



LDB
EMPRESAS

SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO
AGOSTO 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 31.08.2023.

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

84,43%

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%)	0,41	0,03	0,72	7,39	82.045.310,11	6,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,825500%)	4,03	0,08	0,74	2,16	51.376.272,97	4,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,41	0,03	0,75	7,58	114.036.279,03	9,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,410000%)	3,09	0,04	0,79	4,60	51.661.178,75	4,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,530000%)	0,41	0,03	0,72	7,34	50.328.657,74	4,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	0,41	0,03	0,73	7,40	94.658.559,35	8,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	0,41	0,05	0,74	7,50	43.420.205,97	3,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	0,41	0,03	0,75	7,56	43.315.464,05	3,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,151000%)	0,41	0,05	0,77	7,06	50.024.415,37	4,24
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,41	0,04	0,74	7,53	580.866.343,34	49,21

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	1,14	1,70	6.957.559,52	0,59	39.669.959.126,67	0,02
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,02	0,05	0,49	0,49	11.196.679,34	0,95	29.293.680.703,24	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,24	-0,24	0,60	8,67	76.150.529,86	6,45	8.195.443.440,71	0,93
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,24	-0,24	0,59	8,58	43.404.709,39	3,68	1.116.268.609,34	3,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,93	-0,36	0,37	11,68	49.598.597,22	4,20	2.203.872.085,49	2,25
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,82	-0,24	0,59	9,36	187.308.075,33	15,87		

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	1,05	8,15	2.082.491,43	0,18	3.554.344.878,79	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	-0,04	0,96	7,71	8.032.611,92	0,68	875.310.436,12	0,92
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,05	1,27	9,16	66.863.089,10	5,66	9.013.672.474,30	0,74
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,26	0,03	1,20	8,37	38.442.082,86	3,26	2.286.111.406,16	1,68
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,58	-0,17	0,62	9,51	47.977.653,44	4,06	747.044.008,11	6,42
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,45	-0,02	1,05	9,07	163.397.928,75	13,84		

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	0,90	-0,15	0,61	8,22	5.690.904,11	0,48		
BRADESCO	BRADESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	0,42	0,01	0,76	7,83	11.091.217,49	0,94		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 6,25% a.a	0,42	0,02	0,76	7,84	11.084.413,03	0,94		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a. a	0,43	0,01	0,75	7,80	9.058.921,80	0,77		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a. a	0,43	0,01	0,76	7,95	9.086.330,40	0,77		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	0,44	0,04	0,78	7,84	15.724.757,18	1,33		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	0,92	-0,15	0,66	8,66	3.249.112,21	0,28		
Sub-total Artigo 7º IV			0,43	-0,00	0,75	7,92	64.985.656,22	5,51		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,33	0,33	-13,01	35.759,17	0,00	19.400.107,45	0,18
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			15,96	0,33	0,33	-13,01	35.759,17	0,00		
Renda Fixa			0,78	-0,03	0,76	8,12	996.593.762,81	84,43		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

9,26%

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	20,26	-1,34	-7,18	2,03	29.800.162,06	2,52	1.370.470.559,17	2,17
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,06	-0,77	-4,95	-3,99	18.869.447,14	1,60	1.414.031.639,81	1,33
BRAM	BEM	BRABESCO F I A SELECTION	20,19	-1,72	-6,32	1,51	17.877.205,26	1,51	452.902.777,24	3,95
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	24,26	-2,05	-6,60	13,97	18.075.506,67	1,53	402.081.467,39	4,50
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	22,18	-1,30	-4,22	9,08	2.765.980,22	0,23	176.964.622,29	1,56
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	23,09	-1,46	-7,30	1,51	21.908.261,96	1,86	728.238.113,46	3,01
Sub-total Artigo 8º I			20,33	-1,45	-6,52	2,67	109.296.563,31	9,26		
Renda Variável			20,33	-1,45	-6,52	2,67	109.296.563,31	9,26		

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	17,28	-1,21	-5,58	8,19	3.227.615,45	0,27	48.992.030,65	6,59
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	24,23	0,85	-0,43	31,06	15.221.464,45	1,29	235.828.232,83	6,45
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,05	2,56	1,35	27,77	17.312.681,87	1,47	665.927.943,70	2,60
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,24	1,52	2,09	4,97	20.892.358,01	1,77	630.406.686,67	3,31
Sub-total Artigo 9º II			19,28	1,49	0,71	17,90	56.654.119,78	4,80		
Investimentos no Exterior			19,28	1,49	0,71	17,90	56.654.119,78	4,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,51%

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	0,50	0,03	0,93	7,88	3.480.770,48	0,29	833.168.219,43	0,42
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	17,83	-0,08	-0,89	23,69	13.605.285,04	1,15	528.109.144,51	2,58
Sub-total Artigo 10º I			15,81	-0,06	-0,30	19,49	17.086.055,52	1,45		

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	8,48	-2,39	-2,39	-8,22	689.056,91	0,06	75.842.901,38	0,91
Sub-total Artigo 10º II			8,48	-2,39	-2,39	-8,22	689.056,91	0,06		

Investimentos Estruturados			15,75	-0,15	-0,36	18,50	17.775.112,43	1,51		
-----------------------------------	--	--	--------------	--------------	--------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

Total			2,39	-0,09	0,03	8,13	1.180.319.558,33	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	580.866.343,34	49,21	30,00	50,00	85,00	52,68	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	187.308.075,33	15,87	5,00	12,50	30,00	1,65	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	163.397.928,75	13,84	5,00	15,00	30,00	15,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	64.985.656,22	5,51	3,00	6,00	10,00	5,76	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	35.759,17	0,00	0,00	0,10	0,20	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	996.593.762,81	84,43					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	109.296.563,31	9,26	3,00	7,00	15,00	4,92	30,00
	Total Renda Variável	109.296.563,31	9,26					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	56.654.119,78	4,80	3,00	6,90	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	56.654.119,78	4,80					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	17.086.055,52	1,45	0,50	2,30	5,00	10,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	689.056,91	0,06	0,10	0,20	2,50	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	17.775.112,43	1,51					15,00
Total		1.180.319.558,33	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	0,74 65,21	7,53 84,92	1,69 50,89	5,28 79,00	10,33 76,24	4.309.521,08	37.337.867,20
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,59 51,70	9,36 105,57	2,92 87,86	6,95 104,10	11,77 86,82	1.024.293,37	16.170.707,58
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,05 92,00	9,07 102,30	3,47 104,41	6,98 104,49	13,54 99,89	1.727.836,34	14.678.111,45
Artigo 7º IV % do CDI	0,75 65,44	7,92 89,35	1,86 56,06	5,62 84,16	10,80 79,72	480.934,05	4.770.266,41
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,33 29,33	-13,01 -146,70	1,27 38,24	2,04 30,61	-11,85 -87,40	119,11	-5.346,78
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-6,52 -1,43	2,67 -2,80	4,85 -1,99	7,11 -3,19	-0,37 -6,05	-7.617.482,42	2.844.772,18
Artigo 9º II % do CDI	0,71 62,64	17,90 201,93	6,44 194,05	10,39 155,54	13,20 97,43	401.444,65	8.603.221,14
Artigo 10º I % do CDI	-0,30 -26,73	19,49 219,82	8,34 251,17	15,14 226,71	25,29 186,62	43.740,20	2.363.086,02
Artigo 10º II % do CDI	-2,39 -210,19	-8,22 -197,46	-7,09 -213,68			-16.905,02	-61.699,90
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)						353.501,36	86.700.985,30

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%)	81.456.140,04	0,00	0,00	0,00	82.045.310,11	589.170,07	5.757.683,17
NTN-B 150545 (5,825500%)	50.997.499,49	0,00	0,00	0,00	51.376.272,97	378.773,48	1.087.718,99
NTN-B 150545 (5,890000%)	113.188.990,98	0,00	0,00	0,00	114.036.279,03	847.288,05	8.202.654,49
NTN-B 150555 (6,410000%)	51.254.383,61	0,00	0,00	0,00	51.661.178,75	406.795,14	2.304.872,30
NTN-B 150830 (5,530000%)	51.408.032,93	0,00	0,00	1.442.337,76	50.328.657,74	362.962,57	3.557.972,23
NTN-B 150840 (5,620000%)	96.643.276,46	0,00	0,00	2.674.685,59	94.658.559,35	689.968,48	6.740.516,23
NTN-B 150850 (5,761000%)	44.334.316,68	0,00	0,00	1.235.888,36	43.420.205,97	321.777,65	3.129.431,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (5,860000%)	44.239.808,19	0,00	0,00	1.249.195,86	43.315.464,05	324.851,72	3.149.476,19
NTN-B 150850 (6,151000%)	51.134.368,87	0,00	0,00	1.497.887,42	50.024.415,37	387.933,92	3.407.542,57
					580.866.343,34	4.309.521,08	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	11.141.786,50	0,00	0,00	11.196.679,34	54.892,84	54.892,84
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	75.698.542,99	0,00	0,00	0,00	76.150.529,86	451.986,87	6.260.120,55
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	49.415.615,88	0,00	0,00	0,00	49.598.597,22	182.981,34	5.792.306,46
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	6.878.925,84	0,00	0,00	0,00	6.957.559,52	78.633,68	116.559,52
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	43.148.910,75	0,00	0,00	0,00	43.404.709,39	255.798,64	3.429.028,69
					187.308.075,33	1.024.293,37	

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	37.987.696,64	0,00	0,00	0,00	38.442.082,86	454.386,22	2.353.876,54
BB PREV RF FLUXO FIC	2.060.689,58	199.964,56	-199.964,56	0,00	2.082.491,43	21.801,85	265.083,80
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	66.026.523,54	0,00	0,00	0,00	66.863.089,10	836.565,56	7.233.080,56
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	6.520.735,00	18.346.635,72	-16.953.513,47	0,00	8.032.611,92	118.754,67	658.685,77
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	47.681.325,40	0,00	0,00	0,00	47.977.653,44	296.328,04	4.167.384,78
					163.397.928,75	1.727.836,34	

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	11.008.051,38	0,00	0,00	0,00	11.091.217,49	83.166,11	804.990,09
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	8.991.686,06	0,00	0,00	0,00	9.058.921,80	67.235,74	655.790,66
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	5.656.146,48	0,00	0,00	0,00	5.690.904,11	34.757,63	432.222,04
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	11.000.625,50	0,00	0,00	0,00	11.084.413,03	83.787,53	806.195,41
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	15.602.950,76	0,00	0,00	0,00	15.724.757,18	121.806,42	1.142.539,80

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 6,40 % a.a	9.017.574,81	0,00	0,00	0,00	9.086.330,40	68.755,59	669.494,24
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	3.227.687,18	0,00	0,00	0,00	3.249.112,21	21.425,03	259.034,17
					64.985.656,22	480.934,05	

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	35.640,06	0,00	0,00	0,00	35.759,17	119,11	-5.346,78
					35.759,17	119,11	

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	19.083.238,09	0,00	0,00	0,00	17.877.205,26	-1.206.032,83	265.728,69
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	32.106.812,04	0,00	0,00	0,00	29.800.162,06	-2.306.649,98	591.875,94
INDIE FIC FIA	19.352.270,50	0,00	0,00	0,00	18.075.506,67	-1.276.763,83	2.215.975,38
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19.851.545,36	0,00	0,00	0,00	18.869.447,14	-982.098,22	-784.724,42
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.887.720,08	0,00	0,00	0,00	2.765.980,22	-121.739,86	230.253,88
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	23.632.459,66	0,00	0,00	0,00	21.908.261,96	-1.724.197,70	325.662,71
					109.296.563,31	-7.617.482,42	

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	3.418.298,62	0,00	0,00	0,00	3.227.615,45	-190.683,17	244.206,97
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	15.287.954,94	0,00	0,00	0,00	15.221.464,45	-66.490,49	3.607.462,73
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17.082.775,21	0,00	0,00	0,00	17.312.681,87	229.906,66	3.762.384,31
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20.463.646,36	0,00	0,00	0,00	20.892.358,01	428.711,65	989.167,13
					56.654.119,78	401.444,65	

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	10.551.701,90	3.041.791,56	0,00	0,00	13.605.285,04	11.791,58	2.108.829,64
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	3.448.821,86	0,00	0,00	0,00	3.480.770,48	31.948,62	254.256,38
					17.086.055,52	43.740,20	

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	705.961,93	0,00	0,00	0,00	689.056,91	-16.905,02	-61.699,90
					689.056,91	-16.905,02	

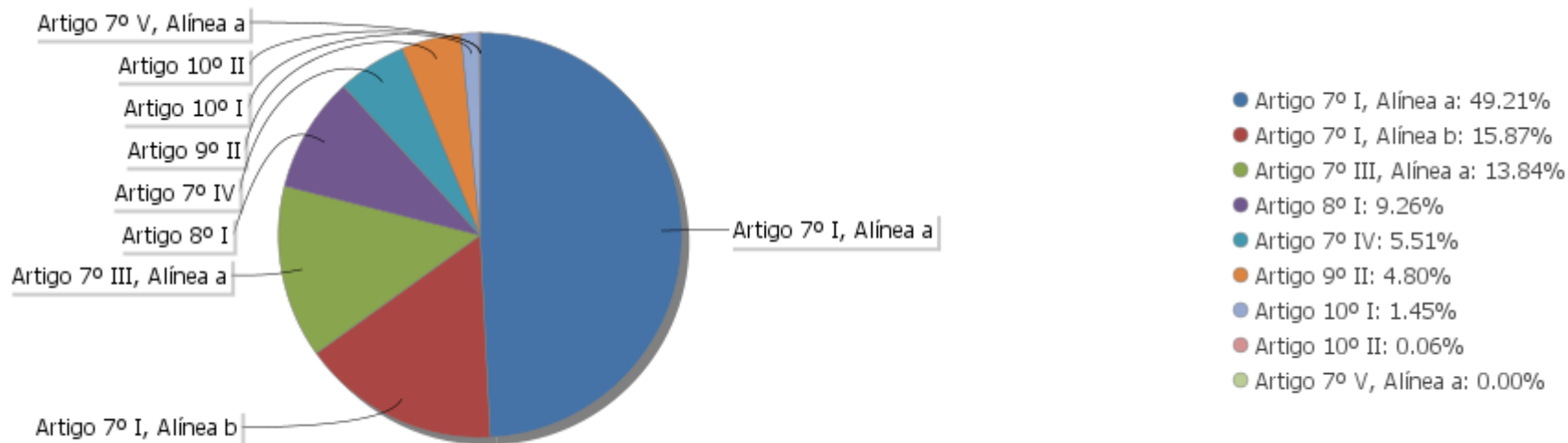
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

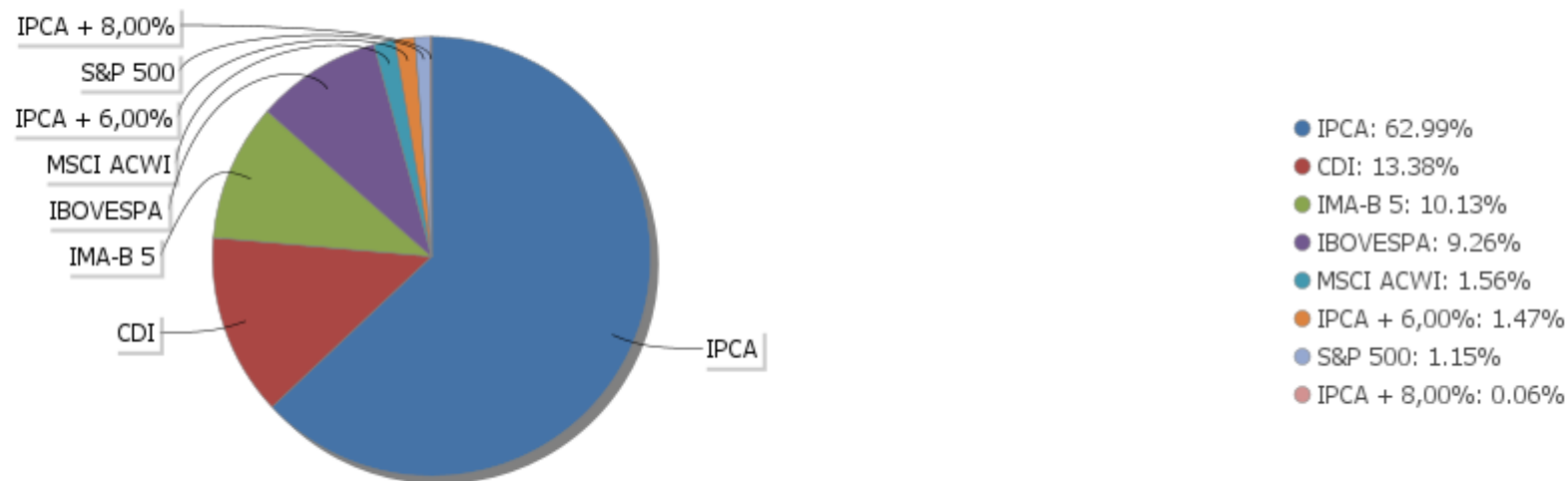
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	442.359.143,81	37,48	442.359.143,81	37,48	
de 31 a 365 dias	91.419.358,05	7,75	533.778.501,86	45,22	
de 1 a 5 anos	64.985.656,22	5,51	598.764.158,08	50,73	
de 5 a 10 anos	51.017.714,65	4,32	649.781.872,73	55,05	
de 10 a 20 anos	176.703.869,46	14,97	826.485.742,19	70,02	
acima de 20 anos	353.833.816,14	29,98	1.180.319.558,33	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

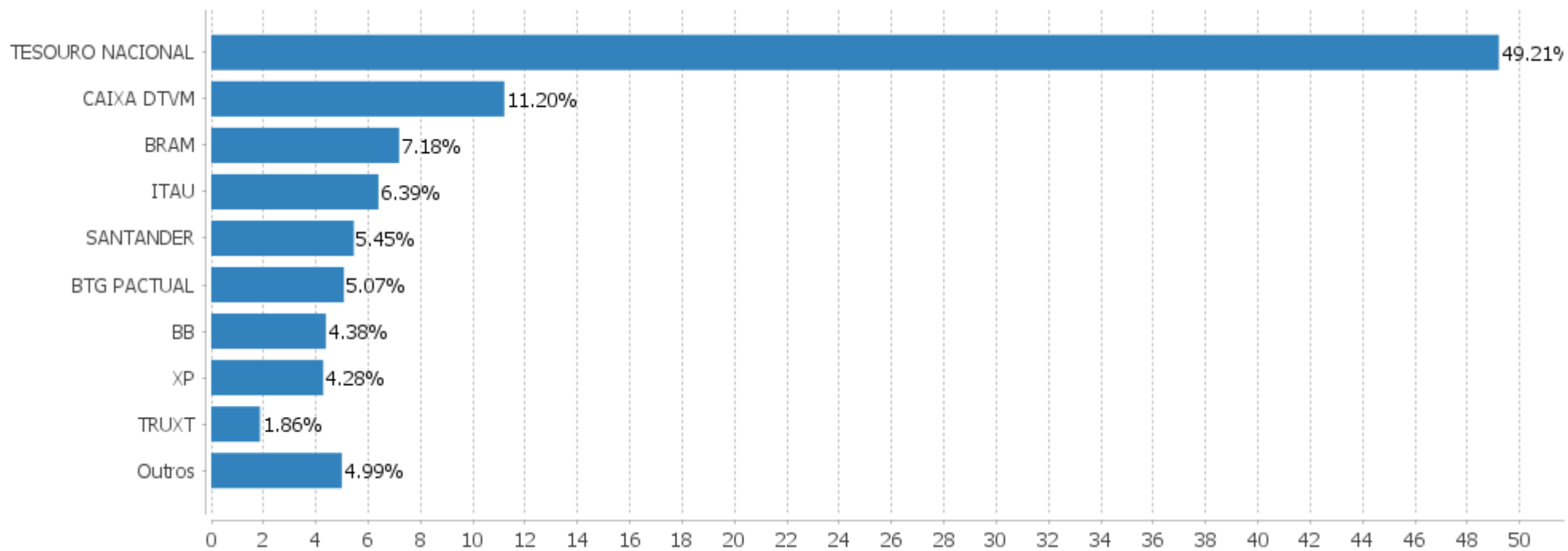


Alocação Por Estratégia



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	0,03					8,13
INPC + 5,10%	0,90	1,13	1,10	0,89	0,80	0,31	0,33	0,66					6,27
p.p. indexador	0,82	-1,12	-0,15	-0,03	0,84	1,28	0,75	-0,63					1,86
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

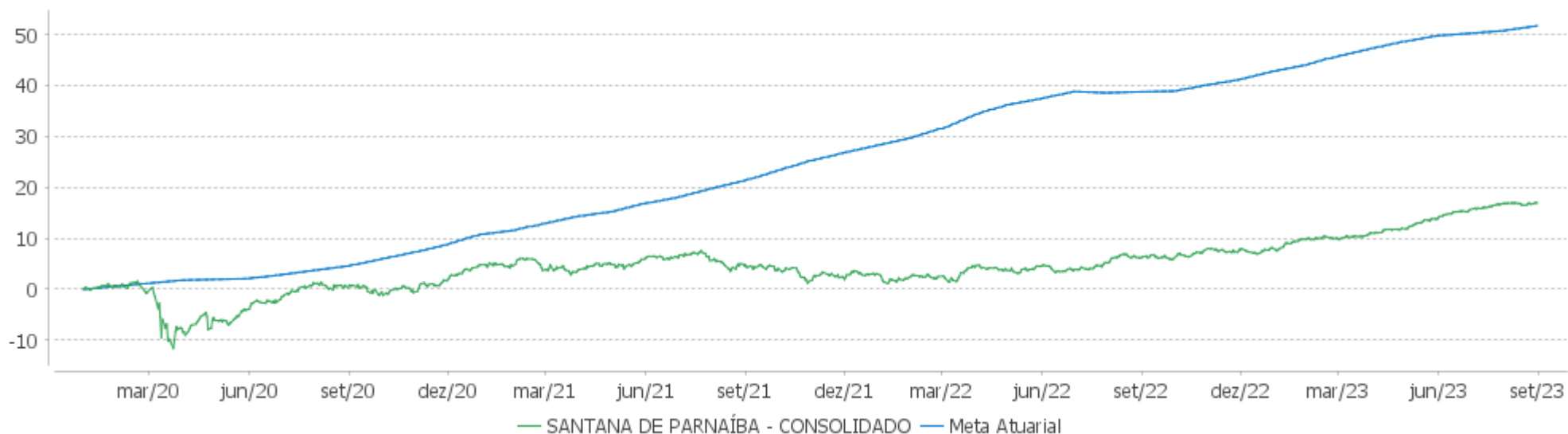
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	31,82	03 meses	2,72	1,30	1,42	1,71
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	68,18	06 meses	6,29	4,15	2,14	1,75
			12 meses	10,09	9,29	0,80	2,39
			24 meses	11,76	25,00	-13,24	3,38
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12	36 meses	16,51	45,70	-29,19	3,84
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03	Desde 31/12/2019	16,90	53,07	-36,17	6,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

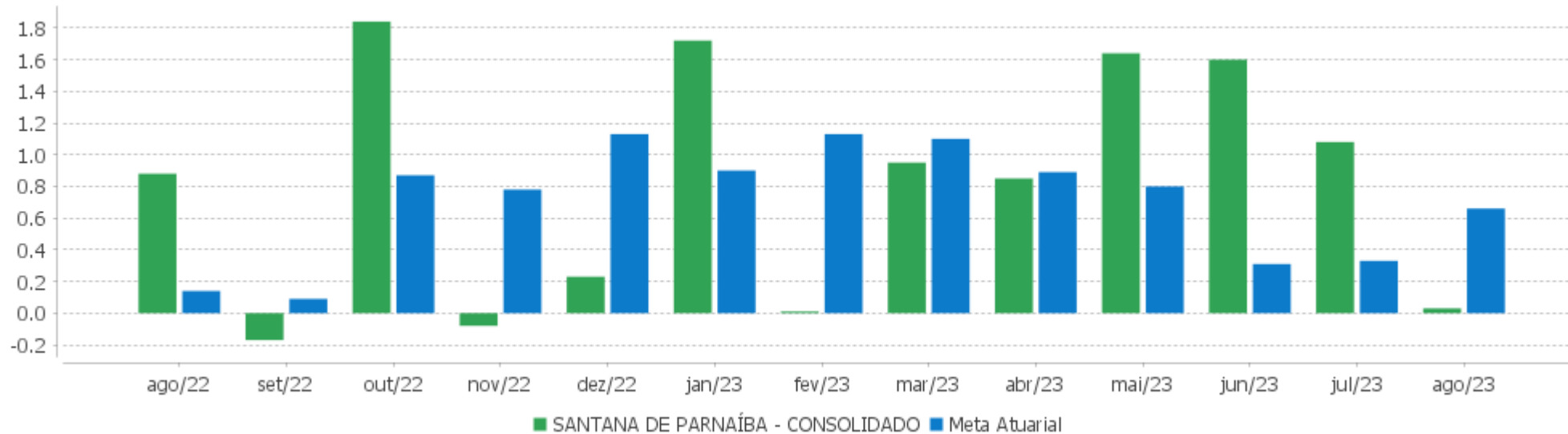


Patrimônio Líquido



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.	0,61 0,38	8,22 4,99	2,11 1,84	6,01 4,18	10,37 5,76		
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA p.p.	0,76 0,53	7,83 4,60	1,80 1,53	5,45 3,62	10,74 6,13		
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA p.p.	0,76 0,53	7,84 4,61	1,81 1,54	5,60 3,77	10,75 6,14		
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,80 4,57	1,80 1,53	5,56 3,73	10,67 6,07		
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a Var. IPCA p.p.	0,66 0,43	8,66 5,43	2,28 2,01	6,36 4,53	11,00 6,39		
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	0,76 0,53	7,95 4,72	1,86 1,59	5,62 3,79	10,86 6,25		
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	0,78 0,55	7,84 4,60	1,80 1,53	5,49 3,66	11,04 6,44		
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,50 4,27	1,67 1,40	5,24 3,41	10,33 5,72	24,21 10,48	35,64 10,90
NTN-B 150545 (5,825500%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	4,57 1,33	1,69 1,42	2,36 0,53	4,31 -0,29		
NTN-B 150840 (5,620000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,50	7,40 4,17	1,64 1,37	5,17 3,34	10,17 5,56	27,40 13,67	39,02 14,27
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,49	7,39 4,16	1,63 1,36	5,16 3,33	10,15 5,54	23,83 10,09	35,05 10,30
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,56 4,33	1,70 1,43	5,29 3,46	10,42 5,81	24,38 10,65	35,85 11,11
NTN-B 150555 (6,410000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,56	7,94 4,71	1,83 1,56	5,57 3,74	7,63 3,02		
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,58 4,35	1,71 1,44	5,31 3,48	10,45 5,84	24,43 10,70	35,91 11,16
NTN-B 150830 (5,530000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,49	7,34 4,11	1,62 1,35	5,13 3,29	10,07 5,47	27,19 13,45	38,58 13,83
NTN-B 150850 (6,151000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,54	7,78 4,54	1,77 1,50	5,44 3,61	10,73 6,12	21,30 7,56	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,60	8,67	2,60	5,72	11,81	22,71	28,23

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	-0,08	-0,06	-0,04	-0,16	-0,31	-0,66
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,59	8,58	2,60	5,64	11,72	22,51	28,07
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,17	-0,06	-0,12	-0,25	-0,51	-0,82
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	1,14	8,84	3,32	6,65	13,52	25,18	28,37
% do CDI	100,38	99,71	99,98	99,53	99,79	100,19	99,47
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	1,14	8,83	3,32	6,64	13,49	25,10	28,17
% do CDI	100,34	99,60	99,93	99,45	99,53	99,87	98,77
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,37	11,68	3,52	9,87	12,79	24,05	26,07
Var. IPCA p.p.	0,14	8,45	3,25	8,04	8,18	10,31	1,33
FIDC ITALIA SENIOR	0,33	-13,01	1,27	2,04	-11,85	21,54	52,02
% do CDI	29,34	-146,70	38,24	30,61	-87,40	85,69	182,41
BB INSTITUCIONAL FI RF	1,20	8,37	3,43	6,74	13,13	25,12	28,94
% do CDI	104,99	94,37	103,33	100,89	96,85	99,94	101,47
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,27	9,16	3,63	7,00	14,06	26,49	30,12
% do CDI	111,21	103,30	109,23	104,85	103,73	105,38	105,63
BB PREV RF FLUXO FIC	1,05	8,15	3,06	6,14	12,44	22,65	24,53
% do CDI	92,46	91,91	92,33	91,93	91,82	90,13	86,01
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,62	9,51	3,34	7,38	13,10	23,77	23,35
Var. IPCA p.p.	0,39	6,28	3,07	5,55	8,50	10,03	-1,40
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1,05	7,80	3,05	5,94	11,81	21,38	23,55
% do CDI	92,12	87,96	92,02	88,89	87,12	85,06	82,57
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-7,18	2,03	4,64	4,03	-2,33	-28,58	-27,65
Var. IBOVESPA p.p.	-2,10	-3,45	-2,20	-6,27	-8,01	-26,02	-44,13
BRADESCO F I A SELECTION	-6,32	1,51	3,86	5,57	-0,80	-8,82	5,16
Var. IBOVESPA p.p.	-1,23	-3,97	-2,98	-4,73	-6,47	-6,27	-11,32
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	-4,22	9,08	7,44	12,22	1,72	-26,20	-12,89
Var. IBOVESPA p.p.	0,87	3,61	0,60	1,91	-3,96	-23,64	-29,36
INDIE FIC FIA	-6,60	13,97	7,95	19,98	6,51	-25,66	-19,23
Var. IBOVESPA p.p.	-1,51	8,50	1,11	9,68	0,83	-23,11	-35,70
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	-7,30	1,51	5,07	8,62	-1,35	-16,22	-0,21
Var. IBOVESPA p.p.	-2,21	-3,97	-1,77	-1,68	-7,02	-13,67	-16,69
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-4,95	-3,99	2,67	0,58	-2,10	-13,16	5,30
Var. IBOVESPA p.p.	0,14	-9,47	-4,16	-9,72	-7,78	-10,60	-11,18
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-0,43	31,06	12,53	20,70	17,87	-17,62	5,32
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,16	24,15	10,00	17,61	11,51	-6,20	-0,22
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	-5,58	8,19	6,37	4,55	6,24	-15,80	-1,79

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.	-6,31	1,27	3,84	1,46	-0,11	-4,38	-7,32
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	2,09 183,89	4,97 56,05	3,10 93,48	2,54 38,04	7,73 57,06	-15,57 -61,93	1,25 4,37
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,35 0,58	27,77 20,45	5,56 3,77	13,52 8,63	17,77 6,91	-28,49 -56,26	-20,65 -69,16
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do CDI	0,93 81,31	7,88 88,88	3,03 91,17	5,96 89,28	12,39 91,45	24,73 98,38	27,31 95,78
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-0,89 -2,86	23,69 12,94	10,02 5,86	18,33 11,02	29,21 20,89	22,85 27,47	62,20 46,35
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA Var. IPCA + 8,00% p.p.	-2,39 -3,33	-8,22 -11,26	-7,09 -9,37				
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO Var. INPC + 5,10% p.p.	0,03 -0,63	8,13 1,86	2,72 1,42	6,29 2,14	10,09 0,75	11,76 -13,30	16,51 -28,60
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51

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
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADERCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADERCO 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 - MULTISTRATÉGIA						
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	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA 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	1,15	9,05	3,44	6,81	13,74	24,03	26,80	33,22	43,08
IRF-M 1+	0,59	12,99	4,10	11,31	16,04	21,61	17,57	30,08	56,68
IRF-M TOTAL	0,76	11,43	3,81	9,56	14,96	22,06	20,53	31,03	52,86
IMA-B 5	0,61	8,75	2,66	5,76	11,97	23,03	28,90	40,81	61,13
IMA-B 5+	-1,27	14,28	2,80	14,40	15,00	16,66	18,76	24,36	71,86
IMA-B TOTAL	-0,38	11,84	2,83	10,43	13,76	20,07	23,99	32,22	68,62
IMA-GERAL TOTAL	0,63	10,39	3,38	8,50	13,72	22,67	24,97	33,10	54,16
IDKA 2	0,77	8,66	2,75	5,42	11,80	22,33	28,55	41,03	58,78
IDKA 20	-3,05	19,50	3,45	24,26	18,37	10,39	11,16	10,89	77,63
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48	14,44	50,95
IBRX 100	-5,01	4,62	6,85	9,37	4,16	-4,36	15,60	14,31	54,15
IBRX 50	-4,76	3,66	7,43	8,45	4,56	-3,16	18,26	15,68	49,30
SMALL CAP	-7,43	8,13	3,26	17,40	-1,94	-23,76	-10,81	-5,44	42,85
Índice Consumo - ICON	-10,42	-0,75	0,30	6,83	-15,38	-41,83	-41,59	-38,22	-6,46
Índice Dividendos - IDIV	-2,83	9,22	8,71	11,58	10,64	15,38	37,76	32,74	99,45

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	1,97	10,75	4,16	7,31	8,32	-4,62	15,85	83,19	84,91

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	12,06	6,62	14,40	7,95	16,84	15,48	20,93	50,17

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,73	6,92	2,53	3,09	6,36	-11,42	5,54	59,73	56,19

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	3,23	0,27	1,83	4,61	13,74	24,75	27,79	32,17
INPC	0,20	2,80	0,01	1,55	4,06	13,24	25,04	28,72	32,95
IGPM	-0,14	-5,28	-2,77	-5,42	-7,20	0,77	32,13	49,34	56,73
SELIC	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	5,97	1,29	3,88	8,78	23,00	40,28	49,45	60,68
IPCA + 5,00%	0,68	6,64	1,54	4,39	9,82	25,37	44,35	55,27	68,52
IPCA + 5,50%	0,72	6,98	1,66	4,64	10,34	26,57	46,42	58,24	72,56
IPCA + 5,89%	0,75	7,25	1,76	4,84	10,74	27,50	48,05	60,59	75,76
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51	61,26	76,67
INPC + 4,00%	0,56	5,52	1,03	3,59	8,20	22,46	40,61	50,54	61,62
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86	62,43	77,71

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%)	82.045.310,11	5,600000	83.351.604,94	5,404200	1.306.294,83
NTN-B 150545 (5,825500%)	51.376.272,97	5,825500	52.748.380,75	5,597500	1.372.107,78
NTN-B 150545 (5,890000%)	114.036.279,03	5,890000	118.016.323,55	5,597500	3.980.044,52
NTN-B 150555 (6,410000%)	51.661.178,75	6,410000	57.442.903,58	5,627600	5.781.724,83
NTN-B 150830 (5,530000%)	50.328.657,74	5,530000	51.127.139,89	5,243400	798.482,15
NTN-B 150840 (5,620000%)	94.658.559,35	5,620000	95.932.608,83	5,492000	1.274.049,48
NTN-B 150850 (5,761000%)	43.420.205,97	5,761000	44.133.618,57	5,636800	713.412,60
NTN-B 150850 (5,860000%)	43.315.464,05	5,860000	44.608.829,92	5,636800	1.293.365,87
NTN-B 150850 (6,151000%)	50.024.415,37	6,151000	53.489.614,37	5,636800	3.465.199,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1440	02/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.448,73	1.067,10183900	2,2947480000
1441	03/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	58.225,89	25.361,64020400	2,2958250000
1426	03/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	647.617,81	0,00	282.085,00647900	2,2958250000
1427	03/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	994,75	433,28649100	2,2958250000
1442	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	63.037,20	0,00	27.432,53728700	2,2978990000
1428	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	679,75	295,81368400	2,2978990000
1443	08/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	8.991.870,43	0,00	3.911.319,99382300	2,2989350000
1444	09/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.937,44	0,00	842,37437300	2,2999750000
1445	10/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	99.545,82	43.261,77684100	2,3010110000
1429	10/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	25.378,60	11.029,32558300	2,3010110000
1446	11/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	921,50	0,00	400,29521500	2,3020510000
1447	14/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	587.398,53	255.048,12431700	2,3030890000
1434	14/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	581.080,91	0,00	252.305,01730500	2,3030890000
1448	15/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	8.059.036,26	0,00	3.497.648,24901300	2,3041300000
1449	15/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	921,50	0,00	399,93403100	2,3041300000
1435	15/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	25.379,67	11.014,86001600	2,3041300000
1450	17/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	14.183.306,73	6.150.047,29668300	2,3062110000
1418	17/08/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	11.141.786,50	0,00	3.444.763,47461700	3,2344126330
1425	17/08/2023	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	3.041.791,56	0,00	1.428.024,09047400	2,1300702000
1436	18/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	9.466,58	4.102,96572000	2,3072530000
1451	21/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	212,67	0,00	92,13285800	2,3082970000
1437	21/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	500,00	216,60989800	2,3082970000
1452	25/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.701.359,48	735.731,29083500	2,3124740000
1422	25/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	199.964,56	0,00	76.258,01636000	2,6222103530
1438	25/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	70.297,06	30.399,06993700	2,3124740000
1423	28/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	189.701,29	72.311,35132200	2,6233957260
1453	29/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	147.268,43	63.626,74613400	2,3145680000
1424	29/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.263,27	3.910,41486600	2,6245987580

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1439	30/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	41.263,45	17.819,67406200	2,3156120000
Total			32.730.178,34	17.153.478,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.579.987,79

Value-At-Risk: 0,81%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO		0,81		0,81			1.180.319.558,33	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,19%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,600000%)		0,10	0,00	0,11			82.045.310,11	6,95
NTN-B 150545 (5,825500%)		0,26	-0,00	0,28			51.376.272,97	4,35
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,10	0,00	0,11			114.036.279,03	9,66
NTN-B 150555 (6,410000%)		0,10	0,00	0,11			51.661.178,75	4,38
NTN-B 150830 (5,530000%)		0,10	0,00	0,11			50.328.657,74	4,26
NTN-B 150840 (5,620000%)		0,10	0,00	0,11			94.658.559,35	8,02
NTN-B 150850 (5,761000%)		0,10	0,00	0,11			43.420.205,97	3,68
NTN-B 150850 (5,860000%)		0,10	0,00	0,11			43.315.464,05	3,67
NTN-B 150850 (6,151000%)		0,10	0,00	0,11			50.024.415,37	4,24
Sub-total	0,19	0,09	0,00		-2,06	0,74	580.866.343,34	49,21

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			6.957.559,52	0,59
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO		0,01	0,00	0,01			11.196.679,34	0,95
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,70	0,02	0,03			76.150.529,86	6,45
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		0,70	0,01	0,01			43.404.709,39	3,68
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,35	0,03	1,35			49.598.597,22	4,20
Sub-total	1,95	0,77	0,06		-0,28	0,59	187.308.075,33	15,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

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			2.082.491,43	0,18
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	-0,00	0,01			8.032.611,92	0,68
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			66.863.089,10	5,66
BB INSTITUCIONAL FI RF		0,04	0,00	0,04			38.442.082,86	3,26
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,53	0,01	0,55			47.977.653,44	4,06
Sub-total	0,32	0,16	0,01		-0,29	1,05	163.397.928,75	13,84

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	0,18			5.690.904,11	0,48
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a		0,11	0,00	0,11			11.091.217,49	0,94
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a		0,13	0,00	0,13			11.084.413,03	0,94
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a		0,13	0,00	0,13			9.058.921,80	0,77
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		0,13	0,00	0,13			9.086.330,40	0,77
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a		0,10	0,00	0,11			15.724.757,18	1,33
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a		0,16	0,00	0,18			3.249.112,21	0,28
Sub-total	0,23	0,11	0,00		-1,74	0,75	64.985.656,22	5,51

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			35.759,17	0,00
Sub-total	1,10	0,08	0,00		-0,73	0,33	35.759,17	0,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,39%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,58	0,17	3,74			29.800.162,06	2,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,99	0,09	2,76			18.869.447,14	1,60
BRADESCO F I A SELECTION		7,73	0,11	2,55			17.877.205,26	1,51
INDIE FIC FIA		8,87	0,12	4,65			18.075.506,67	1,53
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		7,23	0,01	1,95			2.765.980,22	0,23
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		7,99	0,13	4,43			21.908.261,96	1,86
Sub-total	13,20	7,39	0,63		-0,58	-6,52	109.296.563,31	9,26

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,78%

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		7,56	0,01	8,28			3.227.615,45	0,27
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		8,29	0,05	7,01			15.221.464,45	1,29
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,25	0,00	9,25			17.312.681,87	1,47
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		6,26	0,01	6,26			20.892.358,01	1,77
Sub-total	13,18	5,78	0,07		-0,03	0,71	56.654.119,78	4,80

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,22%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO		0,17	0,00	0,17			3.480.770,48	0,29
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		5,51	0,03	5,30			13.605.285,04	1,15
Sub-total	9,29	4,39	0,03		-0,16	-0,30	17.086.055,52	1,45

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA		4,83	-0,00	4,82			689.056,91	0,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	8,02	4,83	-0,00		-0,44	-2,39	689.056,91	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 (%)