



**LDB**  
EMPRESAS

**SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO**  
JANEIRO 2023



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.01.2023.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 83,61%

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

| Emissor                                | Título Público           | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)           | % Carteira   |
|--|--------------------------|---------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|
|  |                          |                     | Dia               | Mês         | Ano         |                       |              |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150535 (5,600000%) | 0,63                | 0,05              | 1,17        | 1,17        | 79.498.564,97         | 7,47         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150545 (5,890000%) | 0,63                | 0,05              | 1,19        | 1,19        | 110.381.516,87        | 10,37        |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150830 (5,530000%) | 0,63                | 0,05              | 1,16        | 1,16        | 50.196.116,89         | 4,71         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150840 (5,620000%) | 0,63                | 0,05              | 1,17        | 1,17        | 94.291.007,32         | 8,86         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150850 (5,761000%) | 2,88                | 0,06              | 1,18        | 1,18        | 43.236.616,29         | 4,06         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150850 (5,860000%) | 2,92                | 0,05              | 1,19        | 1,19        | 43.140.503,48         | 4,05         |
| TESOURO NACIONAL                       | NTN-B 150850 (6,151000%) | 4,27                | 0,06              | 0,55        | 0,55        | 49.851.438,59         | 4,68         |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b> |                          | <b>0,64</b>         | <b>0,05</b>       | <b>1,18</b> | <b>1,18</b> | <b>470.595.764,41</b> | <b>44,20</b> |

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

| Gestor                                 | Admin.    | Ativo  | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|--|-----------|--|---------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
|  |           |  |                     | Dia               | Mês         | Ano         |                       |              |                  |         |
| CAIXA DTVM                             | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,62                | 0,04              | 1,37        | 1,37        | 71.040.425,93         | 6,67         | 7.844.346.137,20 | 0,91    |
| SANTANDER                              | SANTANDER | SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI            | 2,63                | 0,04              | 1,38        | 1,38        | 40.525.868,76         | 3,81         | 808.547.889,81   | 5,01    |
| CAIXA DTVM                             | CEF       | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,06                | 0,04              | 0,96        | 0,96        | 2.043.965,80          | 0,19         | 945.396.596,99   | 0,22    |
| ITAU                                   | ITAU      | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI  | 3,35                | 0,15              | 0,50        | 0,50        | 68.146.620,66         | 6,40         | 2.164.364.253,13 | 3,15    |
| SAFRA                                  | SAFRA     | SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF               | 5,43                | 0,09              | 0,21        | 0,21        | 20.662.284,63         | 1,94         | 396.820.883,11   | 5,21    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |           |  | <b>2,81</b>         | <b>0,08</b>       | <b>0,94</b> | <b>0,94</b> | <b>202.419.165,78</b> | <b>19,01</b> |                  |         |

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                   | Admin.   | Ativo                                  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|--|----------|--|------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
|  |          |  |                        | Dia               | Mês         | Ano         |                       |              |                  |         |
| BB                                       | BB       | BB PREV RF FLUXO FIC                   | 0,07                   | 0,05              | 1,03        | 1,03        | 2.671.959,56          | 0,25         | 3.853.684.843,62 | 0,07    |
| BRAM                                     | BRADESCO | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,07                   | 0,05              | 1,13        | 1,13        | 98.022.954,73         | 9,21         | 8.262.735.410,47 | 1,19    |
| BB                                       | BB       | BB INSTITUCIONAL FI RF                 | 0,20                   | 0,05              | 0,82        | 0,82        | 11.302.236,61         | 1,06         | 2.450.304.068,66 | 0,46    |
| CAIXA DTVM                               | CEF      | FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP        | 2,05                   | 0,09              | 0,98        | 0,98        | 44.241.236,12         | 4,16         | 743.904.655,44   | 5,95    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |          |  | <b>0,68</b>            | <b>0,06</b>       | <b>1,05</b> | <b>1,05</b> | <b>156.238.387,02</b> | <b>14,67</b> |                  |         |

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

| Gestor                        | Admin.      | Ativo   | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo | % Fundo |
|-------------------------------|-------------|---|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|-------------|---------|
|                               |             |   |                        | Dia               | Mês         | Ano         |                      |             |             |         |
| XP                            | XP          | LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.<br>a          | 1,62                   | -0,10             | 1,09        | 1,09        | 5.315.827,91         | 0,50        |             |         |
| BRADESCO                      | BRADESCO    | LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA<br>6,23% a.a        | 0,70                   | 0,06              | 1,23        | 1,23        | 10.412.267,46        | 0,98        |             |         |
| VOTORANTIM                    | VOTORANTIM  | LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.<br>A. 6,25% a.a | 0,75                   | 0,03              | 1,20        | 1,20        | 10.401.290,65        | 0,98        |             |         |
| XP                            | XP          | LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.<br>a          | 0,74                   | 0,02              | 1,19        | 1,19        | 8.502.737,31         | 0,80        |             |         |
| SAFRA                         | SAFRA       | LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.<br>a         | 0,84                   | 0,02              | 1,20        | 1,20        | 8.518.151,46         | 0,80        |             |         |
| BTG PACTUAL                   | BTG PACTUAL | LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA<br>6,26% a.a     | 1,30                   | 0,05              | 1,22        | 1,22        | 14.760.150,18        | 1,39        |             |         |
| SAFRA                         | SAFRA       | LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328<br>% a.a        | 2,14                   | -0,11             | 1,13        | 1,13        | 3.023.782,66         | 0,28        |             |         |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV</b> |             |   | <b>0,86</b>            | <b>0,02</b>       | <b>1,19</b> | <b>1,19</b> | <b>60.934.207,63</b> | <b>5,72</b> |             |         |

## Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

| Gestor                                 | Admin.   | Ativo              | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |               |               | Valor (R\$)      | % Carteira  | PL do Fundo   | % Fundo |
|--|----------|--------------------|------------------------|-------------------|---------------|---------------|------------------|-------------|---------------|---------|
|  |          |                    |                        | Dia               | Mês           | Ano           |                  |             |               |         |
| VILA RICA                              | BRL DTVM | FIDC ITALIA SENIOR | 29,91                  | -14,66            | -14,66        | -14,66        | 35.079,82        | 0,00        | 18.916.364,87 | 0,19    |
| <b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b> |          |                    | <b>29,91</b>           | <b>-14,66</b>     | <b>-14,66</b> | <b>-14,66</b> | <b>35.079,82</b> | <b>0,00</b> |               |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

1,06

0,06

1,10

1,10

890.222.604,66

83,61

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**RENTA VARIÁVEL**

**10,39%**

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor                       | Admin.      | Ativo                                      | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|------------------------------|-------------|--|------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
|                              |             |  |                        | Dia               | Mês         | Ano         |                       |              |                  |         |
| BTG PACTUAL                  | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 22,40                  | 0,50              | 4,66        | 4,66        | 30.568.798,36         | 2,87         | 1.435.098.805,67 | 2,13    |
| ITAU                         | ITAU        | ITAU ACOES DUNAMIS FIC                     | 20,52                  | 0,50              | 2,42        | 2,42        | 20.129.316,00         | 1,89         | 1.863.800.941,22 | 1,08    |
| BRAM                         | BEM         | BRADERCO F I A SELECTION                   | 21,41                  | 1,30              | 3,93        | 3,93        | 18.302.945,06         | 1,72         | 462.566.575,32   | 3,96    |
| INDIE CAPITAL                | BTG PACTUAL | INDIE FIC FIA                              | 26,41                  | 1,80              | 3,50        | 3,50        | 16.415.394,35         | 1,54         | 468.521.482,83   | 3,50    |
| SAFRA                        | SAFRA       | SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA                  | 26,22                  | 1,03              | 5,07        | 5,07        | 2.664.290,60          | 0,25         | 207.422.620,07   | 1,28    |
| TRUXT                        | INTRAG      | TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA        | 23,53                  | 1,42              | 4,42        | 4,42        | 22.536.655,20         | 2,12         | 945.872.938,54   | 2,38    |
| <b>Sub-total Artigo 8º I</b> |             |  | <b>21,97</b>           | <b>1,02</b>       | <b>3,91</b> | <b>3,91</b> | <b>110.617.399,57</b> | <b>10,39</b> |                  |         |
| <b>Renda Variável</b>        |             |  | <b>21,97</b>           | <b>1,02</b>       | <b>3,91</b> | <b>3,91</b> | <b>110.617.399,57</b> | <b>10,39</b> |                  |         |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,85%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

| Gestor                           | Admin.      | Ativo   | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo    | % Fundo |
|----------------------------------|-------------|---|---------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|----------------|---------|
|                                  |             |   |                     | Dia               | Mês         | Ano         |                      |             |                |         |
| XP                               | BNP PARIBAS | ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE               | 21,69               | -0,47             | 10,10       | 10,10       | 3.284.640,73         | 0,31        | 62.879.218,80  | 5,22    |
| XP                               | BNP PARIBAS | AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE            | 32,62               | 1,01              | 11,98       | 11,98       | 13.005.017,80        | 1,22        | 230.832.362,56 | 5,63    |
| XP                               | BNP PARIBAS | MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 40,19               | -0,96             | 11,00       | 11,00       | 15.040.983,12        | 1,41        | 588.945.660,50 | 2,55    |
| SANTANDER                        | SANTANDER   | SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR        | 22,13               | -0,24             | 1,92        | 1,92        | 20.284.342,62        | 1,91        | 963.607.601,30 | 2,11    |
| <b>Sub-total Artigo 9º II</b>    |             |   | <b>25,26</b>        | <b>-0,15</b>      | <b>7,42</b> | <b>7,42</b> | <b>51.614.984,27</b> | <b>4,85</b> |                |         |
| <b>Investimentos no Exterior</b> |             |   | <b>25,26</b>        | <b>-0,15</b>      | <b>7,42</b> | <b>7,42</b> | <b>51.614.984,27</b> | <b>4,85</b> |                |         |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,15%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor                        | Admin.      | Ativo                                   | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|-------------------------------|-------------|---|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
|                               |             |   |                        | Dia               | Mês         | Ano         |                      |             |                  |         |
| SAFRA                         | SAFRA       | SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO  | 1,12                   | 0,04              | 0,95        | 0,95        | 3.257.058,45         | 0,31        | 1.243.850.744,80 | 0,26    |
| BTG PACTUAL                   | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO | 23,86                  | 1,40              | 6,38        | 6,38        | 8.994.121,21         | 0,84        | 494.455.251,27   | 1,82    |
| <b>Sub-total Artigo 10º I</b> |             |   | <b>20,83</b>           | <b>1,04</b>       | <b>4,88</b> | <b>4,88</b> | <b>12.251.179,66</b> | <b>1,15</b> |                  |         |
| Investimentos Estruturados    |             |   | 20,83                  | 1,04              | 4,88        | 4,88        | 12.251.179,66        | 1,15        |                  |         |
| Total                         |             |   | 3,32                   | 0,16              | 1,72        | 1,72        | 1.064.706.168,16     | 100,00      |                  |         |



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo                            | Tipo de Ativo                           | Valor(R\$)              | % Carteira    | Política de Investimentos |          |        |       |              |
|-----------------------------------|---|-------------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|-------|--------------|
|                                   |   |                         |               | Mínimo                    | Objetivo | Máximo | ALM   | Limite Legal |
| <b>Renda Fixa</b>                 |   |                         |               |                           |          |        |       |              |
| Artigo 7º I, Alínea a             | Títulos do Tesouro Nacional             | 470.595.764,41          | 44,20         | 30,00                     | 50,00    | 85,00  | 50,00 | 100,00       |
| Artigo 7º I, Alínea b             | Fundos 100% Títulos Públicos            | 202.419.165,78          | 19,01         | 5,00                      | 12,50    | 30,00  | 8,48  | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a           | Fundos Renda Fixa                       | 156.238.387,02          | 14,67         | 5,00                      | 15,00    | 30,00  | 14,99 | 60,00        |
| Artigo 7º IV                      | Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira) | 60.934.207,63           | 5,72          | 3,00                      | 6,00     | 10,00  | 6,03  | 20,00        |
| Artigo 7º V, Alínea a             | FIDC Cota Sênior                        | 35.079,82               | 0,00          | 0,00                      | 0,10     | 0,20   | 0,01  | 5,00         |
|                                   | <b>Total Renda Fixa</b>                 | <b>890.222.604,66</b>   | <b>83,61</b>  |                           |          |        |       | 100,00       |
| <b>Renda Variável</b>             |   |                         |               |                           |          |        |       |              |
| Artigo 8º I                       | Fundos de Ações                         | 110.617.399,57          | 10,39         | 3,00                      | 7,00     | 15,00  | 0,49  | 30,00        |
|                                   | <b>Total Renda Variável</b>             | <b>110.617.399,57</b>   | <b>10,39</b>  |                           |          |        |       | 30,00        |
| <b>Investimentos no Exterior</b>  |   |                         |               |                           |          |        |       |              |
| Artigo 9º II                      | Fundos de Investimento no Exterior      | 51.614.984,27           | 4,85          | 3,00                      | 6,90     | 10,00  | 10,00 | 10,00        |
|                                   | <b>Total Investimentos no Exterior</b>  | <b>51.614.984,27</b>    | <b>4,85</b>   |                           |          |        |       | 10,00        |
| <b>Investimentos Estruturados</b> |   |                         |               |                           |          |        |       |              |
| Artigo 10º I                      | Fundos Multimercados                    | 12.251.179,66           | 1,15          | 0,50                      | 2,30     | 5,00   | 10,00 | 10,00        |
|                                   | <b>Total Investimentos Estruturados</b> | <b>12.251.179,66</b>    | <b>1,15</b>   |                           |          |        |       | 15,00        |
| <b>Total</b>                      |   | <b>1.064.706.168,16</b> | <b>100,00</b> |                           |          |        |       |              |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

| Estratégia Indexador                             | No Mês              | No Ano              | 3 meses           | 6 meses           | 12 meses          | No Mês(R\$)          | No Ano(R\$)          |
|--|---------------------|---------------------|-------------------|-------------------|-------------------|----------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea a<br>% do CDI                | 1,18<br>104,86      | 1,18<br>104,86      | 3,14<br>95,01     | 3,77<br>56,25     |                   | 5.160.228,01         | 5.160.228,01         |
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI                | 0,94<br>84,05       | 0,94<br>84,05       | 0,88<br>26,67     | 3,67<br>54,77     | 9,26<br>72,31     | 2.137.821,14         | 2.137.821,14         |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI              | 1,05<br>93,90       | 1,05<br>93,90       | 2,91<br>88,12     | 6,59<br>98,25     | 12,53<br>97,79    | 1.719.270,52         | 1.719.270,52         |
| Artigo 7º IV<br>% do CDI                         | 1,19<br>106,27      | 1,19<br>106,27      | 3,21<br>97,11     | 3,75<br>55,87     |                   | 718.817,82           | 718.817,82           |
| Artigo 7º V, Alínea a<br>% do CDI                | -14,66<br>-1.305,06 | -14,66<br>-1.305,06 | -14,28<br>-432,42 | -13,16<br>-196,18 | 11,06<br>86,32    | -6.026,13            | -6.026,13            |
| Artigo 8º I<br>Var. IBOVESPA p.p.                | 3,91<br>0,55        | 3,91<br>0,55        | -6,43<br>-4,18    | 8,07<br>-1,88     | -2,53<br>-3,68    | 4.165.608,44         | 4.165.608,44         |
| Artigo 9º II<br>% do CDI                         | 7,42<br>660,31      | 7,42<br>660,31      | 10,97<br>332,03   | 1,04<br>15,49     | -19,21<br>-149,99 | 3.564.085,63         | 3.564.085,63         |
| Artigo 10º I<br>% do CDI                         | 4,88<br>434,40      | 4,88<br>434,40      | 6,36<br>192,59    | 6,52<br>97,27     | 6,05<br>47,22     | 570.001,72           | 570.001,72           |
| <b>SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)</b> |                     |                     |                   |                   |                   | <b>18.029.807,15</b> | <b>18.029.807,15</b> |

**RESULTADO POR ATIVO**

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

| Ativo                    | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates | Amortização | Saldo          | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------|----------------|---------------|----------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| NTN-B 150535 (5,600000%) | 78.582.896,55  | 0,00          | 0,00     | 0,00        | 79.498.564,97  | 915.668,42                  | 915.668,42                  |
| NTN-B 150545 (5,890000%) | 109.084.089,64 | 0,00          | 0,00     | 0,00        | 110.381.516,87 | 1.297.427,23                | 1.297.427,23                |
| NTN-B 150830 (5,530000%) | 49.620.851,02  | 0,00          | 0,00     | 0,00        | 50.196.116,89  | 575.265,87                  | 575.265,87                  |
| NTN-B 150840 (5,620000%) | 93.203.418,62  | 0,00          | 0,00     | 0,00        | 94.291.007,32  | 1.087.588,70                | 1.087.588,70                |
| NTN-B 150850 (5,761000%) | 42.732.981,26  | 0,00          | 0,00     | 0,00        | 43.236.616,29  | 503.635,03                  | 503.635,03                  |
| NTN-B 150850 (5,860000%) | 42.634.490,78  | 0,00          | 0,00     | 0,00        | 43.140.503,48  | 506.012,70                  | 506.012,70                  |
| NTN-B 150850 (6,151000%) | 0,00           | 49.576.808,53 | 0,00     | 0,00        | 49.851.438,59  | 274.630,06                  | 274.630,06                  |
|                          |                |               |          |             | 470.595.764,41 | 0,00                        | 0,00                        |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

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

| Ativo  | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates       | Amortização | Saldo          | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|---------------|----------------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 1.375.572,91   | 52.811.880,85 | -52.197.376,86 | 0,00        | 2.043.965,80   | 53.888,90                   | 53.888,90                   |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 96.190.409,31  | 0,00          | -26.300.000,00 | 0,00        | 71.040.425,93  | 1.150.016,62                | 1.150.016,62                |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI  | 67.806.290,76  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 68.146.620,66  | 340.329,90                  | 340.329,90                  |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF               | 20.618.886,97  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 20.662.284,63  | 43.397,66                   | 43.397,66                   |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI            | 39.975.680,70  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 40.525.868,76  | 550.188,06                  | 550.188,06                  |
|  |                |               |                |             | 202.419.165,78 | 0,00                        | 0,00                        |

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

| Ativo                                  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates       | Amortização | Saldo          | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB INSTITUCIONAL FI RF                 | 11.210.346,24  | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 11.302.236,61  | 91.890,37                   | 91.890,37                   |
| BB PREV RF FLUXO FIC                   | 20.568.493,06  | 169.708,97 | -18.169.708,97 | 0,00        | 2.671.959,56   | 103.466,50                  | 103.466,50                  |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 96.930.008,54  | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 98.022.954,73  | 1.092.946,19                | 1.092.946,19                |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP        | 43.810.268,66  | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 44.241.236,12  | 430.967,46                  | 430.967,46                  |
|  |                |            |                |             | 156.238.387,02 | 0,00                        | 0,00                        |

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

| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a       | 10.286.227,40  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 10.412.267,46 | 126.040,06                  | 126.040,06                  |
| LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a          | 8.403.131,14   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 8.502.737,31  | 99.606,17                   | 99.606,17                   |
| LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a          | 5.258.682,07   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 5.315.827,91  | 57.145,84                   | 57.145,84                   |
| LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a | 10.278.217,62  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 10.401.290,65 | 123.073,03                  | 123.073,03                  |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a    | 14.582.217,38  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 14.760.150,18 | 177.932,80                  | 177.932,80                  |
| LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a         | 8.416.836,16   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 8.518.151,46  | 101.315,30                  | 101.315,30                  |
| LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a       | 2.990.078,04   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 3.023.782,66  | 33.704,62                   | 33.704,62                   |
|   |                |            |          |             | 60.934.207,63 | 0,00                        | 0,00                        |

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo              | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo     | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--------------------|----------------|------------|----------|-------------|-----------|-----------------------------|-----------------------------|
| FIDC ITALIA SENIOR | 41.105,95      | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 35.079,82 | -6.026,13                   | -6.026,13                   |
|                    |                |            |          |             | 35.079,82 | 0,00                        | 0,00                        |

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Ativo                                      | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo          | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRADESCO F I A SELECTION                   | 17.611.476,57  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 18.302.945,06  | 691.468,49                  | 691.468,49                  |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 29.208.286,12  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 30.568.798,36  | 1.360.512,24                | 1.360.512,24                |
| INDIE FIC FIA                              | 15.859.531,29  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 16.415.394,35  | 555.863,06                  | 555.863,06                  |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                     | 19.654.171,56  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 20.129.316,00  | 475.144,44                  | 475.144,44                  |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA                  | 2.535.726,34   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.664.290,60   | 128.564,26                  | 128.564,26                  |
| TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA        | 21.582.599,25  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 22.536.655,20  | 954.055,95                  | 954.055,95                  |
|  |                |            |          |             | 110.617.399,57 | 0,00                        | 0,00                        |

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE               | 2.983.408,48   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 3.284.640,73  | 301.232,25                  | 301.232,25                  |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE            | 11.614.001,72  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 13.005.017,80 | 1.391.016,08                | 1.391.016,08                |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 13.550.297,56  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 15.040.983,12 | 1.490.685,56                | 1.490.685,56                |
| SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR        | 19.903.190,88  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 20.284.342,62 | 381.151,74                  | 381.151,74                  |
|   |                |            |          |             | 51.614.984,27 | 0,00                        | 0,00                        |

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Ativo                                   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO | 8.454.663,84   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 8.994.121,21  | 539.457,37                  | 539.457,37                  |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO  | 3.226.514,10   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 3.257.058,45  | 30.544,35                   | 30.544,35                   |
|   |                |            |          |             | 12.251.179,66 | 0,00                        | 0,00                        |

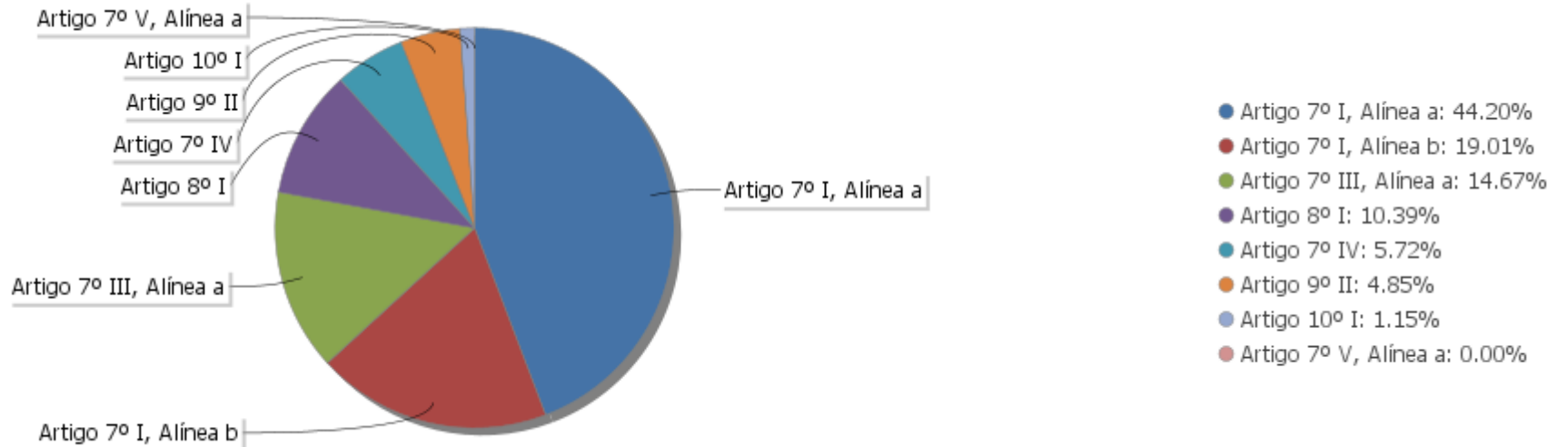
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

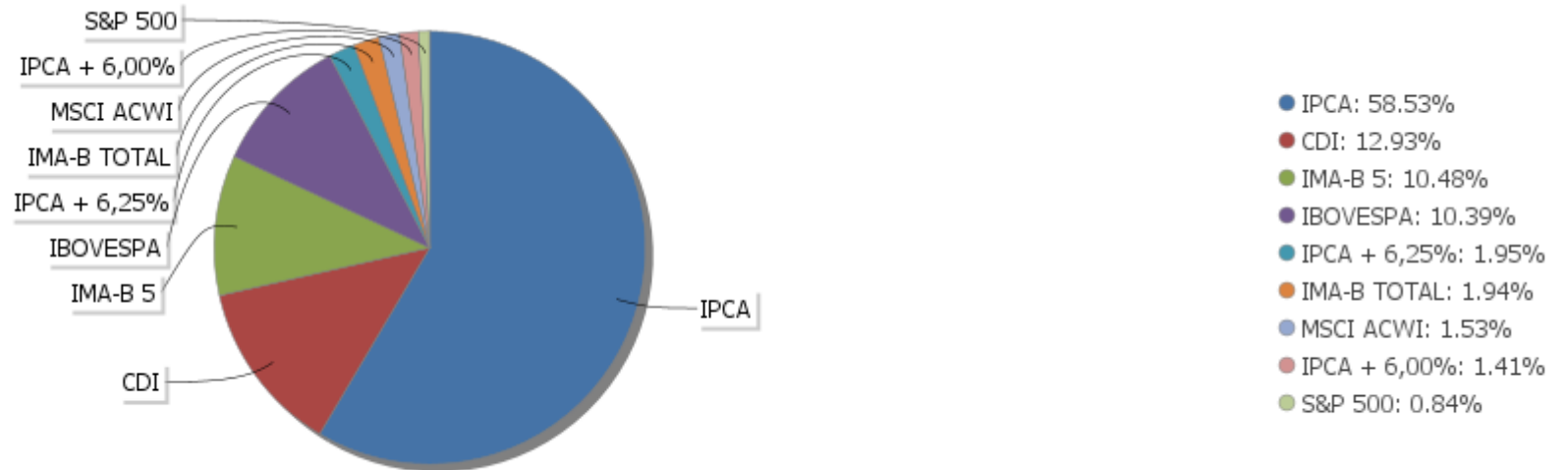
| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 440.861.741,61 | 41,41 | 440.861.741,61        | 41,41     |
| de 31 a 365 dias  | 92.314.454,51  | 8,67  | 533.176.196,12        | 50,08     |
| acima de 365 dias | 531.529.972,04 | 49,92 | 1.064.706.168,16      | 100,00    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

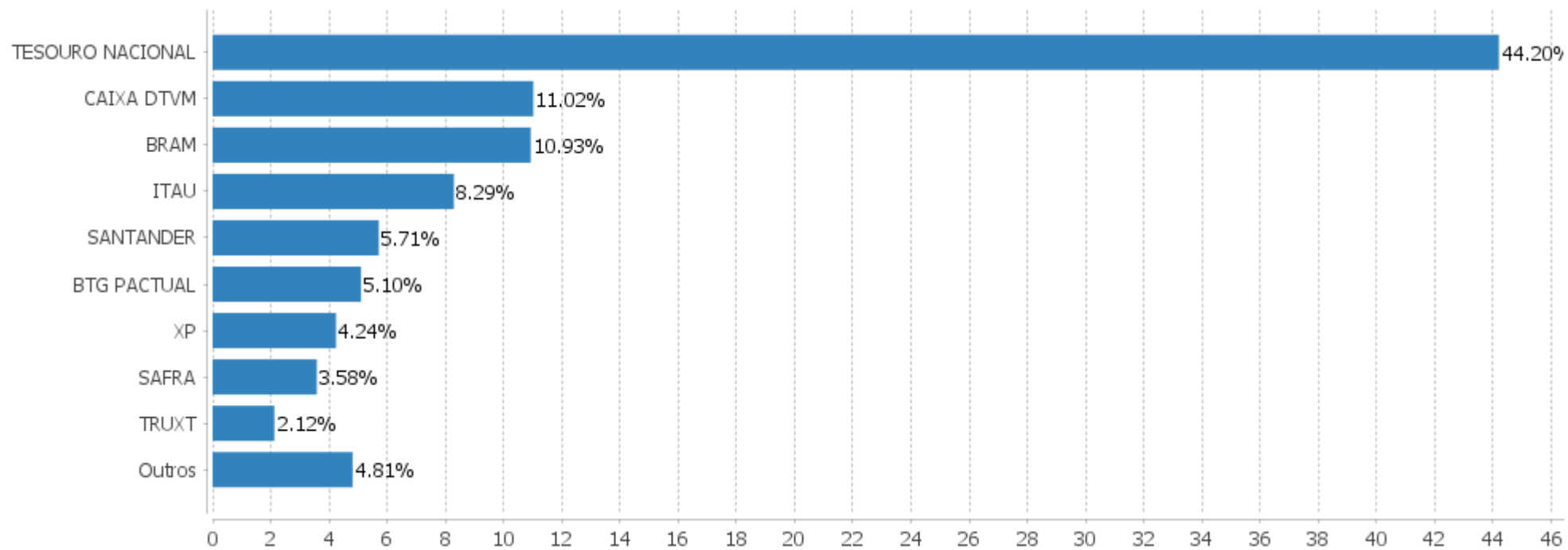


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Gestor



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

| Ano            | Jan   | Fev   | Mar   | Abr   | Mai   | Jun   | Jul   | Ago   | Set   | Out   | Nov   | Dez   | Rent. Ano |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| 2023           | 1,72  |       |       |       |       |       |       |       |       |       |       |       | 1,72      |
| INPC + 5,10%   | 0,90  |       |       |       |       |       |       |       |       |       |       |       | 0,90      |
| p.p. indexador | 0,82  |       |       |       |       |       |       |       |       |       |       |       | 0,82      |
| 2022           | -0,50 | -0,02 | 1,78  | -0,52 | 0,76  | -0,85 | 1,52  | 0,88  | -0,17 | 1,84  | -0,08 | 0,23  | 4,93      |
| INPC + 4,94%   | 1,08  | 1,37  | 2,14  | 1,41  | 0,87  | 1,03  | -0,20 | 0,13  | 0,08  | 0,86  | 0,76  | 1,11  | 11,14     |
| p.p. indexador | -1,58 | -1,39 | -0,36 | -1,93 | -0,11 | -1,88 | 1,72  | 0,75  | -0,25 | 0,99  | -0,85 | -0,89 | -6,21     |
| 2021           | -0,25 | -0,80 | 0,07  | 1,08  | 0,98  | 0,37  | -0,62 | -1,00 | -0,86 | -2,11 | 0,81  | 0,67  | -1,69     |
| INPC + 5,43%   | 0,69  | 1,20  | 1,35  | 0,80  | 1,41  | 1,04  | 1,49  | 1,35  | 1,65  | 1,59  | 1,26  | 1,22  | 16,12     |
| p.p. indexador | -0,94 | -2,00 | -1,28 | 0,27  | -0,43 | -0,67 | -2,11 | -2,35 | -2,51 | -3,70 | -0,45 | -0,54 | -17,81    |
| 2020           | 0,39  | -1,01 | -7,26 | 1,95  | 2,14  | 2,21  | 3,07  | -0,76 | -1,08 | 0,12  | 2,29  | 3,11  | 4,80      |
| INPC + 5,87%   | 0,69  | 0,58  | 0,68  | 0,22  | 0,20  | 0,78  | 0,96  | 0,84  | 1,35  | 1,37  | 1,41  | 1,97  | 11,61     |
| p.p. indexador | -0,30 | -1,59 | -7,94 | 1,72  | 1,94  | 1,43  | 2,10  | -1,60 | -2,44 | -1,25 | 0,88  | 1,15  | -6,81     |

## Performance Sobre a Meta Atuarial

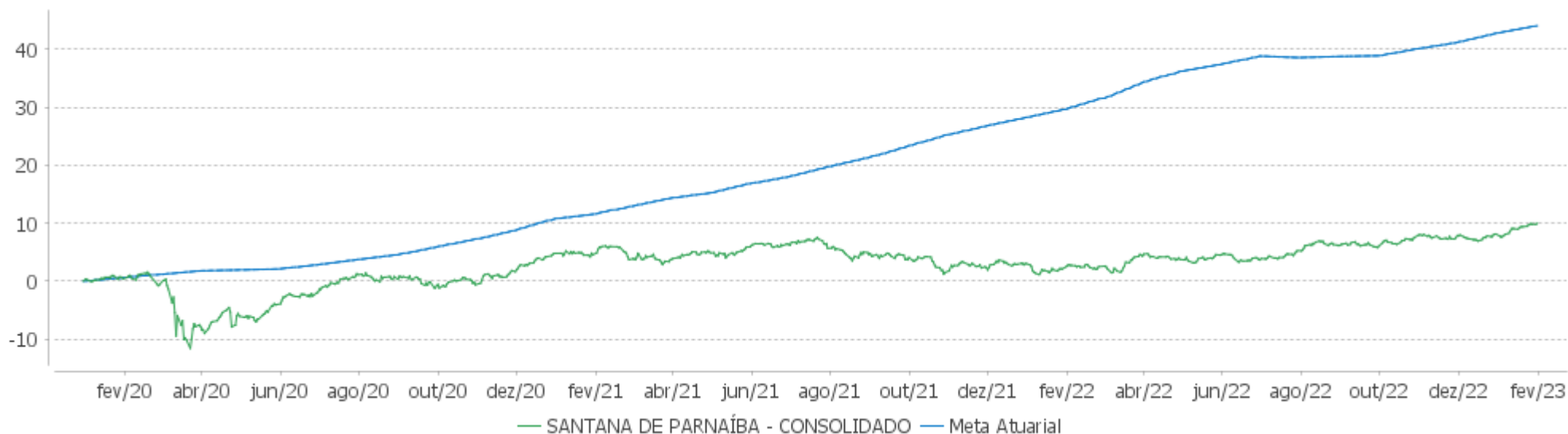
## Relatório

|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial     | 11         | 29,73     | 03 meses         | 1,87     | 2,80          | -0,94      | 2,80               |
| Meses abaixo - Meta Atuarial    | 26         | 70,27     | 06 meses         | 4,48     | 3,90          | 0,58       | 3,04               |
|                                 |            |           | 12 meses         | 7,27     | 10,95         | -3,67      | 3,32               |
|                                 |            |           | 24 meses         | 5,19     | 29,32         | -24,13     | 4,04               |
|                                 |            |           | 36 meses         | 9,54     | 44,34         | -34,80     | 7,04               |
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,11       | 2020-12   | Desde 31/12/2019 | 9,97     | 45,34         | -35,37     | 6,97               |
| Menor rentabilidade da Carteira | -7,26      | 2020-03   |                  |          |               |            |                    |

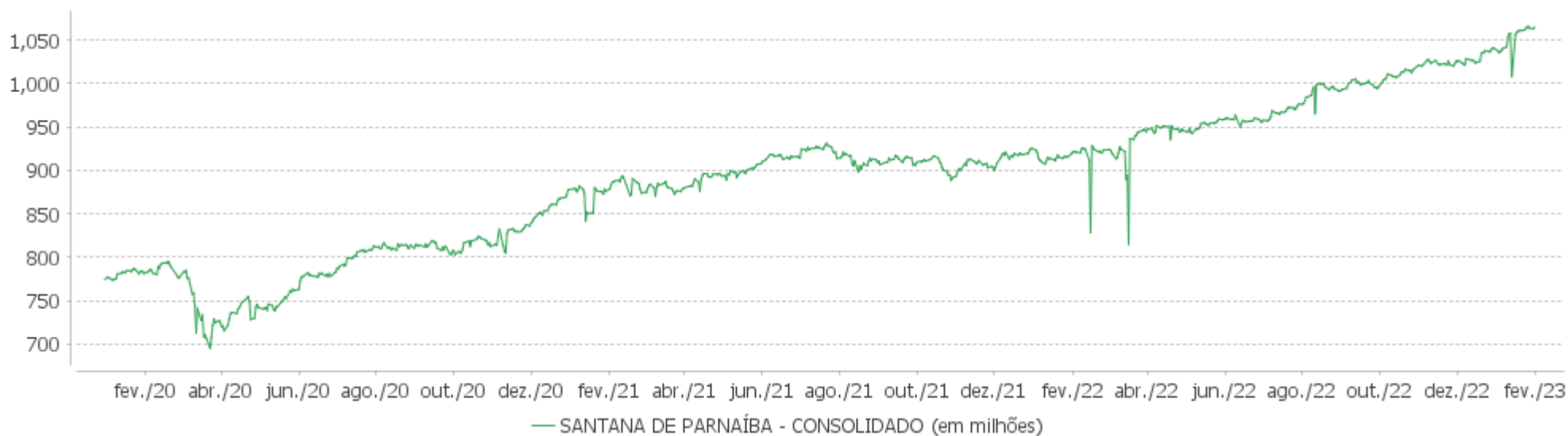


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

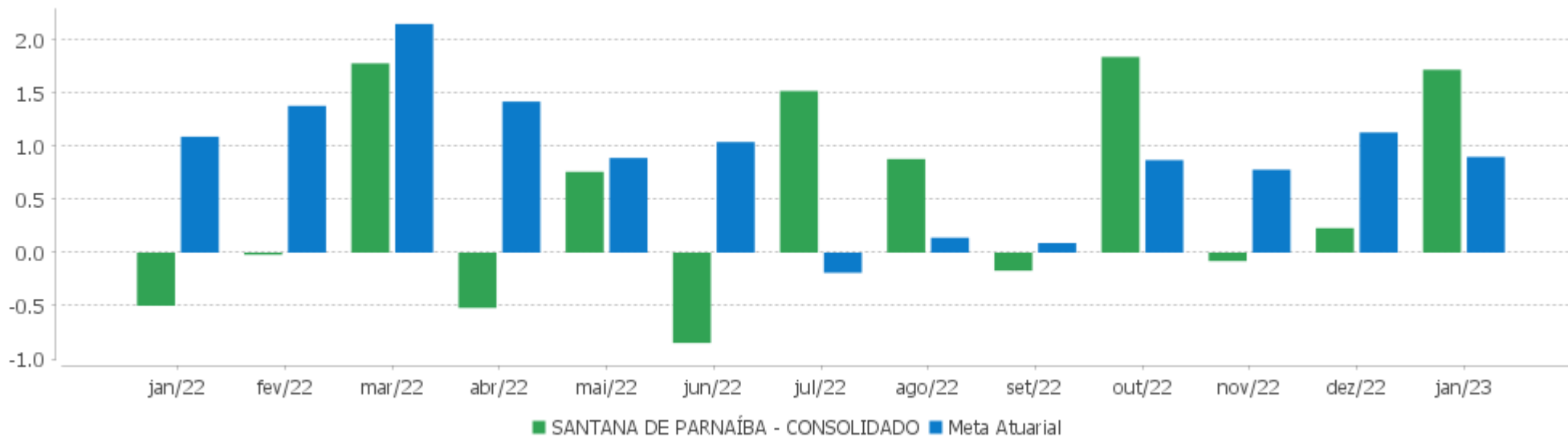


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

| Fundo<br>Variação da Estratégia   | No Mês        | No Ano        | 3 meses       | 6 meses       | 12 meses       | 24 meses       | 36 meses       |
|---|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|----------------|----------------|
| LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a<br>Var. IPCA p.p.                  | 1,09<br>0,56  | 1,09<br>0,56  | 2,87<br>1,30  | 3,60<br>2,09  |                |                |                |
| LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a<br>Var. IPCA + 6,25% p.p.       | 1,23<br>0,16  | 1,23<br>0,16  | 3,26<br>0,11  | 3,94<br>-0,74 |                |                |                |
| LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a<br>Var. IPCA + 6,25% p.p. | 1,20<br>0,13  | 1,20<br>0,13  | 3,24<br>0,09  | 3,91<br>-0,76 |                |                |                |
| LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a<br>Var. IPCA p.p.                  | 1,19<br>0,66  | 1,19<br>0,66  | 3,23<br>1,66  | 3,84<br>2,34  |                |                |                |
| LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a<br>Var. IPCA p.p.               | 1,13<br>0,60  | 1,13<br>0,60  | 2,98<br>1,42  | 3,90<br>2,39  |                |                |                |
| LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a<br>Var. IPCA p.p.                 | 1,20<br>0,67  | 1,20<br>0,67  | 3,28<br>1,71  | 3,89<br>2,39  |                |                |                |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a<br>Var. IPCA p.p.            | 1,22<br>0,69  | 1,22<br>0,69  | 3,27<br>1,70  | 3,38<br>1,88  |                |                |                |
| NTN-B 150850 (5,761000%)<br>Var. IPCA p.p.  | 1,18<br>0,65  | 1,18<br>0,65  | 3,15<br>1,58  | 3,81<br>2,30  | 8,81<br>3,03   | 19,86<br>3,11  | 25,13<br>3,06  |
| NTN-B 150840 (5,620000%)<br>Var. IPCA p.p.  | 1,17<br>0,64  | 1,17<br>0,64  | 3,11<br>1,54  | 3,72<br>2,22  | 11,75<br>5,98  | 23,00<br>6,25  | 28,32<br>6,24  |
| NTN-B 150535 (5,600000%)<br>Var. IPCA p.p.  | 1,17<br>0,64  | 1,17<br>0,64  | 3,11<br>1,54  | 3,71<br>2,21  | 11,73<br>5,95  | 22,92<br>6,16  | 28,16<br>6,08  |
| NTN-B 150850 (5,860000%)<br>Var. IPCA p.p.  | 1,19<br>0,66  | 1,19<br>0,66  | 3,17<br>1,60  | 3,84<br>2,34  | 8,85<br>3,08   | 19,94<br>3,18  | 25,23<br>3,16  |
| NTN-B 150545 (5,890000%)<br>Var. IPCA p.p.  | 1,19<br>0,66  | 1,19<br>0,66  | 3,18<br>1,61  | 3,86<br>2,35  | 12,04<br>6,26  | 23,44<br>6,68  | 28,88<br>6,80  |
| NTN-B 150830 (5,530000%)<br>Var. IPCA p.p.  | 1,16<br>0,63  | 1,16<br>0,63  | 3,09<br>1,52  | 3,68<br>2,17  | 11,66<br>5,88  | 22,72<br>5,97  | 27,85<br>5,78  |
| NTN-B 150850 (6,151000%)<br>Var. IPCA p.p.  | 1,22<br>0,69  | 1,22<br>0,69  | 3,26<br>1,69  | 0,96<br>-0,54 | 5,86<br>0,09   |                |                |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                           | 0,21<br>0,21  | 0,21<br>0,21  | -0,64<br>0,35 | 3,43<br>0,59  | 7,32<br>0,17   | 2,80<br>-3,13  | 8,38<br>-3,08  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.                 | 1,37<br>-0,02 | 1,37<br>-0,02 | 1,95<br>-0,06 | 4,36<br>-0,04 | 11,08<br>-0,11 | 15,87<br>-0,40 | 24,28<br>-0,78 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI   | 1,38          | 1,38          | 1,96          | 4,30          | 10,97          | 15,81          | 24,31          |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia   | No Mês              | No Ano              | 3 meses           | 6 meses           | 12 meses          | 24 meses         | 36 meses             |
|---|---------------------|---------------------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|----------------------|
| Var. IMA-B 5 p.p.   | -0,02               | -0,02               | -0,05             | -0,10             | -0,22             | -0,46            | -0,75                |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI<br>Var. IPCA p.p.                             | 0,50<br>-0,03       | 0,50<br>-0,03       | -0,90<br>-2,47    | 2,12<br>0,62      | 7,81<br>2,03      | 13,13<br>-3,63   | 16,12<br>-5,95       |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF<br>% do CDI   | 0,96<br>85,61       | 0,96<br>85,61       | 2,83<br>85,82     | 5,78<br>86,22     | 10,97<br>85,61    | 15,22<br>82,47   | 17,15<br>79,93       |
| FIDC ITALIA SENIOR<br>% do CDI  | -14,66<br>-1.305,06 | -14,66<br>-1.305,06 | -14,28<br>-432,42 | -13,16<br>-196,17 | 11,06<br>86,32    | 7,42<br>40,21    | 1.595,22<br>7.434,98 |
| BB INSTITUCIONAL FI RF<br>% do CDI  | 0,82<br>72,97       | 0,82<br>72,97       | 3,01<br>91,24     | 6,54<br>97,51     | 12,78<br>99,75    | 18,94<br>102,64  | 21,62<br>100,78      |
| BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM<br>% do CDI  | 1,13<br>100,38      | 1,13<br>100,38      | 3,39<br>102,66    | 6,94<br>103,53    | 13,39<br>104,56   | 19,73<br>106,95  | 22,02<br>102,64      |
| BB PREV RF FLUXO FIC<br>% do CDI  | 1,03<br>92,07       | 1,03<br>92,07       | 3,03<br>91,82     | 6,18<br>92,15     | 11,68<br>91,20    | 15,99<br>86,66   | 17,65<br>82,28       |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP<br>Var. IPCA p.p.   | 0,98<br>0,45        | 0,98<br>0,45        | 1,99<br>0,43      | 5,93<br>4,43      | 10,96<br>5,19     | 12,55<br>-4,20   |                      |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                            | 4,66<br>1,29        | 4,66<br>1,29        | -6,75<br>-4,50    | 5,94<br>-4,01     | -4,99<br>-6,14    | -31,52<br>-30,10 | -28,05<br>-27,76     |
| BRADERCO F I A SELECTION<br>Var. IBOVESPA p.p.  | 3,93<br>0,56        | 3,93<br>0,56        | -2,67<br>-0,42    | 10,30<br>0,35     | 4,30<br>3,16      | -5,91<br>-4,48   | -10,46<br>-10,17     |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.   | 5,07<br>1,70        | 5,07<br>1,70        | -7,18<br>-4,94    | 7,87<br>-2,08     | -7,76<br>-8,91    | -24,82<br>-23,40 | -16,81<br>-16,52     |
| INDIE FIC FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.   | 3,50<br>0,14        | 3,50<br>0,14        | -9,66<br>-7,42    | 6,85<br>-3,10     | -17,85<br>-19,00  | -34,54<br>-33,11 | -31,20<br>-30,91     |
| TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                   | 4,42<br>1,05        | 4,42<br>1,05        | -7,96<br>-5,71    | 7,42<br>-2,53     | 2,66<br>1,51      | -8,10<br>-6,68   | 0,65<br>0,94         |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC<br>Var. IBOVESPA p.p.  | 2,42<br>-0,95       | 2,42<br>-0,95       | -4,62<br>-2,37    | 11,26<br>1,31     | 6,28<br>5,13      | 0,01<br>1,43     | -6,08<br>-5,79       |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE<br>Var. MSCI ACWI p.p.               | 11,98<br>7,31       | 11,98<br>7,31       | 10,07<br>2,81     | -2,78<br>-2,71    | -20,91<br>-6,93   | -17,38<br>-11,29 | 15,14<br>-23,48      |
| SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR<br>% do CDI                      | 1,92<br>170,48      | 1,92<br>170,48      | 6,85<br>207,40    | 1,32<br>19,70     | -13,23<br>-103,32 | -11,19<br>-60,63 | 42,18<br>196,61      |
| ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE<br>Var. MSCI ACWI p.p.                  | 10,10<br>5,43       | 10,10<br>5,43       | 24,98<br>17,72    | 7,73<br>7,81      | -12,06<br>1,91    | -17,26<br>-11,18 |                      |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR<br>Var. IPCA + 6,00% p.p. | 11,00<br>9,96       | 11,00<br>9,96       | 14,94<br>11,85    | 2,75<br>-1,80     | -26,03<br>-38,15  | -37,52<br>-68,71 | 14,56<br>-30,73      |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO  | 0,95                | 0,95                | 2,84              | 6,65              | 13,95             | 18,41            | 21,16                |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia                              | No Mês       | No Ano       | 3 meses       | 6 meses       | 12 meses      | 24 meses       | 36 meses       |
|--|--------------|--------------|---------------|---------------|---------------|----------------|----------------|
| % do CDI   | 84,27        | 84,27        | 86,13         | 99,08         | 108,88        | 99,77          | 98,60          |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO<br>Var. S&P 500 p.p. | 6,38<br>2,61 | 6,38<br>2,61 | 7,48<br>5,35  | 7,64<br>10,64 | 3,25<br>17,32 | 31,03<br>28,82 |                |
| SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO<br>Var. INPC + 5,10% p.p.  | 1,72<br>0,82 | 1,72<br>0,82 | 1,87<br>-0,96 | 4,48<br>0,51  | 7,27<br>-3,83 | 5,19<br>-23,95 | 9,54<br>-33,62 |
| CDI  | 1,12         | 1,12         | 3,30          | 6,71          | 12,81         | 18,45          | 21,46          |
| IBOVESPA   | 3,37         | 3,37         | -2,25         | 9,95          | 1,15          | -1,42          | -0,29          |
| INPC + 6,00%   | 0,97         | 0,97         | 3,05          | 4,42          | 12,05         | 31,37          | 46,85          |
| IPCA + 6,00%   | 1,04         | 1,04         | 3,08          | 4,55          | 12,12         | 31,18          | 45,29          |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

| Fundo  | Aplicação     |               | Resgate                                    |  | Taxas  |               |
|--|---------------|---------------|--|--|--|---------------|
|  | Cotização     | Liquidação    | Cotização                                  | Liquidação                                 | Performance  | Administração |
| ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE    | D+1 du        | D+0           | D+1 du                                     | D+5 du                                     |  |               |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE | D+1 du        | D+0           | D+1 du                                     | D+6 du                                     |  | 0,80          |
| BB INSTITUCIONAL FI RF                                 | D+0           | D+0           | D+0  | D+0  |  | 0,20          |
| BB PREV RF FLUXO FIC                                   | D+0           | D+0           | D+0  | D+0  |  | 1,00          |
| BRADESCO F I A SELECTION                               | D+1 du        | D+0           | D+1 du                                     | D+3 du                                     |  | 1,50          |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM                 | D+0           | D+0           | D+0  | D+0  |  | 0,20          |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA             | D+1 du        | D+0           | D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate) | D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate) |  | 3,00          |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO                | D+0           | D+0           | D+0  | D+2 du                                     |  |               |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF                    | D+0           | D+0           | D+0  | D+0  |  | 0,80          |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP         | D+0           | D+0           | D+0  | D+0  |  | 0,20          |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP                        | D+0           | D+0           |  | D +1                                       |  |               |
| FIDC ITALIA SENIOR                                     | Não se aplica | Não se aplica |  |  |  |               |
| INDIE FIC FIA  | D+1 du        | D+0           | D+30                                       | D+32                                       | O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBX_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro e Julho | 1,34          |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                                 | D+0           | D+0           | D+21 du                                    | D+23 du                                    | O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE                               | 1,90          |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo   | Aplicação |            | Resgate                                    |  | Taxas   |               |
|---|-----------|------------|--|--|---|---------------|
|   | Cotização | Liquidação | Cotização                                  | Liquidação                                 | Performance   | Administração |
|   |           |            |  |  | EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA |               |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI                     | D+0       | D+0        | D+0  | D+1 du                                     |   | 0,40          |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | D+1 du    | D+0        | D+1 du                                     | D+5 du                                     |   | 0,80          |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA   | D+1 du    | D+0        | D+30                                       | D+32                                       | Método Passivo.   | 0,00          |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO                            | D+0       | D+0        | D+0  | D+1 du                                     |   | 0,50          |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF                                  | D+0       | D+0        | D+3 du                                     | D+4 du                                     |   | 0,15          |
| SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR        | D+1 du    | D+0        | D+1 du                                     | D+8 du                                     |   | 1,00          |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI                               | D+0       | D+0        | D+0  | D+1 du                                     |   | 0,10          |
| TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA                               | D+1 du    | D+0        | D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate) | D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate) |   | 2,90          |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

| Indexador       | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1         | 1,10   | 1,10   | 3,25    | 6,75    | 12,54    | 16,51    | 20,51    | 28,48    | 37,42    |
| IRF-M 1+        | 0,72   | 0,72   | 0,90    | 6,13    | 8,73     | 4,24     | 10,25    | 25,21    | 40,80    |
| IRF-M TOTAL     | 0,84   | 0,84   | 1,65    | 6,17    | 9,82     | 8,42     | 13,75    | 26,79    | 40,53    |
| IMA-B 5         | 1,40   | 1,40   | 2,01    | 4,40    | 11,19    | 16,27    | 25,06    | 40,14    | 54,28    |
| IMA-B 5+        | -1,26  | -1,26  | -3,59   | 1,84    | 3,66     | -3,05    | 0,52     | 22,96    | 44,15    |
| IMA-B TOTAL     | -0,00  | -0,00  | -0,99   | 2,84    | 7,15     | 5,93     | 11,46    | 31,65    | 50,23    |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,70   | 0,70   | 1,42    | 5,19    | 10,20    | 11,76    | 16,79    | 30,01    | 43,27    |
| IDKA 2          | 1,44   | 1,44   | 1,90    | 3,99    | 10,86    | 16,26    | 25,79    | 39,66    | 54,03    |
| IDKA 20         | -4,58  | -4,58  | -9,69   | -0,34   | -3,60    | -17,66   | -17,08   | 6,23     | 30,85    |
| CDI             | 1,12   | 1,12   | 3,30    | 6,71    | 12,81    | 18,45    | 21,46    | 28,49    | 36,69    |

Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | 3,37   | 3,37   | -2,25   | 9,95    | 1,15     | -1,42    | -0,29    | 16,47    | 33,58    |
| IBRX 100                 | 3,51   | 3,51   | -2,34   | 9,39    | 0,75     | -1,38    | 0,24     | 19,26    | 37,61    |
| IBRX 50                  | 3,38   | 3,38   | -1,47   | 10,88   | 1,52     | 0,57     | 3,26     | 18,48    | 34,15    |
| SMALL CAP                | 2,92   | 2,92   | -11,39  | 3,51    | -15,47   | -24,13   | -27,55   | 5,24     | 19,33    |
| Índice Consumo - ICON    |        |        | -16,42  | -6,37   | -24,84   | -42,47   | -44,77   | -20,86   | -20,70   |
| Índice Dividendos - IDIV | 5,89   | 5,89   | 5,00    | 11,84   | 10,99    | 17,61    | 12,30    | 42,62    | 69,29    |



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Investimentos Estruturados**

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| S&P 500   | 3,77   | 3,77   | 2,13    | -2,99   | -14,07   | 2,21     | 50,95    | 110,51   | 132,79   |

**Investimentos Imobiliários**

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX      | -1,60  | -1,60  | -5,69   | 0,25    | 1,59     | -2,03    | -8,32    | 17,07    | 23,45    |

**Investimentos no Exterior**

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | 4,67   | 4,67   | 7,25    | -0,08   | -13,97   | -6,09    | 38,62    | 84,31    | 93,01    |

**Indicadores Econômicos**

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA      | 0,53   | 0,53   | 1,57    | 1,50    | 5,77     | 16,75    | 22,08    | 27,19    | 32,00    |
| INPC      | 0,46   | 0,46   | 1,54    | 1,37    | 5,71     | 16,92    | 23,38    | 28,69    | 33,29    |
| IGPM      | 0,21   | 0,21   | 0,09    | -2,50   | 3,79     | 21,34    | 52,54    | 64,45    | 75,53    |
| SELIC     | 1,12   | 1,12   | 3,30    | 6,71    | 12,81    | 18,45    | 21,46    | 28,49    | 36,70    |

**Meta Atuarial**

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,87   | 0,87   | 2,58    | 3,55    | 10,01    | 26,28    | 37,25    | 48,75    | 60,49    |
| IPCA + 5,00% | 0,96   | 0,96   | 2,83    | 4,05    | 11,06    | 28,72    | 41,24    | 54,54    | 68,33    |
| IPCA + 5,50% | 1,00   | 1,00   | 2,96    | 4,30    | 11,59    | 29,95    | 43,26    | 57,50    | 72,37    |
| IPCA + 5,89% | 1,03   | 1,03   | 3,06    | 4,50    | 12,00    | 30,91    | 44,84    | 59,84    | 75,57    |
| IPCA + 6,00% | 1,04   | 1,04   | 3,08    | 4,55    | 12,12    | 31,18    | 45,29    | 60,50    | 76,48    |
| INPC + 4,00% | 0,80   | 0,80   | 2,55    | 3,41    | 9,94     | 26,46    | 38,73    | 50,51    | 62,06    |
| INPC + 6,00% | 0,97   | 0,97   | 3,05    | 4,42    | 12,05    | 31,37    | 46,85    | 62,40    | 78,20    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR          | Data       | Ativo  | Aplicação             | Resgate              | Quantidade          | Valor Cota       |
|--------------|------------|--|-----------------------|----------------------|---------------------|------------------|
| 930          | 02/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 500,00               | 232,56084300        | 2,1499750000     |
| 931          | 04/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 2.500,00             | 1.161,79964900      | 2,1518340000     |
| 922          | 05/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 142,13               | 66,02197600         | 2,1527680000     |
| 932          | 05/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 831,20               | 386,10754600        | 2,1527680000     |
| 923          | 09/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 2.569,94              | 0,00                 | 1.192,75013700      | 2,1546340000     |
| 933          | 09/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 233,00               | 108,13900900        | 2,1546340000     |
| 924          | 10/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 7.990.197,69          | 0,00                 | 3.706.771,34286600  | 2,1555680000     |
| 934          | 10/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 195.523,61           | 90.706,30556800     | 2,1555680000     |
| 925          | 11/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 588.320,03           | 272.811,68134100    | 2,1565060000     |
| 935          | 11/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 519.113,22            | 0,00                 | 240.719,58065500    | 2,1565060000     |
| 926          | 12/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 44.300.000,00         | 0,00                 | 20.533.576,33716200 | 2,1574420000     |
| 916          | 12/01/2023 | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00                  | 26.300.000,00        | 7.069.666,31832800  | 3,7201190000     |
| 917          | 12/01/2023 | BB PREV RF FLUXO FIC                           | 0,00                  | 18.000.000,00        | 7.378.687,16420500  | 2,4394583480     |
| 927          | 13/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 49.576.808,53        | 22.969.410,69081800 | 2,1583840000     |
| 936          | 13/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 67.755,41            | 31.391,73052800     | 2,1583840000     |
| 915          | 16/01/2023 | NTN-B 150850 (6,151000%)                       | 49.576.808,53         | 0,00                 | 12.269,00000000     | 4.040,8190180000 |
| 937          | 19/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 16.369,65            | 7.570,99578200      | 2,1621530000     |
| 938          | 25/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 36.377,68            | 16.795,38431100     | 2,1659330000     |
| 928          | 27/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 1.443.321,00         | 665.791,59625900    | 2,1678270000     |
| 939          | 27/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 77.405,36            | 35.706,42848200     | 2,1678270000     |
| 919          | 27/01/2023 | BB PREV RF FLUXO FIC                           | 169.708,97            | 0,00                 | 69.212,16162000     | 2,4520108320     |
| 920          | 30/01/2023 | BB PREV RF FLUXO FIC                           | 0,00                  | 160.246,12           | 65.322,89890500     | 2,4531385270     |
| 929          | 31/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 189.289,26           | 87.241,21049500     | 2,1697230000     |
| 940          | 31/01/2023 | FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            | 0,00                  | 2.000,00             | 921,77662300        | 2,1697230000     |
| 921          | 31/01/2023 | BB PREV RF FLUXO FIC                           | 0,00                  | 9.462,85             | 3.855,65664700      | 2,4542771480     |
| <b>Total</b> |            |  | <b>102.558.398,35</b> | <b>96.667.085,83</b> |                     |                  |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 14.733.692,96

Value-At-Risk: 1,38%

|                                   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)       | % Carteira |
|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|------------------|------------|
| SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO |                             | 1,38               | 1,38                |        |       | 1.064.706.168,16 | 100,00     |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,41%

Artigo 7º I, Alínea a

| Ativo                    | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| NTN-B 150535 (5,600000%) |                             | 0,14               | 0,00                | 0,16                |        |       | 79.498.564,97  | 7,47       |
| NTN-B 150545 (5,890000%) |                             | 0,14               | 0,00                | 0,16                |        |       | 110.381.516,87 | 10,37      |
| NTN-B 150830 (5,530000%) |                             | 0,14               | 0,00                | 0,16                |        |       | 50.196.116,89  | 4,71       |
| NTN-B 150840 (5,620000%) |                             | 0,14               | 0,00                | 0,16                |        |       | 94.291.007,32  | 8,86       |
| NTN-B 150850 (5,761000%) |                             | 0,14               | 0,00                | 0,17                |        |       | 43.236.616,29  | 4,06       |
| NTN-B 150850 (5,860000%) |                             | 0,14               | 0,00                | 0,16                |        |       | 43.140.503,48  | 4,05       |
| NTN-B 150850 (6,151000%) |                             | 0,14               | 0,00                | 0,16                |        |       | 49.851.438,59  | 4,68       |
| <b>Sub-total</b>         | 0,51                        | 0,14               | 0,00                |                     | 0,11   | 1,18  | 470.595.764,41 | 44,20      |

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo  | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP |                             | 1,39               | 0,06                | 0,02                |        |       | 71.040.425,93  | 6,67       |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI            |                             | 1,40               | 0,03                | 0,01                |        |       | 40.525.868,76  | 3,81       |
| FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF            |                             | 0,00               | -0,00               | 0,00                |        |       | 2.043.965,80   | 0,19       |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI  |                             | 1,95               | 0,08                | 1,96                |        |       | 68.146.620,66  | 6,40       |
| SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF               |                             | 2,65               | 0,04                | 0,42                |        |       | 20.662.284,63  | 1,94       |
| <b>Sub-total</b>                               | 3,26                        | 1,64               | 0,21                |                     | -0,05  | 0,94  | 202.419.165,78 | 19,01      |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|------------|------------|
|-------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|------------|------------|

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                                  | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| BB PREV RF FLUXO FIC                   |                             | 0,01               | -0,00               | 0,01                |        |       | 2.671.959,56   | 0,25       |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM |                             | 0,01               | -0,00               | 0,01                |        |       | 98.022.954,73  | 9,21       |
| BB INSTITUCIONAL FI RF                 |                             | 0,05               | 0,00                | 0,05                |        |       | 11.302.236,61  | 1,06       |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP        |                             | 0,83               | 0,02                | 0,84                |        |       | 44.241.236,12  | 4,16       |
| <b>Sub-total</b>                       | 0,33                        | 0,24               | 0,02                |                     | -0,21  | 1,05  | 156.238.387,02 | 14,67      |

## Artigo 7º IV

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a          |                             | 0,42               | -0,00               | 0,42                |        |       | 5.315.827,91  | 0,50       |
| LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a       |                             | 0,14               | -0,00               | 0,17                |        |       | 10.412.267,46 | 0,98       |
| LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a |                             | 0,14               | -0,00               | 0,16                |        |       | 10.401.290,65 | 0,98       |
| LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a          |                             | 0,14               | -0,00               | 0,17                |        |       | 8.502.737,31  | 0,80       |
| LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a         |                             | 0,14               | -0,00               | 0,17                |        |       | 8.518.151,46  | 0,80       |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a    |                             | 0,15               | 0,00                | 0,19                |        |       | 14.760.150,18 | 1,39       |
| LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a       |                             | 0,42               | -0,00               | 0,42                |        |       | 3.023.782,66  | 0,28       |
| <b>Sub-total</b>  | 0,53                        | 0,16               | -0,00               |                     | 0,13   | 1,19  | 60.934.207,63 | 5,72       |

## Artigo 7º V, Alínea a

| Ativo              | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent.  | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|--------|------------|------------|
| FIDC ITALIA SENIOR |                             | 0,67               | -0,00               | 0,67                |        |        | 35.079,82  | 0,00       |
| <b>Sub-total</b>   | 53,65                       | 0,67               | -0,00               |                     | -0,29  | -14,66 | 35.079,82  | 0,00       |

## Renda Variável

Value-At-Risk: 12,20%

## Artigo 8º I

| Ativo                                      | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA |                             | 10,98              | 0,28                | 5,28                |        |       | 30.568.798,36 | 2,87       |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                     |                             | 11,82              | 0,19                | 5,24                |        |       | 20.129.316,00 | 1,89       |
| BRADESCO F I A SELECTION                   |                             | 10,61              | 0,16                | 2,04                |        |       | 18.302.945,06 | 1,72       |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                               | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| INDIE FIC FIA                       |                             | 14,05              | 0,20                | 5,87                |        |       | 16.415.394,35  | 1,54       |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA           |                             | 13,35              | 0,03                | 4,31                |        |       | 2.664.290,60   | 0,25       |
| TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA |                             | 15,70              | 0,30                | 7,51                |        |       | 22.536.655,20  | 2,12       |
| <b>Sub-total</b>                    | 21,55                       | 12,20              | 1,16                |                     | 0,13   | 3,91  | 110.617.399,57 | 10,39      |

## Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,62%

## Artigo 9º II

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE               |                             | 9,07               | 0,01                | 11,59               |        |       | 3.284.640,73  | 0,31       |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE            |                             | 12,71              | 0,05                | 9,37                |        |       | 13.005.017,80 | 1,22       |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR |                             | 19,50              | -0,05               | 19,49               |        |       | 15.040.983,12 | 1,41       |
| SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR        |                             | 10,42              | -0,06               | 10,42               |        |       | 20.284.342,62 | 1,91       |
| <b>Sub-total</b>  | 19,85                       | 11,62              | -0,04               |                     | 0,32   | 7,42  | 51.614.984,27 | 4,85       |

## Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,75%

## Artigo 10º I

| Ativo                                   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO  |                             | 0,31               | -0,00               | 0,31                |        |       | 3.257.058,45  | 0,31       |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO |                             | 10,60              | 0,03                | 8,38                |        |       | 8.994.121,21  | 0,84       |
| <b>Sub-total</b>                        | 11,46                       | 7,75               | 0,03                |                     | 0,33   | 4,88  | 12.251.179,66 | 1,15       |