



**LDB**  
EMPRESAS

**SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO**  
MAIO 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 31.05.2023.

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

84,85%

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%)	0,47	0,04	1,04	5,66	80.726.416,22	7,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,825500%)	4,03	0,08	0,47	0,47	50.523.008,23	4,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,47	0,04	1,07	5,78	112.123.679,59	9,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,410000%)	3,10	0,04	1,11	2,71	50.730.574,05	4,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,530000%)	0,47	0,04	1,04	5,63	50.953.130,56	4,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	0,47	0,04	1,04	5,67	95.774.495,29	8,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	0,47	0,05	1,05	5,73	43.926.044,31	3,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	0,47	0,04	1,06	5,77	43.825.487,92	3,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,151000%)	3,05	0,05	1,09	5,20	50.632.445,23	4,49
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,47</b>	<b>0,04</b>	<b>1,06</b>	<b>5,74</b>	<b>579.215.281,40</b>	<b>51,34</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	2,45	0,00	0,63	5,91	74.219.378,75	6,58	8.623.099.025,61	0,86
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,46	0,00	0,56	5,83	42.306.065,08	3,75	1.154.899.961,96	3,66
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,01	0,05	0,97	4,60	4.752.552,64	0,42	900.415.296,74	0,53
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,82	0,01	2,35	7,88	47.910.203,99	4,25	2.062.404.983,41	2,32
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,86</b>	<b>0,00</b>	<b>1,12</b>	<b>6,18</b>	<b>169.188.200,46</b>	<b>15,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,04	4,93	2.186.311,50	0,19	3.860.323.166,27	0,06
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,06	1,16	5,34	64.523.684,98	5,72	8.436.127.357,01	0,76
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,27	0,06	1,18	4,77	31.989.200,65	2,84	2.441.185.966,26	1,31
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,98	0,04	1,67	5,98	46.428.756,45	4,11	737.859.385,86	6,29
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,64</b>	<b>0,05</b>	<b>1,31</b>	<b>5,46</b>	<b>145.127.953,58</b>	<b>12,86</b>		

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	1,36	0,20	1,28	5,98	5.573.114,89	0,49		
BRADESCO	BRADESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	0,53	0,05	1,10	5,92	10.895.165,93	0,97		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	0,57	0,05	1,11	5,92	10.887.099,65	0,96		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	0,54	0,07	1,12	5,90	8.898.986,27	0,79		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	0,53	0,08	1,14	5,98	8.920.418,59	0,79		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	1,09	0,04	1,10	5,93	15.447.125,60	1,37		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	1,74	0,20	1,33	6,24	3.176.559,49	0,28		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>0,67</b>	<b>0,07</b>	<b>1,14</b>	<b>5,95</b>	<b>63.798.470,42</b>	<b>5,65</b>		

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	15,93	0,36	0,36	-14,10	35.310,93	0,00	19.087.385,82	0,18
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>15,93</b>	<b>0,36</b>	<b>0,36</b>	<b>-14,10</b>	<b>35.310,93</b>	<b>0,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,88

0,04

1,11

5,80

957.365.216,79

84,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

9,24%

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	21,32	-0,32	7,44	-2,50	28.479.331,70	2,52	1.350.305.370,46	2,11
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,83	-0,61	0,64	-6,49	18.378.291,34	1,63	1.449.896.602,59	1,27
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	21,12	-0,03	5,90	-2,26	17.213.502,19	1,53	414.831.621,42	4,15
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	25,38	0,13	10,90	5,58	16.744.779,44	1,48	392.393.734,14	4,27
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	24,24	0,19	6,24	1,53	2.574.539,11	0,23	170.086.670,42	1,51
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	23,05	-0,17	4,89	-3,39	20.851.358,86	1,85	831.275.581,97	2,51
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>21,06</b>	<b>-0,21</b>	<b>5,91</b>	<b>-2,08</b>	<b>104.241.802,64</b>	<b>9,24</b>		
Renda Variável			21,06	-0,21	5,91	-2,08	104.241.802,64	9,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,72%

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	18,00	-0,99	-2,45	1,71	3.034.338,50	0,27	50.524.212,70	6,01
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	27,73	0,29	3,81	16,47	13.526.397,20	1,20	221.795.564,18	6,10
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	35,10	-0,36	6,84	21,04	16.401.547,37	1,45	658.978.226,88	2,49
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,58	-0,34	1,04	1,81	20.263.588,88	1,80	796.561.244,67	2,54
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>22,18</b>	<b>-0,22</b>	<b>3,25</b>	<b>10,77</b>	<b>53.225.871,95</b>	<b>4,72</b>		
Investimentos no Exterior			22,18	-0,22	3,25	10,77	53.225.871,95	4,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,19%

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	0,89	0,06	1,10	4,71	3.378.530,70	0,30	962.710.255,67	0,35
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	20,66	-0,48	1,23	12,43	9.505.233,13	0,84	457.117.581,91	2,08
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>19,26</b>	<b>-0,34</b>	<b>1,19</b>	<b>10,30</b>	<b>12.883.763,83</b>	<b>1,14</b>		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	4,56	-1,21	-1,21	-1,21	577.013,54	0,05	61.989.720,05	0,93
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>4,56</b>	<b>-1,21</b>	<b>-1,21</b>	<b>-1,21</b>	<b>577.013,54</b>	<b>0,05</b>		

<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>19,25</b>	<b>-0,38</b>	<b>1,06</b>	<b>10,15</b>	<b>13.460.777,37</b>	<b>1,19</b>		
-----------------------------------	--	--	--------------	--------------	-------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

<b>Total</b>			<b>2,72</b>	<b>0,00</b>	<b>1,64</b>	<b>5,27</b>	<b>1.128.293.668,75</b>	<b>100,00</b>		
--------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-------------	-------------------------	---------------	--	--



## 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	579.215.281,40	51,34	30,00	50,00	85,00	52,68	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	169.188.200,46	15,00	5,00	12,50	30,00	1,65	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	145.127.953,58	12,86	5,00	15,00	30,00	15,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	63.798.470,42	5,65	3,00	6,00	10,00	5,76	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	35.310,93	0,00	0,00	0,10	0,20	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>957.365.216,79</b>	<b>84,85</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	104.241.802,64	9,24	3,00	7,00	15,00	4,92	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>104.241.802,64</b>	<b>9,24</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	53.225.871,95	4,72	3,00	6,90	10,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>53.225.871,95</b>	<b>4,72</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	12.883.763,83	1,14	0,50	2,30	5,00	10,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	577.013,54	0,05	0,10	0,20	2,50	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>13.460.777,37</b>	<b>1,19</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>1.128.293.668,75</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 % do CDI	1,06 94,71	5,74 106,97	3,53 108,48	6,64 101,38	10,04 74,50	5.822.391,23	27.586.810,27
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,12 99,28	6,18 115,12	3,88 119,25	6,68 101,90	9,63 71,48	1.903.868,75	11.619.671,79
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,31 116,30	5,46 101,64	3,43 105,42	6,68 101,91	13,07 96,97	2.051.230,58	8.837.688,24
Artigo 7º IV % do CDI	1,14 101,16	5,95 110,83	3,69 113,53	6,93 105,78	10,58 78,49	716.812,11	3.583.080,61
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,36 32,43	-14,10 -262,58	0,76 23,53	-13,84 -211,18	-12,31 -91,35	128,18	-5.795,02
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,91 2,17	-2,08 -0,80	2,16 -1,08	-4,29 -0,60	-3,56 -0,85	5.816.303,88	-2.209.988,49
Artigo 9º II % do CDI	3,25 289,73	10,77 200,59	3,71 114,04	7,11 108,55	9,20 68,23	1.677.667,89	5.174.973,31
Artigo 10º I % do CDI	1,19 106,24	10,30 191,75	6,28 193,16	5,74 87,59	13,80 102,42	151.948,37	1.202.585,89
Artigo 10º II % do CDI	-1,21 -148,53	-1,21 -148,53				-7.076,60	-7.076,60
<b>SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>18.133.274,39</b>	<b>55.781.950,00</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%)	82.176.275,46	0,00	0,00	2.295.269,61	80.726.416,22	845.410,37	4.438.789,28
NTN-B 150545 (5,825500%)	0,00	50.288.553,98	0,00	0,00	50.523.008,23	234.454,25	234.454,25
NTN-B 150545 (5,890000%)	114.172.758,65	0,00	0,00	3.250.465,10	112.123.679,59	1.201.386,04	6.290.055,05
NTN-B 150555 (6,410000%)	51.739.331,72	0,00	0,00	1.574.702,77	50.730.574,05	565.945,10	1.374.267,60
NTN-B 150830 (5,530000%)	50.430.835,15	0,00	0,00	0,00	50.953.130,56	522.295,41	2.740.107,29
NTN-B 150840 (5,620000%)	94.785.720,24	0,00	0,00	0,00	95.774.495,29	988.775,05	5.181.766,58
NTN-B 150850 (5,761000%)	43.467.549,37	0,00	0,00	0,00	43.926.044,31	458.494,94	2.399.381,01

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (5,860000%)	43.364.463,40	0,00	0,00	0,00	43.825.487,92	461.024,52	2.410.304,20
NTN-B 150850 (6,151000%)	50.087.839,68	0,00	0,00	0,00	50.632.445,23	544.605,55	2.517.685,01
					579.215.281,40	5.822.391,23	

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	3.524.606,47	53.399.054,27	-52.273.860,15	0,00	4.752.552,64	102.752,05	338.605,22
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	73.754.320,25	0,00	0,00	0,00	74.219.378,75	465.058,50	4.328.969,44
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	46.809.266,74	0,00	0,00	0,00	47.910.203,99	1.100.937,25	4.103.913,23
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	42.070.944,13	0,00	0,00	0,00	42.306.065,08	235.120,95	2.330.384,38
					169.188.200,46	1.903.868,75	

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	31.616.366,34	0,00	0,00	0,00	31.989.200,65	372.834,31	1.123.286,81
BB PREV RF FLUXO FIC	2.746.153,45	10.232,07	-594.322,21	0,00	2.186.311,50	24.248,19	202.237,20
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	100.934.161,58	0,00	-37.300.000,00	0,00	64.523.684,98	889.523,40	4.893.676,44
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	45.664.131,77	0,00	0,00	0,00	46.428.756,45	764.624,68	2.618.487,79
					145.127.953,58	2.051.230,58	

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	10.776.301,89	0,00	0,00	0,00	10.895.165,93	118.864,04	608.938,53
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	8.800.532,89	0,00	0,00	0,00	8.898.986,27	98.453,38	495.855,13
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	5.502.869,75	0,00	0,00	0,00	5.573.114,89	70.245,14	314.432,82
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	10.768.055,79	0,00	0,00	0,00	10.887.099,65	119.043,86	608.882,03
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	15.279.592,43	0,00	0,00	0,00	15.447.125,60	167.533,17	864.908,22
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	8.819.445,06	0,00	0,00	0,00	8.920.418,59	100.973,53	503.582,43
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	3.134.860,50	0,00	0,00	0,00	3.176.559,49	41.698,99	186.481,45

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					63.798.470,42	716.812,11	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC ITALIA SENIOR	35.182,75	0,00	0,00	0,00	35.310,93	128,18	-5.795,02
					35.310,93	128,18	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADERCO F I A SELECTION	16.254.831,51	0,00	0,00	0,00	17.213.502,19	958.670,68	-397.974,38
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	26.507.936,48	0,00	0,00	0,00	28.479.331,70	1.971.395,22	-728.954,42
INDIE FIC FIA	15.098.694,30	0,00	0,00	0,00	16.744.779,44	1.646.085,14	885.248,15
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18.262.316,28	0,00	0,00	0,00	18.378.291,34	115.975,06	-1.275.880,22
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.423.370,63	0,00	0,00	0,00	2.574.539,11	151.168,48	38.812,77
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	19.878.349,56	0,00	0,00	0,00	20.851.358,86	973.009,30	-731.240,39
					104.241.802,64	5.816.303,88	

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	3.110.472,96	0,00	0,00	0,00	3.034.338,50	-76.134,46	50.930,02
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	13.030.213,26	0,00	0,00	0,00	13.526.397,20	496.183,94	1.912.395,48
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15.351.931,23	0,00	0,00	0,00	16.401.547,37	1.049.616,14	2.851.249,81
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20.055.586,61	0,00	0,00	0,00	20.263.588,88	208.002,27	360.398,00
					53.225.871,95	1.677.667,89	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9.389.891,55	0,00	0,00	0,00	9.505.233,13	115.341,58	1.050.569,29
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	3.341.923,91	0,00	0,00	0,00	3.378.530,70	36.606,79	152.016,60
					12.883.763,83	151.948,37	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	0,00	584.090,14	0,00	0,00	577.013,54	-7.076,60	-7.076,60
					577.013,54	-7.076,60	

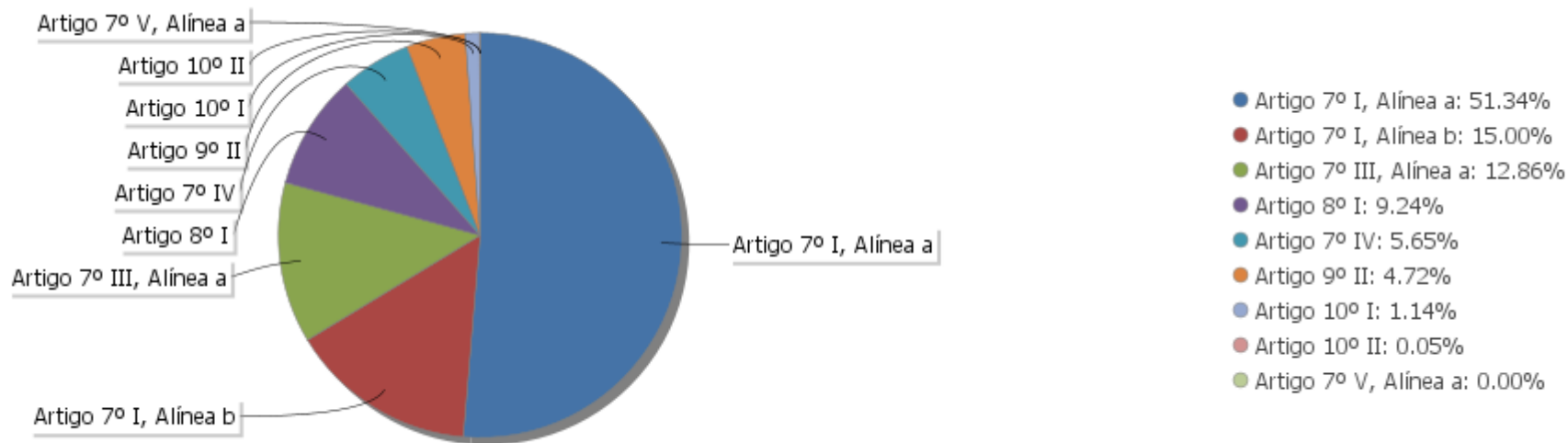
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

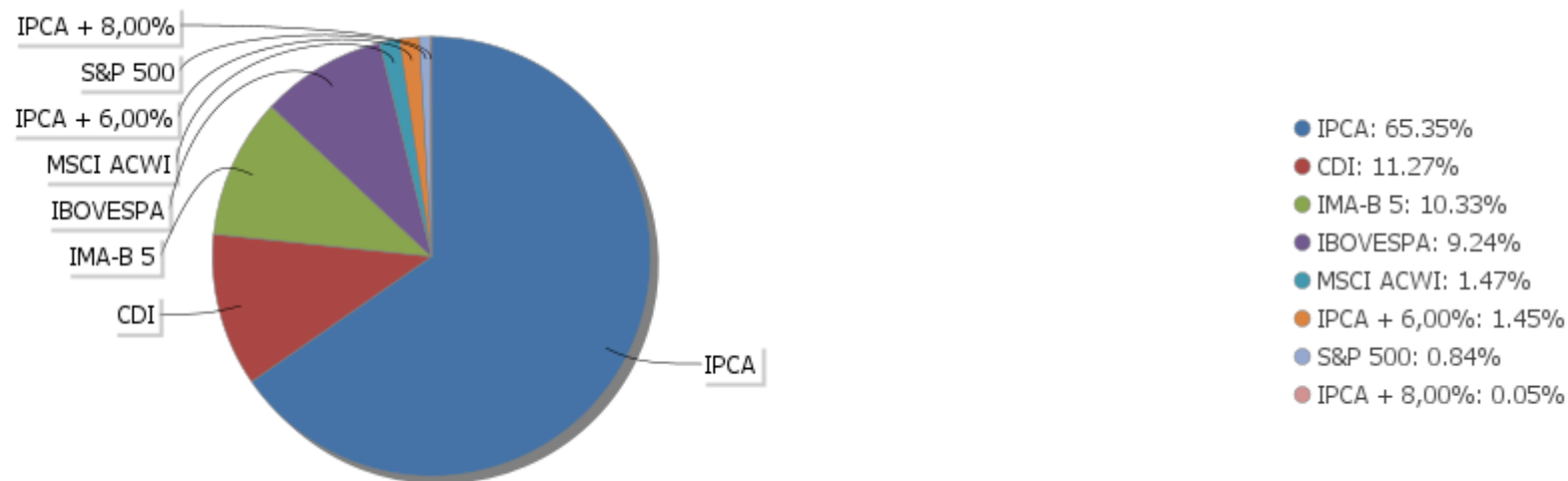
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	397.674.602,94	35,25	397.674.602,94	35,25	
de 31 a 365 dias	87.028.300,45	7,71	484.702.903,39	42,96	
de 1 a 5 anos	63.798.470,42	5,65	548.501.373,81	48,61	
de 5 a 10 anos	51.530.144,10	4,57	600.031.517,91	53,18	
de 10 a 20 anos	176.500.911,51	15,64	776.532.429,42	68,82	
acima de 20 anos	351.761.239,33	31,18	1.128.293.668,75	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

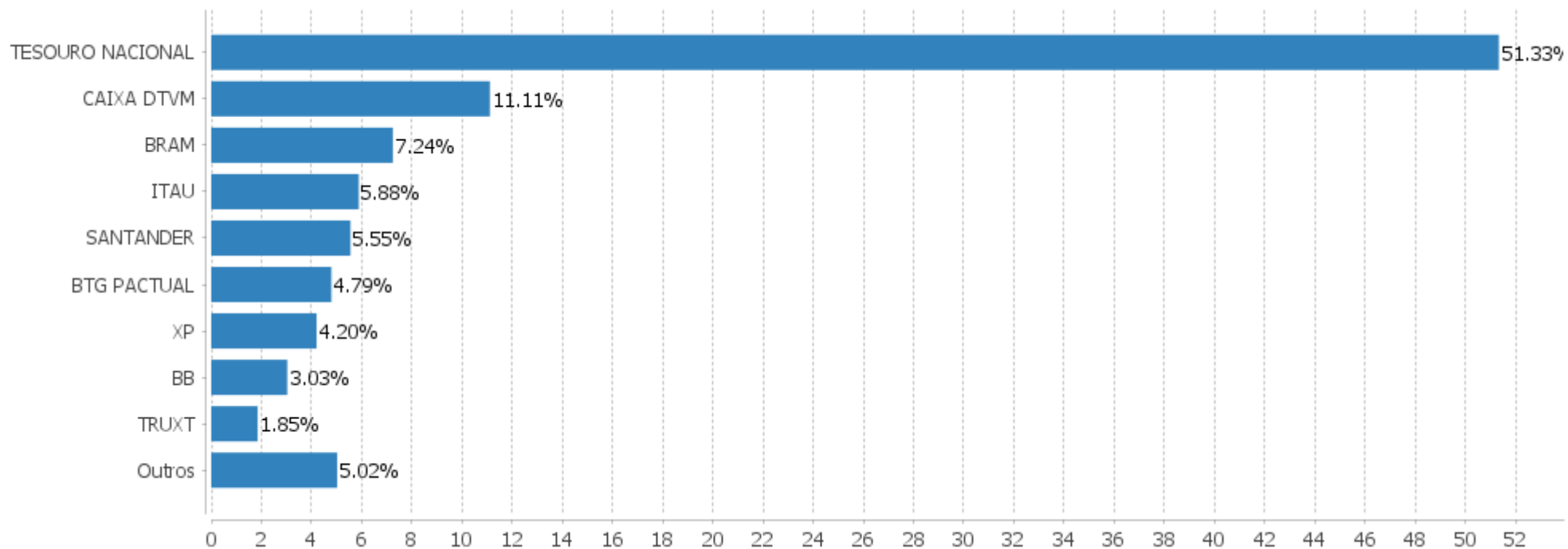


Alocação Por Estratégia



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	0,95	0,85	1,64								5,27
INPC + 5,10%	0,90	1,13	1,10	0,89	0,80								4,90
p.p. indexador	0,82	-1,12	-0,15	-0,03	0,84								0,36
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

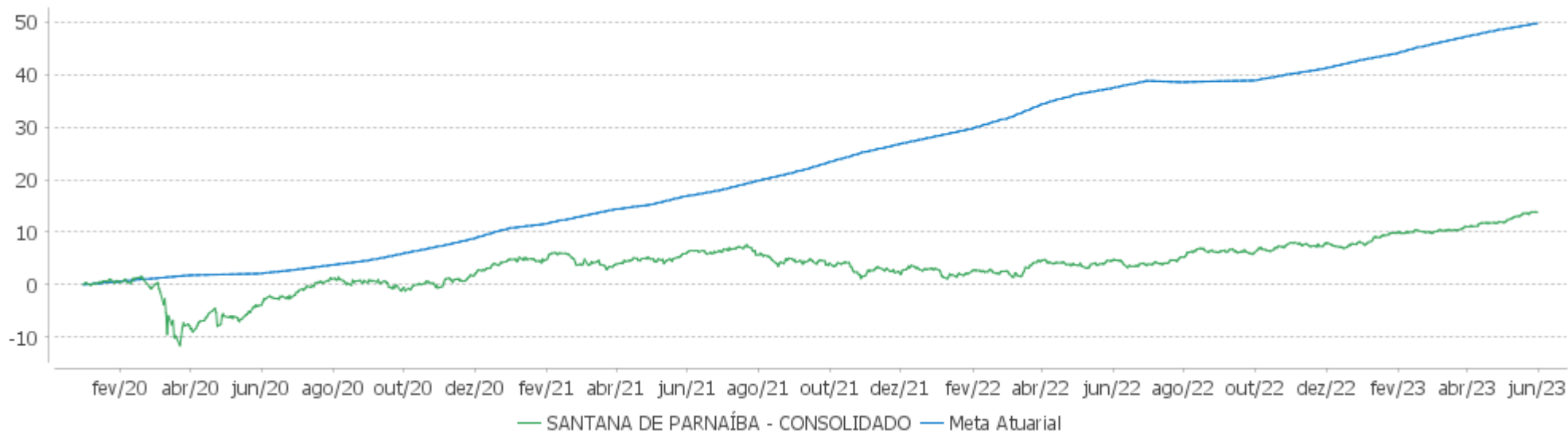
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	12	29,27	03 meses	3,48	2,81	0,67	1,81
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	70,73	06 meses	5,51	6,07	-0,57	2,13
			12 meses	8,83	8,91	-0,08	2,72
			24 meses	7,44	28,24	-20,81	3,64
			36 meses	18,58	47,57	-28,99	4,08
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12	Desde 31/12/2019	13,80	51,10	-37,30	6,66
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

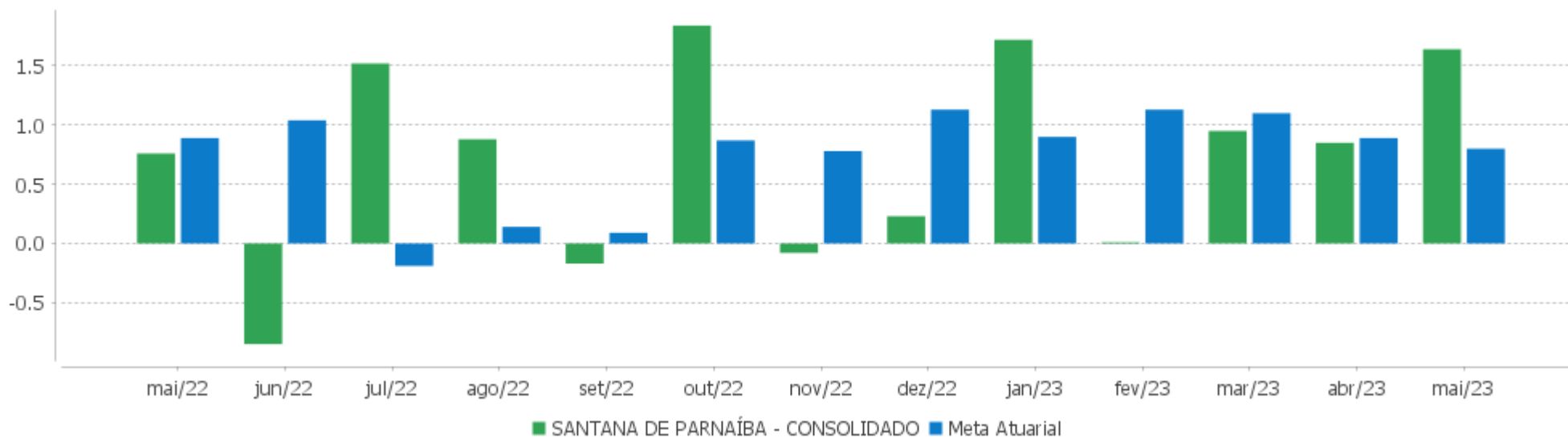


Patrimônio Líquido



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.	1,28 1,05	5,98 3,03	3,82 2,26	7,09 3,50			
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA p.p.	1,10 0,87	5,92 2,97	3,59 2,03	6,86 3,26	10,53 6,60		
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA p.p.	1,11 0,88	5,92 2,97	3,72 2,16	6,89 3,30	10,57 6,64		
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	1,12 0,89	5,90 2,95	3,70 2,14	6,87 3,28	10,53 6,59		
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a Var. IPCA p.p.	1,33 1,10	6,24 3,28	3,99 2,43	7,41 3,81			
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	1,14 0,91	5,98 3,03	3,69 2,14	6,96 3,37	10,74 6,80		
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	1,10 0,87	5,93 2,98	3,63 2,07	6,88 3,29	10,31 6,38		
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,82	5,73 2,77	3,51 1,95	6,63 3,04	10,07 6,13	23,31 7,18	32,35 6,86
NTN-B 150545 (5,825500%) Var. IPCA p.p.	-1,74 -1,97	2,83 -0,12	0,66 -0,89	3,71 0,12	4,07 0,13		
NTN-B 150840 (5,620000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,81	5,67 2,72	3,48 1,92	6,56 2,97	9,91 5,97	26,51 10,38	35,68 10,19
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,81	5,66 2,71	3,47 1,91	6,55 2,96	9,89 5,95	26,44 10,31	35,53 10,05
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,77 2,82	3,53 1,98	6,68 3,09	10,16 6,22	23,43 7,31	32,50 7,02
NTN-B 150555 (6,410000%) Var. IPCA p.p.	1,11 0,88	5,99 3,04	3,67 2,11	6,96 3,36	7,38 3,44		
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,78 2,83	3,54 1,98	6,70 3,10	10,19 6,25	27,06 10,93	36,39 10,90
NTN-B 150830 (5,530000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,81	5,63 2,68	3,45 1,90	6,52 2,92	9,81 5,88	26,26 10,13	35,21 9,73
NTN-B 150850 (6,151000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,86	5,90 2,95	3,61 2,05	6,84 3,25	7,25 3,31		
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,56	5,83	2,96	6,81	9,23	19,39	27,91

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.	-0,01	-0,10	-0,06	-0,12	-0,22	-0,51	-0,85
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,63	5,91	3,04	6,89	9,41	19,60	28,08
Var. IMA-B 5 p.p.	0,06	-0,02	0,02	-0,04	-0,03	-0,30	-0,68
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,35	7,88	6,13	7,48	11,36	20,73	22,83
Var. IPCA p.p.	2,12	4,93	4,57	3,89	7,43	4,60	-2,65
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,97	4,60	2,80	5,61	11,56	18,74	20,31
% do CDI	86,36	85,75	86,01	85,64	85,76	83,53	80,91
FIDC ITALIA SENIOR	0,36	-14,10	0,76	-13,84	-12,31	20,39	1.592,85
% do CDI	32,43	-262,58	23,53	-211,18	-91,35	90,91	6.346,19
BB INSTITUCIONAL FI RF	1,18	4,77	3,20	5,96	13,02	22,47	25,68
% do CDI	104,98	88,91	98,37	90,99	96,59	100,15	102,30
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,16	5,34	3,26	6,57	13,81	23,57	26,44
% do CDI	103,35	99,46	100,23	100,23	102,50	105,06	105,36
BB PREV RF FLUXO FIC	1,04	4,93	2,98	6,02	12,36	19,92	21,20
% do CDI	92,96	91,88	91,76	91,84	91,75	88,82	84,44
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,67	5,98	3,91	7,25	11,96	17,50	20,85
Var. IPCA p.p.	1,44	3,02	2,35	3,66	8,02	1,37	-4,63
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7,44	-2,50	-0,58	-5,48	-4,40	-38,53	-17,72
Var. IBOVESPA p.p.	3,70	-1,22	-3,82	-1,79	-1,69	-24,36	-41,67
BRADESCO F I A SELECTION	5,90	-2,26	1,65	-4,78	-2,06	-16,67	20,01
Var. IBOVESPA p.p.	2,16	-0,98	-1,59	-1,09	0,65	-2,51	-3,94
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	6,24	1,53	4,45	-0,64	-5,12	-33,86	-1,36
Var. IBOVESPA p.p.	2,50	2,81	1,21	3,05	-2,41	-19,69	-25,31
INDIE FIC FIA	10,90	5,58	11,15	0,99	-1,95	-37,55	-8,37
Var. IBOVESPA p.p.	7,16	6,86	7,91	4,68	0,75	-23,38	-32,32
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	0,64	-6,49	-2,04	-4,81	-4,28	-20,00	20,29
Var. IBOVESPA p.p.	-3,10	-5,22	-5,28	-1,12	-1,57	-5,83	-3,66
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	4,89	-3,39	3,38	-6,18	-4,06	-22,64	20,10
Var. IBOVESPA p.p.	1,16	-2,11	0,14	-2,49	-1,36	-8,48	-3,85
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	3,81	16,47	7,26	10,12	2,57	-19,04	11,49
Var. MSCI ACWI p.p.	3,25	12,19	6,71	11,51	-4,12	-7,52	-7,66
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	-2,45	1,71	-1,71	-1,15	-5,93	-25,06	
Var. MSCI ACWI p.p.	-3,01	-2,57	-2,26	0,23	-12,63	-13,54	
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,04	1,81	-0,55	-0,37	7,51	-15,19	16,64
% do CDI	92,33	33,73	-16,79	-5,69	55,70	-67,69	66,28
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	6,84	21,04	7,55	17,16	21,65	-31,28	-3,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6,00% p.p.	6,10	15,61	4,50	10,53	11,50	-61,73	-53,00
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do CDI	1,10 97,51	4,71 87,75	2,85 87,66	5,82 88,75	12,92 95,84	21,84 97,37	24,62 98,10
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	1,23 -0,93	12,43 6,10	7,55 4,53	6,96 8,35	15,57 6,56	21,88 25,04	68,08 39,14
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA Var. IPCA + 8,00% p.p.	-1,21 -1,95	-1,21 -1,95					
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO Var. INPC + 5,10% p.p.	1,64 0,84	5,27 0,36	3,48 0,67	5,51 -0,58	8,83 -0,18	7,44 -20,76	18,58 -28,12
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38

## 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 ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA						
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	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO 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
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	1,14	5,42	3,26	6,67	13,53	20,82	23,37	31,17	40,60
IRF-M 1+	2,85	8,54	6,92	10,30	15,84	14,80	14,48	30,11	50,74
IRF-M TOTAL	2,20	7,34	5,54	8,93	14,73	16,57	17,40	30,67	48,09
IMA-B 5	0,57	5,93	3,02	6,92	9,45	19,90	28,76	40,94	59,58
IMA-B 5+	4,13	11,16	11,29	9,84	11,30	11,03	22,89	28,01	69,69
IMA-B TOTAL	2,53	8,76	7,39	8,55	10,47	15,54	26,13	34,56	66,49
IMA-GERAL TOTAL	1,77	6,78	4,95	7,60	12,55	18,47	23,45	32,82	51,09
IDKA 2	0,29	5,76	2,60	7,07	8,74	18,79	28,85	40,48	57,41
IDKA 20	7,14	15,51	20,12	11,68	12,90	1,60	17,65	14,97	73,96
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95	11,65	41,15
IBRX 100	3,59	-2,09	2,36	-4,66	-4,47	-16,34	23,50	12,48	44,21
IBRX 50	2,92	-3,51	0,95	-5,97	-4,44	-15,81	25,71	11,41	38,93
SMALL CAP	13,54	4,71	13,69	1,56	-7,34	-32,24	6,89	5,09	34,10
Índice Consumo - ICON	12,26		6,51	-6,28	-15,80	-46,84	-32,02	-26,79	-9,87
Índice Dividendos - IDIV	0,84	0,48	2,64	-1,14	-0,85	1,55	39,98	32,28	81,33

**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	2,16	6,32	3,02	-1,39	9,00	-3,17	28,94	96,40	109,24

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	5,43	5,10	7,30	5,10	6,84	6,99	13,39	18,05	36,10

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,56	4,28	0,55	-1,39	6,70	-11,51	19,15	69,85	72,84

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	2,95	1,56	3,59	3,94	16,13	25,48	27,84	33,80
INPC	0,36	2,79	1,54	3,50	3,74	16,08	26,41	29,00	35,17
IGPM	-1,84	-2,58	-2,73	-2,14	-4,47	5,78	44,96	54,39	66,19
SELIC	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	4,62	2,56	5,63	8,08	25,59	41,11	49,48	62,68
IPCA + 5,00%	0,66	5,03	2,80	6,13	9,11	28,01	45,21	55,30	70,63
IPCA + 5,50%	0,70	5,23	2,93	6,38	9,63	29,23	47,29	58,27	74,72
IPCA + 5,89%	0,73	5,39	3,02	6,57	10,03	30,18	48,92	60,62	77,96
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38	61,28	78,88
INPC + 4,00%	0,70	4,45	2,54	5,53	7,87	25,54	42,15	50,84	64,35
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49	62,75	80,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (5,600000%)	80.726.416,22	5,600000	81.043.730,81	5,552700	317.314,59
NTN-B 150545 (5,825500%)	50.523.008,23	5,825500	51.079.121,11	5,730200	556.112,88
NTN-B 150545 (5,890000%)	112.123.679,59	5,890000	114.281.613,91	5,730200	2.157.934,32
NTN-B 150555 (6,410000%)	50.730.574,05	6,410000	55.761.436,75	5,722200	5.030.862,70
NTN-B 150830 (5,530000%)	50.953.130,56	5,530000	51.180.805,79	5,450000	227.675,23
NTN-B 150840 (5,620000%)	95.774.495,29	5,620000	95.234.129,41	5,674600	-540.365,88
NTN-B 150850 (5,761000%)	43.926.044,31	5,761000	44.120.462,79	5,726200	194.418,48
NTN-B 150850 (5,860000%)	43.825.487,92	5,860000	44.595.532,48	5,726200	770.044,56
NTN-B 150850 (6,151000%)	50.632.445,23	6,151000	53.473.669,66	5,726200	2.841.224,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1037	02/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.406,07	631,27003400	2,2273670000
1038	03/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	201,19	0,00	90,28738500	2,2283290000
1024	05/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.209,72	2.335,91661300	2,2302680000
1039	05/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.197,07	2.330,24468100	2,2302680000
1020	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	647.617,81	0,00	290.249,91910300	2,2312420000
1025	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	486,10	217,86072000	2,2312420000
1040	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	396,60	177,74852800	2,2312420000
1018	09/05/2023	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	584.090,14	0,00	584.090,14000000	1,0000000000
1019	09/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	584.090,14	230.884,89102200	2,5297893570
1041	09/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	8.397.316,82	0,00	3.761.871,29572470	2,2322180000
1026	10/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	37.896,77	16.969,73873300	2,2331970000
1042	10/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	81.261,38	36.387,91355800	2,2331970000
1017	11/05/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	37.300.000,00	2.448.960,17400000	15,2309541000
1027	11/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.490,00	1.114,50783700	2,2341700000
1028	12/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	951,20	425,56561800	2,2351430000
1043	12/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	37.300.000,00	0,00	16.687.970,29988600	2,2351430000
1029	15/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	562.032,36	0,00	251.342,66497326	2,2361200000
1044	15/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	6.490.381,60	0,00	2.902.519,36389818	2,2361200000
1021	16/05/2023	NTN-B 150545 (5,825500%)	50.288.553,98	0,00	11.932,00000000	4.214,5955400000
1045	16/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	50.288.553,98	22.479.370,13935018	2,2370980000
1030	19/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	12.608,37	5.628,74421300	2,2399970000
1031	23/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	500,00	223,01904100	2,2419610000
1032	25/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	895,61	399,12616500	2,2439270000
1046	25/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	18.691,08	8.329,62925000	2,2439270000
1033	26/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.254,00	1.004,04871000	2,2449110000
1022	29/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	10.232,07	0,00	4.017,93563800	2,5465987810
1034	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	75.348,78	33.549,57090700	2,2458940000
1047	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.586.307,25	706.314,38972632	2,2458940000

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1023	30/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.232,07	4.016,09094100	2,5477685020
1035	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.702,05	1.202,54442300	2,2469440000
1048	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	144.704,12	64.400,41195600	2,2469440000
1036	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.000,00	2.669,04619100	2,2479940000
1049	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.504,49	0,00	669,25890300	2,2479940000
<b>Total</b>			<b>104.281.930,46</b>	<b>90.168.182,36</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.940.582,16

Value-At-Risk: 0,88%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO		0,88	0,88			1.128.293.668,75	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,20%

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%)		0,07	-0,00	0,10			80.726.416,22	7,15
NTN-B 150545 (5,825500%)		0,19	-0,00	0,20			50.523.008,23	4,48
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,07	-0,00	0,10			112.123.679,59	9,94
NTN-B 150555 (6,410000%)		0,07	-0,00	0,10			50.730.574,05	4,50
NTN-B 150830 (5,530000%)		0,07	-0,00	0,10			50.953.130,56	4,52
NTN-B 150840 (5,620000%)		0,07	-0,00	0,10			95.774.495,29	8,49
NTN-B 150850 (5,761000%)		0,07	-0,00	0,11			43.926.044,31	3,89
NTN-B 150850 (5,860000%)		0,07	-0,00	0,10			43.825.487,92	3,88
NTN-B 150850 (6,151000%)		0,07	-0,00	0,11			50.632.445,23	4,49
<b>Sub-total</b>	0,30	0,07	-0,00		-0,20	1,06	579.215.281,40	51,34

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		0,86	0,02	0,03			74.219.378,75	6,58
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		0,87	0,01	0,01			42.306.065,08	3,75
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,00	-0,00	0,00			4.752.552,64	0,42
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,54	0,03	1,55			47.910.203,99	4,25
<b>Sub-total</b>	1,36	0,99	0,07		-0,01	1,12	169.188.200,46	15,00

Artigo 7º III, Alínea a

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			2.186.311,50	0,19
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			64.523.684,98	5,72
BB INSTITUCIONAL FI RF		0,06	0,00	0,06			31.989.200,65	2,84
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,41	0,01	0,43			46.428.756,45	4,11
<b>Sub-total</b>	0,28	0,14	0,01		0,64	1,31	145.127.953,58	12,86

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		0,08	0,00	0,11			5.573.114,89	0,49
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a		0,07	0,00	0,10			10.895.165,93	0,97
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a		0,08	-0,00	0,11			10.887.099,65	0,96
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a		0,08	-0,00	0,11			8.898.986,27	0,79
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		0,07	-0,00	0,11			8.920.418,59	0,79
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a		0,07	-0,00	0,10			15.447.125,60	1,37
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a		0,08	0,00	0,11			3.176.559,49	0,28
<b>Sub-total</b>	0,31	0,07	-0,00		0,04	1,14	63.798.470,42	5,65

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		0,70	-0,00	0,70			35.310,93	0,00
<b>Sub-total</b>	1,23	0,70	-0,00		-0,62	0,36	35.310,93	0,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,26%

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		8,82	0,20	4,18			28.479.331,70	2,52
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		7,32	0,09	4,30			18.378.291,34	1,63

## 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
BRDESCO F I A SELECTION		8,19	0,11	2,40			17.213.502,19	1,53
INDIE FIC FIA		11,37	0,14	5,88			16.744.779,44	1,48
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		8,54	0,02	2,32			2.574.539,11	0,23
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		8,88	0,14	5,50			20.851.358,86	1,85
<b>Sub-total</b>	15,53	8,26	0,69		0,31	5,91	104.241.802,64	9,24

## Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,74%

## 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		7,32	0,01	7,67			3.034.338,50	0,27
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		9,80	0,05	8,31			13.526.397,20	1,20
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		13,53	0,03	13,53			16.401.547,37	1,45
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		6,61	0,01	6,61			20.263.588,88	1,80
<b>Sub-total</b>	12,85	7,74	0,09		0,17	3,25	53.225.871,95	4,72

## Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,12%

## 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		0,19	-0,00	0,19			3.378.530,70	0,30
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		7,26	0,03	6,00			9.505.233,13	0,84
<b>Sub-total</b>	9,38	5,34	0,03		0,01	1,19	12.883.763,83	1,14

## Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA		0,79	0,00	0,83			577.013,54	0,05
<b>Sub-total</b>	4,84	0,79	0,00		-0,42	-1,21	577.013,54	0,05



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS