



LDB
EMPRESAS

SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO
2º TRIMESTRE 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 30.06.2023.

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

84,22%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,600000%)	0,47	0,02	0,44	2,44	81.084.531,33	7,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,825500%)	4,03	0,06	0,46	0,93	50.756.000,08	4,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,47	0,02	0,47	2,50	112.646.939,27	9,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,410000%)	3,10	0,02	0,51	2,63	50.988.106,35	4,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,530000%)	0,47	0,02	0,44	2,42	51.176.351,75	4,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	0,47	0,02	0,45	2,44	96.200.948,25	8,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	0,47	0,03	0,46	2,47	44.126.515,54	3,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	0,47	0,02	0,46	2,50	44.028.985,10	3,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,151000%)	3,05	0,03	0,49	2,56	50.879.102,94	4,41
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,47	0,02	0,46	2,49	581.887.480,61	50,48

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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,39	0,22	1,03	2,57	74.984.990,36	6,50	8.254.253.931,25	0,91
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,40	0,22	1,03	2,49	42.741.293,48	3,71	1.128.559.610,31	3,79
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,91	0,44	2,22	5,91	48.975.770,37	4,25	2.099.537.000,43	2,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,85	0,29	1,37	3,50	166.702.054,21	14,46		

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	Trim.				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,00	2,90	2.040.422,31	0,18	4.278.810.513,26	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,05	0,99	2,77	6.026.296,16	0,52	743.796.291,54	0,81
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	1,13	3,22	65.254.386,19	5,66	8.773.662.957,45	0,74
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,27	0,05	1,12	3,19	37.583.323,00	3,26	2.449.962.875,95	1,53
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,78	0,19	1,69	4,31	47.211.396,78	4,10	752.880.094,54	6,27
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,56	0,09	1,29	3,52	158.115.824,44	13,72		

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	Trim.				
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a. a	1,39	0,41	0,91	3,33	5.623.710,99	0,49		
BRADERCO	BRADERCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADERCO SA 6,23% a.a	0,53	0,06	0,53	2,66	10.953.280,81	0,95		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 6,25% a.a	0,56	0,07	0,54	2,67	10.946.297,42	0,95		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a. a	0,54	0,08	0,55	2,68	8.948.098,53	0,78		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a. a	0,52	0,10	0,59	2,74	8.973.034,74	0,78		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	1,06	0,02	0,50	2,59	15.523.719,25	1,35		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	1,71	0,42	0,96	3,51	3.207.203,53	0,28		
Sub-total Artigo 7º IV			0,67	0,11	0,59	2,76	64.175.345,27	5,57		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	15,93	-0,03	-0,03	0,47	35.300,38	0,00	19.087.385,82	0,18
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			15,93	-0,03	-0,03	0,47	35.300,38	0,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,86

0,09

0,76

2,85

970.916.004,91

84,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

9,83%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,05	0,73	9,39	15,10	31.152.219,56	2,70	1.451.994.845,07	2,15
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,51	-0,09	5,27	7,34	19.346.097,14	1,68	1.502.509.907,38	1,29
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	20,82	0,31	8,01	14,39	18.592.712,10	1,61	468.779.708,09	3,97
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	24,92	1,62	11,40	28,99	18.653.027,34	1,62	421.768.382,80	4,42
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	23,71	0,06	7,80	15,99	2.775.349,04	0,24	178.207.023,06	1,56
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	23,16	1,21	9,41	18,28	22.813.377,86	1,98	883.153.600,15	2,58
Sub-total Artigo 8º I			20,82	0,75	8,72	16,26	113.332.783,04	9,83		
Renda Variável			20,82	0,75	8,72	16,26	113.332.783,04	9,83		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,70%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	17,18	0,35	5,96	0,40	3.215.214,51	0,28	52.037.848,85	6,18
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	25,29	1,26	6,51	8,57	14.406.291,35	1,25	228.145.793,34	6,31
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	33,30	-0,60	0,56	5,61	16.493.871,13	1,43	652.308.818,52	2,53
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,56	-0,43	-0,78	0,12	20.106.474,86	1,74	635.463.967,91	3,16
Sub-total Artigo 9º II			20,74	0,01	1,87	3,93	54.221.851,85	4,70		
Investimentos no Exterior			20,74	0,01	1,87	3,93	54.221.851,85	4,70		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,24%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
SAFRA	SAFRA	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,63	0,03	1,07	2,95	3.414.679,18	0,30	903.104.465,06	0,38
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	19,08	1,31	7,07	10,58	10.177.619,64	0,88	491.326.352,47	2,07
Sub-total Artigo 10º I			17,42	0,99	5,50	8,56	13.592.298,82	1,18		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	10,15	-3,35	-3,35	-4,52	716.792,27	0,06	119.499.190,53	0,60
Sub-total Artigo 10º II			10,15	-3,35	-3,35	-4,52	716.792,27	0,06		

Investimentos Estruturados			17,39	0,76	5,05	7,96	14.309.091,09	1,24		
-----------------------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	-------------	----------------------	-------------	--	--

Total			2,60	0,15	1,60	4,14	1.152.779.730,89	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	581.887.480,61	50,48	30,00	50,00	85,00	52,68	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	166.702.054,21	14,46	5,00	12,50	30,00	1,65	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	158.115.824,44	13,72	5,00	15,00	30,00	15,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	64.175.345,27	5,57	3,00	6,00	10,00	5,76	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	35.300,38	0,00	0,00	0,10	0,20	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	970.916.004,91	84,22					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	113.332.783,04	9,83	3,00	7,00	15,00	4,92	30,00
	Total Renda Variável	113.332.783,04	9,83					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	54.221.851,85	4,70	3,00	6,90	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	54.221.851,85	4,70					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	13.592.298,82	1,18	0,50	2,30	5,00	10,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	716.792,27	0,06	0,10	0,20	2,50	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	14.309.091,09	1,24					15,00
Total		1.152.779.730,89	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,46 43,04	2,49 79,21	2,49 79,21	6,23 95,88	9,47 69,90	2.672.199,21	13.469.431,11
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,37 128,21	3,50 111,22	3,50 111,22	7,64 117,57	10,72 79,15	2.264.901,90	5.795.344,95
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,29 120,14	3,52 111,99	3,52 111,99	6,82 104,88	13,70 101,15	2.017.798,41	5.635.339,77
Artigo 7º IV % do CDI	0,59 55,11	2,76 87,72	2,76 87,72	6,58 101,20	10,21 75,41	376.874,85	1.723.305,18
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,03 -2,79	0,47 14,98	0,47 14,98	-14,12 -217,33	-12,71 -93,83	-10,55	165,53
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	8,72 -0,28	16,26 0,35	16,26 0,35	6,46 -1,15	17,78 -2,06	9.090.980,40	15.849.482,42
Artigo 9º II % do CDI	1,87 174,56	3,93 124,82	3,93 124,82	12,84 197,62	15,18 112,08	995.979,90	2.048.648,08
Artigo 10º I % do CDI	5,50 513,02	8,56 272,22	8,56 272,22	16,36 251,76	30,25 223,37	708.534,99	1.072.156,27
Artigo 10º II % do CDI	-3,35 -312,79	-4,52 -238,55				-26.887,94	-33.964,54
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)						18.100.371,17	45.559.908,77

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (5,600000%)	80.726.416,22	0,00	0,00	0,00	81.084.531,33	358.115,11	1.962.172,84
NTN-B 150545 (5,825500%)	50.523.008,23	0,00	0,00	0,00	50.756.000,08	232.991,85	467.446,10
NTN-B 150545 (5,890000%)	112.123.679,59	0,00	0,00	0,00	112.646.939,27	523.259,68	2.800.918,48
NTN-B 150555 (6,410000%)	50.730.574,05	0,00	0,00	0,00	50.988.106,35	257.532,30	1.329.135,70
NTN-B 150830 (5,530000%)	50.953.130,56	0,00	0,00	0,00	51.176.351,75	223.221,19	1.208.713,12
NTN-B 150840 (5,620000%)	95.774.495,29	0,00	0,00	0,00	96.200.948,25	426.452,96	2.291.623,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150850 (5,761000%)	43.926.044,31	0,00	0,00	0,00	44.126.515,54	200.471,23	1.064.917,90
NTN-B 150850 (5,860000%)	43.825.487,92	0,00	0,00	0,00	44.028.985,10	203.497,18	1.072.404,75
NTN-B 150850 (6,151000%)	50.632.445,23	0,00	0,00	0,00	50.879.102,94	246.657,71	1.272.098,71
					581.887.480,61	2.672.199,21	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	4.752.552,64	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	74.219.378,75	0,00	0,00	0,00	74.984.990,36	765.611,61	1.877.840,04
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	47.910.203,99	0,00	0,00	0,00	48.975.770,37	1.065.566,38	2.733.401,98
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	42.306.065,08	0,00	0,00	0,00	42.741.293,48	435.228,40	1.040.191,74
					166.702.054,21	2.264.901,90	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB INSTITUCIONAL FI RF	31.989.200,65	5.222.292,48	0,00	0,00	37.583.323,00	371.829,87	989.925,49
BB PREV RF FLUXO FIC	2.186.311,50	0,00	-166.666,67	0,00	2.040.422,31	20.777,48	67.695,79
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	64.523.684,98	0,00	0,00	0,00	65.254.386,19	730.701,21	2.517.013,69
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	10.184.343,11	-9.020.944,62	0,00	6.026.296,16	110.345,03	255.760,71
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	46.428.756,45	0,00	0,00	0,00	47.211.396,78	782.640,33	1.948.855,28
					158.115.824,44	2.017.798,41	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	10.895.165,93	0,00	0,00	0,00	10.953.280,81	58.114,88	284.031,76
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	8.898.986,27	0,00	0,00	0,00	8.948.098,53	49.112,26	233.150,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	5.573.114,89	0,00	0,00	0,00	5.623.710,99	50.596,10	181.463,34
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	10.887.099,65	0,00	0,00	0,00	10.946.297,42	59.197,77	284.513,73
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	15.447.125,60	0,00	0,00	0,00	15.523.719,25	76.593,65	391.928,99
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	8.920.418,59	0,00	0,00	0,00	8.973.034,74	52.616,15	239.425,51
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	3.176.559,49	0,00	0,00	0,00	3.207.203,53	30.644,04	108.790,95
					64.175.345,27	376.874,85	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIDC ITALIA SENIOR	35.310,93	0,00	0,00	0,00	35.300,38	-10,55	165,53
					35.300,38	-10,55	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO F I A SELECTION	17.213.502,19	0,00	0,00	0,00	18.592.712,10	1.379.209,91	2.339.348,93
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	28.479.331,70	0,00	0,00	0,00	31.152.219,56	2.672.887,86	4.086.101,40
INDIE FIC FIA	16.744.779,44	0,00	0,00	0,00	18.653.027,34	1.908.247,90	4.192.289,45
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18.378.291,34	0,00	0,00	0,00	19.346.097,14	967.805,80	1.322.733,41
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.574.539,11	0,00	0,00	0,00	2.775.349,04	200.809,93	382.563,22
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	20.851.358,86	0,00	0,00	0,00	22.813.377,86	1.962.019,00	3.526.446,01
					113.332.783,04	9.090.980,40	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	3.034.338,50	0,00	0,00	0,00	3.215.214,51	180.876,01	12.682,38
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	13.526.397,20	0,00	0,00	0,00	14.406.291,35	879.894,15	1.136.780,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16.401.547,37	0,00	0,00	0,00	16.493.871,13	92.323,76	875.641,58
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20.263.588,88	0,00	0,00	0,00	20.106.474,86	-157.114,02	23.544,03
					54.221.851,85	995.979,90	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9.505.233,13	0,00	0,00	0,00	10.177.619,64	672.386,51	974.172,21
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	3.378.530,70	0,00	0,00	0,00	3.414.679,18	36.148,48	97.984,06
					13.592.298,82	708.534,99	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	577.013,54	166.666,67	0,00	0,00	716.792,27	-26.887,94	-33.964,54
					716.792,27	-26.887,94	

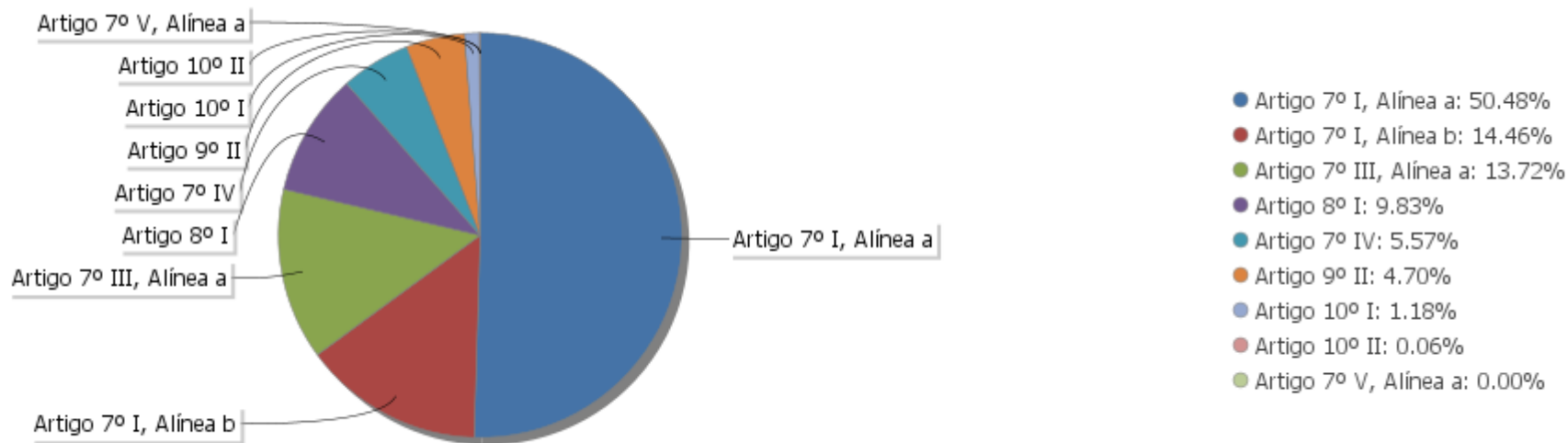
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

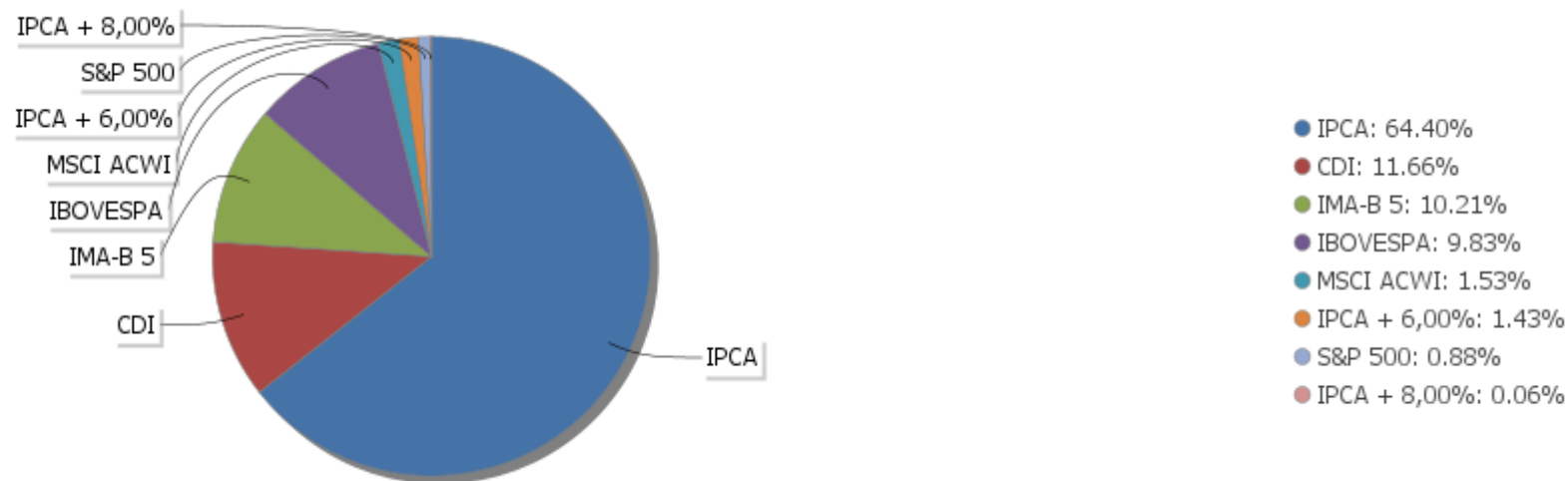
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	411.260.041,80	35,68	411.260.041,80	35,68	
de 31 a 365 dias	94.740.070,94	8,22	506.000.112,74	43,89	
de 1 a 5 anos	64.175.345,27	5,57	570.175.458,01	49,46	
de 5 a 10 anos	51.893.144,02	4,50	622.068.602,03	53,96	
de 10 a 20 anos	177.285.479,58	15,38	799.354.081,61	69,34	
acima de 20 anos	353.425.649,28	30,66	1.152.779.730,89	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

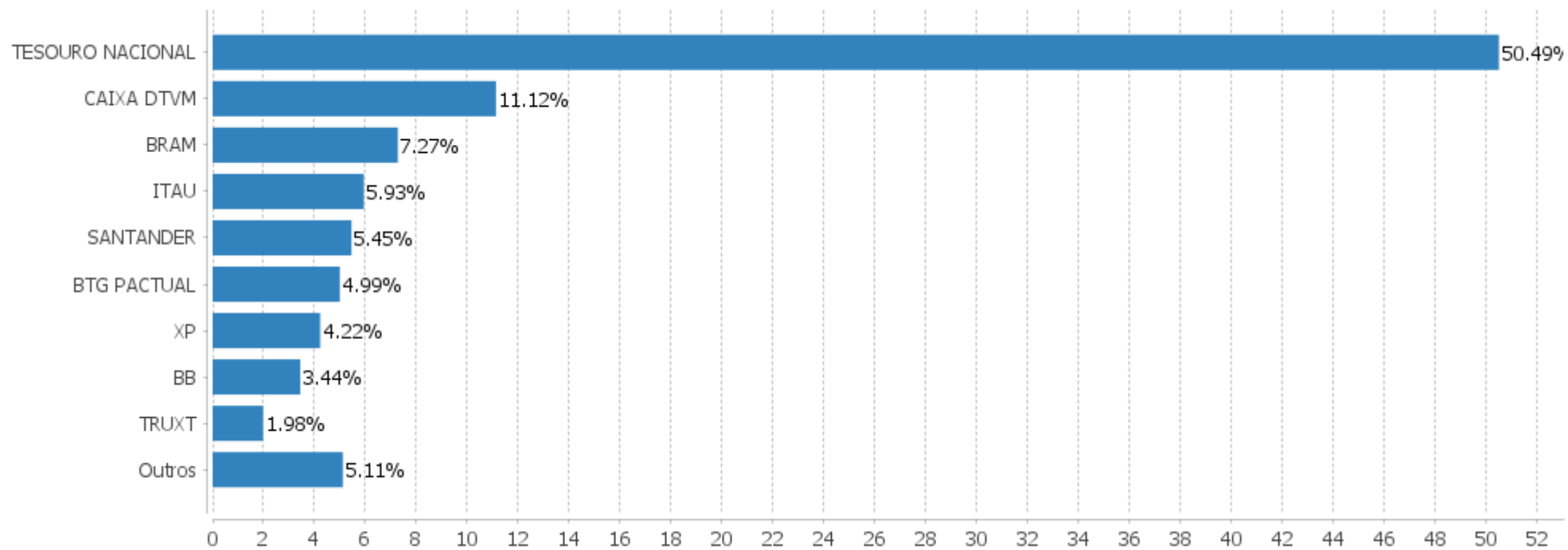


Alocação Por Estratégia



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	1,60							6,95
INPC + 5,10%	0,90	1,13	1,10	0,89	0,80	0,31							5,23
p.p. indexador	0,82	-1,12	-0,15	-0,03	0,84	1,28							1,71
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

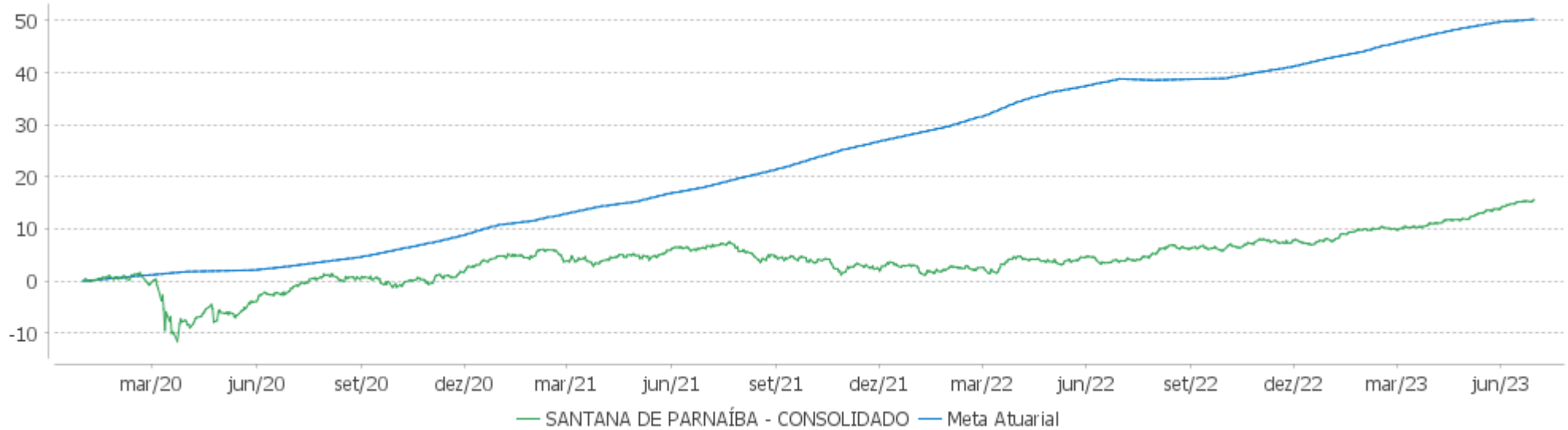
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	13	30,95	03 meses	4,14	2,01	2,13	1,73
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	69,05	06 meses	6,95	5,23	1,71	2,01
			12 meses	11,52	8,15	3,37	2,60
			24 meses	8,75	27,32	-18,57	3,62
			36 meses	17,86	46,89	-29,03	3,99
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12	Desde 31/12/2019	15,62	51,58	-35,96	6,58
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

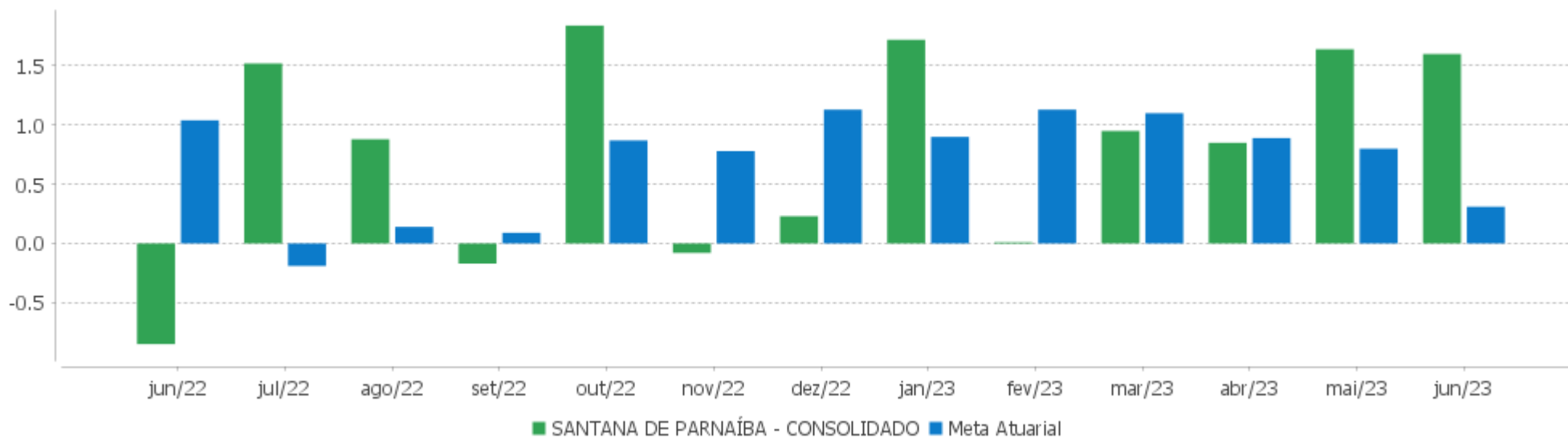


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	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.	0,91 0,99	3,33 2,57	3,33 2,57	6,94 4,07	10,78 7,62		
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA p.p.	0,53 0,61	2,66 1,90	2,66 1,90	6,48 3,61	9,99 6,83		
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA p.p.	0,54 0,62	2,67 1,91	2,67 1,91	6,50 3,63	10,04 6,88		
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	0,55 0,63	2,68 1,91	2,68 1,91	6,49 3,61	10,01 6,85		
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a Var. IPCA p.p.	0,96 1,04	3,51 2,75	3,51 2,75	7,26 4,39			
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	0,59 0,67	2,74 1,98	2,74 1,98	6,61 3,74	10,23 7,07		
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	0,50 0,58	2,59 1,83	2,59 1,83	6,46 3,59	10,12 6,96		
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	2,47 1,71	2,47 1,71	6,21 3,34	9,48 6,32	22,36 6,94	32,36 7,30
NTN-B 150545 (5,825500%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	-0,35 -1,11	-0,35 -1,11	3,30 0,43	3,52 0,36		
NTN-B 150840 (5,620000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	2,44 1,68	2,44 1,68	6,14 3,27	9,32 6,16	25,54 10,11	35,69 10,63
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,52	2,44 1,67	2,44 1,67	6,13 3,26	9,30 6,14	25,47 10,04	35,54 10,48
NTN-B 150555 (6,410000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,59	2,63 1,86	2,63 1,86	6,53 3,66	6,81 3,65		
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	2,50 1,74	2,50 1,74	6,26 3,39	9,57 6,41	22,48 7,06	32,51 7,46
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	2,50 1,74	2,50 1,74	6,27 3,40	9,60 6,44	26,08 10,65	36,40 11,34
NTN-B 150830 (5,530000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,52	2,42 1,66	2,42 1,66	6,10 3,23	9,23 6,07	25,29 9,86	35,23 10,17
NTN-B 150850 (6,151000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,57	2,56 1,80	2,56 1,80	6,42 3,55	6,68 3,52		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,03	2,57	2,57	7,00	10,18	21,01	28,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	0,02	0,02	-0,04	-0,05	-0,30	-0,68
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,03	2,49	2,49	6,92	10,00	20,80	27,85
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,05	-0,05	-0,12	-0,23	-0,51	-0,83
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,22	5,91	5,91	10,28	12,95	23,06	25,02
Var. IPCA p.p.	2,30	5,15	5,15	7,41	9,79	7,64	-0,04
FIDC ITALIA SENIOR	-0,03	0,47	0,47	-14,12	-12,71	20,48	1.387,34
% do CDI	-2,79	14,98	14,98	-217,33	-93,83	87,64	5.301,50
BB INSTITUCIONAL FI RF	1,12	3,19	3,19	5,95	13,13	23,41	26,65
% do CDI	104,43	101,54	101,54	91,50	96,95	100,16	101,85
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,13	3,22	3,22	6,53	13,87	24,53	27,55
% do CDI	105,64	102,48	102,48	100,53	102,45	104,96	105,26
BB PREV RF FLUXO FIC	1,00	2,90	2,90	5,98	12,44	20,85	22,25
% do CDI	93,03	92,23	92,23	92,01	91,84	89,21	85,01
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,69	4,31	4,31	7,76	13,75	19,35	22,08
Var. IPCA p.p.	1,77	3,54	3,54	4,89	10,58	3,93	-2,98
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,99	2,77	2,77	5,64	11,68	19,63	21,32
% do CDI	92,18	88,15	88,15	86,75	86,27	84,00	81,48
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	9,39	15,10	15,10	6,66	17,15	-33,62	-18,39
Var. IBOVESPA p.p.	0,38	-0,81	-0,81	-0,96	-2,69	-26,74	-42,61
BRADESCO F I A SELECTION	8,01	14,39	14,39	5,57	19,10	-11,84	18,98
Var. IBOVESPA p.p.	-0,99	-1,51	-1,51	-2,04	-0,74	-4,97	-5,25
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	7,80	15,99	15,99	9,45	17,61	-30,88	-5,85
Var. IBOVESPA p.p.	-1,20	0,08	0,08	1,84	-2,23	-24,01	-30,08
INDIE FIC FIA	11,40	28,99	28,99	17,61	26,49	-30,93	-9,44
Var. IBOVESPA p.p.	2,39	13,09	13,09	10,00	6,66	-24,06	-33,67
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	9,41	18,28	18,28	5,70	14,93	-17,85	17,25
Var. IBOVESPA p.p.	0,41	2,38	2,38	-1,91	-4,91	-10,98	-6,98
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5,27	7,34	7,34	-1,57	13,35	-15,61	15,87
Var. IBOVESPA p.p.	-3,74	-8,57	-8,57	-9,18	-6,48	-8,73	-8,36
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	6,51	8,57	8,57	24,04	18,53	-18,54	14,00
Var. MSCI ACWI p.p.	6,60	8,42	8,42	19,86	13,26	-9,91	-0,48
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	5,96	0,40	0,40	7,77	4,66	-20,61	
Var. MSCI ACWI p.p.	6,06	0,25	0,25	3,59	-0,61	-11,98	
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-0,78	0,12	0,12	1,02	7,24	-13,40	11,83
% do CDI	-72,33	3,73	3,73	15,72	53,46	-57,33	45,20
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,56	5,61	5,61	21,72	25,89	-30,09	-9,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,16	3,41	3,41	15,86	16,57	-59,75	-58,87
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do CDI	1,07 99,81	2,95 93,91	2,95 93,91	5,83 89,74	12,72 93,93	22,63 96,82	25,61 97,85
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	7,07 6,38	10,58 7,85	10,58 7,85	20,38 13,32	34,24 26,07	27,00 27,23	78,76 52,43
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA + 8,00% p.p.	-3,35 -3,92	-4,52 -5,83					
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO Var. INPC + 5,10% p.p.	1,60 1,28	4,14 2,13	4,14 2,13	6,95 1,71	11,52 3,29	8,75 -18,56	17,86 -28,25
CDI	1,07	3,15	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	15,91	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	2,22	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	2,19	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,19	3,22	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	6,89	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	5,52	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	2,55	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	10,90	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	7,10	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	4,83	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	1,99	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	19,68	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	3,15	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	15,91	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	14,96	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	13,79	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	25,16	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	24,04	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	13,95	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	0,69	2,73	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	14,28	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	0,15	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	0,76	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	0,79	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,65	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	3,15	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	1,72	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	1,96	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	2,08	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	2,17	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	2,19	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	1,75	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	2,22	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

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%)	81.084.531,33	5,600000	83.601.913,40	5,229500	2.517.382,07
NTN-B 150545 (5,825500%)	50.756.000,08	5,825500	53.002.649,46	5,459700	2.246.649,38
NTN-B 150545 (5,890000%)	112.646.939,27	5,890000	118.585.210,35	5,459700	5.938.271,08
NTN-B 150555 (6,410000%)	50.988.106,35	6,410000	58.204.417,33	5,452600	7.216.310,98
NTN-B 150830 (5,530000%)	51.176.351,75	5,530000	52.308.895,03	5,132700	1.132.543,28
NTN-B 150840 (5,620000%)	96.200.948,25	5,620000	98.702.963,70	5,371900	2.502.015,45
NTN-B 150850 (5,761000%)	44.126.515,54	5,761000	45.902.732,02	5,459000	1.776.216,48
NTN-B 150850 (5,860000%)	44.028.985,10	5,860000	46.396.992,40	5,459000	2.368.007,30
NTN-B 150850 (6,151000%)	50.879.102,94	6,151000	55.633.766,59	5,459000	4.754.663,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
998	04/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	379,99	171,87249500	2,2108830000
1008	04/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	570,04	257,83363000	2,2108830000
999	05/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.724,23	2.587,98640700	2,2118470000
1009	05/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	57.137,37	25.832,42457300	2,2118470000
1000	06/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	244,46	110,47490400	2,2128100000
1001	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	33.742,83	15.242,20591100	2,2137760000
1010	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	8.129.469,74	0,00	3.672.218,75203200	2,2137760000
1002	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	588.320,03	0,00	265.638,17817100	2,2147420000
1011	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	578.555,42	261.229,26531800	2,2147420000
994	12/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	647.617,81	0,00	292.286,13737000	2,2156980000
1003	13/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	31,40	14,16549200	2,2166530000
995	14/04/2023	BB INSTITUCIONAL FI RF	5.765.613,58	0,00	518.133,02481700	11,1276705090
1004	14/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	12.346,91	5.567,63260000	2,2176230000
1012	14/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.807.674,36	2.618.873,61423800	2,2176230000
1005	20/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	44.821,40	20.175,94184800	2,2215270000
1006	25/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	70.321,77	31.627,00922400	2,2234720000
1013	25/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.688.844,26	759.552,74565800	2,2234720000
996	26/04/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	9.462,85	0,00	3.754,58260700	2,5203467310
1014	26/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	197.228,95	0,00	88.664,34099200	2,2244450000
997	27/04/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.462,85	3.752,86384100	2,5215010190
1015	27/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	194.912,19	87.584,49096000	2,2254190000
1007	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.107,00	2.742,99573800	2,2263970000
1016	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.406,07	0,00	631,54504700	2,2263970000
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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
1064	01/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.504,49	668,94584300	2,2490460000
1055	05/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	790,90	351,33121800	2,2511520000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1065	05/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	8.873.262,00	0,00	3.941.653,87321600	2,2511520000
1056	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	69.466,83	30.829,50555800	2,2532580000
1066	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	94.988,39	42.156,02040600	2,2532580000
1054	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	647.617,81	0,00	287.413,96236000	2,2532580000
1057	13/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	586.314,92	0,00	259.842,64475200	2,2564230000
1067	13/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	629.031,44	278.773,72488000	2,2564230000
1053	13/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	166.666,67	65.138,39244300	2,5586549460
1058	19/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	15.048,74	6.656,80502800	2,2606550000
1051	19/06/2023	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	166.666,67	0,00	166.666,67000000	1,0000000000
1059	21/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	800,00	353,54800600	2,2627760000
1060	22/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.040,67	459,69320800	2,2638360000
1068	22/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	20.016,51	8.841,85508800	2,2638360000
1050	23/06/2023	BB INSTITUCIONAL FI RF	5.222.292,48	0,00	457.965,69496200	11,4032394510
1069	23/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.212.231,40	2.301.307,51863500	2,2649000000
1061	26/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.254,00	994,72284300	2,2659580000
1070	27/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	9.307,18	0,00	4.105,46885300	2,2670200000
1062	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	127.276,63	56.116,34041900	2,2680850000
1071	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.841.053,62	1.252.622,19921700	2,2680850000
1063	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.000,00	1.762,77847700	2,2691450000
1072	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	67.841,20	0,00	29.897,25204800	2,2691450000
1073	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.441,00	634,74386300	2,2702070000
Total			135.194.351,75	107.866.670,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 10.792.966,02

Value-At-Risk: 0,94%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO		0,94	0,94			1.152.779.730,89	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,22%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,600000%)		0,13	-0,00	0,12			81.084.531,33	7,03
NTN-B 150545 (5,825500%)		0,23	-0,00	0,24			50.756.000,08	4,40
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,13	-0,00	0,12			112.646.939,27	9,77
NTN-B 150555 (6,410000%)		0,13	-0,00	0,12			50.988.106,35	4,42
NTN-B 150830 (5,530000%)		0,13	-0,00	0,12			51.176.351,75	4,44
NTN-B 150840 (5,620000%)		0,13	-0,00	0,12			96.200.948,25	8,35
NTN-B 150850 (5,761000%)		0,11	-0,00	0,11			44.126.515,54	3,83
NTN-B 150850 (5,860000%)		0,13	-0,00	0,12			44.028.985,10	3,82
NTN-B 150850 (6,151000%)		0,11	-0,00	0,11			50.879.102,94	4,41
Sub-total	0,36	0,12	-0,01		-1,68	0,46	581.887.480,61	50,48

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		0,91	0,02	0,03			74.984.990,36	6,50
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		0,91	0,01	0,01			42.741.293,48	3,71
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,45	0,03	1,47			48.975.770,37	4,25
Sub-total	2,07	1,03	0,06		0,15	1,37	166.702.054,21	14,46

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			2.040.422,31	0,18
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	0,00	0,01			6.026.296,16	0,52
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			65.254.386,19	5,66
BB INSTITUCIONAL FI RF		0,04	0,00	0,04			37.583.323,00	3,26
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,44	0,01	0,48			47.211.396,78	4,10
Sub-total	0,35	0,13	0,01		0,62	1,29	158.115.824,44	13,72

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		0,16	0,00	0,19			5.623.710,99	0,49
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a		0,14	-0,00	0,13			10.953.280,81	0,95
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a		0,14	-0,00	0,14			10.946.297,42	0,95
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a		0,14	-0,00	0,14			8.948.098,53	0,78
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		0,12	-0,00	0,12			8.973.034,74	0,78
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a		0,13	-0,00	0,12			15.523.719,25	1,35
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a		0,16	0,00	0,19			3.207.203,53	0,28
Sub-total	0,47	0,12	-0,00		-1,02	0,59	64.175.345,27	5,57

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		0,03	-0,00	0,03			35.300,38	0,00
Sub-total	0,10	0,03	-0,00		-10,64	-0,03	35.300,38	0,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,31%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,98	0,22	3,84			31.152.219,56	2,70
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,98	0,09	4,12			19.346.097,14	1,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRANCO F I A SELECTION		8,11	0,12	2,50			18.592.712,10	1,61
INDIE FIC FIA		11,50	0,16	6,20			18.653.027,34	1,62
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		8,55	0,02	2,25			2.775.349,04	0,24
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		8,85	0,15	5,48			22.813.377,86	1,98
Sub-total	15,69	8,31	0,75		0,49	8,72	113.332.783,04	9,83

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,88%

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		7,48	0,01	7,94			3.215.214,51	0,28
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		9,04	0,05	7,67			14.406.291,35	1,25
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		11,84	0,02	11,85			16.493.871,13	1,43
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		6,59	0,01	6,59			20.106.474,86	1,74
Sub-total	10,10	6,88	0,09		0,08	1,87	54.221.851,85	4,70

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,85%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO		0,15	0,00	0,15			3.414.679,18	0,30
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		6,85	0,03	5,44			10.177.619,64	0,88
Sub-total	7,90	5,12	0,03		0,56	5,50	13.592.298,82	1,18

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA		5,03	-0,00	5,02			716.792,27	0,06
Sub-total	13,31	5,03	-0,00		-0,33	-3,35	716.792,27	0,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS