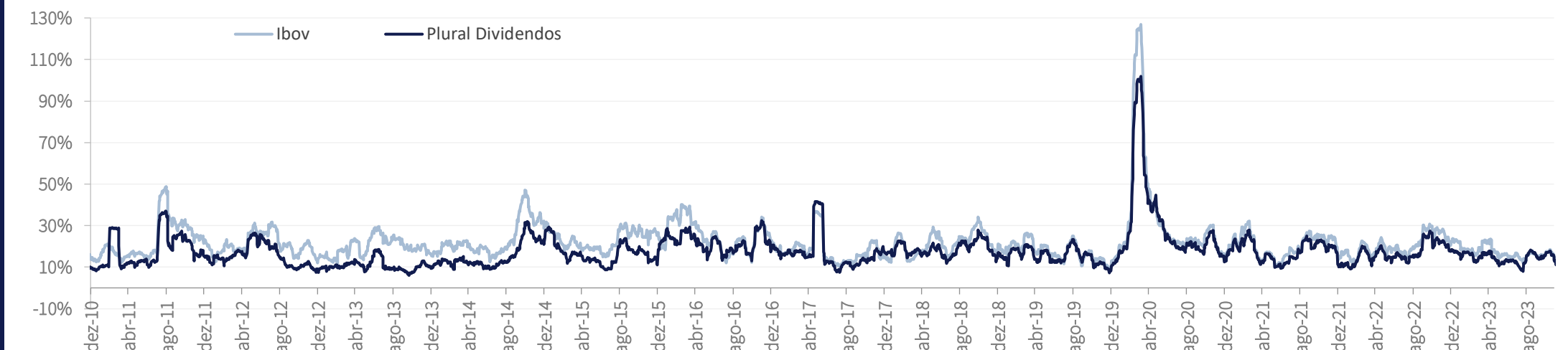
	Fundo	Ibov
Volatil. Anualizada	9,29%	12,91%
Sharpe Anualizado	0,53	0,09
Maior Retorno Mês	14,65%	16,97%
Menor Retorno Mês	-26,93%	-29,90%
% Meses Positivos	61,01%	55,35%
% Meses Negativos	38,99%	44,65%

Patrimônio Atual	209.068.993,89
Patri. Médio 12m	122.348.705,88

EVOLUÇÃO DESEMPENHO



VOLATILIDADES ANUALIZADAS (21 DIAS)

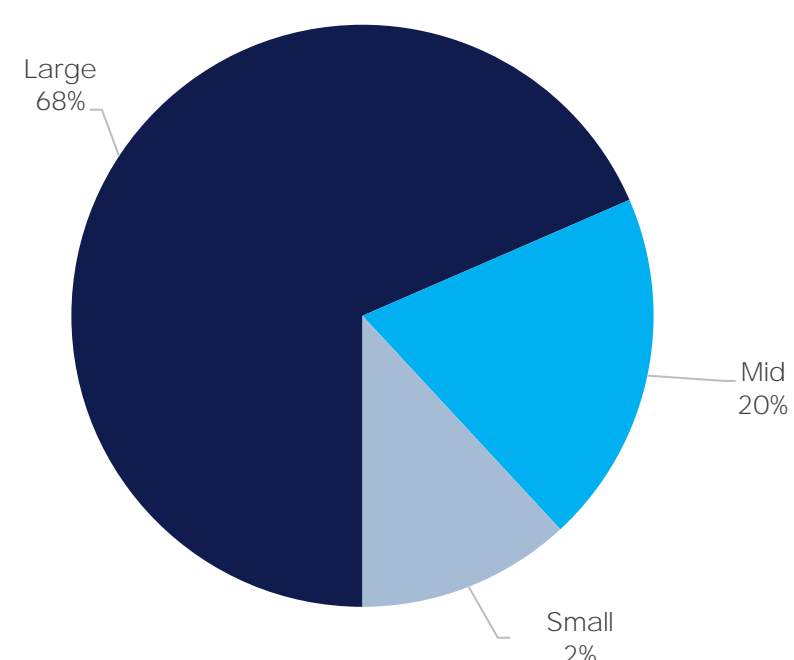


Plural Investimentos Gestão de Recursos Ltda.
Av. Brigadeiro Faria Lima, 3400 - 8º andar
São Paulo - SP - CEP 04538-132
Tel: (55 11) 2137-8888 / Fax: (55 11) 3524-8927
Site: www.pluralgestao.com

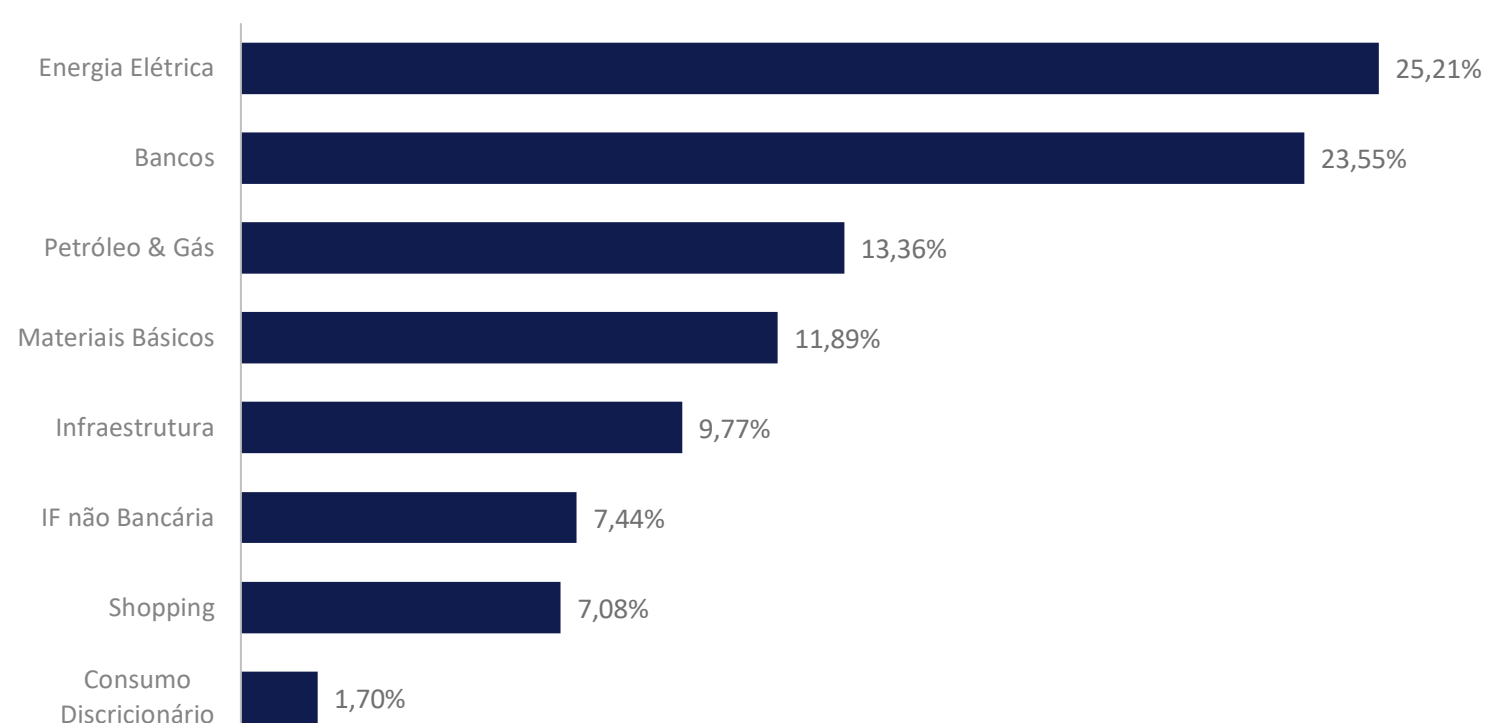
ATRIBUIÇÃO DE DESEMPENHO POR SETOR

Setores	Mês	Ano
Bancos	1,29%	9,36%
Energia Elétrica	0,66%	6,27%
Materiais Básicos	0,56%	1,04%
IF não Bancária	0,49%	1,24%
Petróleo & Gás	0,33%	4,14%
Shopping	0,28%	1,30%
Infraestrutura	0,24%	0,98%
Consumo Discricionário	0,22%	-1,20%
Índice	0,11%	1,02%
TMT	0,00%	0,33%
Retorno Bruto	4,18%	25,34%
Outros	0,02%	-1,38%
Retorno	4,21%	23,96%

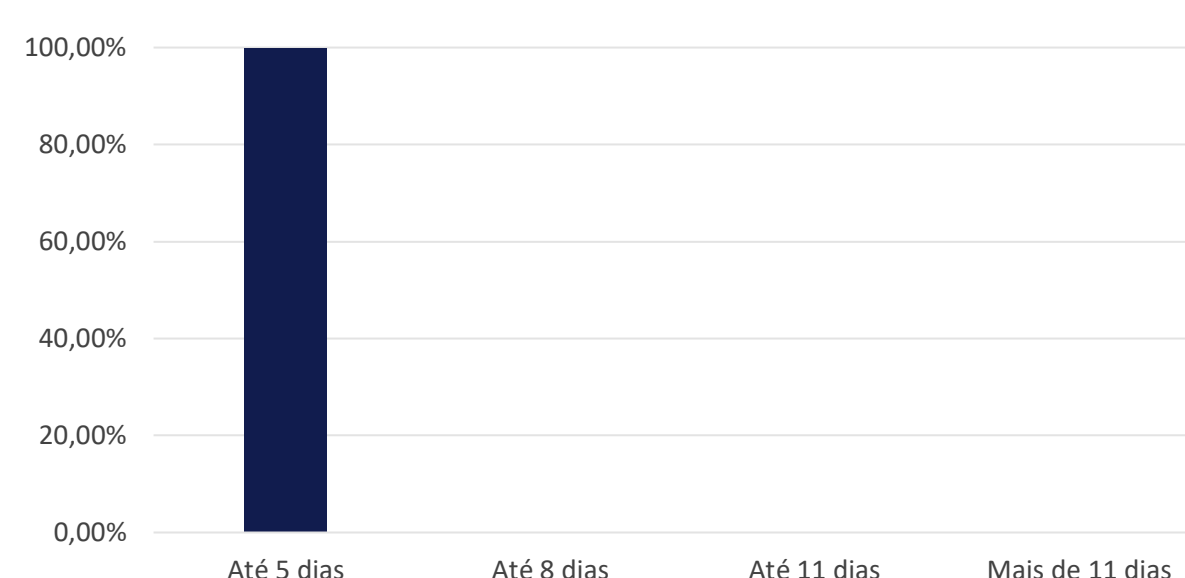
ALOCAÇÃO POR MARKET CAP



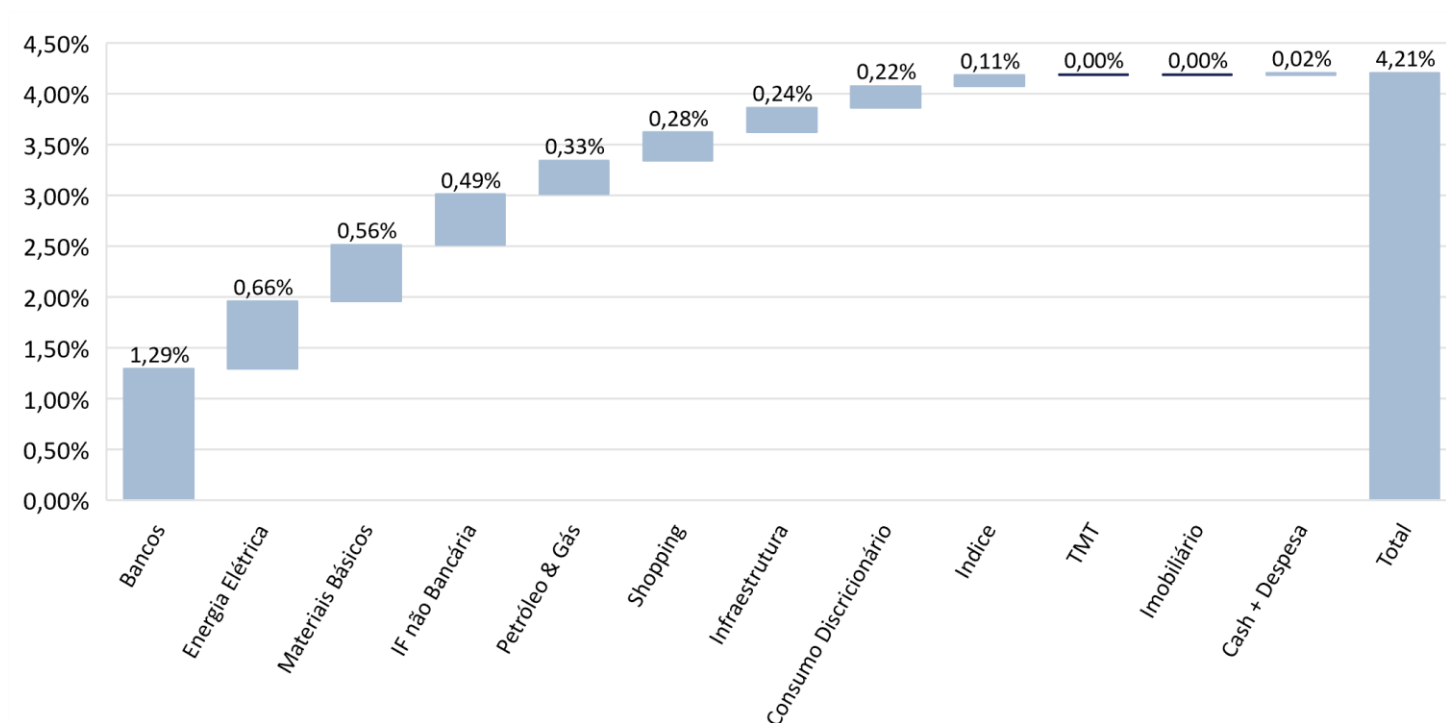
ALOCAÇÃO POR SEGMENTO



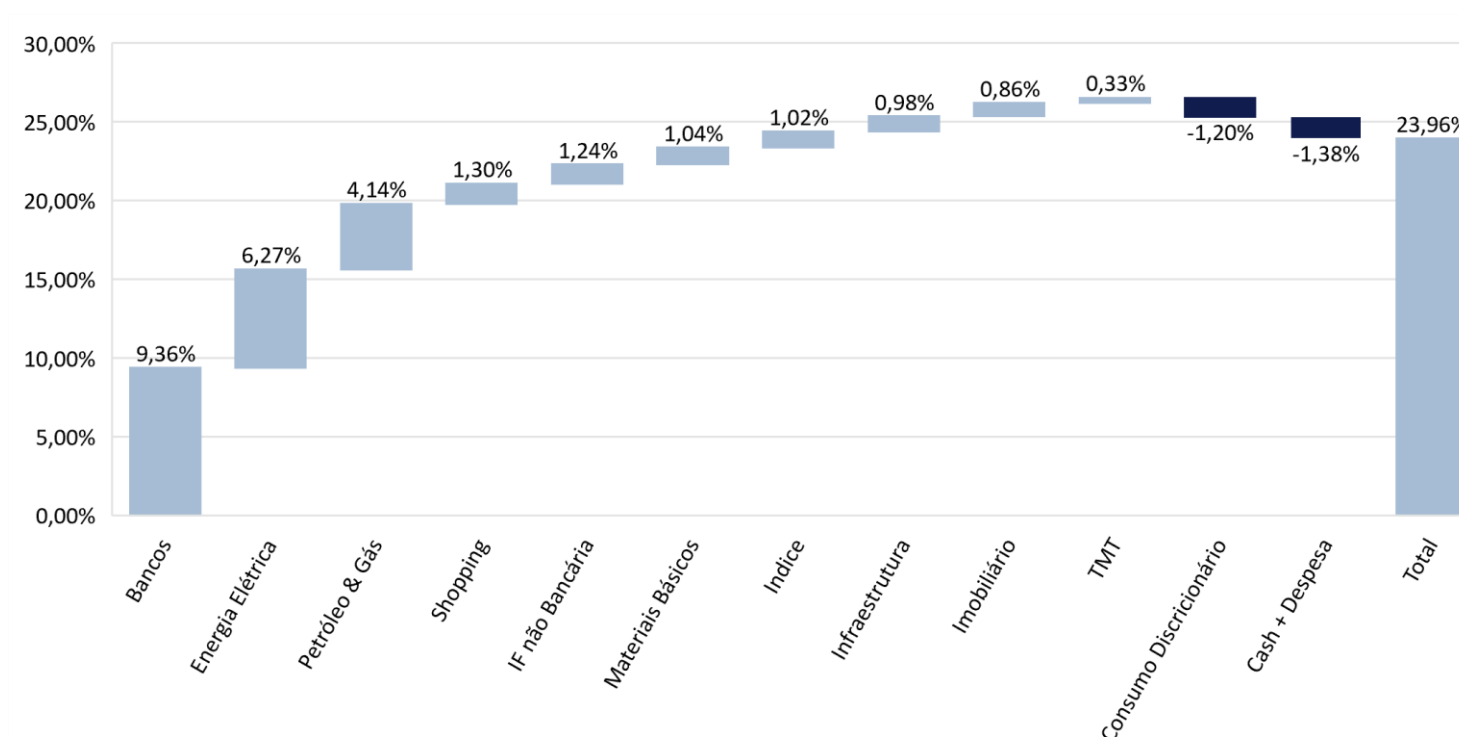
ALOCAÇÃO POR LIQUIDEZ



DESEMPENHO POR SEGMENTO NO MÊS



DESEMPENHO POR SEGMENTO NO ANO



Carteira Diária

Data de Emissão : 03/01/2024 10:19

Data de Posição : 29/12/2023

Cliente : PLURAL DIVIDENDOS FIA

Ações													
Código	Papel	Qtd. Disponível	Qtd. Bloqueada	Qtd. Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pós. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/RV	% s/Total
ALOS3	ALOS - ALLOS S.A.	229.749	0	229.749	26,55	26,55	6.099.835,95	0,00	6.099.835,95	0,00	6.099.835,95	3,20%	2,92%
AURE3	AURE3 ON	474.100	0	474.100	13,31	13,31	6.310.271,00	0,00	6.310.271,00	0,00	6.310.271,00	3,31%	3,02%
B3SA3	B3 ON NM	640.391	0	640.391	14,55	14,55	9.317.689,05	0,00	9.317.689,05	0,00	9.317.689,05	4,88%	4,46%
BBAS3	BRASILON EJ NM	133.341	0	133.341	55,39	55,39	7.385.757,99	0,00	7.385.757,99	0,00	7.385.757,99	3,87%	3,53%
BBSE3	BRASIL SEGURIDADE ON	144.745	0	144.745	33,65	33,65	4.870.669,25	0,00	4.870.669,25	0,00	4.870.669,25	2,55%	2,33%
BPAC11	BTGP BANCO UNT N2	308.709	0	308.709	37,61	37,61	11.610.545,49	0,00	11.610.545,49	0,00	11.610.545,49	6,09%	5,55%
CCRO3	CCR RODOVIASION NM	816.500	0	816.500	14,18	14,18	11.577.970,00	0,00	11.577.970,00	0,00	11.577.970,00	6,07%	5,54%
CPF3	CPFL ENERGIAON NM	280.605	0	280.605	38,51	38,51	10.806.098,55	0,00	10.806.098,55	0,00	10.806.098,55	5,66%	5,17%
ELET3	ELETROBRASON * N1	249.099	0	249.099	42,43	42,43	10.569.270,57	0,00	10.569.270,57	0,00	10.569.270,57	5,54%	5,06%
ENG11	ENERGISA UNT	197.053	0	197.053	53,83	53,83	10.607.362,99	0,00	10.607.362,99	0,00	10.607.362,99	5,56%	5,07%
EQTL3	EQUATORIALON N2	274.414	0	274.414	35,72	35,72	9.802.068,08	0,00	9.802.068,08	0,00	9.802.068,08	5,14%	4,69%
IGT11	IGUATEMI S.AUNT N1	304.072	0	304.072	24,38	24,38	7.413.275,36	0,00	7.413.275,36	0,00	7.413.275,36	3,89%	3,55%
ITSA4	ITAUSAPN N1	1.029.140	0	1.029.140	10,37	10,37	10.672.181,80	0,00	10.672.181,80	0,00	10.672.181,80	5,59%	5,10%
ITUB4	ITAU UNIBANCO PN N1	449.408	0	449.408	33,97	33,97	15.266.389,76	0,00	15.266.389,76	0,00	15.266.389,76	8,00%	7,30%
PETR4	PETROBRASPN	479.400	0	479.400	37,24	37,24	17.852.856,00	0,00	17.852.856,00	0,00	17.852.856,00	9,36%	8,54%
RAIL3	RUMO SA ON	308.000	0	308.000	22,95	22,95	7.068.600,00	0,00	7.068.600,00	0,00	7.068.600,00	3,70%	3,38%
SUZB3	SUZANO PAPELON I06 N1	58.200	0	58.200	55,63	55,63	3.237.666,00	0,00	3.237.666,00	0,00	3.237.666,00	1,70%	1,55%
VALE3	VALE R DOCEON N1	148.944	103.024	251.968	77,20	77,20	19.451.929,60	0,00	19.451.929,60	0,00	19.451.929,60	10,20%	9,30%
VBBR3	VIBRA ON NM	335.731	0	335.731	22,76	22,76	7.641.237,56	0,00	7.641.237,56	0,00	7.641.237,56	4,00%	3,65%
VIVA3	VIVARA ON NM	94.431	0	94.431	34,25	34,25	3.234.261,75	0,00	3.234.261,75	0,00	3.234.261,75	1,70%	1,55%
TOTAL		6.956.032	103.024	7.059.056			190.795.936,75	0,00	190.795.936,75	0,00	190.795.936,75	100,00%	91,26%

Opções														
Código	Papel	Tipo	Corretora	Praça	Exercício	Data Vencto.	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corret.	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	% S/RV	% s/Total
B3SAA145	B3SA FM/EDJ ON NM	CALL	XP_INV	SP	14,45	19/01/2024	(400.000)	0,48	0,48	(191.296,02)	0,00	(191.296,02)	28,62%	(0,09%)
B3SAM130	B3SA /EDJ ON NM	PUT	XP_INV	SP	12,95	19/01/2024	(400.000)	0,05	0,05	(18.706,43)	0,00	(18.706,43)	2,80%	(0,01%)
B3SAM137	B3SA /EDJ ON NM	PUT	XP_INV	SP	13,70	19/01/2024	400.000	0,14	0,14	55.199,61	0,01	55.199,62	(8,26%)	0,03%
BPACA351	BPAC UNT N2	CALL	XP CCTVM	SP	34,96	19/01/2024	(100.000)	2,99	2,99	(299.431,99)	0,00	(299.431,99)	44,80%	(0,14%)
BPACM301	BPAC UNT N2	PUT	XP CCTVM	SP	29,96	19/01/2024	(100.000)	0,00	0,00	(156,86)	(0,01)	(156,87)	0,02%	0,00%
BPACM326	BPAC UNT N2	PUT	XP CCTVM	SP	32,46	19/01/2024	100.000	0,03	0,03	2.565,64	0,00	2.565,64	(0,38%)	0,00%
CCROA140	CCRO ON NM	CALL	XP_INV	SP	14,05	19/01/2024	(270.000)	0,47	0,47	(126.000,28)	(0,01)	(126.000,29)	18,85%	(0,06%)
CCROM12	CCRO ON NM	PUT	XP_INV	SP	12,30	19/01/2024	(270.000)	0,01	0,01	(3.549,59)	0,00	(3.549,59)	0,53%	0,00%
CCROM130	CCRO ON NM	PUT	XP CCTVM	SP	13,05	19/01/2024	270.000	0,05	0,05	13.652,19	0,01	13.652,20	(2,04%)	0,01%
CPFEA385	CPFE ON NM	CALL	XP_INV	SP	38,50	19/01/2024	(95.000)	0,98	0,98	(93.114,72)	(0,01)	(93.114,73)	13,93%	(0,04%)
CPFEM342	CPFE ON NM	PUT	XP_INV	SP	34,25	19/01/2024	(95.000)	0,06	0,06	(6.099,42)	0,00	(6.099,42)	0,91%	0,00%
CPFEM362	CPFE ON NM	PUT	XP CCTVM	SP	36,25	19/01/2024	95.000	0,18	0,18	16.708,14	0,00	16.708,14	(2,50%)	0,01%
ENGA560	ENGI FM/ED UNT N2	CALL	XP_INV	SP	55,05	19/01/2024	(65.000)	0,50	0,50	(32.455,25)	0,00	(32.455,25)	4,86%	(0,02%)
ENGIM49	ENGI /ED UNT N2	PUT	XP_INV	SP	48,05	19/01/2024	(65.000)	0,10	0,10	(6.419,23)	0,00	(6.419,23)	0,96%	0,00%
ENGIM515	ENGI FM/ED UNT N2	PUT	XP_INV	SP	50,55	19/01/2024	65.000	0,38	0,38	24.637,55	0,00	24.637,55	(3,69%)	0,01%
RAILA242	RAIL ON NM	CALL	XP CCTVM	SP	24,25	19/01/2024	(160.000)	0,19	0,19	(30.840,79)	(0,01)	(30.840,80)	4,61%	(0,01%)
RAILM205	RAIL ON NM	PUT	XP CCTVM	SP	20,50	19/01/2024	(160.000)	0,04	0,04	(6.609,36)	0,00	(6.609,36)	0,99%	0,00%
RAILM220	RAIL FM ON NM	PUT	XP CCTVM	SP	22,00	19/01/2024	160.000	0,21	0,21	33.545,29	0,01	33.545,30	(5,02%)	0,02%
TOTAL							(1.090.000)			(668.371,52)	(0,01)	(668.371,53)	100,00%	(0,29%)

Futuros													
Ativo	Vencto.	Corretora	Quantidade	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% s/Total				
FUT IND	G24	GENIAL	35,00	0,00	0,00	135.790,00	4.752.650,00	100,00%	2,27%				
TOTAL				0,00	0,00		4.752.650,00	100,00%	2,27%				

Renda Fixa																
Código	Aplicação	Emitente	MTM % AA	Tx. Over %	Tx % AA	Index	Emissão	Venc.	Quantidade	PU Mercado	Valor da Aplicação	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/RF	% s/Total
LFT-O																
L800289	29/12/2023	TESOURO	0,000000%	0,000000%	11,640000%	PRE	02/10/2020	02/01/2024	1.415	14.169,73592933	20.050.176,34	20.050.176,34	0,00	20.050.176,34	100,00%	9,59%
SUBTOTAL									1.415		20.050.176,34	20.050.176,34	0,00	20.050.176,34	100,00%	9,59%
TOTAL									1.415,00000000		20.050.176,34	20.050.176,34	0,00	20.050.176,34	100,00%	9,59%

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% s/Total
Ajuste Devedor de Futuros	(5.915,00)	0,53%	0,00%
Cotas a Emitir	(2.035.901,17)	183,46%	(0,97%)
Cotas a Resgatar	(19.296,35)	1,74%	(0,01%)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 15/03/24	(17.301,20)	1,56%	(0,01%)
Despesa de B 10 - TARIFA DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA com pagamento 08/01/24	(378,00)	0,03%	0,00%
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 22/01/24	(2.263,09)	0,20%	0,00%
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 25/01/24	(69,47)	0,01%	0,00%
Despesa de DESPESA DE CBLC com pagamento 25/01/24	(499,15)	0,04%	0,00%
Despesa de Taxa de Distribuição ref Agosto 22-Plural Investimento a pg	(221,97)	0,02%	0,00%
Devolução - Pagamento Maior de Resgate em 24/08/2018	23,55	0,00%	0,00%
Diferimento de despesa de TAXA ANBIMA com vencimento 31/01/24	385,52	(0,03%)	0,00%
Distrib. Taxa GestÃo (DBEM_GF_BEM) - 03/2022	(11.885,01)	1,07%	(0,01%)
Distrib. Taxa Gestao TORO CORRETORA - 08/2023	(0,08)	0,00%	0,00%
Distrib. Taxa Gestao(DBEM_PLU_CM) - 07/2023	(0,17)	0,00%	0,00%
Distrib. Taxa Gestao(DBEM_PLU_CM) - 08/2023	(0,25)	0,00%	0,00%
Distrib. Taxa Gestao(DBEM_PLU_CM) - 09/2023	(0,13)	0,00%	0,00%
Distrib. Taxa Gestao(DBEM_PLU_CM) - 10/2023	(0,14)	0,00%	0,00%
Distrib. Taxa Gestao(DBEM_PLU_CM) - 11/2023	(0,06)	0,00%	0,00%
Performance FEE Bruta a Pagar em 08/01/2024	(118,31)	0,01%	0,00%
Performance Fee Proveniente de Resgate a Pagar em 08/01/24	(4.337,58)	0,39%	0,00%
Receb. Divid. 0.24 de PETR4 s/ 286,600 em 20/02/2024	69.726,11	(6,28%)	0,03%
Receb. Divid. 0.67 de PETR4 s/ 286,600 em 20/03/2024	192.788,22	(17,37%)	0,09%
Receb. Juros s/ Cap. 0.02 de ITSA4 s/ 991,840 em 02/01/2024	23.337,49	(2,10%)	0,01%
Receb. Juros s/ Cap. 0.02 de ITUB4 s/ 433,108 em 02/01/2024	7.644,35	(0,69%)	0,00%
Receb. Juros s/ Cap. 0.05 de ITSA4 s/ 723,807 em 30/12/2024	37.276,06	(3,36%)	0,02%
Receb. Juros s/ Cap. 0.05 de ITSA4 s/ 933,407 em 30/12/2024	48.070,46	(4,33%)	0,02%
Receb. Juros s/ Cap. 0.08 de ITSA4 s/ 1,029,140 em 30/12/2024	81.713,71	(7,36%)	0,04%
Receb. Juros s/ Cap. 0.12 de ITSA4 s/ 895,207 em 30/12/2024	104.291,61	(9,40%)	0,05%
Receb. Juros s/ Cap. 0.19 de VIVT3 s/ 85,991 em 30/04/2024	16.577,49	(1,49%)	0,01%
Receb. Juros s/ Cap. 0.23 de BPAC11 s/ 240,709 em 15/02/2024	55.578,54	(5,01%)	0,03%
Receb. Juros s/ Cap. 0.25 de ITUB4 s/ 449,408 em 30/04/2024	111.111,63	(10,01%)	0,05%
Receb. Juros s/ Cap. 0.27 de ITUB4 s/ 404,508 em 30/04/2024	108.934,00	(9,82%)	0,05%
Receb. Juros s/ Cap. 0.40 de VBBR3 s/ 335,731 em 29/05/2024	135.507,99	(12,21%)	0,06%
Receb. Juros s/ Cap. 0.43 de PETR4 s/ 286,600 em 20/02/2024	123.062,25	(11,09%)	0,06%
Receb. Juros s/ Cap. 0.43 de VBBR3 s/ 320,431 em 28/06/2024	137.495,47	(12,39%)	0,07%
Receb. Juros s/ Cap. 1.16 de SUZB3 s/ 58,200 em 10/01/2024	67.708,42	(6,10%)	0,03%
Recebimento de Rebate de Taxa de Adm - GF Programado FIA	942,92	(0,08%)	0,00%
Resgate Não Liquidado (Devolução de TED) Ref. 04/06/2018	(2.476,89)	0,22%	0,00%
Taxa de Administração - Distribuição pendente 04/2020	(1,97)	0,00%	0,00%
Taxa de Administração - Distribuição pendente 05/2020	(2,01)	0,00%	0,00%
Taxa de Administração - Distribuição Pendente 07/2020	(1,92)	0,00%	0,00%
Taxa de Administração - Uniletra	(16.064,84)	1,45%	(0,01%)
Taxa de Administração a Pagar em 31/12/49	(2,39)	0,00%	0,00%
Taxa de Administração a Receber em 31/12/49	16.417,40	(1,48%)	0,01%
Tx Administração Bruta a Pagar em 08/01/2024	(316.302,12)	28,50%	(0,15%)
Tx Administração Ref a Abril 22_fundo sem Saldo_Distribuição Genial	(5.021,75)	0,45%	0,00%
Tx Custódia Bruta a Pagar em 08/01/2024	(10.279,84)	0,93%	0,00%
TOTAL	(1.109.747,67)	100,00%	(0,53%)

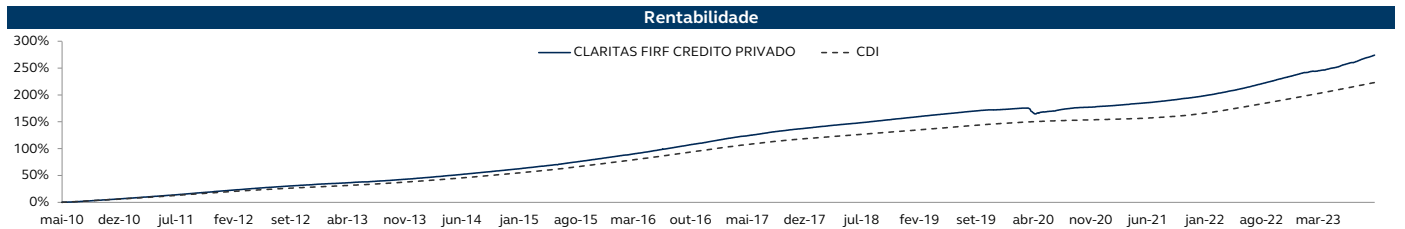
Tesouraria			
Descrição	Valor	% S/TES	% s/Total
Saldo em Tesouraria	1.000,00	100,00%	0,00%
TOTAL	1.000,00	100,00%	0,00%

Patrimônio			
Total do Patrimônio			
			209.068.993,89

Rentabilidade Acumulada							
Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 Meses
COTA	0,0000%	0,0000%	(0,00414610%)	4,20709590%	23,95532990%	12,65012660%	23,95532990%
IBOVESPA	0,0000%	(0,0041%)	0,00000000%	5,38291030%	22,28161400%	13,63252520%	22,28161400%
IBX	0,0000%	(0,0041%)	0,00000000%	5,48310280%	21,27474040%	13,77226010%	21,27474040%
Valor da Cota Bruta de Performance	2,918303600						
Quantidade de Cotas (Líquida)	71.640.630,969312300						
Valor da cota unitária (Líquida)	2,918301900						

Informações Gerais		Dados	
Data de Início	04/05/2010	Valor da cota em 29/09/2023	37,438884
Taxa de Administração ³	0,50% a.a. (máxima de 1,00% a.a.)	Patrimônio Líquido	R\$ 133.146.413,53
Taxa de Performance	Não se aplica	PL Médio 12 meses ¹	R\$ 114.613.739,78
Aplicação Cotização	D+0 (fechamento)	Informações Adicionais	
Aplicação Liquidação	D+0 (fechamento)	Gestor	Claritas Administração de Recursos LTDA.
Resgate Cotização	D+30 (30º dia após o pedido de resgate ou no 1º d.u. subsequente)	Administrador	BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM
Resgate Liquidação	D+31 (1º d.u. após a cotização de resgate)	Custodiante	Banco BTG Pactual S.A.
Taxa de Saída	Não se aplica	Objetivos do Fundo e Política de Investimento	
Horário de movimentação ²	Solicitação até às 14:30h	O fundo tem por objetivo buscar retorno em ativos de renda fixa, admitindo-se estratégias com risco de juros e de índice de preços, integrando, inclusive, questões ASG por meio da aplicação em ativos com boas práticas Ambientais, Sociais e de Governança ("ASG"), observando o do Formulário de Metodologia ASG disponível no link https://www.claritas.com.br/esg/ . Para atingir seus objetivos o FUNDO deverá manter, no mínimo, 80% (oitenta por cento) da carteira em ativos relacionados diretamente, ou sintetizado via derivativos, a exposição de riscos de crédito privado, ao risco de juros do mercado doméstico ou risco de índices de preço, excluindo estratégias que impliquem em risco de moeda estrangeira ou de renda variável.	
Aplicação inicial	R\$ 1.000,00 (mil reais)	Público Alvo	
Movimentação Mínima	R\$ 1,00 (um real)	O FUNDO tem como público alvo investidores em geral, nos termos da regulamentação vigente. Deve-se observar, no que couber, as vedações aplicadas às entidades fechadas de previdência complementar ("EFC") previstas na Resolução do CMN nº 4.994/22 (EFPC) e na Resolução nº 4.963/21, aplicada aos recursos dos Regimes Próprios de Previdência Complementar instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios ("RPPS").	
Saldo Mínimo	R\$ 1.000,00 (mil reais)	Integração das Questões ASG	
Conta para Aplicação	BTG Pactual - nº 208 Agência: 0001 Conta Corrente: 4149693 Favorecido: CLARITAS FIRF CREDITO PRIVADO CNPJ: 11.447.136/0001-60	O FUNDO integra questões ASG em seu processo de investimento. A equipe de gestão do FUNDO acredita na combinação de uma profunda análise top down alinhada com a escolha de ativos fundamentalista para produzir alpha estável e significativo a médio e longo prazo. Os fatores ASG fazem parte do escopo de análise qualitativa dos ativos para compor a carteira do FUNDO.	

Classificação ANBIMA		Código ANBIMA	
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre		248185	
Bloomberg	CLRTASR BZ	Integração das Questões ASG	
ISIN	BRCLAFCTF000	O FUNDO integra questões ASG em seu processo de investimento. A equipe de gestão do FUNDO acredita na combinação de uma profunda análise top down alinhada com a escolha de ativos fundamentalista para produzir alpha estável e significativo a médio e longo prazo. Os fatores ASG fazem parte do escopo de análise qualitativa dos ativos para compor a carteira do FUNDO.	
CNPJ	11.447.136/0001-60		
Tributação	Longo Prazo		



Retornos mensais															
		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Desde Início
2010	Fundo	-	-	-	-	0,46%	0,78%	0,91%	1,02%	0,98%	0,98%	0,93%	1,03%	7,30%	7,30%
	% CDI	-	-	-	-	68%	99%	106%	115%	116%	121%	115%	111%	108%	108%
2011	Fundo	0,95%	0,98%	1,06%	0,92%	1,07%	0,99%	1,06%	1,17%	1,12%	1,00%	1,12%	1,01%	13,18%	21,44%
	% CDI	110%	116%	116%	110%	109%	104%	109%	109%	119%	114%	131%	111%	114%	112%
2012	Fundo	1,04%	0,87%	1,07%	0,85%	0,97%	0,73%	0,79%	0,85%	0,63%	0,76%	0,71%	0,67%	10,41%	34,09%
	% CDI	117%	117%	132%	121%	133%	114%	117%	123%	118%	126%	131%	125%	124%	117%
2013	Fundo	0,61%	0,40%	0,56%	0,73%	0,50%	0,46%	0,80%	0,63%	0,78%	0,88%	0,70%	0,92%	8,26%	45,17%
	% CDI	104%	82%	105%	122%	85%	79%	113%	91%	111%	109%	98%	118%	103%	114%
2014	Fundo	0,86%	0,92%	0,85%	0,92%	0,97%	0,90%	1,03%	0,95%	0,93%	1,02%	0,91%	0,98%	11,83%	62,34%
	% CDI	102%	118%	111%	113%	113%	110%	110%	111%	103%	108%	109%	102%	109%	114%
2015	Fundo	1,08%	0,92%	1,10%	0,91%	1,11%	1,15%	1,32%	1,11%	1,16%	1,22%	1,13%	1,28%	14,36%	85,66%
	% CDI	116%	112%	107%	96%	113%	108%	113%	101%	105%	110%	107%	110%	109%	114%
2016	Fundo	1,13%	1,01%	1,23%	1,19%	1,32%	1,24%	1,22%	1,36%	1,28%	1,14%	1,12%	1,30%	15,55%	114,53%
	% CDI	107%	100%	106%	113%	120%	107%	111%	112%	116%	108%	108%	116%	111%	115%
2017	Fundo	1,23%	1,05%	1,16%	0,74%	1,01%	1,00%	1,03%	0,88%	0,72%	0,79%	0,63%	0,65%	11,49%	139,18%
	% CDI	113%	121%	113%	94%	109%	124%	128%	110%	113%	122%	112%	121%	115%	116%
2018	Fundo	0,76%	0,56%	0,64%	0,59%	0,57%	0,58%	0,60%	0,73%	0,62%	0,69%	0,57%	0,63%	7,81%	157,86%
	% CDI	131%	120%	121%	115%	111%	112%	111%	128%	132%	127%	115%	127%	122%	118%
2019	Fundo	0,66%	0,61%	0,54%	0,59%	0,58%	0,50%	0,63%	0,54%	0,48%	0,29%	0,15%	0,32%	6,06%	173,49%
	% CDI	122%	124%	116%	114%	107%	106%	110%	108%	103%	61%	39%	86%	102%	118%
2020	Fundo	0,41%	0,30%	-2,61%	-0,22%	0,59%	0,66%	1,06%	0,61%	0,41%	0,17%	0,41%	0,35%	2,11%	179,27%
	% CDI	110%	101%	-	247%	305%	546%	377%	262%	109%	271%	215%	76%	116%	
2021	Fundo	0,35%	0,41%	0,57%	0,42%	0,41%	0,51%	0,57%	0,62%	0,63%	0,64%	0,66%	0,83%	6,85%	198,40%
	% CDI	231%	306%	290%	204%	154%	168%	161%	147%	144%	133%	113%	109%	156%	120%
2022	Fundo	0,78%	0,89%	1,05%	0,92%	1,10%	1,22%	1,13%	1,30%	1,26%	1,18%	1,16%	1,24%	14,06%	240,37%
	% CDI	107%	118%	113%	110%	107%	121%	110%	112%	118%	115%	114%	111%	114%	121%
2023	Fundo	0,83%	0,44%	0,80%	0,92%	1,40%	1,24%	1,16%	1,55%	1,25%	-	-	-	10,00%	274,39%
	% CDI	74%	48%	68%	100%	125%	125%	108%	136%	128%	-	-	-	101%	120%

Estatísticas			
	% Acum.	% CDI	
Últimos 12 meses	13,98	104	Meses positivos
Últimos 24 meses	28,16	109	Meses negativos
Últimos 36 meses	35,31	119	Meses acima do benchmark
Desde o início	274,39	120	Meses abaixo do benchmark
			Maior retorno mensal
			Menor retorno mensal
Retorno médio mensal (desde o início) ⁴	0,81%		
Volatilidade diária anualizada (12 meses)	0,42%		

Gestora	Administrador
Principal Claritas Av. Brigadeiro Faria Lima, 4221 4º andar 04538-133 São Paulo - São Paulo t + 55 11 2131 4900 f + 55 11 2131 4930 www.claritas.com.br claritas@claritas.com.br	BTG Pactual Serviços Financeiros (CNPJ: 59.281.253/0001-23) Praia de Botafogo, n.º 501, 5º andar, Rio de Janeiro, RJ - CEP 22250-040 Telefone: (21) 3262-9600 www.btgpactual.com SAC: sac@btgpactual.com ou 0800 772 28 27 Ouvidoria: ouvidoria@btgpactual.com ou 0800 772 2827

¹Valor da média aritmética da soma do patrimônio líquido apurado no último dia útil de cada mês, nos 12 (doze) meses anteriores. ²O horário limite de liquidação é 17h30 para TED e CETIP. O horário de entrada das ted's para aplicação é 15h. ³A taxa de administração prevista no caput é a taxa de administração mínima do fundo. Fica instituída a taxa de administração máxima de 1,00% a.a. sobre o valor do patrimônio líquido do fundo. Taxa de administração anterior ao dia 14/10/2019 era de 0,066%. Rentabilidade anterior a 14/10/2019 é referente a taxa de administração passada. ⁴Média da rentabilidade mensal desde o início do fundo. Em 07/11/2022, o fundo teve sua administração fiduciária migrada da BNY Mellon DTVM para o BTG Pactual DTVM. Utiliza-se como metodologia para o cálculo de rentabilidade, as últimas cotas dos meses de referência dos períodos. Leia o formulário de informações complementares, a lâmina de informações essenciais, se houver, e o regulamento antes de investir. Tais documentos encontram-se disponíveis no site do administrador (<https://www.btgpactual.com/asset-management/administracao-fiduciaria/busca-por-fundos/>). Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. Fundos de investimento não contam com a garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O fundo pode utilizar estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento; tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo dos fundos. As informações contidas nesse material são de caráter exclusivamente informativo. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. Este fundo integra questões ASG em sua gestão, conforme Código ANBIMA de Administração de Recursos de Terceiros, disponível no site da Associação na internet. A Claritas Administração de Recursos Ltda ("Principal Claritas") não se responsabiliza por ganhos ou perdas consequentes do uso deste informativo. Este material não pode ser copiado, reproduzido ou distribuído sem a prévia e expressa concordância da Principal Claritas. Principal Asset ManagementSM é o nome comercial para Principal Global Investors, LLC, membro do Principal Financial Group. Principal Claritas é o nome comercial para Claritas Administracao de Recursos Ltda., uma filiada da Principal Global Investors.



FIRF CP LP CLARITAS

Posição:31/07/2023

Resumo da Carteira

Ativos	Financeiro	Varição Diária	%PL.	
PORTFOLIO INVESTIDO	15,296,780.78	9,829.01	12.83	
DEBENTURES	82,577,942.30	84,971.09	69.26	
DESPESA	12,511.50	(201.67)	0.01	
LF-DI CDIE	2,926,212.72	1,667.79	2.45	
LFSC CDIE	865,913.33	523.09	0.73	
LFSC CDIE	342,374.55	205.10	0.29	
LFSC REF	943,801.32	634.49	0.79	
LFSC REF	319,802.24	249.89	0.27	
LFSC REF	446,211.22	306.12	0.37	
LFSC REF	959,429.11	749.69	0.80	
LFSC REF	315,026.34	208.65	0.26	
LFSC REF	318,663.84	189.52	0.27	
LFSC REF	637,327.69	379.05	0.53	
LFSN CDIE	3,289,388.57	1,929.26	2.76	
LFT	814,867.28	408.76	0.68	
OPERAÇÃO COMPROMISSADA	9,261,468.52	5,312.67	7.77	
TX CUSTÓDIA BOLSA	0.00	0.00	0.00	
A Pagar Cotista	(52,213.39)	0.00	(0.04)	
TAXA ADMINISTRACAO	(49,463.82)	(2,356.05)	(0.04)	
TAXA CUSTODIA	(2,974.67)	(141.69)	0.00	
PATRIMÔNIO	119,223,069.42	104,864.76		
COTA LÍQUIDA	36.41277220			
COTA BRUTA	36.41277220			
QUANTIDADE DE COTAS	3,274,210.179729			
DURATION	852.11			
Rentabilidades				
	Dia	Mês	Ano	Acumulado
COTA	0.0881	1.1611	6.9804	264.1277
%CDI	173.4494	108.3087	91.3638	119.3574
TOTAL DE APLICAÇÕES		\$129,718.54		
TOTAL DE RESGATES		\$52,213.39		

Compromissada Over

Data	Vencimento	Volta	Quantidade	Título	Financeiro	P.U.	Taxa Adelic	Contraparte
10/02/2010	15/08/2030	01/08/2023	2,126.00	COMPROMISSADA NTN8 IPCA	\$9,261,468.52	4,356.29	13.64	BANCO BTG PACTUAL S A
					\$9,261,468.52			

Títulos Públicos

Data	Vencimento	Quantidade	Título	Financeiro	P.U.	Coupon/Rent.	Taxa	Ganho Diário	Qtd.Margem	Qtd.Termo
08/03/2019	01/09/2025	60.00	LFT REF	814,867.28	13,581.121292	2.0800	0.00	408.76	0.00	0.00
				814,867.28				408.76		

Títulos Privados

Data	Vencimento	Quantidade	Título	Financeiro	P.U.	Coupon/Rent	Ganho Diários	QtdMargem	Emissor
05/02/2020	05/02/2025	1,160	AEGP14 CDIE	1,242,183.20	1,070.847584	1.8446	763.76	0	AEGEA SANEAMENTO E PARTICIPACOES S.A.
12/04/2021	12/04/2027	478	AEGP17 CDIE	489,435.80	1,023.924263	3.1033	455.83	0	AEGEA SANEAMENTO E PARTICIPACOES S.A.
04/10/2021	04/10/2028	700	AEGP19 CDIE	705,137.63	1,007.339472	3.1558	522.07	0	AEGEA SANEAMENTO E PARTICIPACOES S.A.
				2,436,756.63			1,741.66		
15/01/2021	15/01/2026	300	AERI11 CDIE	264,958.55	883.195180	13.8152	867.26	0	AERIS INDUSTRIA E COMERCIO DE EQUIPAMENTOS PARA GE
31/07/2021	31/07/2026	1,800	AERI12 CDIE	1,390,250.96	772.361646	14.4091	12,879.90	0	AERIS INDUSTRIA E COMERCIO DE EQUIPAMENTOS PARA GE
				1,655,209.52			13,747.15		
15/03/2019	15/03/2027	1,445	TIET19 CDIE	1,497,276.44	1,036.177470	1.6277	1,262.87	0	AES BRASIL OPERACOES S.A.
12/12/2022	12/12/2027	940	TIETAO CDIE	1,017,190.61	1,082.117675	1.8500	580.65	0	AES BRASIL OPERACOES S.A.
				2,514,467.06			1,843.52		
15/07/2019	15/07/2026	92	GRRB14 CDIE	892,232.86	9,698.183262	2.4789	378.74	0	AGUAS GUARIROBA SA
29/10/2020	29/10/2024	613	GRRB15 CDIE	638,774.14	1,042.045904	2.3279	349.35	0	AGUAS GUARIROBA SA
				1,531,007.00			728.09		
15/07/2021	17/07/2028	1,150	ALGAA1 CDIE	1,146,354.09	996.829644	1.8541	556.11	0	ALGAR TELECOM S/A
15/02/2019	18/02/2026	52	ALGA28 CDIE	547,092.11	10,521.002066	1.4780	309.06	0	ALGAR TELECOM S/A
15/01/2022	15/01/2029	300	ALGAA2 CDIE	298,066.74	993.555807	1.8704	351.81	0	ALGAR TELECOM S/A
				1,991,512.94			1,216.98		
15/09/2018	15/09/2023	1,000	ALSCA0 CDIE	527,166.91	527.166910	107.4803	286.88	0	ALIANSCE SONAE SHOPPING CENTERS S.A
				527,166.91			286.88		
15/10/2019	15/10/2025	825	ALUP17 CDIE	862,209.01	1,045.101831	1.1616	442.68	0	ALUPAR INVESTIMENTO S/A
				862,209.01			442.68		
10/01/2022	10/01/2028	725	AMBIP13 CDIE	706,317.14	974.230538	4.2441	517.61	0	AMBIPAR PARTICIPACOES E EMPREENDIMENTOS S.A.
				706,317.14			517.61		
15/10/2019	15/06/2027	1,012	APRB28 CDIE	829,899.36	820.058655	1.6919	534.16	0	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA
				829,899.36			534.16		
11/11/2021	13/11/2023	6	LF CDIE	757,393.85	126,232.308321	1.4273	427.04	0	BANCO BMG S.A
19/04/2022	29/04/2024	7	LF CDIE	842,328.36	120,332.622585	1.6318	481.66	0	BANCO BMG S.A
				1,599,722.21			908.70		
12/11/2018	15/03/2028	1	LFSC REF	315,026.34	315,026.343857	122.3700	208.65	0	BANCO BRADESCO S.A.
14/11/2018	15/03/2029	3	LFSC REF	943,801.32	314,600.439391	122.3700	634.49	0	BANCO BRADESCO S.A.
14/06/2021	14/06/2026	1	LFSN CDIE	400,084.37	400,084.367432	1.6084	228.41	0	BANCO BRADESCO S.A.
16/11/2020	16/11/2025	1	LFSC CDIE	865,913.33	865,913.329452	2.4000	523.09	0	BANCO BRADESCO S.A.
				2,524,825.36			1,594.65		
25/07/2022	01/09/2032	1	LFSN CDIE	349,023.60	349,023.602100	2.2000	207.29	0	BANCO BTG PACTUAL S A
28/10/2021	17/11/2031	3	LFSN CDIE	1,167,154.87	389,051.623495	2.1000	688.68	0	BANCO BTG PACTUAL S A
				1,516,178.47			895.98		
12/05/2022	12/05/2032	790	BRKMB6 CDIE	782,702.03	990.762068	2.8515	(14.79)	0	BRASKEM S.A
09/11/2022	09/11/2029	150	BRKMA8 CDIE	147,929.65	986.197697	2.7952	(127.62)	0	BRASKEM S.A

Data	Vencimento	Quantidade	Título	Financeiro	P.U.	Coupon/Rent	Ganho Diários	QtdMargem	Emissor
09/11/2022	09/11/2032	500	BRKMB8 CDIE	491,757.04	983.514089	2.9500	253.24	0	BRASKEM S.A
				1,422,388.73			110.84		
20/05/2021	20/05/2025	351	CEAB11 CDIE	343,068.12	977.402053	6.7445	342.15	0	CA MODAS S.A.
				343,068.12			342.15		
11/09/2019	30/11/2029	1	LFSC REF	319,802.24	319,802.241779	121.5094	249.89	0	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
11/09/2019	30/11/2029	3	LFSC REF	959,429.11	319,809.703831	121.5094	749.69	0	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
				1,279,231.35			999.58		
30/10/2021	30/10/2028	250	CAMLA1 CDIE	257,152.41	1,028.609656	1.7636	578.21	0	CAMIL ALIMENTOS S.A.
				257,152.41			578.21		
15/12/2020	15/12/2026	1,640	CCROA4 CDIE	1,690,408.97	1,030.737177	1.6430	1,135.88	0	CCR S.A.
				1,690,408.97			1,135.88		
15/05/2023	15/05/2026	1,750	CMGD19 CDIE	1,806,515.96	1,032.294836	1.5697	1,029.92	0	CEMIG DISTRIBUICAO SA
				1,806,515.96			1,029.92		
15/03/2022	15/03/2029	350	SBSPH0 CDIE	371,503.51	1,061.438599	1.4172	(99.24)	0	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO SA
15/12/2020	15/12/2027	900	SBSPC7 CDIE	939,579.56	1,043.977286	1.4685	561.45	0	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO SA
15/07/2021	15/07/2028	100	SBSPF8 CDIE	100,928.36	1,009.283572	1.4992	50.79	0	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO SA
10/05/2019	10/05/2027	415	SBSPC3 CDIE	420,757.14	1,013.872632	1.3394	222.50	0	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO SA
				1,832,768.57			735.50		
20/05/2021	20/05/2031	250	LCAMC2 CDIE	259,033.80	1,036.135186	2.2661	94.24	0	COMPANHIA DE LOCACAO DAS AMERICAS
15/12/2020	15/01/2026	2,000	LCAMA9 CDIE	2,026,746.09	1,013.373043	1.9805	1,873.37	0	COMPANHIA DE LOCACAO DAS AMERICAS
				2,285,779.88			1,967.61		
15/04/2023	15/04/2028	1,020	SAPRC1 CDIE	1,059,362.02	1,038.590219	1.8833	613.01	0	COMPANHIA DE SANEAMENTO DO PARANA SANEPAR
				1,059,362.02			613.01		
15/12/2021	15/12/2028	2,026	PALFA1 CDIE	2,053,906.97	1,013.774418	1.6201	837.03	0	COMPANHIA PAULISTA DE FORCA E LUZ
				2,053,906.97			837.03		
10/11/2021	10/11/2028	250	CSNAA1 CDIE	240,928.22	963.712880	3.6194	68.43	0	COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL
20/10/2022	20/12/2027	1,180	CSNAA2 CDIE	1,160,811.95	983.738938	3.6252	543.14	0	COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL
				1,401,740.17			611.57		
07/05/2021	07/05/2026	1,632	IVIA18 CDIE	1,681,986.64	1,030.629066	1.8486	2,343.96	0	CONCESSIONARIA DE RODOVIAS DO INTERIOR PAULISTA SA
15/05/2018	15/05/2025	116	IVIA35 CDIE	119,041.20	1,026.217224	1.7305	85.71	0	CONCESSIONARIA DE RODOVIAS DO INTERIOR PAULISTA SA
				1,801,027.83			2,429.68		
21/10/2019	21/10/2026	1,065	ANHB10 CDIE	550,868.58	517.247494	1.4544	361.13	0	CONCESSIONARIA DO SISTEMA ANHANGUERA-BANDEIRANTES
14/06/2023	14/06/2028	2,754	ANHBA4 CDIE	2,845,894.92	1,033.367801	1.7176	5,250.25	0	CONCESSIONARIA DO SISTEMA ANHANGUERA-BANDEIRANTES
				3,396,763.51			5,611.38		
15/11/2019	15/07/2027	1,341	CBAN22 CDIE	1,499,139.52	1,117.926563	1.6433	1,226.84	0	CONCESSIONARIA ROTA DAS BANDEIRAS S.A.
				1,499,139.52			1,226.84		
10/09/2018	11/09/2023	1,380	TEND14 CDIE	530,568.08	384.469623	5.0026	356.23	0	CONSTRUTORA TENDA S/A
15/09/2021	15/09/2026	900	TEND19 CDIE	916,253.20	1,018.059114	5.7151	652.49	0	CONSTRUTORA TENDA S/A
				1,446,821.28			1,008.72		
15/07/2021	15/08/2028	1,053	CSAN13 CDIE	1,104,525.13	1,048.931745	2.1411	1,289.09	0	COSAN S.A.
15/07/2021	15/08/2031	409	CSAN23 CDIE	431,617.69	1,055.299982	2.2652	183.66	0	COSAN S.A.
20/06/2023	20/06/2028	330	CSAN16 CDIE	338,223.37	1,024.919314	2.0729	653.27	0	COSAN S.A.
05/05/2022	05/05/2032	1,030	CSAN24 CDIE	1,041,925.54	1,011.578193	2.3784	919.04	0	COSAN S.A.
				2,916,291.73			3,045.07		
12/07/2021	13/07/2026	1,100	CURY21 CDIE	1,097,624.66	997.840596	2.3099	2,355.00	0	CURY CONSTRUTORA E INCORPORADORA S.A.
				1,097,624.66			2,355.00		
10/12/2018	10/12/2024	38	DASAB0 CDIE	386,423.53	10,169.040219	112.7128	188.14	0	DIAGNOSTICOS DA AMERICA S.A.
30/10/2021	30/10/2028	400	DASAB5 CDIE	394,644.15	986.610370	3.0091	376.45	0	DIAGNOSTICOS DA AMERICA S.A.
30/10/2021	30/10/2031	700	DASAC5 CDIE	685,743.68	979.633831	3.2003	772.17	0	DIAGNOSTICOS DA AMERICA S.A.
				1,466,811.36			1,336.77		
21/09/2020	22/09/2025	350	DIRR16 CDIE	373,229.01	1,066.368600	1.9836	244.62	0	DIRECIONAL ENGENHARIA S/A
				373,229.01			244.62		

Data	Vencimento	Quantidade	Título	Financeiro	P.U.	Coupon/Rent	Ganho Diários	QtdMargem	Emissor
20/09/2021	20/09/2024	1,180	ELDC14 CDIE	1,264,129.32	1,071.296038	1.8151	1,135.95	0	ELDORADO BRASIL CELULOSE S/A
				1,264,129.32			1,135.95		
10/06/2019	10/06/2024	425	CEMTA1 CDIE	430,470.90	1,012.872694	1.4699	285.18	0	ENERGISA MATO GROSSO - DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.
				430,470.90			285.18		
25/08/2020	25/08/2025	350	ESULA4 CDIE	375,506.64	1,072.876109	1.5426	192.63	0	ENERGISA MATO GROSSO DO SUL - DISTRIBUIDORA DE ENE
				375,506.64			192.63		
15/10/2021	16/10/2028	220	ENGIC5 CDIE	229,387.21	1,042.669144	1.7966	245.47	0	ENERGISA S/A
20/10/2022	20/10/2027	600	ENGA17 CDIE	622,543.59	1,037.572654	1.5756	118.92	0	ENERGISA S/A
				851,930.80			364.38		
15/05/2019	17/05/2027	1,090	ENEV22 CDIE	1,126,529.43	1,033.513238	1.7252	750.45	0	ENEVA S.A.
15/05/2019	15/05/2024	441	ENEV12 CDIE	453,066.65	1,027.362026	1.5388	284.91	0	ENEVA S.A.
				1,579,596.08			1,035.36		
10/12/2022	10/12/2029	450	EESG12 CDIE	435,354.53	967.454500	4.7012	292.44	0	ENVIRONMENTAL ESG PARTICIPACOES S.A.
				435,354.53			292.44		
01/10/2018	01/10/2024	182	EQTL13 CDIE	190,009.42	1,044.007807	1.5084	122.04	0	EQUATORIAL ENERGIA S/A
				190,009.42			122.04		
15/05/2022	15/05/2028	600	EQMA19 CDIE	609,533.39	1,015.888990	1.8884	2,261.47	0	EQUATORIAL MARANHAO DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A
				609,533.39			2,261.47		
15/05/2022	15/05/2028	1,774,043	CELP16 CDIE	1,800,926.85	1.015154	1.9123	1,238.28	0	EQUATORIAL PARA DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.
				1,800,926.85			1,238.28		
25/10/2022	25/10/2027	1,375	GUAR16 CDIE	1,300,402.90	945.747565	6.2073	976.97	0	GUARARAPES CONFECÇOES S/A
				1,300,402.90			976.97		
15/08/2022	25/08/2024	7	LF CDIE	402,311.15	57,473.021546	1.5688	229.06	0	HAITONG BANCO DE INVESTIMENTO DO BRASIL SA
15/08/2022	15/08/2025	16	LF CDIE	924,179.36	57,761.209795	1.6750	530.02	0	HAITONG BANCO DE INVESTIMENTO DO BRASIL SA
				1,326,490.51			759.08		
10/07/2019	10/07/2024	1,000	HAPV11 CDIE	332,001.15	332.001149	121.6115	192.96	0	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA
				332,001.15			192.96		
15/09/2022	15/09/2027	650	HSPA12 CDIE	606,176.40	932.579082	6.7368	624.37	0	HOSPITAL ANCHIETA S.A
				606,176.40			624.37		
03/11/2021	03/11/2028	432	MATD11 CDIE	442,407.35	1,024.091090	1.9246	64.29	0	HOSPITAL MATER DEI S.A.
				442,407.35			64.29		
28/09/2020	28/09/2027	240	IGTAB0 CDIE	260,172.49	1,084.052061	1.4121	119.59	0	IGUATEMI EMPRESA DE SHOPPING CENTERS S/A
				260,172.49			119.59		
15/04/2022	15/04/2025	100	IOCHA1 CDIE	104,044.14	1,040.441426	2.1725	80.88	0	IOCHPE-MAXION S.A.
15/04/2022	15/04/2027	842	IOCHB1 CDIE	885,711.81	1,051.914263	2.3351	1,481.08	0	IOCHPE-MAXION S.A.
				989,755.95			1,561.97		
23/09/2022	15/10/2027	1	LFSC CDIE	342,374.55	342,374.552126	2.2500	205.10	0	ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.
08/01/2019	15/01/2025	1	LFSC REF	318,663.84	318,663.843360	2.2500	189.52	0	ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.
08/01/2019	15/01/2025	2	LFSC REF	637,327.69	318,663.843360	2.2500	379.05	0	ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.
16/01/2019	15/09/2029	1	LFSC REF	446,211.22	446,211.216795	118.0800	306.12	0	ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.
				1,744,577.30			1,079.78		
15/06/2021	15/06/2027	275	ITSA14 CDIE	280,176.24	1,018.822701	1.3737	127.72	0	ITAUSA INVESTIMENTOS ITAU SA
				280,176.24			127.72		
15/03/2021	17/03/2031	365	LORTA7 IPCA	389,153.10	1,066.172872	7.6456	1,381.64	0	LOCALIZA RENT A CAR SA
25/02/2022	26/02/2029	830	LORTB9 CDIE	878,951.39	1,058.977577	2.1257	453.41	0	LOCALIZA RENT A CAR SA
				1,268,104.49			1,835.05		
10/04/2019	10/04/2024	300	UNDAC1 CDIE	311,250.64	1,037.502149	115.1764	129.70	0	LOCAMERICA RENT A CAR S.A.
				311,250.64			129.70		
28/01/2022	15/01/2026	780	MRFGA0 CDIE	774,696.94	993.201202	2.4528	404.91	0	MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.
11/11/2022	11/11/2027	500	MRFGA1 CDIE	499,535.04	999.070072	2.6500	293.23	0	MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.
				1,274,231.97			698.14		
15/10/2021	15/10/2026	880	MNRVA1 CDIE	895,741.17	1,017.887691	2.5011	520.46	0	MINERVA S.A.
				895,741.17			520.46		
05/04/2022	05/04/2027	660	MVLV19 CDIE	687,449.18	1,041.589666	3.2927	201.84	0	MOVIDA LOCAÇÃO DE VEÍCULOS S.A.
				687,449.18			201.84		
15/09/2021	15/09/2026	200	MOVI17 CDIE	209,604.47	1,048.022341	3.2126	170.00	0	MOVIDA PARTICIPACOES S.A.
15/09/2021	15/09/2031	200	MOVI37 IPCA	225,725.12	1,128.625614	8.2385	37.52	0	MOVIDA PARTICIPACOES S.A.
27/06/2019	27/07/2027	519	MOVI34 CDIE	504,413.79	971.895553	3.2476	467.44	0	MOVIDA PARTICIPACOES S.A.
15/09/2021	17/09/2029	700	MOVI27 CDIE	724,356.30	1,034.794716	3.5880	633.93	0	MOVIDA PARTICIPACOES S.A.

Data	Vencimento	Quantidade	Título	Financeiro	P.U.	Coupon/Rent	Ganho Diários	QtdMargem	Emissor
15/10/2020	15/10/2025	600	MOV125 CDIE	626,915.50	1,044.859173	3.0174	316.05	0	MOVIDA PARTICIPACOES S.A.
12/04/2021	15/04/2027	530	MOV116 CDIE	443,717.60	837.203024	3.2058	323.27	0	MOVIDA PARTICIPACOES S.A.
				2,734,732.79			1,948.21		
24/08/2020	25/08/2025	750	MRVEA8 CDIE	800,417.39	1,067.223184	2.3615	473.64	0	MRV ENGENHARIA E PARTICIPACOES SA
				800,417.39			473.64		
10/05/2018	10/05/2024	112	MULP16 CDIE	1,152,964.32	10,294.324287	109.7256	638.02	0	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S/A
				1,152,964.32			638.02		
21/07/2022	21/07/2027	545	NATUA1 CDIE	540,553.65	991.841557	2.0129	455.84	0	NATURA COSMETICOS S/A
				540,553.65			455.84		
13/09/2022	13/09/2032	1,802	NTSD35 CDIE	1,903,404.15	1,056.273113	1.8701	1,982.55	0	NOVA TRANSPORTADORA DO SUDESTE S/A - NTS
				1,903,404.15			1,982.55		
15/05/2019	15/05/2024	752	OMGE11 CDIE	424,350.21	564.295490	1.7846	306.58	0	OMEGA GERACAO S.A.
15/03/2021	15/03/2029	2,400	OMGE13 CDIE	2,197,868.03	915.778346	2.6679	1,145.80	0	OMEGA GERACAO S.A.
				2,622,218.24			1,452.38		
15/01/2019	15/01/2029	36	PETR26 IPCA	44,277.86	1,229.940493	5.4803	118.43	0	PETROLEO BRASILEIRO S A PETROBRAS
				44,277.86			118.43		
09/09/2021	11/09/2028	2	LFSN CDIE	823,875.44	411,937.718476	2.0000	482.92	0	PORTOSEG S/A - CREDITO FINANCIAMENTO E INVESTIMEN
09/09/2021	11/09/2028	1	LFSN CDIE	549,250.29	549,250.291302	2.0000	321.95	0	PORTOSEG S/A - CREDITO FINANCIAMENTO E INVESTIMEN
				1,373,125.73			804.87		
15/06/2019	17/06/2024	67	RDCO29 CDIE	340,568.28	5,083.108729	1.8741	117.09	0	RODOVIAS DAS COLINAS S/A
				340,568.28			117.09		
23/09/2019	23/09/2024	377	SNGO16 CDIE	143,189.74	379.813628	1.0228	65.83	0	SANEAMENTO DE GOIAS S A
15/11/2018	16/11/2023	503	SNGO15 CDIE	47,149.54	93.736668	1.4864	26.34	0	SANEAMENTO DE GOIAS S A
				190,339.28			92.16		
15/09/2021	15/01/2031	1,505	JSMLA5 CDIE	1,490,024.93	990.049784	3.8869	1,417.20	0	SIMPAR S.A.
				1,490,024.93			1,417.20		
01/02/2021	02/02/2026	1,300	SULM28 CDIE	1,395,574.73	1,073.519026	1.7785	511.44	0	SUL AMERICA S A
				1,395,574.73			511.44		
15/09/2019	15/09/2028	86	SUZB18 CDIE	895,826.92	10,416.592120	1.5021	338.53	0	SUZANO S.A.
				895,826.92			338.53		
15/03/2021	16/03/2026	1,000	CCPRB3 CDIE	1,053,461.83	1,053.461830	2.2312	1,920.74	0	SYN PROP E TECH SA
				1,053,461.83			1,920.74		
25/07/2023	25/07/2028	1,060	TBSP11 CDIE	1,060,000.00	1,000.000000	2.3000	0.00	0	TIM BRASIL SERVICOS E PARTICIPACOES S/A
				1,060,000.00			0.00		
15/05/2021	15/05/2028	820	TAEAA1 CDIE	852,779.42	1,039.974897	1.4739	766.43	0	TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA S/A
				852,779.42			766.43		
15/12/2020	15/12/2025	860	TRIS17 CDIE	548,996.84	638.368415	2.2994	337.80	0	TRISUL S.A.
				548,996.84			337.80		
09/12/2022	09/12/2027	100	USIM19 CDIE	99,894.16	998.941635	2.0791	57.08	0	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS S/A. USIMINAS
09/12/2022	09/12/2032	1,300	USIM39 CDIE	1,298,961.06	999.200818	2.3711	1,215.93	0	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS S/A. USIMINAS
23/05/2022	24/05/2027	300	USIM18 CDIE	302,360.79	1,007.869290	2.1383	152.85	0	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS S/A. USIMINAS
				1,701,216.01			1,425.86		
15/10/2021	15/10/2028	470	VAMO14 CDIE	488,343.92	1,039.029623	2.5606	420.48	0	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS MAQUINAS E EQUIPAMENTO
15/06/2021	16/06/2031	850	VAMO23 CDIE	866,203.63	1,019.063093	2.7680	295.15	0	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS MAQUINAS E EQUIPAMENTO
20/08/2019	20/08/2024	112	VAMO12 CDIE	119,499.92	1,066.963562	1.0800	55.66	0	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS MAQUINAS E EQUIPAMENTO
20/08/2019	20/08/2026	674	VAMO22 CDIE	718,593.72	1,066.162793	1.9908	574.47	0	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS MAQUINAS E EQUIPAMENTO
				2,192,641.19			1,345.76		
30/04/2021	30/04/2024	470	VVAR16 CDIE	441,139.57	938.594828	17.3988	2,001.03	0	VIA S.A.
30/04/2021	30/04/2026	460	VVAR26 CDIE	329,411.73	716.112451	24.3479	4,157.46	0	VIA S.A.
				770,551.30			6,158.48		
03/10/2022	03/10/2029	1,800	VBBR15 CDIE	1,861,998.47	1,034.443592	1.7993	1,780.31	0	VIBRA ENERGIA S.A
				1,861,998.47			1,780.31		
15/10/2019	15/10/2024	1,020	BKBR18 CDIE	1,034,720.56	1,014.431918	3.7461	1,430.87	0	ZAMP S.A.
				1,034,720.56			1,430.87		

Portfólio Investido

Cnpj	Portfólio	Quantidade	Quota	Financeiro	% P.L.	Ganho Diário
34475973000107	FIDC CR AUTO II SNR	492.205.000000	0.080329	\$39.538.46	0.03	26.59
32724252000150	RB CAP A I FIDC SN2	690.000.000000	0.083846	\$57.853.88	0.04	35.48
34850088000152	SUMUP I FIDC	1.450.000.000000	1.005998	\$1.458.696.80	1.22	872.02
24761946000139	FIDC CREDZ SEN 7	600.000.000000	1.006463	\$603.878.07	0.50	388.93
35557748000174	NEON FIDC 1 SEN 2	459.659.000000	1.006943	\$462.850.41	0.38	320.13
24761946000139	FIDC CREDZ SEN 8	360.000.000000	1.006943	\$362.499.48	0.30	250.73
11989256000190	MULTSETORIAL BVA MII	294.408850	9.676450	\$2.848.83	0.00	61.96
32222848000151	FIDC ANGA SABEM X SR	405.000000	135.361093	\$54.821.24	0.04	32.77
36935900000178	FIDC C AUTO III SEN	700.000000	143.613637	\$100.529.55	0.08	67.62
33512396000105	FIDC CREDITAS AUTOIV	75.000000	226.831092	\$17.012.33	0.01	11.12
37676161000100	FIDC ANGA ABEMI SNR	3.102.000000	359.822572	\$1.116.169.62	0.93	346.93
17474548000176	FIDC LF I SENIOR 3	799.999999	377.735752	\$302.188.60	0.25	365.87
41196339000192	SYNGENTA TECHFIDCSRI	180.000.000000	1.008893	\$181.600.67	0.15	107.15
43866348000179	FIDC OPEA AGRO	550.000.000000	1.007754	\$554.264.89	0.46	329.19
35138055000147	FIDC 3R AGR PROD A I	620.000000	1.008.158730	\$625.058.41	0.52	390.57
27984909000188	FIDC CONS I SNR 2	637.000000	1.064.997280	\$678.403.27	0.56	449.89
38455413000133	SIMPAR FIDC SNR	1.250.000000	1.014.274756	\$1.267.843.45	1.06	816.56
30366120000178	FIDC VCK SNR	1.685.491192	675.276476	\$1.138.172.55	0.95	862.02
42860938000121	FIDC CRE AUTO VII SR	600.000000	386.881678	\$232.129.01	0.19	153.94
34218960000144	FIDC ALION CONS SR	547.000000	1.319.602198	\$721.822.40	0.60	492.41
08632394000102	RED FIDC SNR13	880.000000	1.288.641413	\$1.134.004.44	0.95	708.59
43237790000136	FIDC CONSORCIO II	800.770801	1.050.723638	\$841.388.81	0.70	525.74
43143480000152	FIDC RPMC SENIOR	496.890988	1.000.000005	\$496.890.99	0.41	-7.771.15
38137153000158	KOVI I FIDC SR2	700.000000	1.001.441469	\$701.009.03	0.58	504.70
46766050000185	FIDC ALION II CON S1	138.300266	1.134.563432	\$156.910.42	0.13	107.04
40365950000134	INSS I FIDC CL SEN	1.190.000000	817.681198	\$973.040.63	0.81	570.36
46766118000126	FIDC CONSIG QI SEN	700.000000	1.106.828250	\$774.779.78	0.64	513.81
26722650000134	FIDC VERDECARD SR9	240.000000	1.002.394813	\$240.574.76	0.20	143.82
				\$15,296,780.78		1,684.82

Despesas

Nome	Data Início	Data Fim	Valor
Despesa CVM - DIFERIMENTO 5/2023	09/05/2023	09/05/2024	\$15.580.56
Despesa Anbima - DIFERIMENTO 6/2023	07/06/2023	07/08/2023	\$87.63
Despesa SELIC 7/2023	03/07/2023	31/07/2023	(\$93.78)
Despesa CETIP 7/2023	03/07/2023	31/07/2023	(\$2.293.56)
Outras Despesas - DIFERIMENTO 7/2023	06/07/2023	04/08/2023	\$4.64
Despesa CETIP- DIFERIMENTO 6/2023	14/07/2023	15/08/2023	(\$24.68)
Despesa SELIC- DIFERIMENTO 6/2023	14/07/2023	15/08/2023	(\$34.94)
Despesa de Auditoria- DIFERIMENTO 11/2022	24/07/2023	24/07/2024	(\$714.36)
Despesa SELIC 8/2023	01/08/2023	31/08/2023	\$0.00
Despesa CETIP 8/2023	01/08/2023	31/08/2023	\$0.00

Informações Gerais

Público Alvo	Investidores em geral
Classificação ANBIMA	Multimercados Livre
CNPJ	35.637.151/0001-30
Código ANBIMA	524360
Gestor	Icatu Vanguarda Gestão de Recursos
Administrador	BEM DTVM
Custodiante	Banco Bradesco S/A
Status	Aberto
Início	30/dez/19
Benchmark	IMA-B 5
PL Atual	R\$ 343.502.317
PL Médio (12m)	R\$ 221.926.749
Taxa de Administração	2,000% a.a.
Taxa de Performance	20% s/ 100% do IMA B-5
Periodicidade	Anual
Aplicação Mínima Inicial*	R\$ 500,00
Movimentação Mínima*	R\$ 500,00
Saldo Mínimo Permanência*	R\$ 500,00
Horário de Movimentação*	Até as 14h
Aplicações (dias úteis)	Depósito em D+0 Cota em D+1
Resgate	Cota em D+30 d.c.
(30 d.c.+2 d.u.) Pagamento em	D+30 d.c. + D+2 d.u.
Tributação	IR Aliquota de 15% sobre o rendimento, recolhido no momento do resgate.
	IOF
Dados para Aplicação:	Banco 237 Agência 2856-8 Conta Corrente Favorecido 30745-9

Descrição

O Fundo Long Biased tem o objetivo de gerar retorno real atrativo no longo prazo. O book de bolsa é responsável majoritariamente pela utilização do risco do fundo. A composição do portfólio de ações refletirá em grande parte a nossa estratégia do Icatu Vanguarda Dividendos FIA, estratégia core do portfólio, além de oportunidades de investimentos em empresas com elevado potencial de retorno ajustado ao risco que não atendam a todos os critérios de elegibilidade para a estratégia "Dividendos". A exposição à bolsa fluirá de forma significativa ao longo do tempo.

Tabela de Rentabilidades¹

	2023		2022		2021		2020	
	Fundo	IMA-B 5	Fundo	IMA-B 5	Fundo	IMA-B 5	Fundo	IMA-B 5
janeiro	2,74%	1,40%	4,60%	0,11%	-0,98%	0,11%	0,41%	0,56%
fevereiro	0,17%	1,41%	0,32%	1,06%	0,35%	-0,60%	-4,18%	0,64%
março	1,58%	1,52%	4,44%	2,61%	0,64%	0,34%	-22,58%	-1,75%
abril	0,90%	0,90%	-3,04%	1,56%	1,52%	0,87%	5,51%	0,49%
maio	2,91%	0,57%	4,71%	0,78%	3,25%	0,69%	6,22%	2,12%
junho	3,57%	1,05%	-8,58%	0,33%	1,05%	-0,13%	5,61%	1,12%
julho	1,99%	0,97%	3,17%	0,01%	-2,60%	0,03%	5,65%	0,99%
agosto	-1,01%	0,61%	4,26%	0,00%	-2,24%	0,15%	-0,94%	0,43%
setembro	-0,07%	0,13%	1,19%	0,42%	-2,98%	1,00%	-4,93%	-0,12%
outubro	-1,32%	-0,31%	4,75%	1,91%	-4,95%	-1,24%	-1,34%	0,20%
novembro	4,45%	1,80%	0,42%	-0,33%	-0,10%	2,50%	10,72%	1,32%
dezembro	3,86%	1,46%	0,48%	0,94%	0,73%	0,79%	6,22%	1,83%

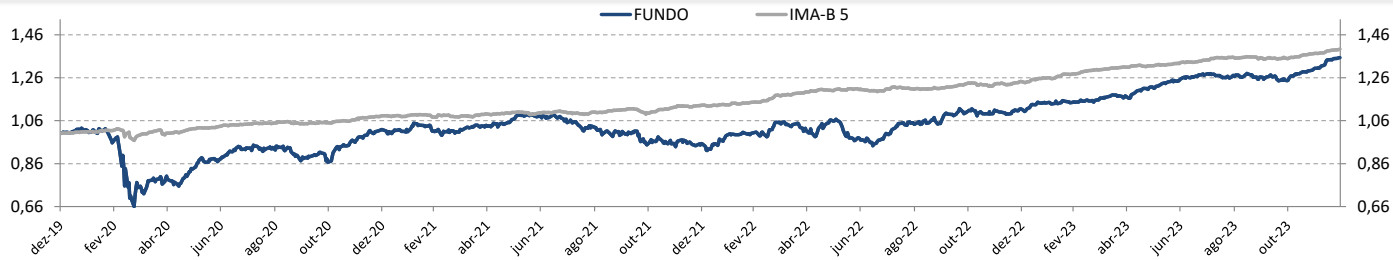
	2023		2022		2021		2020	
	Fundo	IMA-B 5	Fundo	IMA-B 5	Fundo	IMA-B 5	Fundo	IMA-B 5
Acum Ano	21,42%	12,13%	17,00%	9,78%	-6,40%	4,57%	1,79%	8,04%
Acum Início	35,17%	39,14%	11,33%	24,09%	-4,85%	13,04%	1,67%	8,10%

Retornos	6 meses		12 meses		24 meses		36 meses	
	Fundo	IMA-B 5	Fundo	IMA-B 5	Fundo	IMA-B 5	Fundo	IMA-B 5
	8,00%	4,75%	21,42%	12,13%	42,06%	23,09%	32,96%	28,71%

Nível de Risco



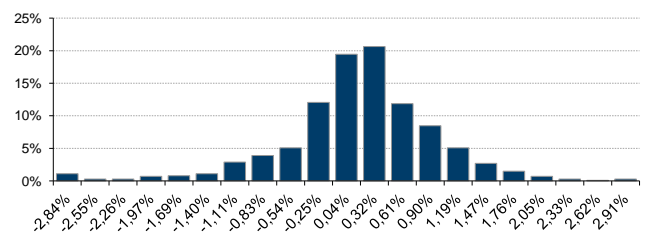
Rentabilidade Acumulada x IMA-B 5



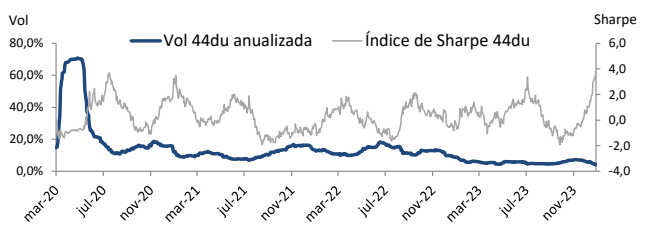
Estatísticas de 2020 a 2023

Descrição	Estatísticas
Nº Meses >0	32 (67%)
Nº Meses <0	16 (33%)
Nº Meses >Benchmark	26 (54%)
Nº Meses <Benchmark	22 (46%)
Maior Rentabilidade Mensal	10,72% - 11/2020
Menor Rentabilidade Mensal	-22,58% - 03/2020
Maximum Drawdown ¹	-35,71%
Volatilidade Diária a.a. (12m)	5,51%
Índice de Sharpe (12m)	1,67

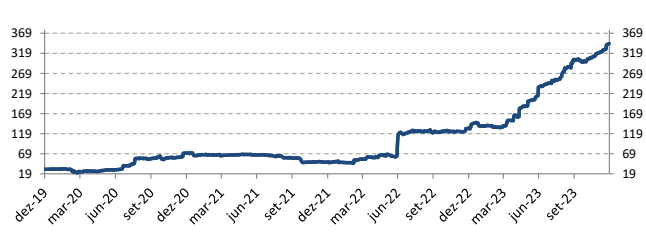
Histograma de Retornos



Evolução da Volatilidade / Índice de Sharpe



Evolução do PL (Milhões)



¹Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Maximum Drawdown é o declínio do valor máximo da cota até seu valor mínimo, calculado desde a constituição do fundo. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou Fundo Garantidor de Crédito - FGC. É recomendada a leitura cuidadosa do formulário de informações complementares, da lâmina de informações essenciais e do regulamento antes de investir. Supervisão e fiscalização: Comissão de Valores Mobiliários - CVM, Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br. Para mais informações, visite nosso site: www.icatu Vanguarda.com.br ou entre em contato pelo número (21) 3824-7107.

*As informações referentes à aplicação mínima inicial, movimentação mínima, saldo mínimo de permanência e o horário de movimentação podem ser diferentes para clientes que realizam movimentações via conta e ordem, favor verificar junto ao distribuidor e consulte o regulamento.



Carteira Diária

Data de Emissão : 03/01/2024 11:27

Data de Posição : 29/12/2023

Cliente : ICATU VANGUARDA IGARATE LONG BIASED FIM

Ações													
Código	Papel	Qtd. Disponível	Qtd. Bloqueada	Qtd. Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pós. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/RV	% s/Total
ARZZ3	AREZZO ON	87.050	100	87.150	58,99	64,53	5.140.775,95	483.013,55	5.623.789,50	0,00	5.623.789,50	2,37%	1,64%
B3SA3	B3 ON NM	547.000	0	547.000	11,50	14,55	6.292.658,02	1.666.191,98	7.958.850,00	0,00	7.958.850,00	3,35%	2,32%
BBAS3	BRASILON EJ NM	134.300	0	134.300	49,14	55,39	6.599.998,07	838.878,93	7.438.877,00	0,00	7.438.877,00	3,13%	2,17%
BBDC3	BRADESCOON EB N1	911.010	0	911.010	12,67	15,28	11.539.940,15	2.380.292,65	13.920.232,80	0,00	13.920.232,80	5,86%	4,05%
BBDC4	BRADESCOPN EB N1	336.500	0	336.500	14,39	17,09	4.843.606,12	907.178,88	5.750.785,00	0,00	5.750.785,00	2,42%	1,67%
BOVA11	ISHARES BOVA	289.749	0	289.749	110,71	130,39	32.077.166,99	5.703.205,12	37.780.372,11	0,00	37.780.372,11	15,90%	11,00%
BPAC11	BTGP BANCO UNT N2	195.244	5.000	200.244	30,49	37,61	6.106.361,13	1.424.815,71	7.531.176,84	0,00	7.531.176,84	3,17%	2,19%
CPLE3	COPELON *	580.200	0	580.200	8,06	9,49	4.673.839,61	832.258,39	5.506.098,00	0,00	5.506.098,00	2,32%	1,60%
CSAN3	COSAN ON NM	290.100	0	290.100	16,11	19,36	4.672.925,05	943.410,95	5.616.336,00	0,00	5.616.336,00	2,36%	1,64%
EGIE3	ENGIE BRASILON NM	132.600	0	132.600	40,16	45,33	5.325.731,73	685.026,27	6.010.758,00	0,00	6.010.758,00	2,53%	1,75%
ELET3	ELETROBRASON * N1	57.145	0	57.145	36,01	42,43	2.057.557,03	367.105,32	2.424.662,35	0,00	2.424.662,35	1,02%	0,71%
ELET6	ELETROBRASPMB* N1	45.700	0	45.700	39,71	46,98	1.814.619,60	332.366,40	2.146.986,00	0,00	2.146.986,00	0,90%	0,63%
EQTL3	EQUATORIALON N2	176.204	0	176.204	32,12	35,72	5.659.836,10	634.170,78	6.294.006,88	0,00	6.294.006,88	2,65%	1,83%
GGBR4	GERDAUPN N1	93.045	0	93.045	21,91	23,76	2.038.722,88	172.026,32	2.210.749,20	0,00	2.210.749,20	0,93%	0,64%
ITSA4	ITAUSAPN N1	1.571.982	0	1.571.982	8,49	10,37	13.343.103,39	2.958.349,95	16.301.453,34	0,00	16.301.453,34	6,86%	4,75%
ITUB4	ITAU UNIBANCO PN N1	329.300	0	329.300	27,65	33,97	9.105.388,55	2.080.932,45	11.186.321,00	0,00	11.186.321,00	4,71%	3,26%
LREN3	LOJAS RENNERTON NM	529.100	17.900	547.000	13,87	17,42	7.588.423,56	1.940.316,44	9.528.740,00	0,00	9.528.740,00	4,01%	2,77%
MULT3	MULTIPLAN ON N2	107.100	3.600	110.700	25,20	28,42	2.789.146,20	356.947,80	3.146.094,00	0,00	3.146.094,00	1,32%	0,92%
NASD11	TREND NASDAQCI	1.909.242	0	1.909.242	10,17	11,43	19.412.823,09	2.409.812,97	21.822.636,06	0,00	21.822.636,06	9,18%	6,35%
PETR3	PETROBRASON	66.100	0	66.100	36,98	38,98	2.444.673,94	131.904,06	2.576.578,00	0,00	2.576.578,00	1,08%	0,75%
PETR4	PETROBRASP	65.300	100	65.400	34,70	37,24	2.269.132,89	166.363,11	2.435.496,00	0,00	2.435.496,00	1,02%	0,71%
PRI03	PETRORIO ON NM	77.700	0	77.700	44,06	46,05	3.423.362,24	154.722,76	3.578.085,00	0,00	3.578.085,00	1,51%	1,04%
RECV3	PETRORECONCA ON	165.800	0	165.800	20,57	21,72	3.410.947,26	190.228,74	3.601.176,00	0,00	3.601.176,00	1,52%	1,05%
RENT1	RENT1 DIR ON	222	0	222	0,00	20,00	0,00	4.440,00	4.440,00	0,00	4.440,00	0,00%	0,00%
RENT3	LOCALIZAON NM	62.039	0	62.039	52,63	63,60	3.264.834,33	680.846,07	3.945.680,40	0,00	3.945.680,40	1,66%	1,15%
SBSP3	SABESPON * NM	102.700	0	102.700	60,33	75,37	6.196.083,01	1.544.415,99	7.740.499,00	0,00	7.740.499,00	3,26%	2,25%
SMAL11	ISHARES SMAL CI	42.674	0	42.674	95,71	113,20	4.084.501,35	746.195,45	4.830.696,80	0,00	4.830.696,80	2,03%	1,41%
SMFT3	SMART FIT SMFT-M2 ON	357.500	0	357.500	20,07	26,03	7.175.016,21	2.130.708,79	9.305.725,00	0,00	9.305.725,00	3,92%	2,71%
SUZB3	SUZANO PAPELON I06 N1	122.400	0	122.400	51,84	55,63	6.344.795,03	464.316,97	6.809.112,00	0,00	6.809.112,00	2,86%	1,98%
VALE3	VALE R DOCEON N1	150.428	39.300	189.728	70,64	77,20	13.403.176,82	1.243.824,78	14.647.001,60	0,00	14.647.001,60	4,26%	3,06%
TOTAL		9.535.434	66.000	9.601.434			203.099.146,30	34.574.267,58	237.673.413,88	0,00	237.673.413,88	100,00%	69,20%

Opções														
Código	Papel	Tipo	Corretora	Praça	Exercício	Data Vencto.	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corret.	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	% S/RV	% s/Total
ARZZA720	ARZZ ON NM	CALL	BRADCTVM	SP	71,04	19/01/2024	(100)	0,92	0,31	(91,85)	60,35	(31,50)	0,00%	0,00%
CMIGB124	CMIG FMEJ PN N1	CALL	BRADCTVM	SP	11,98	16/02/2024	12.000	0,20	0,27	2.420,49	772,73	3.193,22	(0,08%)	0,00%
CMIGM107	CMIG /EJ PN N1	PUT	BRADCTVM	SP	10,24	19/01/2024	(78.300)	0,28	0,02	(21.881,01)	19.931,56	(1.949,45)	0,05%	0,00%
CMIGN119	CMIG FMEJ PN N1	PUT	BRADCTVM	SP	11,48	16/02/2024	(113.200)	0,47	0,34	(52.727,52)	14.142,51	(38.585,01)	0,98%	(0,01%)
IBOVA130	IBOV IBO	CALL	BRADCTVM	SP	130.000,00	17/01/2024	(39)	1.304,06	5.299,67	(50.858,27)	(155.828,84)	(206.687,11)	5,23%	(0,06%)
IBOVA131	IBOV IBO	CALL	BRADCTVM	SP	131.000,00	17/01/2024	(264)	1.129,01	4.452,19	(298.059,93)	(877.317,90)	(1.175.377,83)	29,76%	(0,34%)
IBOVA134	IBOV FM IBO	CALL	BRADCTVM	SP	134.000,00	17/01/2024	(76)	1.161,50	2.284,25	(88.274,11)	(85.328,54)	(173.602,65)	4,39%	(0,05%)
IBOVA135	IBOV FM IBO	CALL	BRADCTVM	SP	135.000,00	17/01/2024	(310)	1.090,20	1.730,28	(337.962,96)	(198.424,00)	(536.386,96)	13,58%	(0,16%)
IBOVA136	IBOV FM IBO	CALL	BRADCTVM	SP	136.000,00	17/01/2024	(43)	996,09	1.274,23	(42.831,96)	(54.791,82)	(11.959,86)	1,39%	(0,02%)
IBOVA55	IBOV FM IBO	CALL	BRADCTVM	SP	132.000,00	17/01/2024	(234)	1.089,98	3.657,75	(255.054,39)	(600.857,95)	(855.912,34)	21,67%	(0,25%)
IBOV138	IBOV FM IBO	CALL	BRADCTVM	SP	138.000,00	14/02/2024	(66)	1.108,49	2.035,18	(73.160,04)	(61.161,95)	(134.321,99)	3,40%	(0,04%)
IBOVM123	IBOV IBO	PUT	BRADCTVM	SP	123.000,00	17/01/2024	(77)	1.077,87	81,84	(82.996,01)	76.694,39	(6.301,62)	0,16%	0,00%
IBOVM124	IBOV FM IBO	PUT	BRADCTVM	SP	124.000,00	17/01/2024	(324)	1.105,14	101,26	(358.066,97)	325.257,84	(32.809,13)	0,83%	(0,01%)
IBOVM125	IBOV FM IBO	PUT	BRADCTVM	SP	125.000,00	17/01/2024	(84)	1.083,88	126,26	(91.045,87)	80.439,84	(10.606,03)	0,27%	0,00%
IBOVM126	IBOV FM IBO	PUT	BRADCTVM	SP	126.000,00	17/01/2024	(77)	1.170,94	158,74	(90.162,61)	77.939,35	(12.223,26)	0,31%	0,00%
IBOVM127	IBOV FM IBO	PUT	BRADCTVM	SP	127.000,00	17/01/2024	(26)	1.227,59	201,36	(31.917,22)	26.681,77	(5.235,45)	0,13%	0,00%
IBOVM129	IBOV FM IBO	PUT	BRADCTVM	SP	129.000,00	17/01/2024	(13)	1.067,87	333,43	(13.882,29)	9.547,69	(4.334,60)	0,11%	0,00%
IBOVM130	IBOV FM IBO	PUT	BRADCTVM	SP	130.000,00	17/01/2024	(152)	1.003,03	435,44	(152.459,90)	86.272,42	(66.187,48)	1,68%	(0,02%)
IBOVM131	IBOV FM IBO	PUT	BRADCTVM	SP	131.000,00	17/01/2024	(342)	1.186,03	573,98	(405.622,36)	209.322,90	(196.299,46)	4,97%	(0,06%)
IBOVM133	IBOV FM IBO	PUT	BRADCTVM	SP	133.000,00	17/01/2024	(150)	1.017,63	1.017,28	(152.643,94)	52,33	(152.591,61)	3,86%	(0,04%)
IBOVM55	IBOV FM IBO	PUT	BRADCTVM	SP	132.000,00	17/01/2024	(151)	1.022,09	762,41	(154.335,67)	39.212,25	(115.123,42)	2,91%	(0,03%)
IBOVN126	IBOV FM IBO	PUT	BRADCTVM	SP	126.000,00	14/02/2024	(38)	1.076,40	654,19	(40.903,32)	16.044,23	(24.859,09)	0,63%	(0,01%)
LRENA182	LREN FMEJ ON NM	CALL	BRADCTVM	SP	18,05	19/01/2024	(226.400)	0,51	0,38	(115.248,71)	28.927,00	(86.321,71)	2,19%	(0,03%)
LRENA187	LREN FMEJ ON NM	CALL	BRADCTVM	SP	18,55	19/01/2024	(75.500)	0,32	0,24	(24.114,96)	5.903,35	(18.211,61)	0,46%	(0,01%)

MULTA290	MULT FM/EJ ON	N2	CALL	BRADCTVM	SP	28,65	19/01/2024	(35.200)	0,57	0,53	(20.026,60)	1.305,53	(18.721,07)	0,47%	(0,01%)	
MULTA295	MULT FM/EJ ON	N2	CALL	BRADCTVM	SP	29,15	19/01/2024	(75.500)	0,39	0,34	(29.390,10)	3.556,02	(25.834,08)	0,65%	(0,01%)	
TOTAL								(594.666)			(2.981.298,08)	(968.814,98)	(3.950.113,06)	100,00%	(1,16%)	
Futuros																
Ativo	Vencdo.	Corretora						Quantidade	Ajuste Equalização		Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% s/Total	
FUT DAP	G24	BRADCTVM						56,00	0,00		0,00	96.076,04	9.074.235,94	(16,22%)	2,64%	
FUT DOL	G24	BRADCTVM						85,00	0,00		0,00	4.869,03	20.693.390,25	(37,00%)	6,02%	
FUT IND	G24	BRADCTVM						(447,00)	0,00		0,00	135.790,00	(60.698.130,00)	108,52%	(17,67%)	
FUT WDO	G24	BRADCTVM						46,00	0,00		0,00	4.869,03	2.239.755,18	(4,00%)	0,65%	
FUT WIN	G24	BRADCTVM						(1.003,00)	0,00		0,00	135.790,00	(27.239.474,00)	48,70%	(7,93%)	
TOTAL								0,00	0,00		0,00		(55.930.222,63)	100,00%	(16,29%)	
Opções de Futuros																
Código	Vencdo.	Tipo	Papel	Corretora	Exercício	Data Vcto		Quantidade	Custo Médio	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado	% S/FU	% s/Total	
OPD DOL	FSD9	V	Opção s/disp. / Dólar comercia	BRADCTVM	4.900,00	02/01/2024		(53)	39,14	59,96	(103.728,18)	(55.179,07)	(158.907,25)	68,17%	(0,05%)	
OPD DOL	FSG7	V	Opção s/disp. / Dólar comercia	BRADCTVM	4.875,00	02/01/2024		(6)	33,99	37,11	(10.196,77)	(935,93)	(11.132,70)	4,78%	0,00%	
OPD DOL	FSG8	V	Opção s/disp. / Dólar comercia	BRADCTVM	4.925,00	02/01/2024		(15)	41,00	84,10	(30.749,56)	(32.326,94)	(63.076,50)	27,06%	(0,02%)	
TOTAL											(144.674,51)	(88.441,94)	(233.116,45)	100,00%	(0,07%)	
Renda Fixa																
Código	Aplicação	Emitente	MTM % AA	Tx. Over %	Tx % AA	Index	Emissão	Venc.	Quantidade	PU Mercado	Valor da Aplicação	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/RF	% s/Total
LFT																
K861616	05/01/2023	TESOURO	0,021088%	1,315172%	0,053332%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	396	14.264,55547300	5.001.684,85	5.648.763,97	0,00	5.648.763,97	4,90%	1,64%
L730511	01/12/2023	TESOURO	0,005024%	1,312170%	0,007919%	SELIC	26/10/2018	01/03/2025	864	14.268,72218200	12.223.730,51	12.328.175,97	0,00	12.328.175,97	10,70%	3,59%
L791725	27/12/2023	TESOURO	0,005024%	1,312170%	0,005751%	SELIC	26/10/2018	01/03/2025	877	14.268,72218200	12.502.617,29	12.513.669,35	0,00	12.513.669,35	10,86%	3,64%
SUBTOTAL									2.137		29.728.032,65	30.490.609,29	0,00	30.490.609,29	26,46%	8,87%
LFT-O																
L800393	29/12/2023	TESOURO	0,000000%	0,000000%	11,640000%	PRE	02/10/2020	02/01/2024	1.270	14.169,70003150	17.995.519,04	17.995.519,04	0,00	17.995.519,04	15,61%	5,24%
SUBTOTAL									1.270		17.995.519,04	17.995.519,04	0,00	17.995.519,04	15,61%	5,24%
NTN-B																
J583273	09/08/2021	TESOURO	5,220716%	2,904540%	4,391462%	IPCA	10/01/2018	15/08/2028	1.000	4.406,14233800	4.045.035,92	4.406.142,33	0,00	4.406.142,33	3,82%	1,28%
J583277	09/08/2021	TESOURO	5,200006%	2,903270%	4,260950%	IPCA	20/01/2016	15/08/2026	21	4.353,18404700	83.540,42	91.416,86	0,00	91.416,86	0,08%	0,03%
J655709	06/09/2021	TESOURO	5,220716%	2,904540%	4,663669%	IPCA	10/01/2018	15/08/2028	189	4.406,14233800	741.928,50	832.760,90	0,00	832.760,90	0,72%	0,24%
J655713	06/09/2021	TESOURO	5,220716%	2,904540%	4,673689%	IPCA	10/01/2018	15/08/2028	300	4.406,14233800	1.177.010,72	1.321.842,70	0,00	1.321.842,70	1,15%	0,38%
J655720	06/09/2021	TESOURO	5,200006%	2,903270%	4,561714%	IPCA	20/01/2016	15/08/2026	975	4.353,18404700	3.771.719,59	4.244.354,44	0,00	4.244.354,44	3,68%	1,24%
K81169	11/03/2022	TESOURO	5,200006%	2,903270%	5,730521%	IPCA	20/01/2016	15/08/2026	200	4.353,18404700	780.459,27	870.636,80	0,00	870.636,80	0,76%	0,25%
K81180	11/03/2022	TESOURO	5,220716%	2,904540%	5,839877%	IPCA	10/01/2018	15/08/2028	300	4.406,14233800	1.169.332,06	1.321.842,70	0,00	1.321.842,70	1,15%	0,38%
K379027	04/07/2022	TESOURO	5,220716%	2,904540%	5,823375%	IPCA	10/01/2018	15/08/2028	1.100	4.406,14233800	4.528.154,45	4.846.756,57	0,00	4.846.756,57	4,20%	1,41%
K379032	04/07/2022	TESOURO	5,200006%	2,903270%	5,800056%	IPCA	20/01/2016	15/08/2026	1.100	4.353,18404700	4.517.572,69	4.788.502,45	0,00	4.788.502,45	4,15%	1,39%
K605092	27/09/2022	TESOURO	5,220014%	2,903205%	5,753623%	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	900	4.457,31096000	3.643.522,80	4.011.579,86	0,00	4.011.579,86	3,48%	1,17%
K605096	27/09/2022	TESOURO	5,220014%	2,903205%	5,747617%	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100	4.457,31096000	404.981,81	445.731,09	0,00	445.731,09	0,39%	0,13%
K835705	27/12/2022	TESOURO	5,200006%	2,903270%	6,355331%	IPCA	20/01/2016	15/08/2026	1.000	4.353,18404700	4.038.229,03	4.353.184,04	0,00	4.353.184,04	3,78%	1,27%
L617488	11/10/2023	TESOURO	5,220716%	2,904540%	5,610046%	IPCA	10/01/2018	15/08/2028	8.000	4.406,14233800	34.065.872,08	35.249.138,70	0,00	35.249.138,70	30,58%	10,26%
SUBTOTAL									15.185		62.967.359,34	66.783.889,44	0,00	66.783.889,44	57,94%	19,43%
TOTAL									18.592,00000000		110.690.911,03	115.270.017,77	0,00	115.270.017,77	100,00%	33,54%
Contas a Pagar/Receber																
Descrição												Valor	% S/ITES		% s/Total	
Ajuste Credor de Futuros												231.268,41	(4,39%)		0,07%	
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DOL]/[F24]/[BRADCTVM] a pagar em 02/01/20												(80,68)	0,00%		0,00%	
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DOL]/[G24]/[BRADCTVM] a pagar em 02/01/20												(81,02)	0,00%		0,00%	
Corretagem de Futuros/Opções [FUT WDO]/[F24]/[BRADCTVM] a pagar em 02/01/20												(8,73)	0,00%		0,00%	
Corretagem de Futuros/Opções [FUT WDO]/[G24]/[BRADCTVM] a pagar em 02/01/20												(8,77)	0,00%		0,00%	
Cotas a Emitir												(803.135,00)	15,25%		(0,23%)	
Cotas a Resgatar												(5.355,19)	0,10%		0,00%	
Despesa de AUDITORIA com pagamento 15/01/25												(893,35)	0,02%		0,00%	
Despesa de B 10 - TARIFA DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA com pagamento 08/01/24												(351,00)	0,01%		0,00%	
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 22/01/24												(4.038,60)	0,08%		0,00%	
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 25/01/24												(328,65)	0,01%		0,00%	
Despesa de DESPESA DE CBLC com pagamento 25/01/24												(612,20)	0,01%		0,00%	
Despesas com Auditoria em 15/01/24												(6.179,00)	0,12%		0,00%	
Diferimento de despesa de TAXA ANBIMA com vencimento 31/01/24												385,52	(0,01%)		0,00%	
Performance FEE Apropriada												(6.107.373,37)	115,94%		(1,78%)	
Performance Fee Proveniente de Resgate a Pagar em 02/01/25												(492,00)	0,01%		0,00%	
Performance Fee Proveniente de Resgate a Pagar em 08/01/24												(61.056,44)	1,16%		(0,02%)	
Receb. Divid. 0.24 de PETR3 s/ 32,900 em 20/02/2024												8.004,14	(0,15%)		0,00%	
Receb. Divid. 0.24 de PETR4 s/ 108,400 em 20/02/2024												26.372,33	(0,50%)		0,01%	

Receb. Divid. 0.67 de PETR3 s/ 32,900 em 20/03/2024	22.130,95	(0,42%)	0,01%
Receb. Divid. 0.67 de PETR4 s/ 108,400 em 20/03/2024	72.917,80	(1,38%)	0,02%
Receb. Juros s/ Cap. 0.02 de BBDC3 s/ 830,110 em 02/01/2024	14.319,25	(0,27%)	0,00%
Receb. Juros s/ Cap. 0.02 de BBDC4 s/ 306,700 em 02/01/2024	5.819,57	(0,11%)	0,00%
Receb. Juros s/ Cap. 0.02 de ITSA4 s/ 1,432,382 em 02/01/2024	33.703,23	(0,64%)	0,01%
Receb. Juros s/ Cap. 0.02 de ITUB4 s/ 300,000 em 02/01/2024	5.295,00	(0,10%)	0,00%
Receb. Juros s/ Cap. 0.05 de ITSA4 s/ 1,223,236 em 30/12/2024	62.996,65	(1,20%)	0,02%
Receb. Juros s/ Cap. 0.05 de ITSA4 s/ 990,836 em 30/12/2024	51.028,05	(0,97%)	0,01%
Receb. Juros s/ Cap. 0.08 de ITSA4 s/ 1,520,582 em 30/12/2024	120.734,21	(2,29%)	0,04%
Receb. Juros s/ Cap. 0.12 de ITSA4 s/ 1,150,336 em 30/12/2024	134.014,14	(2,54%)	0,04%
Receb. Juros s/ Cap. 0.16 de CPLE3 s/ 642,000 em 31/12/2049	102.090,59	(1,94%)	0,03%
Receb. Juros s/ Cap. 0.17 de LREN3 s/ 529,100 em 05/01/2024	90.763,93	(1,72%)	0,03%
Receb. Juros s/ Cap. 0.18 de BBDC3 s/ 881,210 em 02/01/2024	157.734,15	(2,99%)	0,05%
Receb. Juros s/ Cap. 0.18 de EGIE3 s/ 128,300 em 31/12/2049	22.800,42	(0,43%)	0,01%
Receb. Juros s/ Cap. 0.18 de LREN3 s/ 700 em 05/01/2024	125,78	0,00%	0,00%
Receb. Juros s/ Cap. 0.19 de MULT3 s/ 110,700 em 31/12/2024	20.920,98	(0,40%)	0,01%
Receb. Juros s/ Cap. 0.20 de BBDC4 s/ 325,500 em 02/01/2024	64.089,96	(1,22%)	0,02%
Receb. Juros s/ Cap. 0.21 de MULT3 s/ 92,500 em 30/09/2024	19.060,06	(0,36%)	0,01%
Receb. Juros s/ Cap. 0.22 de MULT3 s/ 92,100 em 31/10/2024	20.718,27	(0,39%)	0,01%
Receb. Juros s/ Cap. 0.23 de BPAC11 s/ 182,344 em 15/02/2024	42.102,34	(0,80%)	0,01%
Receb. Juros s/ Cap. 0.25 de ITUB4 s/ 319,500 em 30/04/2024	78.993,18	(1,50%)	0,02%
Receb. Juros s/ Cap. 0.27 de ITUB4 s/ 256,000 em 30/04/2024	68.940,80	(1,31%)	0,02%
Receb. Juros s/ Cap. 0.38 de RENT3 s/ 62,039 em 15/02/2024	23.752,27	(0,45%)	0,01%
Receb. Juros s/ Cap. 0.43 de PETR3 s/ 32,900 em 20/02/2024	14.126,82	(0,27%)	0,00%
Receb. Juros s/ Cap. 0.43 de PETR4 s/ 108,400 em 20/02/2024	46.545,52	(0,88%)	0,01%
Receb. Juros s/ Cap. 0.45 de BBDC3 s/ 881,210 em 28/06/2024	394.177,65	(7,48%)	0,11%
Receb. Juros s/ Cap. 0.49 de BBDC4 s/ 325,500 em 28/06/2024	160.160,81	(3,04%)	0,05%
Receb. Juros s/ Cap. 1.16 de SUZB3 s/ 118,800 em 10/01/2024	138.208,95	(2,62%)	0,04%
Taxa de Futuros/Opções [FUT DOL][F24][BRADCTVM] a pagar em 02/01/2024	(324,88)	0,01%	0,00%
Taxa de Futuros/Opções [FUT DOL][G24][BRADCTVM] a pagar em 02/01/2024	(326,20)	0,01%	0,00%
Taxa de Futuros/Opções [FUT WDO][F24][BRADCTVM] a pagar em 02/01/2024	(35,16)	0,00%	0,00%
Taxa de Futuros/Opções [FUT WDO][G24][BRADCTVM] a pagar em 02/01/2024	(35,31)	0,00%	0,00%
Taxa de Permanência do ativo FUT DAP na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,52)	0,00%	0,00%
Tx Administração Bruta a Pagar em 08/01/2024	(521.049,50)	9,89%	(0,15%)
Tx Custódia Bruta a Pagar em 08/01/2024	(10.421,01)	0,20%	0,00%
TOTAL	(5.267.884,85)	100,00%	(1,51%)

Tesouraria			
Descrição	Valor	% S/TES	% s/Total
Saldo em Tesouraria	10.000,00	100,00%	0,00%
TOTAL	10.000,00	100,00%	0,00%

Patrimônio			
Total do Patrimônio			
			343.502.317,29

Rentabilidade Acumulada							
Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 Meses
CDI	71,6514%	(0,0124%)	0,04373920%	0,89631800%	13,04743940%	6,14927610%	13,04743940%
COTA	0,0000%	0,0000%	0,03133980%	3,85776590%	21,42070270%	8,00065360%	21,42070270%
SELIC	71,6514%	(0,0124%)	0,04373920%	0,89631800%	13,04743940%	6,14927610%	13,04743940%

Valor da Cota Bruta de Performance	1,375774000
Quantidade de Cotas (Líquida)	254.118.530,716447400
Valor da cota unitária (Líquida)	1,351740500



ICATU | VANGUARDA

ICATU VANGUARDA
GESTÃO DE RECURSOS LTDA

IGARATÉ LB

CNPJ: 35.637.151/0001-30

RENTABILIDADE

Category	jan-22	fev-22	mar-22	abr-22	mai-22	jun-22	jul-22	ago-22	set-22	out-22	nov-22	dez-22	jan-23	fev-23	mar-23	abr-23	mai-23	jun-23	jul-23	ago-23	set-23	out-23	nov-23	dez-23
Bolsa Internacional	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,48%	-0,41%	-0,49%	0,46%	-0,09%	-0,22%	0,47%	0,14%	0,50%	-0,09%	0,30%	-0,01%	0,09%	0,26%	-0,48%	-0,52%	0,98%	0,28%
Bolsa Local	6,40%	0,17%	4,50%	-5,82%	2,58%	-9,19%	1,28%	4,75%	0,73%	5,16%	-0,93%	-1,77%	1,95%	-4,39%	-1,09%	1,40%	2,73%	5,12%	2,10%	-3,14%	-0,36%	-1,96%	7,17%	3,85%
Câmbio	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-0,02%	0,35%	-0,20%	-0,22%	0,20%	-0,55%	-0,15%	0,21%	0,15%	-0,04%	-0,16%	-0,08%
Hedge	-1,29%	0,01%	-0,87%	-0,65%	0,98%	-1,99%	0,85%	4,99%	-0,06%	-0,68%	1,90%	2,09%	-0,93%	2,61%	1,53%	0,56%	0,02%	-0,75%	-0,24%	0,63%	0,18%	0,38%	-0,06%	-0,09%
Juros Pré	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-0,09%	0,00%	0,06%	0,00%	0,00%	0,18%	-0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Juros Real	-0,24%	0,28%	1,37%	0,53%	0,16%	-0,21%	-0,21%	0,04%	0,09%	0,38%	-0,28%	0,01%	0,20%	0,36%	0,50%	0,29%	0,26%	0,20%	0,11%	0,03%	-0,06%	-0,21%	0,52%	0,39%
Volatilidade	0,00%	0,00%	-0,18%	2,77%	1,25%	2,78%	1,19%	-4,61%	1,10%	0,05%	-0,13%	0,44%	1,44%	0,90%	0,44%	-0,96%	-0,07%	0,16%	0,28%	0,61%	0,46%	0,88%	-3,29%	0,12%
Caixa	0,02%	0,03%	0,04%	0,09%	0,11%	0,11%	0,16%	0,18%	0,15%	0,14%	0,12%	0,11%	0,14%	0,12%	0,15%	0,12%	0,19%	0,20%	0,24%	0,24%	0,19%	0,13%	0,09%	-0,76%
Despesas	-0,29%	-0,17%	-0,43%	0,03%	-0,36%	0,01%	-0,59%	-0,74%	-0,33%	-0,76%	-0,35%	-0,16%	-0,51%	0,08%	-0,25%	-0,20%	-0,73%	-0,79%	-0,44%	0,15%	-0,15%	0,01%	-0,78%	0,14%
IV Igaraté LB	4,60%	0,32%	4,44%	-3,05%	4,71%	-8,58%	3,17%	4,26%	1,19%	4,75%	0,42%	0,48%	2,74%	0,17%	1,58%	0,90%	2,91%	3,57%	1,99%	-1,01%	-0,07%	-1,32%	4,45%	3,86%
IBX	6,87%	1,46%	5,96%	-10,11%	3,23%	-11,57%	4,40%	6,15%	-0,05%	5,57%	-3,11%	-2,63%	3,51%	-7,59%	-3,07%	1,93%	3,59%	8,87%	3,32%	-5,01%	0,84%	-3,03%	12,38%	5,48%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,04%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%	1,12%	0,92%	1,18%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,98%	1,00%	0,92%	0,85%
IMA-B5	0,11%	1,06%	2,61%	1,56%	0,78%	0,33%	0,01%	0,00%	0,42%	1,92%	-0,33%	0,94%	1,40%	1,41%	1,52%	0,90%	0,57%	1,05%	0,97%	0,61%	0,13%	-0,31%	1,80%	1,36%

Atribuição de Resultados	Mês	Ano	12M	20M
Bolsa Internacional	0,28%	2,05%	2,05%	1,79%
Bolsa Local	3,85%	14,24%	14,24%	16,84%
Câmbio	-0,08%	-0,49%	-0,49%	-0,48%
Hedge	-0,09%	4,07%	4,07%	13,34%
Juros Pré	0,00%	0,00%	0,00%	0,16%
Juros Real	0,39%	2,77%	2,77%	2,80%
Volatilidade	0,12%	0,92%	0,92%	3,00%
Caixa	-0,76%	1,10%	1,10%	2,30%
Despesas	0,14%	-3,24%	-3,24%	-6,04%
IV Igaraté LB	3,86%	21,42%	21,42%	33,70%

IBX	5,48%	21,28%	21,28%	22,16%
CDI	0,85%	13,00%	13,00%	22,95%
IMA-B5	1,36%	12,01%	12,01%	16,64%

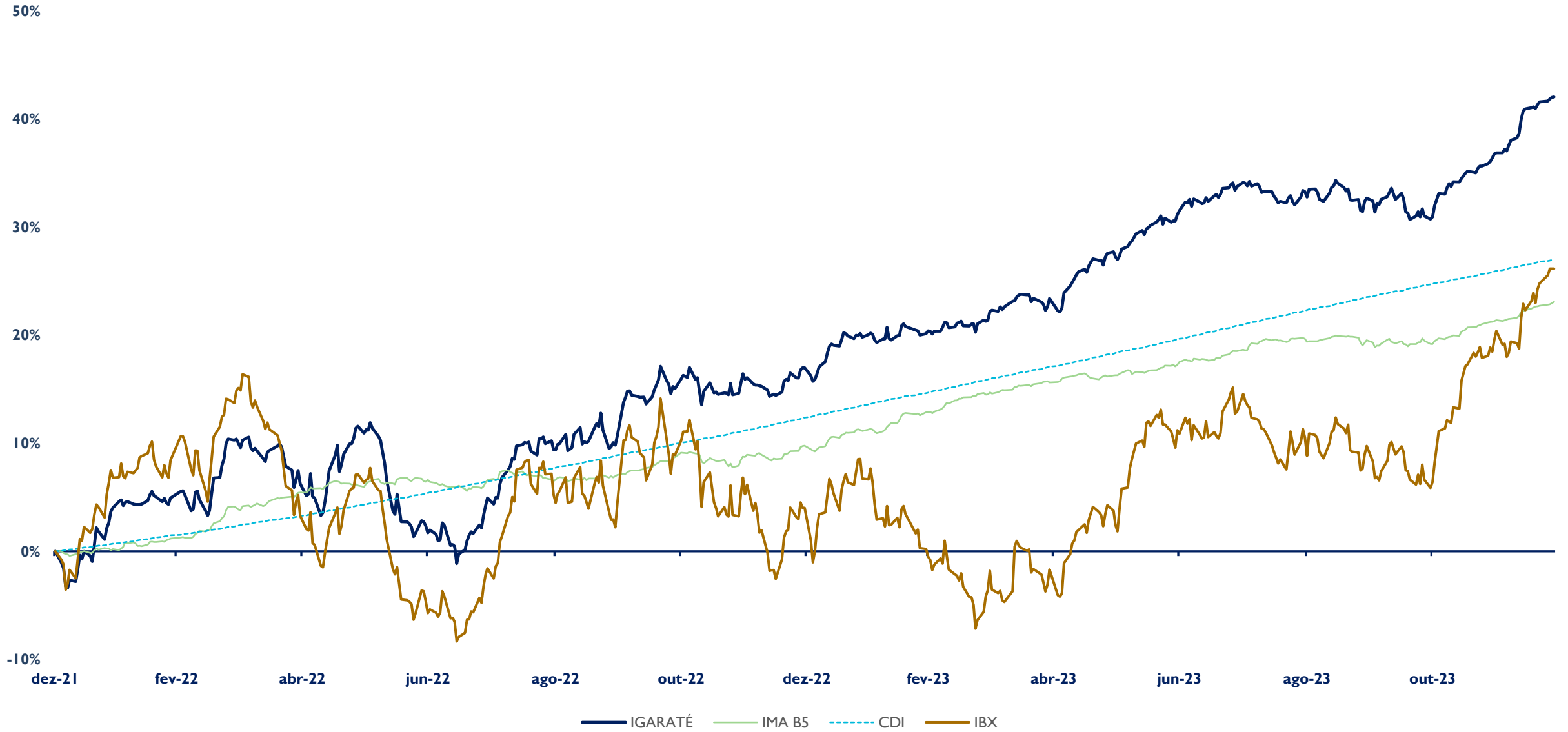
Data Base: 29/12/2023

RENTABILIDADE

Ativo/Janela	Ano	Vol a.a	6 Meses	Vol a.a	12 Meses	Vol a.a	24 Meses	Vol a.a
Icatu Vanguarda Igaraté FIM	21,4%	5,5%	8,3%	5,5%	21,4%	5,5%	43,1%	9,7%
IMA-B5	12,0%	2,0%	4,9%	2,0%	12,1%	2,0%	23,2%	2,3%
CDI	13,0%	0,0%	6,2%	0,0%	13,1%	0,0%	27,1%	0,1%
IBX	21,3%	16,9%	13,5%	15,1%	21,3%	16,9%	27,0%	19,1%

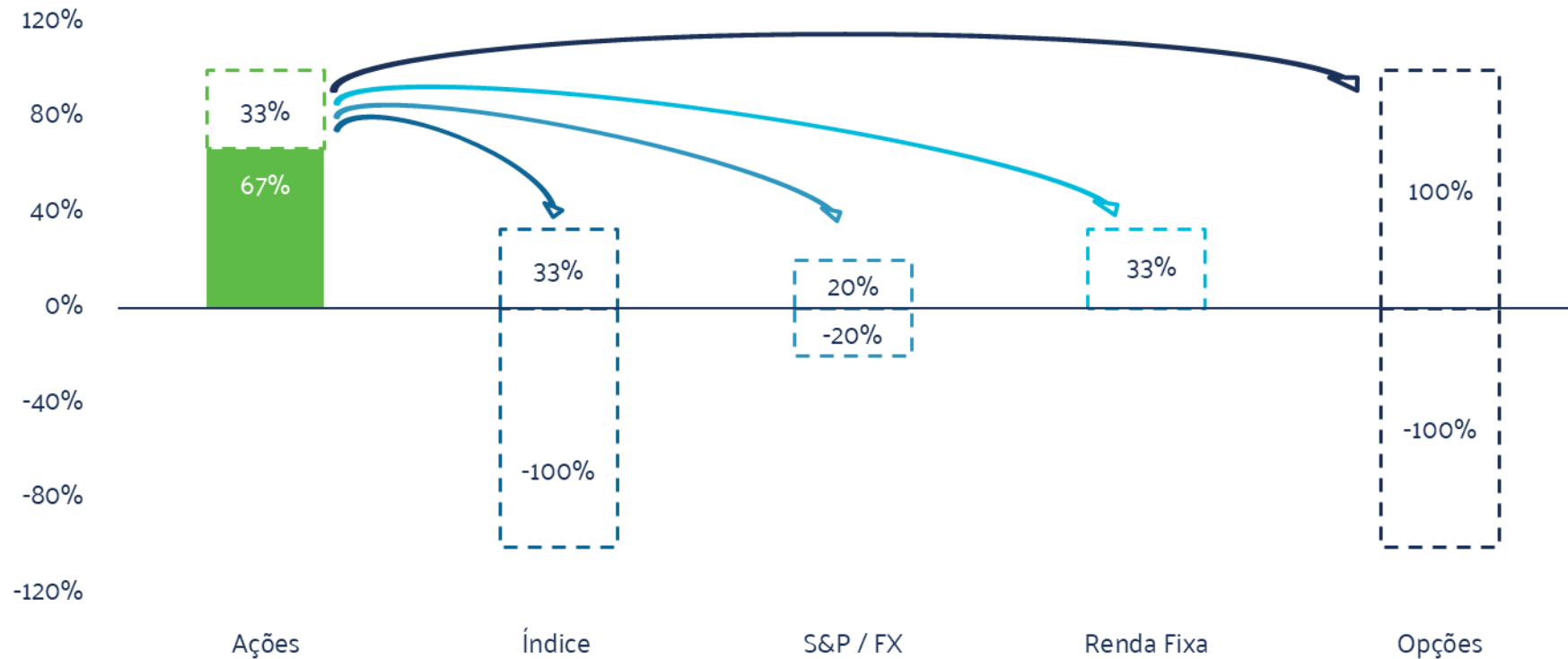
*Data Base: 29/12/2023

RENTABILIDADE IV IGARATÉ



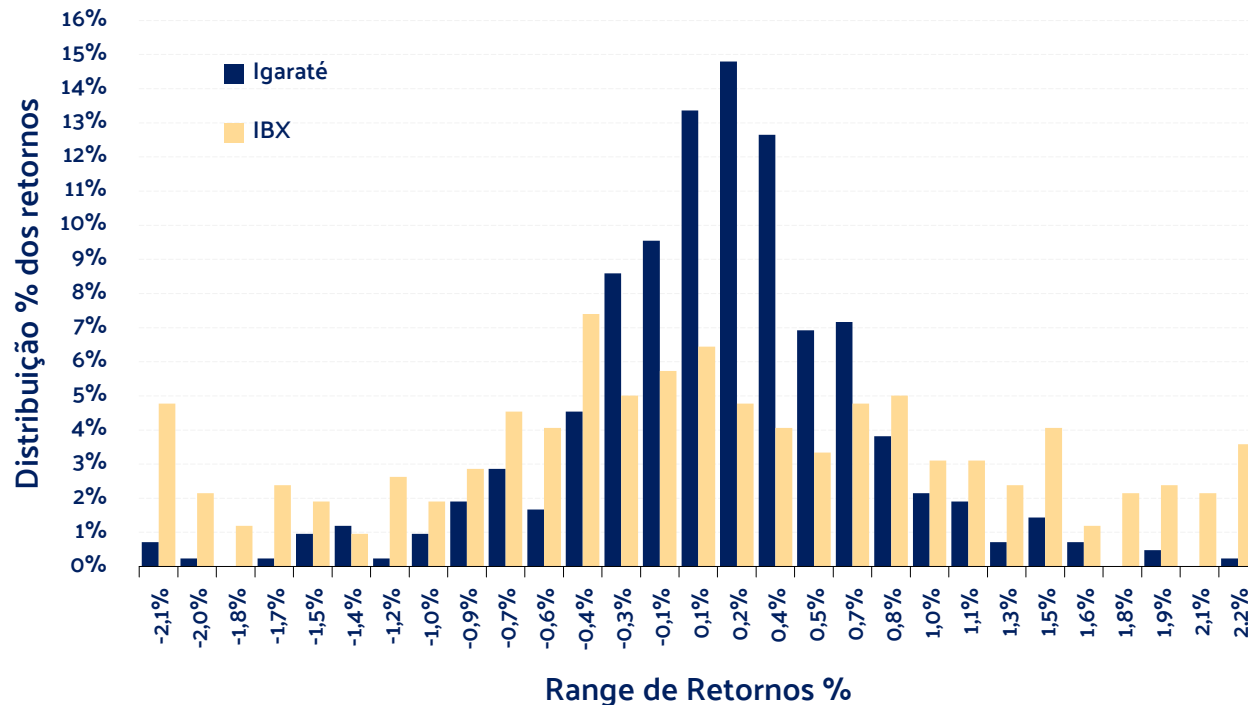
Estratégia de Alocação

- A posição Mínima em Ações corresponde a 67% - Tributação FIA;
- Podem ser utilizados outros instrumentos (gráfico abaixo) com o objetivo de maximizar a relação risco x retorno do produto na busca pela geração de retornos reais (benchmark: IMA-B5).



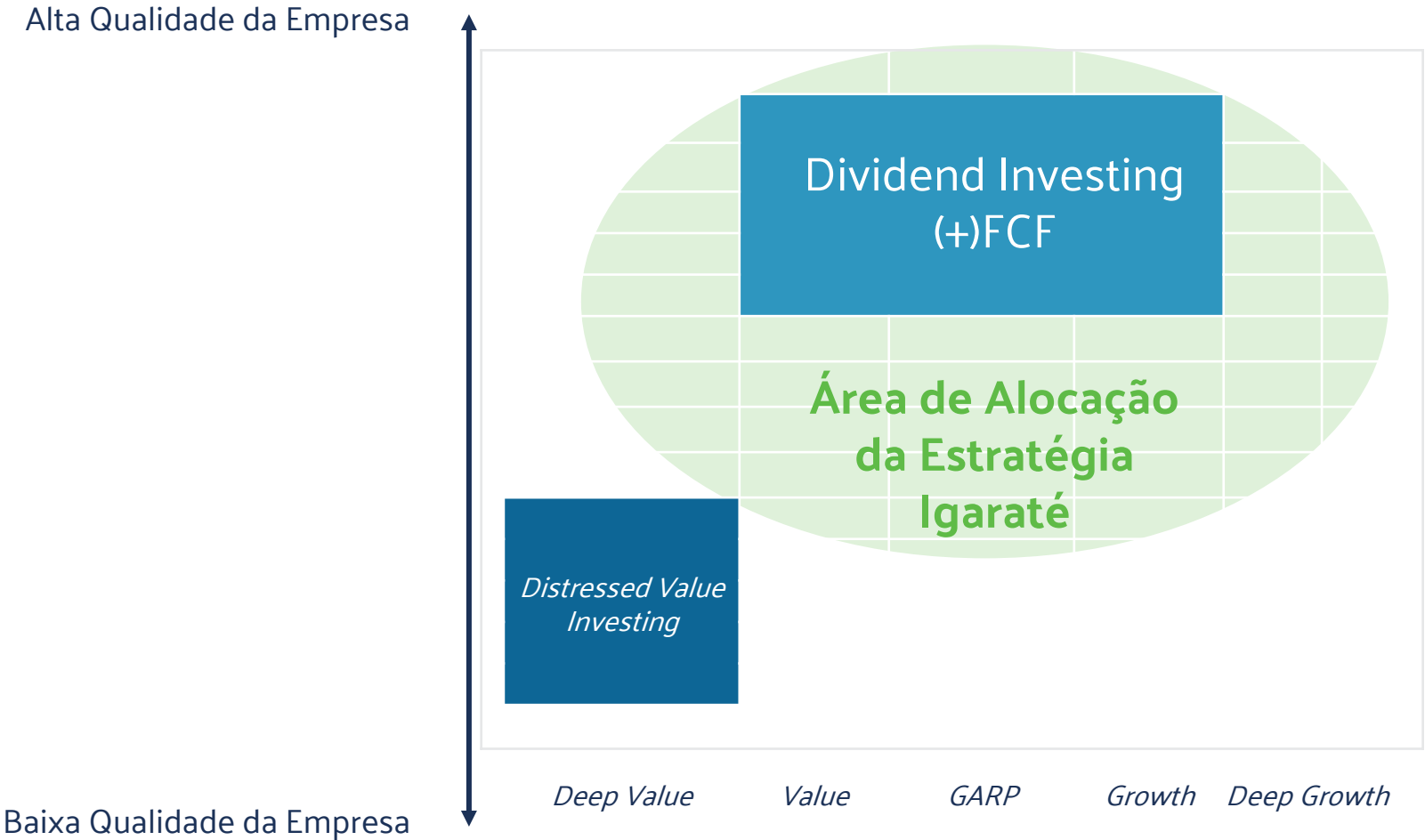
Análise da Distribuição de Retorno Diário (02/03/2022 – 31/12/2023)

Gráfico: Histograma dos Retornos Diários

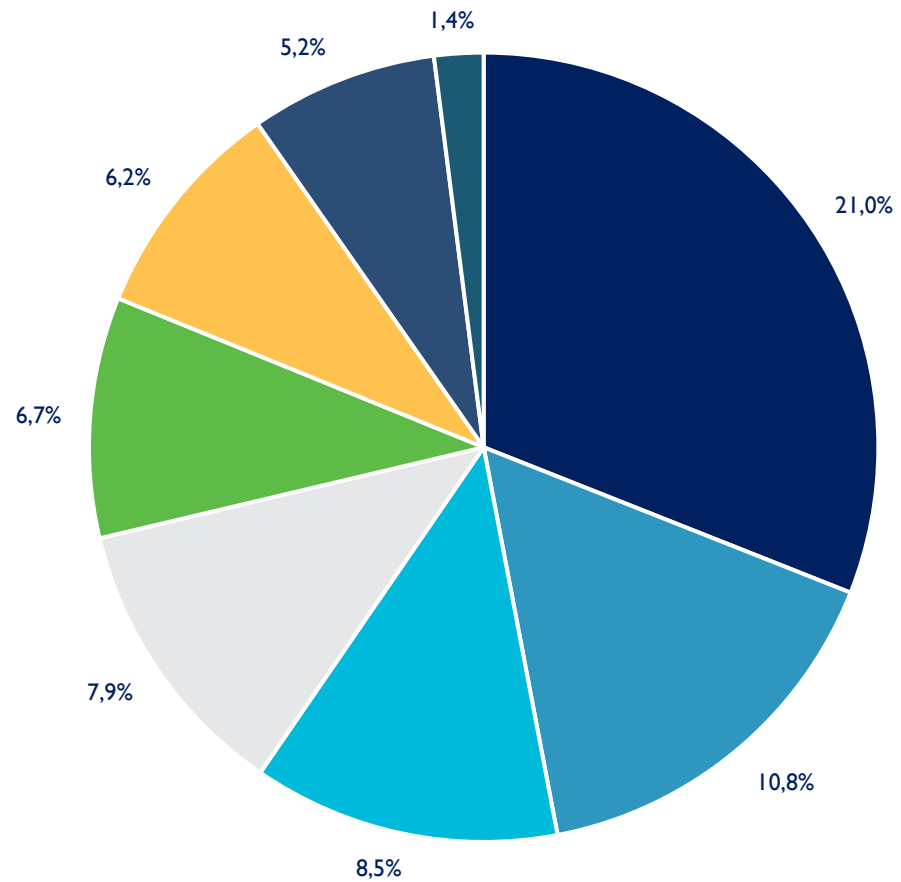


Em 80% das vezes os retornos diários do fundo encontram-se no *range* de -0,5% a +1,5%, enquanto 42% dos retornos do IBX permanecem neste *range*.

Espectro de Alocação do Produto Igaraté FIM



Alocação do Produto Igaraté FIM



- Financeiro
- ETF BOVA11
- Utilidade Pública
- Consumo Cíclico
- Materiais Básicos
- ETF NASD11
- Petróleo, Gás e Biocombustíveis
- ETF SMAL11

Características do Portfólio



Limite de Gross: 250%

(1) Parte Comprada:

- 100% em ações;
- índice e futuro de S&P;
- Estratégia de Opções.

(2) Parte Vendida:

- até 100% índice e/ou futuro de Ibov;
- até 20% índice e/ou futuro de S&P;
- Estratégia de Opções.



Net exposição mínima : 0%

Net exposição máxima: 100% (*)

(*) passivamente pode ser mais de 100%.

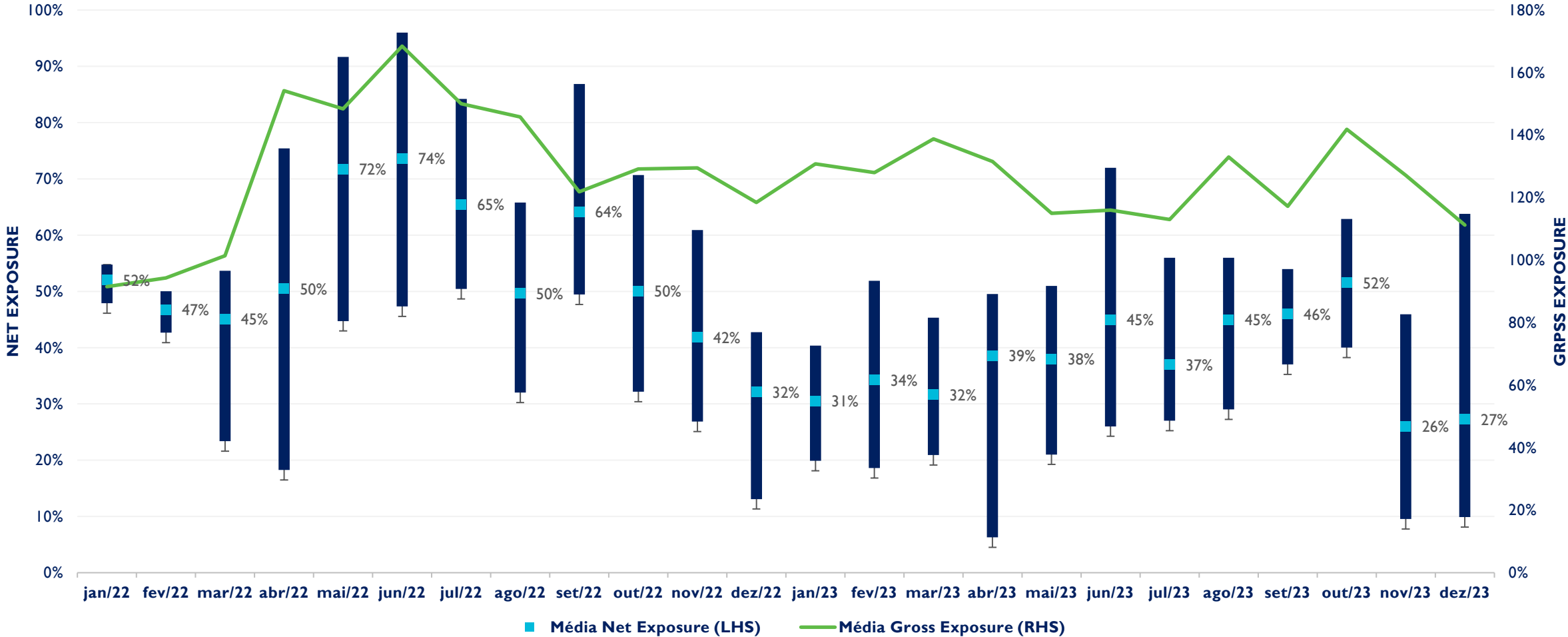


Concentração máxima por ativo: 20%

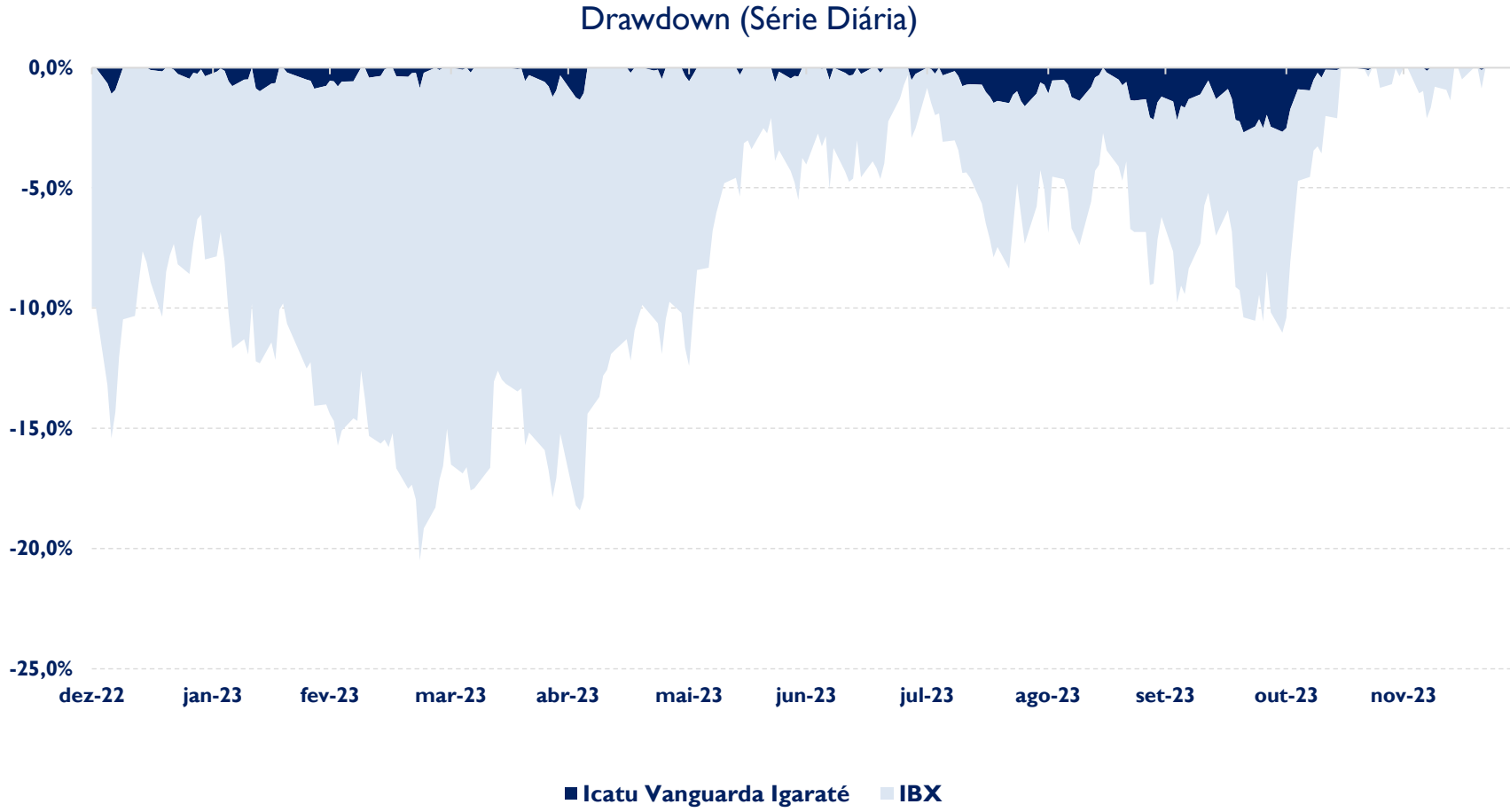
Concentração máxima por setor: 30%

Histórico Net/Gross

Exposição IV Igaraté



DrawDown (12M)



© Todos os direitos reservados para Icatu Vanguarda Gestão de recursos LTDA. 2019
Nenhuma parte desta publicação pode ser reproduzida, arquivada ou transmitida de nenhuma forma ou por meio nenhum, sem prévia permissão e por escrito da Icatu Vanguarda.

ICATU | VANGUARDA

Contato RI:

ri@icatu Vanguarda.com.br

Bruno Horovitz

Head of Institucional Sales and Business

bhorovitz@icatu Vanguarda.com.br

Bruno Balassiano

Account Manager

bbalassiano@icatu Vanguarda.com.br

Rafael Mendes

Account Manager

remendes@icatu Vanguarda.com.br

Rachel Cunha

Account Manager

rscunha@icatu Vanguarda.com.br

Marcos Botler

Account Manager

marcbotler@icatu Vanguarda.com.br

Daniel Novaes

Business Intelligence (BI)

dmnovaes@icatu Vanguarda.com.br

Luisa Speiski

Intern BI

lspeiski@icatu Vanguarda.com.br

Signatory of:

