



LDB
EMPRESAS

SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO
JULHO 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 31.07.2023.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

83,98%

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%)	0,45	0,03	0,46	6,62	81.456.140,04	6,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,825500%)	4,03	0,07	0,48	1,41	50.997.499,49	4,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,45	0,03	0,48	6,79	113.188.990,98	9,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,410000%)	3,09	0,03	0,52	3,77	51.254.383,61	4,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,530000%)	0,45	0,03	0,45	6,58	51.408.032,93	4,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	0,45	0,03	0,46	6,63	96.643.276,46	8,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	0,45	0,04	0,47	6,71	44.334.316,68	3,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	0,45	0,03	0,48	6,77	44.239.808,19	3,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,151000%)	3,05	0,04	0,50	6,24	51.134.368,87	4,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,45	0,03	0,48	6,74	584.656.817,25	49,86

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				
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,02	0,05	0,55	0,55	6.878.925,84	0,59	39.259.981.227,70	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,32	0,12	0,95	8,02	75.698.542,99	6,46	8.226.261.315,96	0,92
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,32	0,12	0,95	7,94	43.148.910,75	3,68	1.108.295.759,82	3,89
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,96	0,17	0,90	11,27	49.415.615,88	4,21	2.143.764.034,65	2,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,90	0,13	0,92	8,72	175.141.995,46	14,94		

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	0,98	7,02	2.060.689,58	0,18	3.542.574.797,77	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	-0,02	1,07	6,68	6.520.735,00	0,56	721.224.783,88	0,90
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	1,18	7,79	66.026.523,54	5,63	8.447.360.930,23	0,78
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,27	0,05	1,08	7,09	37.987.696,64	3,24	2.342.321.851,53	1,62
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,61	0,10	1,00	8,84	47.681.325,40	4,07	759.378.428,92	6,28
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,46	0,07	1,09	7,94	160.276.970,16	13,67		

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	1,32	0,08	0,58	7,56	5.656.146,48	0,48		
BRADESCO	BRADESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	0,50	0,02	0,50	7,02	11.008.051,38	0,94		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	0,53	0,01	0,50	7,03	11.000.625,50	0,94		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	0,51	0,01	0,49	7,00	8.991.686,06	0,77		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	0,49	0,00	0,50	7,14	9.017.574,81	0,77		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	0,86	0,03	0,51	7,00	15.602.950,76	1,33		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	1,57	0,09	0,64	7,95	3.227.687,18	0,28		
Sub-total Artigo 7º IV			0,60	0,03	0,51	7,12	64.504.722,17	5,50		

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	15,96	0,96	0,96	-13,30	35.640,06	0,00	19.335.486,65	0,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	15,96	0,96	0,96	-13,30	35.640,06	0,00		
		Renda Fixa	0,83	0,05	0,66	7,31	984.616.145,10	83,98		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

9,97%

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	20,87	0,47	3,06	9,92	32.106.812,04	2,74	1.488.977.770,22	2,16
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,43	1,45	2,61	1,00	19.851.545,36	1,69	1.516.010.022,90	1,31
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	20,64	0,84	2,64	8,36	19.083.238,09	1,63	483.820.683,81	3,94
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	24,85	0,99	3,75	22,02	19.352.270,50	1,65	435.215.102,93	4,45
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	23,24	1,46	4,05	13,88	2.887.720,08	0,25	184.070.374,20	1,57
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	23,24	0,57	3,59	9,50	23.632.459,66	2,02	902.717.323,27	2,62
Sub-total Artigo 8º I			20,76	0,83	3,16	9,83	116.914.045,73	9,97		
Renda Variável			20,76	0,83	3,16	9,83	116.914.045,73	9,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,80%

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	17,04	0,59	6,32	14,58	3.418.298,62	0,29	53.875.559,61	6,34
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	24,55	0,87	6,12	31,63	15.287.954,94	1,30	239.265.030,75	6,39
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,45	1,75	3,57	26,07	17.082.775,21	1,46	662.986.244,95	2,58
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,92	0,15	1,78	2,82	20.463.646,36	1,75	632.349.627,55	3,24
Sub-total Artigo 9º II			19,88	0,86	3,75	17,07	56.252.675,13	4,80		
Investimentos no Exterior			19,88	0,86	3,75	17,07	56.252.675,13	4,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,25%

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	0,53	0,08	1,00	6,89	3.448.821,86	0,29	870.304.577,19	0,40
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	18,38	0,11	3,68	24,80	10.551.701,90	0,90	531.369.874,48	1,99
Sub-total Artigo 10º I			16,59	0,10	3,00	19,86	14.000.523,76	1,19		

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	8,71	-1,51	-1,51	-5,97	705.961,93	0,06	75.842.901,38	0,93
Sub-total Artigo 10º II			8,71	-1,51	-1,51	-5,97	705.961,93	0,06		

Investimentos Estruturados			16,55	0,02	2,78	18,93	14.706.485,69	1,25		
-----------------------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

Total			2,53	0,17	1,08	8,10	1.172.489.351,65	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	584.656.817,25	49,86	30,00	50,00	85,00	52,68	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	175.141.995,46	14,94	5,00	12,50	30,00	1,65	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	160.276.970,16	13,67	5,00	15,00	30,00	15,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	64.504.722,17	5,50	3,00	6,00	10,00	5,76	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	35.640,06	0,00	0,00	0,10	0,20	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	984.616.145,10	83,98					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	116.914.045,73	9,97	3,00	7,00	15,00	4,92	30,00
	Total Renda Variável	116.914.045,73	9,97					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	56.252.675,13	4,80	3,00	6,90	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	56.252.675,13	4,80					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	14.000.523,76	1,19	0,50	2,30	5,00	10,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	705.961,93	0,06	0,10	0,20	2,50	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	14.706.485,69	1,25					15,00
Total		1.172.489.351,65	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	0,48 44,40	6,74 88,17	2,01 60,96	5,49 85,25	9,47 69,74	2.769.336,64	33.028.346,12
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,92 86,07	8,72 114,13	3,45 104,35	7,70 119,45	11,48 84,49	1.598.941,25	15.146.414,21
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,09 102,00	7,94 103,92	3,71 112,32	6,81 105,75	13,84 101,91	1.757.687,76	12.950.275,11
Artigo 7º IV % do CDI	0,51 47,88	7,12 93,23	2,26 68,30	5,86 90,92	9,83 72,34	329.376,90	4.289.332,36
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,96 89,76	-13,30 -174,04	1,30 39,35	1,60 24,78	-11,77 -86,66	339,68	-5.465,89
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,16 -0,11	9,83 -1,30	18,78 2,02	5,69 -1,81	14,23 -3,98	3.581.262,69	10.462.254,60
Artigo 9º II % do CDI	3,75 349,39	17,07 223,41	9,13 276,31	8,99 139,42	10,12 74,48	2.030.823,28	8.201.776,49
Artigo 10º I % do CDI	3,00 280,17	19,86 259,88	9,96 301,69	14,28 221,57	21,73 160,00	408.224,94	2.319.345,82
Artigo 10º II % do CDI	-1,51 -140,95	-5,97 -199,64				-10.830,34	-44.794,88
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)						12.465.162,80	86.347.483,94

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%)	81.084.531,33	0,00	0,00	0,00	81.456.140,04	371.608,71	5.168.513,10
NTN-B 150545 (5,825500%)	50.756.000,08	0,00	0,00	0,00	50.997.499,49	241.499,41	708.945,51
NTN-B 150545 (5,890000%)	112.646.939,27	0,00	0,00	0,00	113.188.990,98	542.051,71	7.355.366,44
NTN-B 150555 (6,410000%)	50.988.106,35	0,00	0,00	0,00	51.254.383,61	266.277,26	1.898.077,16
NTN-B 150830 (5,530000%)	51.176.351,75	0,00	0,00	0,00	51.408.032,93	231.681,18	3.195.009,66
NTN-B 150840 (5,620000%)	96.200.948,25	0,00	0,00	0,00	96.643.276,46	442.328,21	6.050.547,75
NTN-B 150850 (5,761000%)	44.126.515,54	0,00	0,00	0,00	44.334.316,68	207.801,14	2.807.653,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (5,860000%)	44.028.985,10	0,00	0,00	0,00	44.239.808,19	210.823,09	2.824.624,47
NTN-B 150850 (6,151000%)	50.879.102,94	0,00	0,00	0,00	51.134.368,87	255.265,93	3.019.608,65
					584.656.817,25	2.769.336,64	

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 IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	74.984.990,36	0,00	0,00	0,00	75.698.542,99	713.552,63	5.808.133,68
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	48.975.770,37	0,00	0,00	0,00	49.415.615,88	439.845,51	5.609.325,12
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	6.841.000,00	0,00	0,00	6.878.925,84	37.925,84	37.925,84
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	42.741.293,48	0,00	0,00	0,00	43.148.910,75	407.617,27	3.173.230,05
					175.141.995,46	1.598.941,25	

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	37.583.323,00	0,00	0,00	0,00	37.987.696,64	404.373,64	1.899.490,32
BB PREV RF FLUXO FIC	2.040.422,31	207.134,34	-207.134,34	0,00	2.060.689,58	20.267,27	243.281,95
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	65.254.386,19	0,00	0,00	0,00	66.026.523,54	772.137,35	6.396.515,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	6.026.296,16	10.060.388,10	-9.656.930,14	0,00	6.520.735,00	90.980,88	539.931,10
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	47.211.396,78	0,00	0,00	0,00	47.681.325,40	469.928,62	3.871.056,74
					160.276.970,16	1.757.687,76	

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	10.953.280,81	0,00	0,00	0,00	11.008.051,38	54.770,57	721.823,98
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	8.948.098,53	0,00	0,00	0,00	8.991.686,06	43.587,53	588.554,92
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	5.623.710,99	0,00	0,00	0,00	5.656.146,48	32.435,49	397.464,41
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	10.946.297,42	0,00	0,00	0,00	11.000.625,50	54.328,08	722.407,88
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	15.523.719,25	0,00	0,00	0,00	15.602.950,76	79.231,51	1.020.733,38
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	8.973.034,74	0,00	0,00	0,00	9.017.574,81	44.540,07	600.738,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	3.207.203,53	0,00	0,00	0,00	3.227.687,18	20.483,65	237.609,14
					64.504.722,17	329.376,90	

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	35.300,38	0,00	0,00	0,00	35.640,06	339,68	-5.465,89
					35.640,06	339,68	

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	18.592.712,10	0,00	0,00	0,00	19.083.238,09	490.525,99	1.471.761,52
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	31.152.219,56	0,00	0,00	0,00	32.106.812,04	954.592,48	2.898.525,92
INDIE FIC FIA	18.653.027,34	0,00	0,00	0,00	19.352.270,50	699.243,16	3.492.739,21
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19.346.097,14	0,00	0,00	0,00	19.851.545,36	505.448,22	197.373,80
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.775.349,04	0,00	0,00	0,00	2.887.720,08	112.371,04	351.993,74
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22.813.377,86	0,00	0,00	0,00	23.632.459,66	819.081,80	2.049.860,41
					116.914.045,73	3.581.262,69	

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	3.215.214,51	0,00	0,00	0,00	3.418.298,62	203.084,11	434.890,14
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	14.406.291,35	0,00	0,00	0,00	15.287.954,94	881.663,59	3.673.953,22
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16.493.871,13	0,00	0,00	0,00	17.082.775,21	588.904,08	3.532.477,65
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20.106.474,86	0,00	0,00	0,00	20.463.646,36	357.171,50	560.455,48
					56.252.675,13	2.030.823,28	

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	10.177.619,64	0,00	0,00	0,00	10.551.701,90	374.082,26	2.097.038,06
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	3.414.679,18	0,00	0,00	0,00	3.448.821,86	34.142,68	222.307,76
					14.000.523,76	408.224,94	

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	716.792,27	0,00	0,00	0,00	705.961,93	-10.830,34	-44.794,88
					705.961,93	-10.830,34	

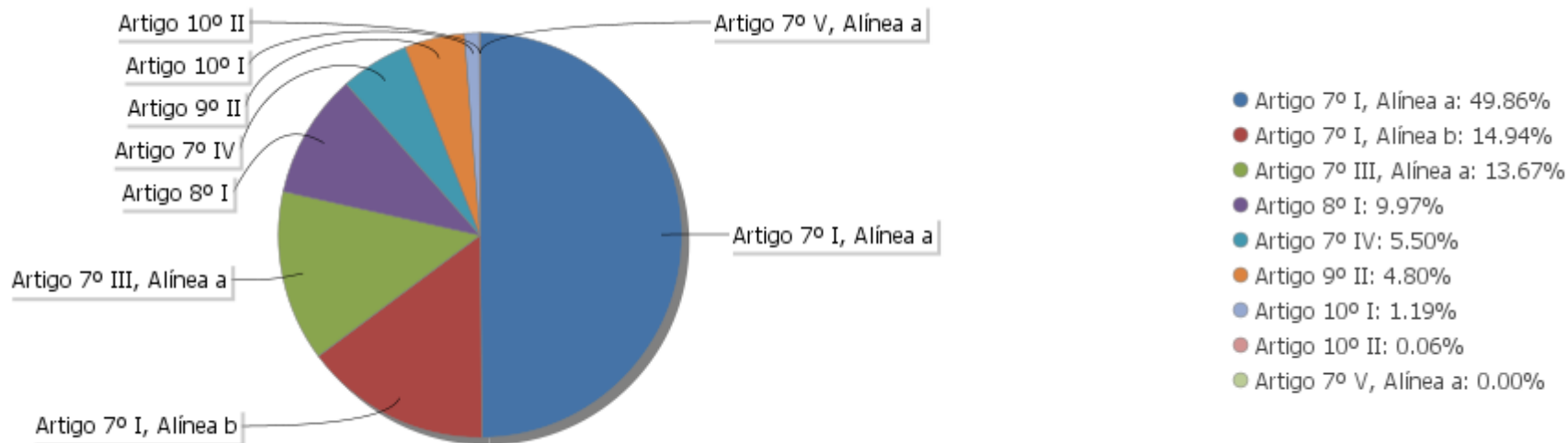
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

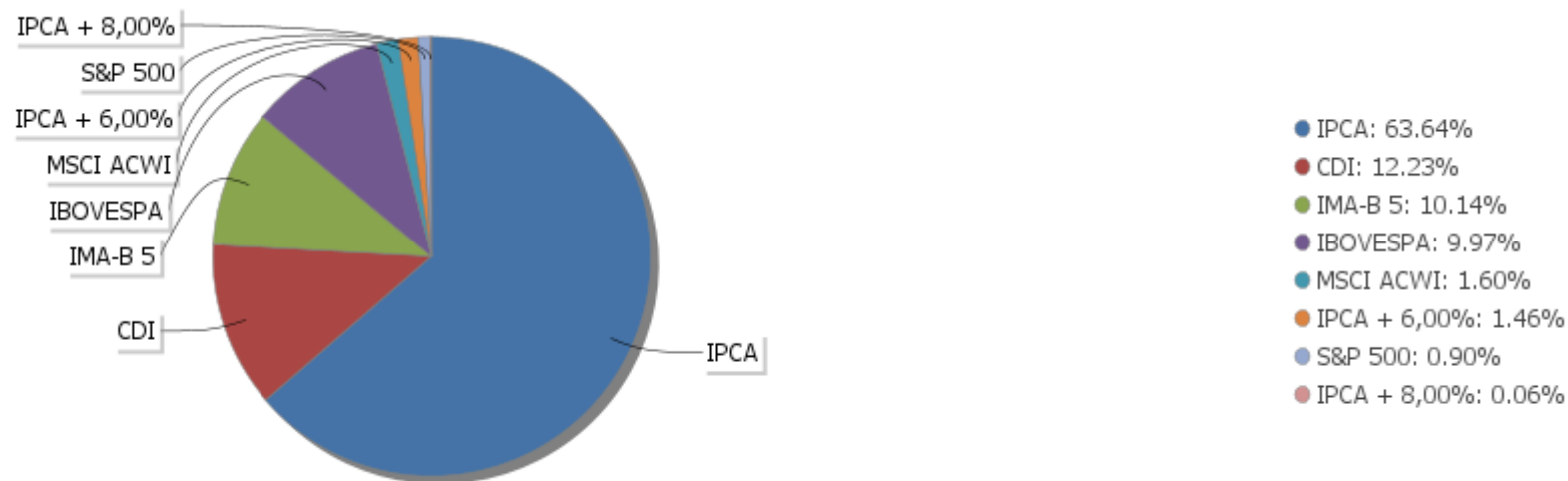
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	424.791.042,66	36,23	424.791.042,66	36,23	
de 31 a 365 dias	97.830.807,64	8,34	522.621.850,30	44,57	
de 1 a 5 anos	64.504.722,17	5,50	587.126.572,47	50,08	
de 5 a 10 anos	52.113.994,86	4,44	639.240.567,33	54,52	
de 10 a 20 anos	178.099.416,50	15,19	817.339.983,83	69,71	
acima de 20 anos	355.149.367,82	30,29	1.172.489.351,65	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

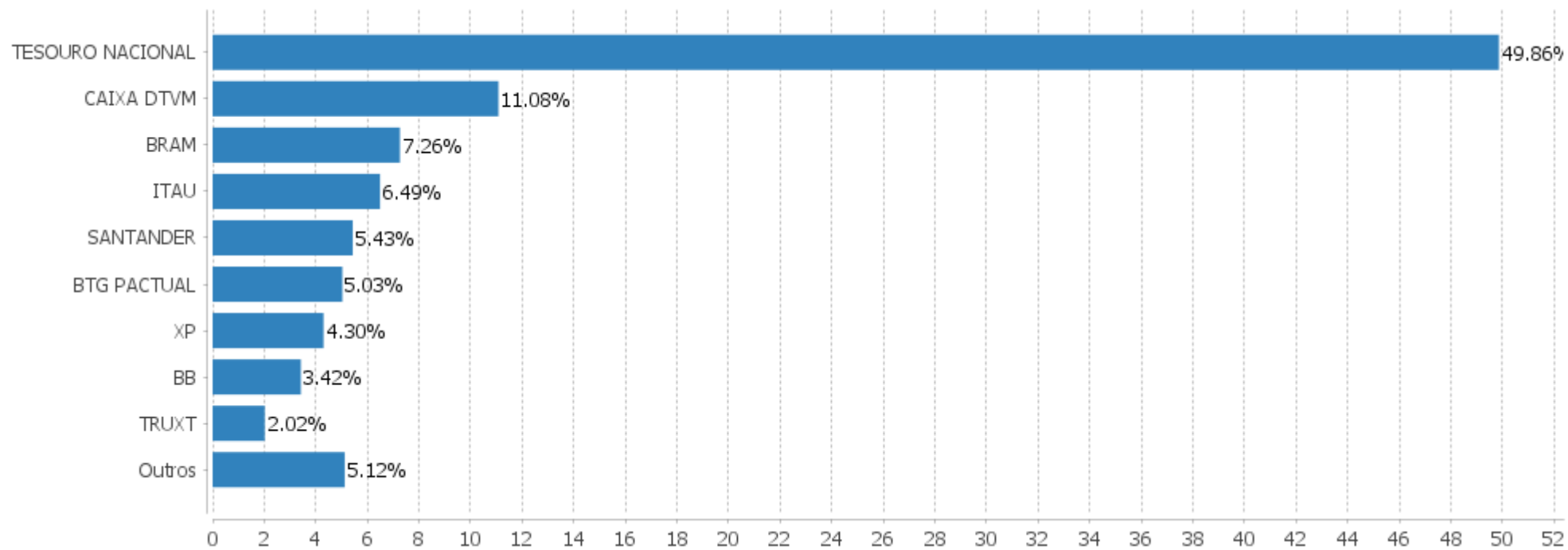


Alocação Por Estratégia



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	1,08						8,10
INPC + 5,10%	0,90	1,13	1,10	0,89	0,80	0,31	0,33						5,57
p.p. indexador	0,82	-1,12	-0,15	-0,03	0,84	1,28	0,75						2,52
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	1,73	1,93	1,43	2,10	-1,60	-2,44	-1,25	0,88	1,15	-6,81

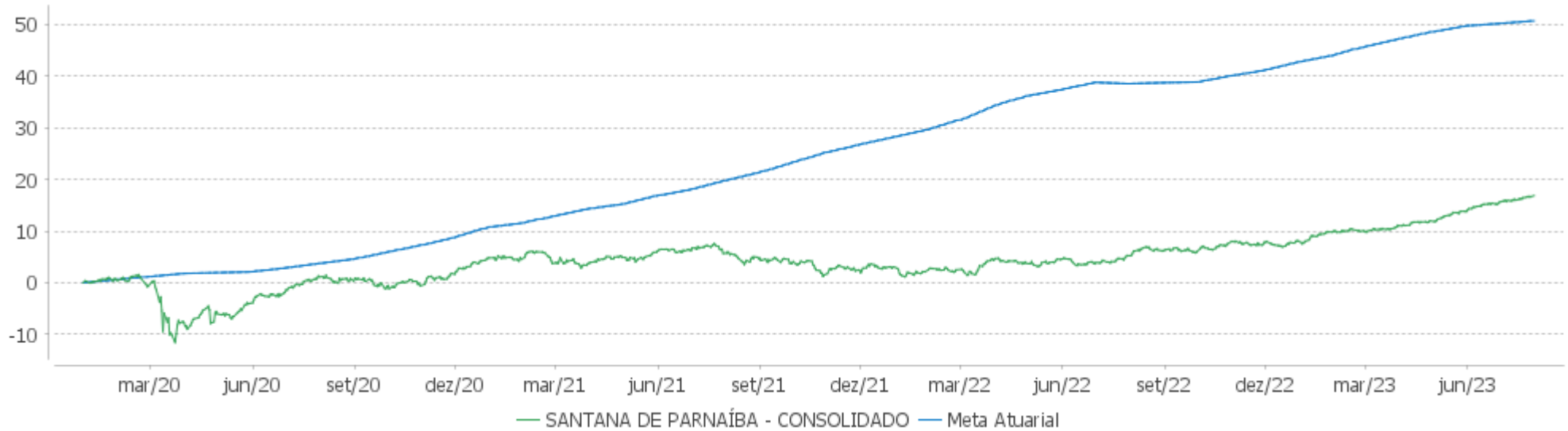
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

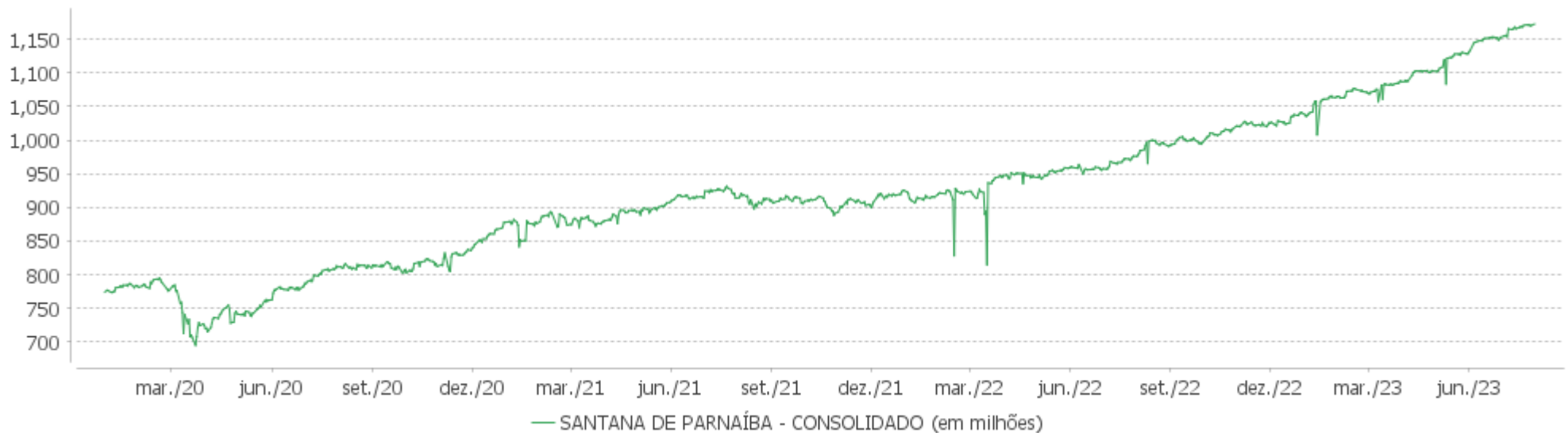
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	32,56	03 meses	4,37	1,44	2,93	1,71
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	67,44	06 meses	6,27	4,63	1,63	1,85
			12 meses	11,03	8,72	2,31	2,53
			24 meses	10,60	25,86	-15,26	3,51
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12	36 meses	15,59	45,96	-30,37	3,94
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03	Desde 31/12/2019	16,86	52,07	-35,21	6,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

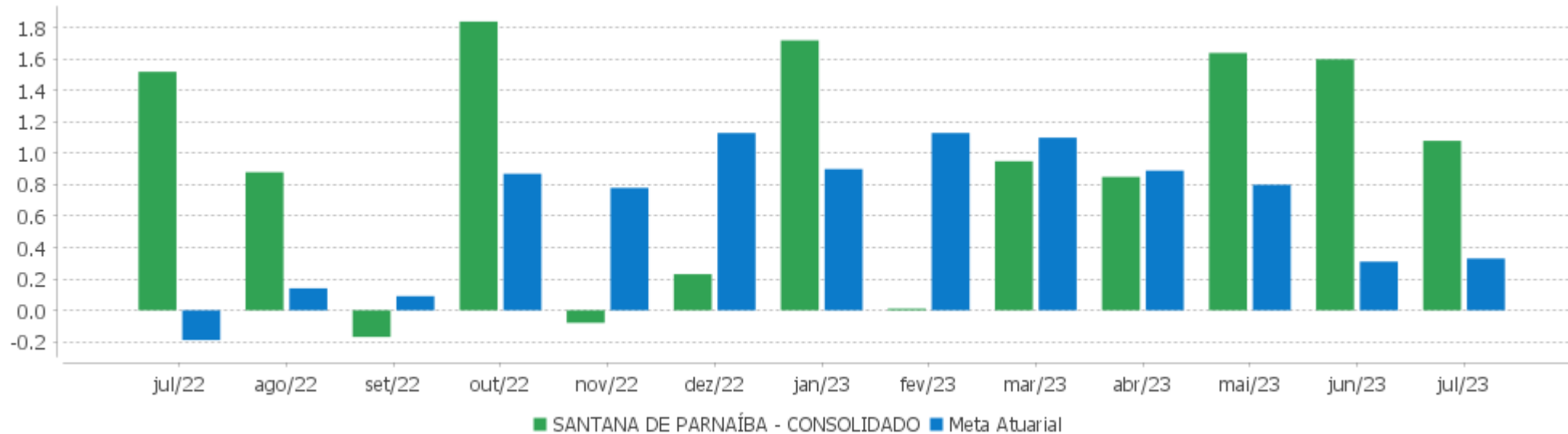


Patrimônio Líquido



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.	0,58 0,46	7,56 4,56	2,79 2,52	6,40 3,95	10,23 6,24		
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA p.p.	0,50 0,38	7,02 4,02	2,15 1,88	5,72 3,27	9,88 5,89		
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA p.p.	0,50 0,38	7,03 4,03	2,16 1,89	5,76 3,31	9,90 5,91		
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	0,49 0,37	7,00 4,01	2,17 1,90	5,75 3,30	9,81 5,82		
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	0,50 0,38	7,14 4,14	2,25 1,98	5,86 3,41	9,99 5,99		
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a Var. IPCA p.p.	0,64 0,52	7,95 4,95	2,96 2,69	6,74 4,29	10,90 6,91		
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	0,51 0,39	7,00 4,01	2,12 1,85	5,71 3,26	9,29 5,29		
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,71 3,72	1,99 1,72	5,47 3,02	9,48 5,49	21,48 7,02	31,89 7,13
NTN-B 150545 (5,825500%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	3,79 0,80	-0,81 -1,08	2,58 0,13	3,51 -0,48		
NTN-B 150840 (5,620000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,34	6,63 3,63	1,96 1,69	5,40 2,95	9,32 5,33	24,64 10,17	35,20 10,44
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,34	6,62 3,62	1,95 1,68	5,39 2,94	9,30 5,31	24,57 10,10	35,06 10,30
NTN-B 150555 (6,410000%) Var. IPCA p.p.	0,52 0,40	7,09 4,09	2,15 1,88	5,78 3,33	6,81 2,81		
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,77 3,77	2,02 1,75	5,52 3,06	9,57 5,58	21,60 7,14	32,04 7,28
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,79 3,79	2,03 1,76	5,53 3,08	9,60 5,61	25,17 10,71	35,91 11,15
NTN-B 150830 (5,530000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,33	6,58 3,58	1,94 1,67	5,35 2,90	9,23 5,24	24,39 9,92	34,74 9,99
NTN-B 150850 (6,151000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,38	6,95 3,96	2,09 1,82	5,66 3,21	6,67 2,68	18,45 3,99	
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,95	7,94	2,56	6,47	11,05	21,95	27,83

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	-0,15	-0,06	-0,12	-0,23	-0,52	-0,83
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,95	8,02	2,64	6,56	11,20	22,15	27,97
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,06	0,02	-0,04	-0,09	-0,32	-0,69
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	1,06	7,60	3,31	6,41	13,51	24,20	26,90
% do CDI	98,60	99,49	100,33	99,47	99,44	99,81	98,65
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,90	11,27	5,57	10,71	13,06	23,97	25,45
Var. IPCA p.p.	0,78	8,28	5,30	8,26	9,07	9,51	0,69
FIDC ITALIA SENIOR	0,96	-13,30	1,30	1,60	-11,77	21,04	1.403,08
% do CDI	89,76	-174,04	39,35	24,78	-86,66	86,78	5.144,40
BB INSTITUCIONAL FI RF	1,08	7,09	3,41	6,22	13,16	24,26	27,67
% do CDI	100,37	92,75	103,32	96,45	96,90	100,02	101,46
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,18	7,79	3,52	6,59	13,99	25,52	28,71
% do CDI	110,38	102,00	106,48	102,28	103,01	105,22	105,28
BB PREV RF FLUXO FIC	0,98	7,02	3,06	5,93	12,47	21,74	23,32
% do CDI	91,73	91,90	92,50	91,96	91,82	89,64	85,51
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,99	6,68	2,97	5,66	11,77	20,50	22,38
% do CDI	92,01	87,42	90,02	87,88	86,67	84,54	82,04
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,00	8,84	4,42	7,78	14,17	21,28	22,15
Var. IPCA p.p.	0,88	5,84	4,15	5,32	10,18	6,81	-2,61
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	3,06	9,92	21,12	5,03	11,27	-28,30	-22,39
Var. IBOVESPA p.p.	-0,20	-1,20	4,35	-2,47	-6,93	-28,42	-40,88
BRADESCO F I A SELECTION	2,64	8,36	17,40	4,26	15,00	-4,88	10,97
Var. IBOVESPA p.p.	-0,63	-2,77	0,63	-3,24	-3,20	-5,00	-7,52
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4,05	13,88	19,16	8,39	16,92	-26,24	-9,09
Var. IBOVESPA p.p.	0,78	2,76	2,39	0,88	-1,28	-26,36	-27,58
INDIE FIC FIA	3,75	22,02	28,17	17,89	25,97	-26,78	-13,11
Var. IBOVESPA p.p.	0,48	10,90	11,40	10,39	7,76	-26,90	-31,60
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	3,59	9,50	18,89	4,86	12,64	-11,05	8,31
Var. IBOVESPA p.p.	0,32	-1,63	2,12	-2,64	-5,56	-11,17	-10,18
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	2,61	1,00	8,70	-1,38	9,73	-10,65	10,56
Var. IBOVESPA p.p.	-0,65	-10,12	-8,07	-8,88	-8,48	-10,77	-7,93
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	6,12	31,63	17,33	17,55	14,28	-14,93	13,85
Var. MSCI ACWI p.p.	4,24	25,49	14,97	16,15	12,95	-5,32	-2,91
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,78	2,82	2,03	0,88	2,22	-16,22	10,92
% do CDI	165,71	36,86	61,60	13,72	16,32	-66,87	40,03
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	6,32	14,58	9,90	4,07	12,11	-10,16	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. MSCI ACWI p.p.	4,43	8,43	7,54	2,66	10,78	-0,55	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	3,57 2,96	26,07 19,56	11,27 9,51	13,57 8,17	16,70 6,50	-28,42 -56,98	-9,76 -58,21
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do CDI	1,00 93,27	6,89 90,18	3,20 96,84	5,89 91,36	12,92 95,14	23,97 98,83	26,19 96,02
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	3,68 2,22	24,80 16,19	12,37 8,02	17,32 12,65	26,28 24,75	28,16 31,50	75,24 47,41
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA + 8,00% p.p.	-1,51 -2,28	-5,97 -8,05					
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO Var. INPC + 5,10% p.p.	1,08 0,75	8,10 2,52	4,37 2,93	6,27 1,63	11,03 2,24	10,60 -15,28	15,59 -29,69
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45

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
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
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	1,07	7,81	3,44	6,64	13,84	23,07	25,52	32,43	42,08
IRF-M 1+	0,82	12,33	6,44	11,52	18,36	19,55	15,56	29,44	53,47
IRF-M TOTAL	0,89	10,59	5,29	9,67	16,44	20,41	18,73	30,37	50,29
IMA-B 5	0,97	8,08	2,62	6,60	11,29	22,46	28,66	40,02	59,74
IMA-B 5+	0,73	15,74	8,42	17,22	19,37	15,53	15,93	24,98	73,16
IMA-B TOTAL	0,81	12,27	5,83	12,27	15,46	19,21	22,22	32,19	68,50
IMA-GERAL TOTAL	0,98	9,70	4,55	8,94	14,59	21,41	23,44	32,48	52,87
IDKA 2	0,98	7,84	2,26	6,31	10,55	21,73	28,89	40,07	57,72
IDKA 20	0,76	23,26	14,33	29,18	28,75	8,83	7,52	12,84	82,11
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49	19,77	53,93
IBRX 100	3,32	10,13	16,52	6,40	16,39	-2,60	17,59	20,13	57,20
IBRX 50	3,70	8,84	16,09	5,28	16,73	-1,88	19,92	20,20	51,93
SMALL CAP	3,12	16,80	26,65	13,48	17,47	-20,79	-4,84	2,63	47,75
Índice Consumo - ICON	2,22	10,79	25,68	7,60	0,74	-37,60	-35,76	-27,95	-0,79
Índice Dividendos - IDIV	2,84	12,41	12,81	6,16	18,72	18,15	34,93	39,66	97,67

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	1,45	8,61	4,36	4,67	1,54	-3,34	27,84	93,91	105,76

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,33	11,51	11,86	13,33	13,61	13,21	16,98	20,22	48,40

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,88	6,14	2,36	1,41	1,33	-9,61	16,75	69,84	71,77

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,12	2,99	0,27	2,45	3,99	14,46	24,76	27,64	31,75
INPC	-0,09	2,59	0,17	2,13	3,53	14,01	25,24	28,62	32,68
IGPM	-0,72	-5,15	-4,43	-5,35	-7,72	1,58	35,94	48,54	58,04
SELIC	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,45	5,34	1,27	4,43	8,14	23,77	40,25	49,25	60,17
IPCA + 5,00%	0,53	5,93	1,52	4,92	9,17	26,15	44,31	55,05	67,99
IPCA + 5,50%	0,57	6,22	1,64	5,16	9,69	27,35	46,37	58,02	72,01
IPCA + 5,89%	0,60	6,44	1,74	5,35	10,09	28,29	47,99	60,36	75,20
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45	61,03	76,11
INPC + 4,00%	0,24	4,94	1,17	4,10	7,65	23,27	40,79	50,39	61,30
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03	62,26	77,35

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%)	81.456.140,04	5,600000	83.904.526,39	5,237600	2.448.386,35
NTN-B 150545 (5,825500%)	50.997.499,49	5,825500	53.581.728,60	5,406400	2.584.229,11
NTN-B 150545 (5,890000%)	113.188.990,98	5,890000	119.880.810,15	5,406400	6.691.819,17
NTN-B 150555 (6,410000%)	51.254.383,61	6,410000	58.680.753,85	5,426800	7.426.370,24
NTN-B 150830 (5,530000%)	51.408.032,93	5,530000	52.691.781,04	5,076000	1.283.748,11
NTN-B 150840 (5,620000%)	96.643.276,46	5,620000	99.439.892,93	5,342400	2.796.616,47
NTN-B 150850 (5,761000%)	44.334.316,68	5,761000	46.210.755,20	5,442100	1.876.438,52
NTN-B 150850 (5,860000%)	44.239.808,19	5,860000	46.708.332,24	5,442100	2.468.524,05
NTN-B 150850 (6,151000%)	51.134.368,87	6,151000	56.007.088,37	5,442100	4.872.719,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1121	05/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	10.551,89	4.641,45160361	2,2734030000
1129	05/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.739,76	765,26687085	2,2734030000
1127	05/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	720,00	0,00	316,70583702	2,2734030000
1138	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	647.617,81	0,00	284.601,11675180	2,2755280000
1120	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	8.824.450,26	0,00	3.877.979,20306847	2,2755280000
1130	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	37.897,37	16.654,31934918	2,2755280000
1122	10/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	588.320,03	258.421,59984890	2,2765900000
1128	10/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	587.600,03	0,00	258.105,33736861	2,2765900000
1123	14/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.870.412,78	3.012.218,60465932	2,2808480000
1140	14/07/2023	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	6.841.000,00	0,00	111.730,96216528	61,2274330000
1131	14/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	22.976,30	10.073,57789734	2,2808480000
1132	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	17.416,97	7.625,49002954	2,2840460000
1124	24/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	30.449,02	13.312,50191278	2,2872500000
1133	24/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.519,21	664,20811018	2,2872500000
1141	25/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	207.134,34	0,00	79.827,04375991	2,5947890620
1144	25/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.692.900,83	739.801,06357549	2,2883190000
1134	25/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	78.107,67	34.133,20870036	2,2883190000
1142	27/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	196.871,07	75.799,19919388	2,5972711070
1135	27/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	46.200,00	20.170,63836141	2,2904580000
1143	28/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.263,27	3.949,66301044	2,5985178920
1126	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	246.663,19	107.641,35982628	2,2915280000
1136	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	11.565,22	5.046,94684071	2,2915280000
1137	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	209,90	91,55547917	2,2925990000
Total			17.108.522,44	9.864.064,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 10.452.785,32

Value-At-Risk: 0,89%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO		0,89		0,89			1.172.489.351,65	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,20%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,600000%)		0,11	-0,00	0,09			81.456.140,04	6,95
NTN-B 150545 (5,825500%)		0,26	-0,00	0,27			50.997.499,49	4,35
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,11	-0,00	0,09			113.188.990,98	9,65
NTN-B 150555 (6,410000%)		0,11	-0,00	0,09			51.254.383,61	4,37
NTN-B 150830 (5,530000%)		0,11	-0,00	0,09			51.408.032,93	4,38
NTN-B 150840 (5,620000%)		0,11	-0,00	0,09			96.643.276,46	8,24
NTN-B 150850 (5,761000%)		0,13	-0,00	0,10			44.334.316,68	3,78
NTN-B 150850 (5,860000%)		0,11	-0,00	0,09			44.239.808,19	3,77
NTN-B 150850 (6,151000%)		0,13	-0,00	0,10			51.134.368,87	4,36
Sub-total	0,08	0,11	-0,00		-7,41	0,48	584.656.817,25	49,86

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI		0,01	0,00	0,01			6.878.925,84	0,59
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,77	0,02	0,03			75.698.542,99	6,46
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		0,76	0,01	0,01			43.148.910,75	3,68
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI		1,40	0,02	1,40			49.415.615,88	4,21
Sub-total	1,76	0,88	0,05		-0,08	0,92	175.141.995,46	14,94

Artigo 7º III, Alínea a

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			2.060.689,58	0,18
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	0,00	0,01			6.520.735,00	0,56
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			66.026.523,54	5,63
BB INSTITUCIONAL FI RF		0,03	0,00	0,03			37.987.696,64	3,24
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,48	0,01	0,50			47.681.325,40	4,07
Sub-total	0,37	0,15	0,01		0,06	1,09	160.276.970,16	13,67

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		0,13	0,00	0,15			5.656.146,48	0,48
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a		0,13	-0,00	0,11			11.008.051,38	0,94
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a		0,12	-0,00	0,10			11.000.625,50	0,94
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a		0,12	-0,00	0,10			8.991.686,06	0,77
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		0,13	-0,00	0,11			9.017.574,81	0,77
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a		0,11	-0,00	0,09			15.602.950,76	1,33
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a		0,18	0,00	0,19			3.227.687,18	0,28
Sub-total	0,07	0,11	-0,00		-8,53	0,51	64.504.722,17	5,50

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		0,08	0,00	0,08			35.640,06	0,00
Sub-total	3,32	0,08	0,00		-0,03	0,96	35.640,06	0,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,97%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		9,17	0,23	4,05			32.106.812,04	2,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		7,06	0,10	3,68			19.851.545,36	1,69
BRADESCO F I A SELECTION		7,85	0,12	2,77			19.083.238,09	1,63
INDIE FIC FIA		9,36	0,13	4,76			19.352.270,50	1,65
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		8,83	0,02	2,34			2.887.720,08	0,25
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		8,10	0,14	4,82			23.632.459,66	2,02
Sub-total	15,55	7,97	0,75		0,13	3,16	116.914.045,73	9,97

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,03%

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		7,07	0,01	7,27			3.418.298,62	0,29
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		9,39	0,06	7,46			15.287.954,94	1,30
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,41	0,00	9,42			17.082.775,21	1,46
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		5,88	-0,00	5,88			20.463.646,36	1,75
Sub-total	9,85	6,03	0,07		0,27	3,75	56.252.675,13	4,80

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,41%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO		0,19	0,00	0,19			3.448.821,86	0,29
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		6,17	0,03	5,22			10.551.701,90	0,90
Sub-total	5,95	4,64	0,03		0,32	3,00	14.000.523,76	1,19

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA		5,11	-0,00	5,10			705.961,93	0,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	5,27	5,11	-0,00		-0,49	-1,51	705.961,93	0,06

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)