



LDB
EMPRESAS

SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO
FEVEREIRO 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 28.02.2023.

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

84,54%

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	0,06	0,94	2,12	80.246.838,07	7,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,63	0,07	0,96	2,16	111.442.270,81	10,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,530000%)	0,63	0,06	0,94	2,11	49.252.026,79	4,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	0,63	0,06	0,94	2,12	92.557.267,42	8,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	0,63	0,08	0,95	2,14	42.436.467,65	3,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	0,63	0,07	0,96	2,16	42.329.316,74	3,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,151000%)	3,09	0,08	0,98	1,54	48.870.483,17	4,56
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,63	0,07	0,95	2,14	467.134.670,65	43,63

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	2,64	0,01	1,39	2,78	72.028.369,36	6,73	7.935.684.977,28	0,91
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,65	0,01	1,39	2,78	41.088.938,86	3,84	835.837.223,61	4,92
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,04	0,79	1,76	1.993.642,23	0,19	1.066.490.987,09	0,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,52	-0,16	1,14	1,65	68.924.675,90	6,44	2.181.457.433,60	3,16
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	5,51	-0,29	1,25	1,46	20.920.868,24	1,95	332.788.581,85	6,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,88	-0,07	1,26	2,22	204.956.494,59	19,14		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,05	0,85	1,89	2.703.826,60	0,25	3.964.919.513,24	0,07
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,05	0,88	2,02	98.884.308,61	9,24	8.371.920.489,79	1,18
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,27	0,05	0,70	1,53	25.321.159,99	2,36	2.495.126.406,97	1,01
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,07	0,04	0,99	1,99	44.680.769,66	4,17	747.688.315,56	5,98
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,68	0,05	0,90	1,96	171.590.064,86	16,03		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. 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. a	1,54	0,05	0,98	2,08	5.368.124,47	0,50		
BRADESCO	BRADESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	0,68	0,10	1,01	2,25	10.517.900,80	0,98		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 6,25% a.a	0,72	-0,00	0,92	2,13	10.496.744,77	0,98		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a. a	0,71	0,01	0,93	2,13	8.581.805,57	0,80		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a. a	0,81	0,06	0,99	2,21	8.602.674,44	0,80		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	1,27	0,07	0,99	2,22	14.905.710,85	1,39		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	2,01	0,05	1,03	2,17	3.054.824,70	0,29		
Sub-total Artigo 7º IV			0,84	0,05	0,97	2,18	61.527.785,60	5,75		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	29,97	-0,11	-0,11	-14,75	35.042,93	0,00	18.916.364,87	0,19
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			29,97	-0,11	-0,11	-14,75	35.042,93	0,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,97

0,03

1,02

2,13

905.244.058,63

84,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

9,53%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	22,48	-0,92	-6,29	-1,93	28.645.570,74	2,68	1.337.859.374,92	2,14
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,67	-0,76	-6,80	-4,55	18.760.445,58	1,75	1.687.120.867,12	1,11
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	21,71	-1,04	-7,48	-3,85	16.933.315,41	1,58	420.232.220,21	4,03
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	26,69	-0,61	-8,23	-5,01	15.064.845,40	1,41	418.530.878,05	3,60
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	25,94	-0,95	-7,48	-2,79	2.464.878,55	0,23	185.185.325,96	1,33
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	24,01	-1,89	-10,50	-6,55	20.169.944,36	1,88	829.466.129,97	2,43
Sub-total Artigo 8º I			22,19	-1,06	-7,76	-4,15	102.039.000,04	9,53		
Renda Variável			22,19	-1,06	-7,76	-4,15	102.039.000,04	9,53		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,79%

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	21,43	-0,18	-6,01	3,48	3.087.123,64	0,29	57.652.930,65	5,35
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	32,31	-0,17	-3,03	8,58	12.610.793,23	1,18	220.200.259,80	5,73
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	39,18	1,41	1,39	12,55	15.250.757,44	1,42	590.852.345,79	2,58
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,64	0,36	0,45	2,37	20.374.760,77	1,90	922.059.325,60	2,21
Sub-total Artigo 9º II			24,65	0,50	-0,56	6,81	51.323.435,08	4,79		
Investimentos no Exterior			24,65	0,50	-0,56	6,81	51.323.435,08	4,79		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,13%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,10	0,06	0,86	1,81	3.284.923,79	0,31	1.140.954.415,51	0,29
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	23,54	-0,11	-1,74	4,53	8.837.705,66	0,83	485.533.147,91	1,82
Sub-total Artigo 10º I			20,96	-0,06	-1,05	3,78	12.122.629,45	1,13		
Investimentos Estruturados			20,96	-0,06	-1,05	3,78	12.122.629,45	1,13		
Total			3,28	-0,05	0,01	1,73	1.070.729.123,20	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
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	467.134.670,65	43,63	30,00	50,00	85,00	50,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	204.956.494,59	19,14	5,00	12,50	30,00	8,48	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	171.590.064,86	16,03	5,00	15,00	30,00	14,99	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	61.527.785,60	5,75	3,00	6,00	10,00	6,03	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	35.042,93	0,00	0,00	0,10	0,20	0,01	5,00
	Total Renda Fixa	905.244.058,63	84,54					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	102.039.000,04	9,53	3,00	7,00	15,00	0,49	30,00
	Total Renda Variável	102.039.000,04	9,53					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	51.323.435,08	4,79	3,00	6,90	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	51.323.435,08	4,79					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	12.122.629,45	1,13	0,50	2,30	5,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	12.122.629,45	1,13					15,00
Total		1.070.729.123,20	100,00					

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 % do CDI	0,95 103,72	2,14 104,37	3,01 94,15	4,80 74,54	11,66 89,69	4.445.097,23	9.605.325,24
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,26 137,49	2,22 108,12	2,70 84,30	4,57 70,96	9,78 75,25	2.621.587,72	4.759.408,86
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,90 97,92	1,96 95,69	3,14 98,29	6,13 95,17	12,57 96,74	1.452.589,59	3.171.860,11
Artigo 7º IV % do CDI	0,97 106,10	2,18 106,23	3,13 97,73	4,91 76,15	12,27 94,41	593.577,97	1.312.395,79
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,11 -11,45	-14,75 -718,88	-14,49 -453,14	-13,61 -211,20	11,32 87,07	-36,89	-6.063,02
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-7,76 -0,26	-4,15 0,23	-6,31 0,40	-6,99 -2,79	-8,30 -1,04	-8.578.399,53	-4.412.791,09
Artigo 9º II % do CDI	-0,56 -61,52	6,81 331,94	3,28 102,70	2,55 39,62	-13,99 -107,64	-291.549,19	3.272.536,44
Artigo 10º I % do CDI	-1,05 -114,28	3,78 184,19	-0,51 -15,86	8,82 136,83	5,20 40,01	-128.550,21	441.451,51
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)						114.316,69	18.144.123,84

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%)	79.498.564,97	0,00	0,00	0,00	80.246.838,07	748.273,10	1.663.941,52
NTN-B 150545 (5,890000%)	110.381.516,87	0,00	0,00	0,00	111.442.270,81	1.060.753,94	2.358.181,17
NTN-B 150830 (5,530000%)	50.196.116,89	0,00	0,00	1.407.827,75	49.252.026,79	463.737,65	1.039.003,52
NTN-B 150840 (5,620000%)	94.291.007,32	0,00	0,00	2.610.689,91	92.557.267,42	876.950,01	1.964.538,71
NTN-B 150850 (5,761000%)	43.236.616,29	0,00	0,00	1.206.317,96	42.436.467,65	406.169,32	909.804,35
NTN-B 150850 (5,860000%)	43.140.503,48	0,00	0,00	1.219.307,06	42.329.316,74	408.120,32	914.133,02
NTN-B 150850 (6,151000%)	49.851.438,59	0,00	0,00	1.462.048,31	48.870.483,17	481.092,89	755.722,95
					467.134.670,65	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	2.043.965,80	8.574.496,96	-8.658.755,87	0,00	1.993.642,23	33.935,34	87.824,24
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	71.040.425,93	0,00	0,00	0,00	72.028.369,36	987.943,43	2.137.960,05
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	68.146.620,66	0,00	0,00	0,00	68.924.675,90	778.055,24	1.118.385,14
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	20.662.284,63	0,00	0,00	0,00	20.920.868,24	258.583,61	301.981,27
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	40.525.868,76	0,00	0,00	0,00	41.088.938,86	563.070,10	1.113.258,16
					204.956.494,59	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	11.302.236,61	13.889.954,02	0,00	0,00	25.321.159,99	128.969,36	220.859,73
BB PREV RF FLUXO FIC	2.671.959,56	9.134,23	0,00	0,00	2.703.826,60	22.732,81	126.199,31
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	98.022.954,73	0,00	0,00	0,00	98.884.308,61	861.353,88	1.954.300,07
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	44.241.236,12	0,00	0,00	0,00	44.680.769,66	439.533,54	870.501,00
					171.590.064,86	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	10.412.267,46	0,00	0,00	0,00	10.517.900,80	105.633,34	231.673,40
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	8.502.737,31	0,00	0,00	0,00	8.581.805,57	79.068,26	178.674,43
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	5.315.827,91	0,00	0,00	0,00	5.368.124,47	52.296,56	109.442,40
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	10.401.290,65	0,00	0,00	0,00	10.496.744,77	95.454,12	218.527,15
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	14.760.150,18	0,00	0,00	0,00	14.905.710,85	145.560,67	323.493,47
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	8.518.151,46	0,00	0,00	0,00	8.602.674,44	84.522,98	185.838,28
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	3.023.782,66	0,00	0,00	0,00	3.054.824,70	31.042,04	64.746,66
					61.527.785,60	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	35.079,82	0,00	0,00	0,00	35.042,93	-36,89	-6.063,02
					35.042,93	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	18.302.945,06	0,00	0,00	0,00	16.933.315,41	-1.369.629,65	-678.161,16
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	30.568.798,36	0,00	0,00	0,00	28.645.570,74	-1.923.227,62	-562.715,38
INDIE FIC FIA	16.415.394,35	0,00	0,00	0,00	15.064.845,40	-1.350.548,95	-794.685,89
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20.129.316,00	0,00	0,00	0,00	18.760.445,58	-1.368.870,42	-893.725,98
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.664.290,60	0,00	0,00	0,00	2.464.878,55	-199.412,05	-70.847,79
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22.536.655,20	0,00	0,00	0,00	20.169.944,36	-2.366.710,84	-1.412.654,89
					102.039.000,04	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	3.284.640,73	0,00	0,00	0,00	3.087.123,64	-197.517,09	103.715,16
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	13.005.017,80	0,00	0,00	0,00	12.610.793,23	-394.224,57	996.791,51
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15.040.983,12	0,00	0,00	0,00	15.250.757,44	209.774,32	1.700.459,88
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20.284.342,62	0,00	0,00	0,00	20.374.760,77	90.418,15	471.569,89
					51.323.435,08	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	8.994.121,21	0,00	0,00	0,00	8.837.705,66	-156.415,55	383.041,82
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	3.257.058,45	0,00	0,00	0,00	3.284.923,79	27.865,34	58.409,69
					12.122.629,45	0,00	0,00

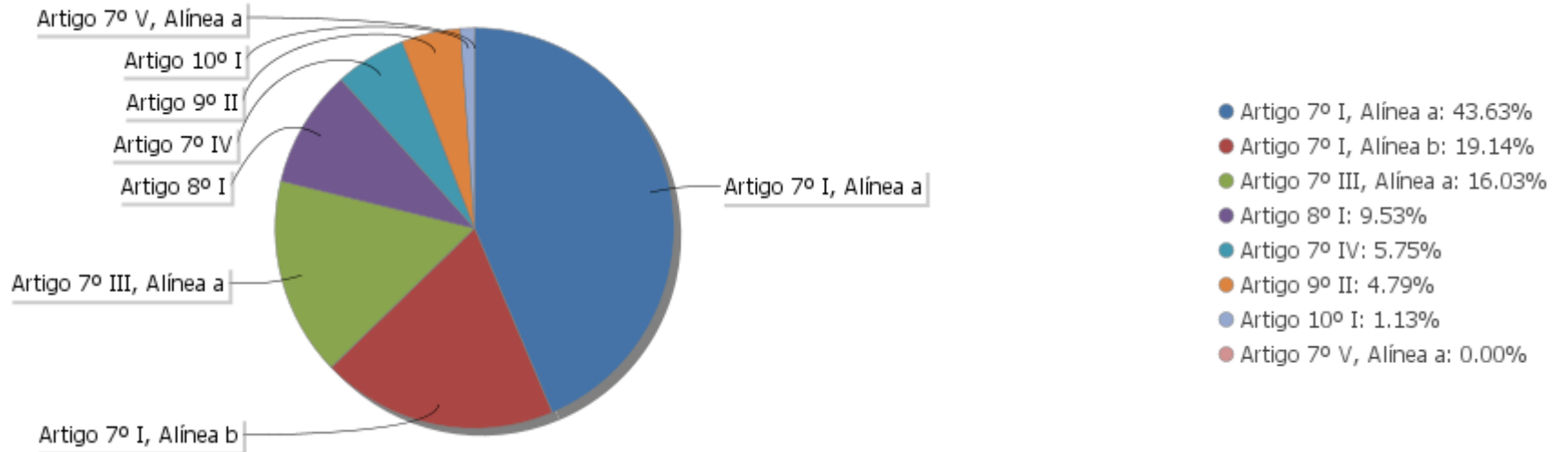
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

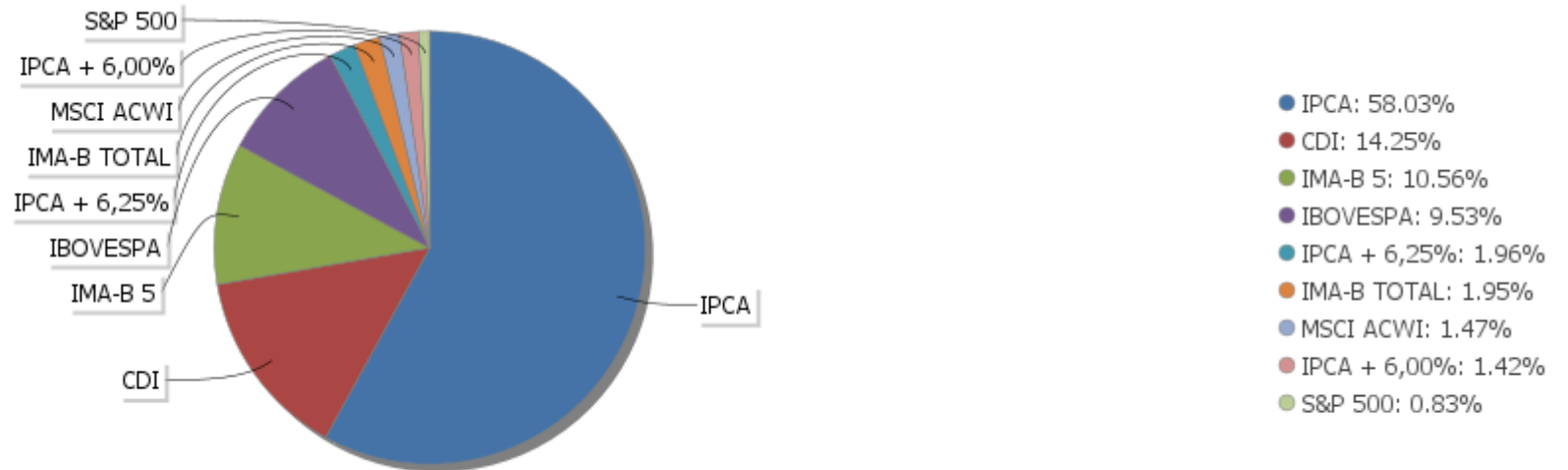
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	456.960.982,32	42,68	456.960.982,32	42,68	
de 31 a 365 dias	85.105.684,63	7,95	542.066.666,95	50,63	
de 1 a 5 anos	61.527.785,60	5,75	603.594.452,55	56,37	
de 5 a 10 anos	49.252.026,79	4,60	652.846.479,34	60,97	
de 10 a 20 anos	172.804.105,49	16,14	825.650.584,83	77,11	
acima de 20 anos	245.078.538,37	22,89	1.070.729.123,20	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

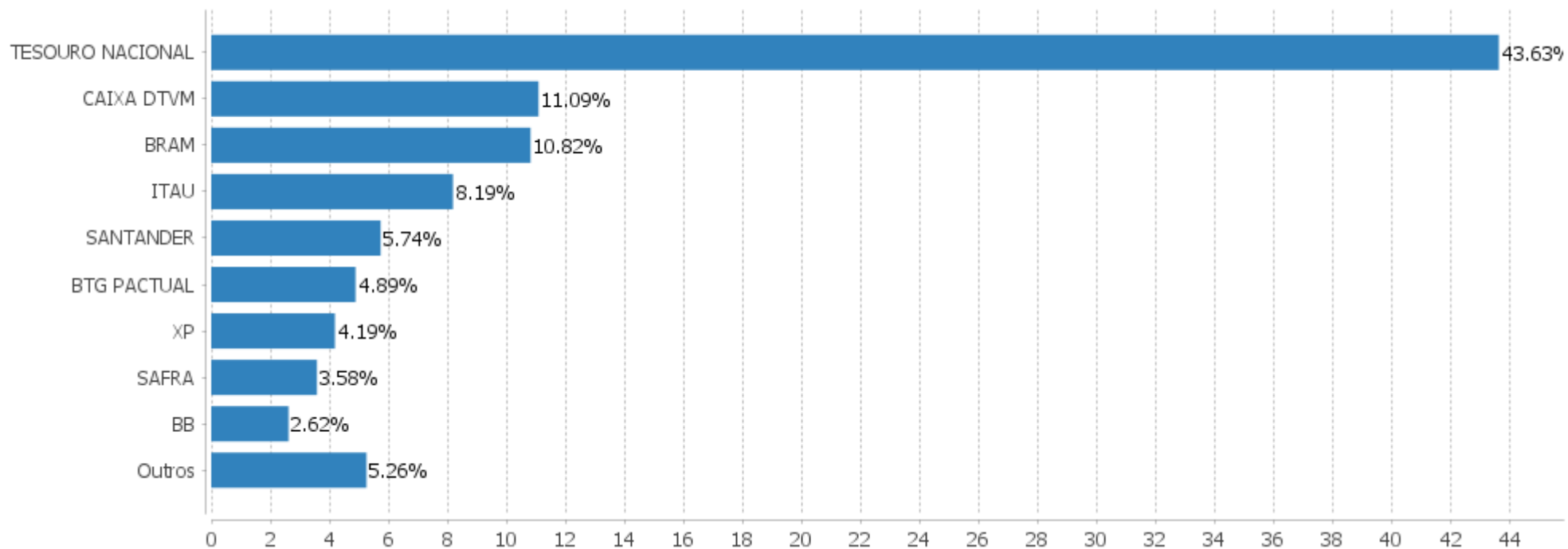


Alocação Por Estratégia



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	0,01											1,73
INPC + 5,10%	0,90	1,13											2,04
p.p. indexador	0,82	-1,12											-0,31
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

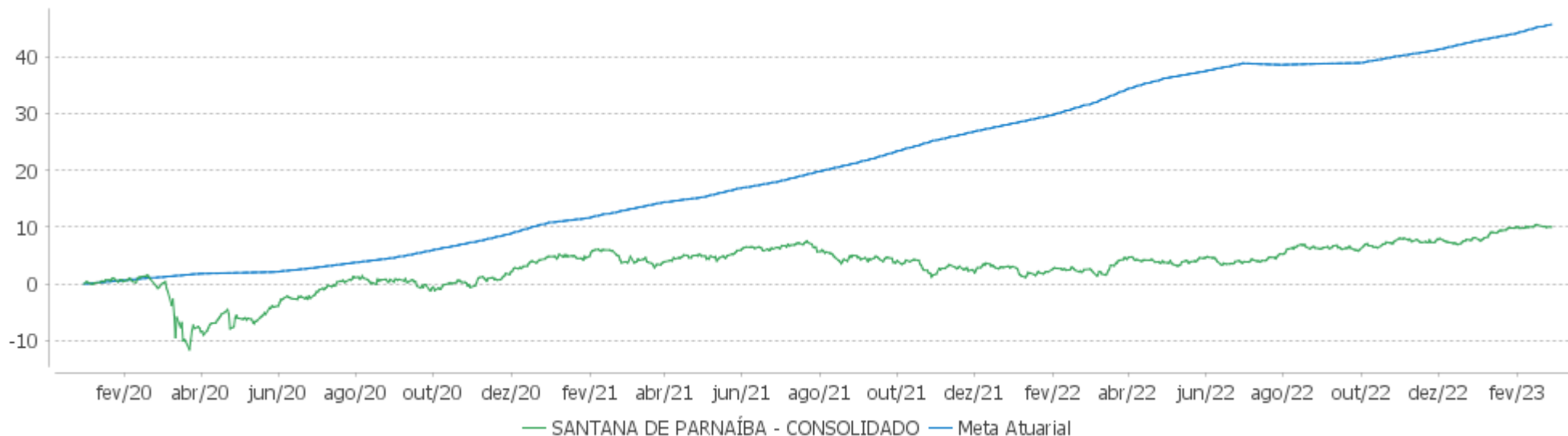
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	11	28,95	03 meses	1,96	3,17	-1,21	2,42
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	71,05	06 meses	3,58	4,94	-1,36	2,91
			12 meses	7,31	10,69	-3,38	3,28
			24 meses	6,05	29,23	-23,18	3,95
			36 meses	10,67	45,13	-34,46	6,98
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12	Desde 31/12/2019	9,98	46,98	-37,00	6,90
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

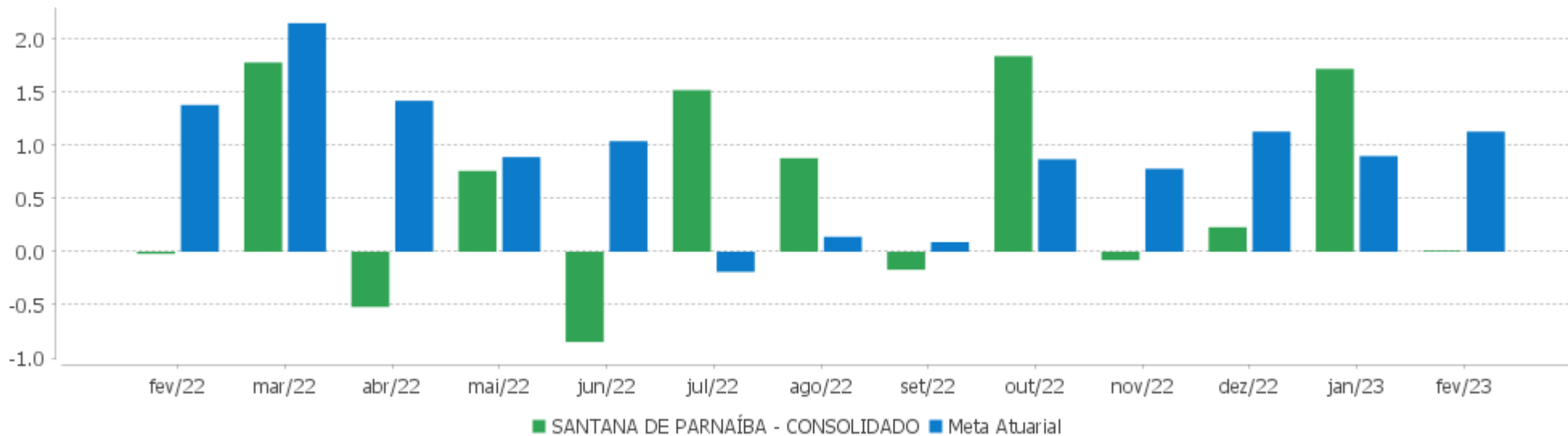


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo 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 Var. IPCA p.p.	0,98 0,14	2,08 0,71	3,15 1,15	4,11 1,39			
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	1,01 -0,26	2,25 -0,10	3,16 -0,38	5,02 -0,80			
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA + 6,25% p.p.	0,92 -0,36	2,13 -0,23	3,05 -0,48	4,88 -0,93			
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	0,93 0,09	2,13 0,75	3,06 1,06	4,85 2,12			
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	0,99 0,15	2,21 0,83	3,15 1,15	4,96 2,23			
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a Var. IPCA p.p.	1,03 0,19	2,17 0,79	3,29 1,29	4,36 1,64			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	0,99 0,15	2,22 0,84	3,13 1,13	5,26 2,53	12,24 6,64		
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,11	2,14 0,77	3,02 1,01	4,83 2,11	11,73 6,13	23,51 6,78	29,28 6,48
NTN-B 150840 (5,620000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,10	2,12 0,75	2,98 0,98	4,75 2,02	11,56 5,97	26,72 9,99	32,53 9,73
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,10	2,12 0,74	2,98 0,97	4,74 2,01	11,54 5,95	23,14 6,41	28,73 5,94
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,16 0,78	3,04 1,04	4,87 2,14	11,82 6,22	23,63 6,90	29,43 6,63
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,16 0,79	3,05 1,04	4,88 2,15	11,85 6,25	23,67 6,94	29,46 6,66
NTN-B 150830 (5,530000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,10	2,11 0,73	2,96 0,96	4,71 1,98	11,47 5,87	26,46 9,73	32,08 9,29
NTN-B 150850 (6,151000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,14	2,21 0,84	3,12 1,12	5,02 2,29	8,86 3,27		
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,25 -0,03	1,46 0,18	1,39 0,30	3,27 0,25	8,12 0,18	6,06 -2,88	9,03 -3,35
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,39 -0,02	2,78 -0,04	3,73 -0,06	5,76 -0,11	11,45 -0,12	18,22 -0,40	25,22 -0,79
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,39	2,78	3,73	5,76	11,34	18,12	25,26

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo 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	-0,04	-0,06	-0,11	-0,23	-0,50	-0,75
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	1,14 0,30	1,65 0,28	1,27 -0,73	2,66 -0,07	8,03 2,44	14,35 -2,38	17,15 -5,65
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,79 86,00	1,76 85,72	2,74 85,65	5,54 86,00	11,14 85,68	16,04 82,77	17,80 80,16
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-0,11 -11,45	-14,75 -718,88	-14,49 -453,14	-13,61 -211,20	11,32 87,08	7,86 40,55	1.626,42 7.322,72
BB INSTITUCIONAL FI RF % do CDI	0,70 76,41	1,53 74,42	2,68 83,76	5,99 92,87	12,67 97,45	19,63 101,28	22,13 99,65
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,88 95,71	2,02 98,27	3,21 100,23	6,59 102,33	13,45 103,47	20,58 106,19	22,79 102,60
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,85 92,66	1,89 92,30	2,95 92,15	5,94 92,17	11,87 91,35	16,92 87,32	18,40 82,84
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,99 0,15	1,99 0,61	3,21 1,21	5,33 2,60	11,04 5,44	14,26 -2,47	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,29 1,20	-1,93 2,45	-4,93 1,78	-6,11 -1,92	-9,07 -1,81	-34,17 -29,53	-27,40 -28,13
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-7,48 0,01	-3,85 0,53	-6,33 0,38	-6,03 -1,84	-1,59 5,67	-10,03 -5,39	-6,86 -7,59
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,48 0,01	-2,79 1,58	-4,87 1,84	-9,35 -5,16	-12,02 -4,76	-30,39 -25,76	-14,40 -15,13
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,23 -0,73	-5,01 -0,63	-9,14 -2,42	-11,23 -7,04	-20,68 -13,42	-37,22 -32,58	-32,63 -33,36
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-10,50 -3,01	-6,55 -2,17	-9,25 -2,53	-9,17 -4,98	-8,55 -1,30	-16,91 -12,27	-1,04 -1,77
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-6,80 0,69	-4,55 -0,17	-2,83 3,89	-2,67 1,52	0,27 7,52	-7,23 -2,60	-2,97 -3,70
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-3,03 -2,11	8,58 4,87	2,67 4,59	-2,35 -5,51	-19,15 -10,40	-21,72 -11,86	17,82 -24,19
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	0,45 48,55	2,37 115,48	0,17 5,44	5,06 78,57	-7,98 -61,39	-14,71 -75,93	46,97 211,50
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-6,01 -5,09	3,48 -0,23	0,57 2,49	1,62 -1,55	-13,83 -5,07	-23,37 -13,51	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,39 0,13	12,55 10,23	8,94 5,46	3,74 -1,95	-16,89 -28,80	-39,33 -70,49	19,72 -26,43
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,86	1,81	2,88	6,07	13,98	19,51	22,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	93,18	88,23	90,17	94,19	107,55	100,66	99,98
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-1,74 -1,20	4,53 1,32	-0,56 3,73	9,19 8,25	3,66 11,90	25,26 27,16	
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO Var. INPC + 5,10% p.p.	0,01 -1,12	1,73 -0,31	1,96 -1,23	3,58 -1,41	7,31 -3,52	6,05 -23,03	10,67 -33,35
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15

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		0,20
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	0,98	2,09	3,30	6,49	12,81	17,61	21,23	29,14	38,03
IRF-M 1+	0,79	1,51	3,16	4,25	9,06	7,22	10,24	25,91	40,07
IRF-M TOTAL	0,86	1,71	3,21	4,93	10,13	10,66	13,99	27,51	40,19
IMA-B 5	1,41	2,82	3,79	5,87	11,57	18,62	26,01	41,34	55,61
IMA-B 5+	1,17	-0,11	-1,30	0,52	4,86	0,42	1,37	23,71	45,02
IMA-B TOTAL	1,28	1,28	1,08	3,02	7,94	8,94	12,38	32,61	51,33
IMA-GERAL TOTAL	1,03	1,74	2,52	4,81	10,51	13,70	17,46	30,71	43,72
IDKA 2	1,62	3,08	4,36	6,05	11,25	18,71	26,96	41,17	55,55
IDKA 20	0,79	-3,83	-7,02	-4,75	-2,27	-14,73	-16,36	6,39	31,39
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,30

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73	9,78	22,94
IBRX 100	-7,59	-4,34	-6,85	-4,76	-8,23	-5,60	0,93	12,19	26,64
IBRX 50	-7,54	-4,41	-6,85	-3,59	-7,74	-3,34	4,52	11,43	23,50
SMALL CAP	-10,52	-7,90	-10,68	-16,48	-20,21	-30,84	-29,32	-4,09	7,17
Índice Consumo - ICON	-9,78		-12,01	-20,80	-30,44	-45,20	-44,63	-25,38	-25,80
Índice Dividendos - IDIV	-7,55	-2,11	-3,69	-0,84	5,04	14,70	10,65	34,58	57,47

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	-0,54	3,21	-4,28	0,94	-8,25	-1,90	55,57	98,62	134,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,45	-2,05	-2,05	-5,64	2,45	-2,71	-5,24	15,36	21,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,92	3,71	-1,93	3,17	-8,75	-9,86	42,01	74,04	94,86

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,84	1,37	2,00	2,73	5,60	16,73	22,79	27,71	32,68
INPC	0,77	1,23	1,93	2,47	5,47	16,86	24,12	28,99	34,07
IGPM	-0,06	0,15	0,60	-1,88	1,86	18,28	52,51	62,91	75,30
SELIC	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,31

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,12	2,01	2,99	4,71	9,80	26,26	38,06	49,31	61,33
IPCA + 5,00%	1,19	2,16	3,23	5,20	10,85	28,69	42,07	55,11	69,21
IPCA + 5,50%	1,23	2,24	3,36	5,45	11,38	29,92	44,10	58,08	73,26
IPCA + 5,89%	1,25	2,30	3,45	5,64	11,79	30,89	45,70	60,42	76,48
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15	61,08	77,39
INPC + 4,00%	1,05	1,87	2,92	4,45	9,67	26,39	39,56	50,81	63,02
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73	62,70	79,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
951	03/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	80.589,32	37.094,12352500	2,1725630000
952	06/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	210,00	96,61791000	2,1735100000
943	07/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	64.990,16	29.887,96756000	2,1744590000
953	07/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	435,49	200,27509200	2,1744590000
944	09/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	7.986.039,59	0,00	3.669.457,99718200	2,1763540000
945	10/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	77.955,58	35.803,71873700	2,1773040000
954	10/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	52.957,87	24.322,68055100	2,1773040000
946	13/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	588.320,03	270.087,89116300	2,1782540000
955	13/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	588.288,63	0,00	270.073,47627900	2,1782540000
941	15/02/2023	BB INSTITUCIONAL FI RF	13.889.954,02	0,00	1.272.295,13345200	10,9172421200
947	15/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.982.688,39	2.744.152,32578300	2,1801590000
956	15/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	28.838,80	13.227,84244400	2,1801590000
957	22/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.489,50	682,31165000	2,1830200000
948	24/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	18.304,55	8.377,62530200	2,1849330000
958	24/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.678,42	1.225,85906400	2,1849330000
949	27/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.679.511,60	768.341,52977400	2,1858920000
959	27/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	75.962,39	34.751,20900100	2,1858920000
942	28/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	9.134,23	0,00	3.690,36249292	2,4751579330
950	28/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	168,74	0,00	77,16103700	2,1868550000
960	28/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.823,77	1.748,52468500	2,1868550000
Total			22.473.585,21	8.658.755,87		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 12.871.355,08

Value-At-Risk: 1,20%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO		1,20	1,20			1.070.729.123,20	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,39%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,600000%)		0,17	0,00	0,19			80.246.838,07	7,49
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,17	0,00	0,19			111.442.270,81	10,41
NTN-B 150830 (5,530000%)		0,17	0,00	0,19			49.252.026,79	4,60
NTN-B 150840 (5,620000%)		0,17	0,00	0,19			92.557.267,42	8,64
NTN-B 150850 (5,761000%)		0,17	0,00	0,19			42.436.467,65	3,96
NTN-B 150850 (5,860000%)		0,17	0,00	0,19			42.329.316,74	3,95
NTN-B 150850 (6,151000%)		0,17	0,00	0,19			48.870.483,17	4,56
Sub-total	0,19	0,17	0,00		0,18	0,95	467.134.670,65	43,63

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,35	0,06	0,01			72.028.369,36	6,73
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,36	0,04	0,01			41.088.938,86	3,84
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,00	-0,00	0,00			1.993.642,23	0,19
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,96	0,09	1,96			68.924.675,90	6,44
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF		2,64	0,04	0,48			20.920.868,24	1,95
Sub-total	3,13	1,62	0,22		0,11	1,26	204.956.494,59	19,14

Artigo 7º III, Alínea a

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			2.703.826,60	0,25
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	0,00	0,03			98.884.308,61	9,24
BB INSTITUCIONAL FI RF		0,05	0,00	0,05			25.321.159,99	2,36
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,57	0,01	0,57			44.680.769,66	4,17
Sub-total	0,28	0,15	0,01		-0,07	0,90	171.590.064,86	16,03

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a		0,14	-0,00	0,16			5.368.124,47	0,50
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a		0,18	0,00	0,19			10.517.900,80	0,98
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a		0,17	0,00	0,19			10.496.744,77	0,98
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a		0,17	-0,00	0,19			8.581.805,57	0,80
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		0,17	-0,00	0,19			8.602.674,44	0,80
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a		0,17	0,00	0,19			14.905.710,85	1,39
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a		0,14	-0,00	0,16			3.054.824,70	0,29
Sub-total	0,18	0,16	-0,00		0,31	0,97	61.527.785,60	5,75

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		0,68	-0,00	0,68			35.042,93	0,00
Sub-total	0,39	0,68	-0,00		-2,60	-0,11	35.042,93	0,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,30%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		9,74	0,23	5,30			28.645.570,74	2,68
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		11,31	0,16	5,57			18.760.445,58	1,75
BRADESCO F I A SELECTION		9,91	0,14	1,91			16.933.315,41	1,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INDIE FIC FIA		13,58	0,17	6,26			15.064.845,40	1,41
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		12,40	0,03	4,09			2.464.878,55	0,23
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		15,03	0,25	7,46			20.169.944,36	1,88
Sub-total	16,70	11,30	0,98		-0,52	-7,76	102.039.000,04	9,53

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,92%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE		9,40	0,01	11,86			3.087.123,64	0,29
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		12,46	0,04	9,46			12.610.793,23	1,18
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		14,70	-0,04	14,70			15.250.757,44	1,42
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,29	-0,05	9,29			20.374.760,77	1,90
Sub-total	16,44	9,92	-0,05		-0,09	-0,56	51.323.435,08	4,79

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,50%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO		0,23	-0,00	0,23			3.284.923,79	0,31
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		10,32	0,03	7,79			8.837.705,66	0,83
Sub-total	11,84	7,50	0,03		-0,17	-1,05	12.122.629,45	1,13