



LDB
EMPRESAS

SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO
SETEMBRO 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 29.09.2023.

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

84,82%

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%)	0,37	0,04	0,68	8,12	82.605.411,91	6,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,825500%)	4,04	0,08	0,70	2,88	51.735.602,00	4,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,37	0,04	0,70	8,34	114.839.733,76	9,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,410000%)	3,09	0,04	0,74	5,38	52.045.380,21	4,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,530000%)	0,37	0,04	0,68	8,07	50.669.575,84	4,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	0,37	0,04	0,68	8,14	95.306.229,84	8,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	0,38	0,05	0,69	8,24	43.721.915,10	3,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	0,37	0,04	0,70	8,32	43.619.637,72	3,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,151000%)	0,37	0,05	0,72	7,84	50.386.681,68	4,23
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,37	0,04	0,70	8,28	584.930.168,06	49,12

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	0,97	2,70	7.025.394,52	0,59	39.295.223.216,04	0,02
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,02	0,05	0,97	1,47	55.287.984,13	4,64	30.629.902.188,38	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,19	0,22	0,11	8,79	76.235.751,71	6,40	8.162.684.334,70	0,93
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,20	0,22	0,11	8,70	43.454.106,00	3,65	1.119.712.182,35	3,88

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	3,86	0,41	-0,30	11,35	49.450.193,34	4,15	2.195.169.805,31	2,25
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,71	0,22	0,26	9,64	231.453.429,70	19,44		

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				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,13	0,21	-0,57	-0,57	3.404.597,08	0,29	877.465.492,31	0,39
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	0,90	9,12	2.102.879,96	0,18	3.380.807.738,12	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	-0,04	0,90	8,67	6.814.881,80	0,57	861.359.920,43	0,79
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	1,05	10,30	67.564.747,86	5,67	8.906.699.435,49	0,76
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,26	0,00	0,45	8,86	0,00	0,00	2.124.288.238,19	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,50	0,16	0,45	10,01	48.194.638,05	4,05	754.235.941,18	6,39
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,43	0,10	0,79	9,93	128.081.744,75	10,76		

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	0,87	-0,03	0,68	8,95	5.729.549,95	0,48		
BRADESCO	BRADESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	0,38	0,03	0,72	8,61	11.171.359,27	0,94		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 6,25% a.a	0,38	0,04	0,73	8,63	11.165.738,58	0,94		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a. a	0,39	0,04	0,73	8,59	9.124.842,19	0,77		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a. a	0,39	0,03	0,73	8,74	9.152.877,12	0,77		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	0,37	0,04	0,73	8,63	15.839.935,85	1,33		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	0,90	-0,04	0,72	9,44	3.272.467,00	0,27		

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 IV	0,40	0,03	0,72	8,70	65.456.769,96	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	19,53	11,76	11,76	-2,77	39.965,89	0,00	21.682.339,69	0,18
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	19,53	11,76	11,76	-2,77	39.965,89	0,00		
		Renda Fixa	0,73	0,09	0,61	8,78	1.009.962.078,36	84,82		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

9,16%

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	19,99	0,58	0,62	2,66	29.985.988,02	2,52	1.378.543.679,32	2,18
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,39	0,40	-0,20	-4,19	18.831.178,82	1,58	1.385.431.873,10	1,36
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	19,69	0,90	-0,96	0,53	17.705.406,38	1,49	431.844.819,05	4,10
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	23,86	1,04	1,00	15,12	18.256.903,76	1,53	401.185.094,20	4,55
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	21,64	0,80	-1,20	7,77	2.732.734,26	0,23	283.428.846,96	0,96
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22,62	0,53	-1,47	0,02	21.586.548,98	1,81	638.456.191,88	3,38
Sub-total Artigo 8º I			19,87	0,67	-0,18	2,49	109.098.760,22	9,16		
Renda Variável			19,87	0,67	-0,18	2,49	109.098.760,22	9,16		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,57%

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	17,05	0,75	-2,79	5,17	3.137.591,58	0,26	46.373.358,90	6,77
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	23,18	0,45	-5,72	23,57	14.351.549,19	1,21	219.244.938,37	6,55
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,81	2,40	-3,77	22,95	16.659.763,88	1,40	634.297.137,32	2,63
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17,79	0,02	-2,79	2,04	20.309.617,22	1,71	602.541.574,43	3,37
Sub-total Artigo 9º II			18,57	0,89	-3,88	13,34	54.458.521,87	4,57		
Investimentos no Exterior			18,57	0,89	-3,88	13,34	54.458.521,87	4,57		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,44%

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	0,42	0,06	1,01	8,97	3.515.836,57	0,30	743.656.002,66	0,47
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	17,00	-0,24	-4,39	18,26	13.008.476,96	1,09	499.498.993,21	2,60
Sub-total Artigo 10º I			14,73	-0,18	-3,29	15,56	16.524.313,53	1,39		

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	8,23	-2,03	-2,03	-10,08	675.084,43	0,06	121.330.556,37	0,56
Sub-total Artigo 10º II			8,23	-2,03	-2,03	-10,08	675.084,43	0,06		

Investimentos Estruturados			14,65	-0,25	-3,24	14,66	17.199.397,96	1,44		
-----------------------------------	--	--	--------------	--------------	--------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

Total			2,29	0,17	0,27	8,42	1.190.718.758,41	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	584.930.168,06	49,12	30,00	50,00	85,00	52,68	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	231.453.429,70	19,44	5,00	12,50	30,00	1,65	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	128.081.744,75	10,76	5,00	15,00	30,00	15,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	65.456.769,96	5,50	3,00	6,00	10,00	5,76	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	39.965,89	0,00	0,00	0,10	0,20	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	1.009.962.078,36	84,82					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	109.098.760,22	9,16	3,00	7,00	15,00	4,92	30,00
	Total Renda Variável	109.098.760,22	9,16					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	54.458.521,87	4,57	3,00	6,90	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	54.458.521,87	4,57					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	16.524.313,53	1,39	0,50	2,30	5,00	10,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	675.084,43	0,06	0,10	0,20	2,50	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	17.199.397,96	1,44					15,00
Total		1.190.718.758,41	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	0,70 71,78	8,28 83,42	1,93 59,96	4,47 69,13	10,98 81,64	4.063.824,72	41.401.691,92
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,26 26,45	9,64 97,13	1,78 55,24	5,35 82,73	11,11 82,61	393.760,78	16.564.468,36
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,79 80,90	9,93 100,03	2,96 91,89	6,56 101,41	13,13 97,64	1.198.467,43	15.876.578,88
Artigo 7º IV % do CDI	0,72 74,38	8,70 87,68	2,00 62,01	4,81 74,40	11,40 84,84	471.113,74	5.241.380,15
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	11,76 1.206,96	-2,77 -27,94	13,22 410,48	13,75 212,62	-1,64 -12,24	4.206,72	-1.140,06
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,18 -0,89	2,49 -3,74	-3,74 -2,45	11,92 -2,50	0,36 -5,57	-197.803,09	2.646.969,09
Artigo 9º II % do CDI	-3,88 -397,61	13,34 134,32	0,44 13,56	4,38 67,73	19,20 142,83	-2.195.597,91	6.407.623,23
Artigo 10º I % do CDI	-3,29 -337,31	15,56 156,75	-0,69 -21,32	7,82 120,90	27,56 205,00	-561.741,99	1.801.344,03
Artigo 10º II % do CDI	-2,03 -208,04	-10,08 -194,68	-5,82 -180,71			-13.972,48	-75.672,38
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)						3.162.257,92	89.863.243,22

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,600000%)	82.045.310,11	0,00	0,00	0,00	82.605.411,91	560.101,80	6.317.784,97
NTN-B 150545 (5,825500%)	51.376.272,97	0,00	0,00	0,00	51.735.602,00	359.329,03	1.447.048,02
NTN-B 150545 (5,890000%)	114.036.279,03	0,00	0,00	0,00	114.839.733,76	803.454,73	9.006.109,22
NTN-B 150555 (6,410000%)	51.661.178,75	0,00	0,00	0,00	52.045.380,21	384.201,46	2.689.073,76
NTN-B 150830 (5,530000%)	50.328.657,74	0,00	0,00	0,00	50.669.575,84	340.918,10	3.898.890,33
NTN-B 150840 (5,620000%)	94.658.559,35	0,00	0,00	0,00	95.306.229,84	647.670,49	7.388.186,72
NTN-B 150850 (5,761000%)	43.420.205,97	0,00	0,00	0,00	43.721.915,10	301.709,13	3.431.140,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (5,860000%)	43.315.464,05	0,00	0,00	0,00	43.619.637,72	304.173,67	3.453.649,86
NTN-B 150850 (6,151000%)	50.024.415,37	0,00	0,00	0,00	50.386.681,68	362.266,31	3.769.808,88
					584.930.168,06	4.063.824,72	

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	11.196.679,34	43.751.593,59	0,00	0,00	55.287.984,13	339.711,20	394.604,04
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	76.150.529,86	0,00	0,00	0,00	76.235.751,71	85.221,85	6.345.342,40
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	49.598.597,22	0,00	0,00	0,00	49.450.193,34	-148.403,88	5.643.902,58
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	6.957.559,52	0,00	0,00	0,00	7.025.394,52	67.835,00	184.394,52
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	43.404.709,39	0,00	0,00	0,00	43.454.106,00	49.396,61	3.478.425,30
					231.453.429,70	393.760,78	

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	38.442.082,86	0,00	-38.615.340,68	0,00	0,00	173.257,82	2.527.134,36
BB PREV RF FLUXO FIC	2.082.491,43	3.893.593,59	-3.893.593,59	0,00	2.102.879,96	20.388,53	285.472,33
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	66.863.089,10	0,00	0,00	0,00	67.564.747,86	701.658,76	7.934.739,32
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,00	3.424.168,61	0,00	0,00	3.404.597,08	-19.571,53	-19.571,53
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	8.032.611,92	10.721.808,86	-12.045.288,22	0,00	6.814.881,80	105.749,24	764.435,01
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	47.977.653,44	0,00	0,00	0,00	48.194.638,05	216.984,61	4.384.369,39
					128.081.744,75	1.198.467,43	

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	11.091.217,49	0,00	0,00	0,00	11.171.359,27	80.141,78	885.131,87
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	9.058.921,80	0,00	0,00	0,00	9.124.842,19	65.920,39	721.711,05
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	5.690.904,11	0,00	0,00	0,00	5.729.549,95	38.645,84	470.867,88
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	11.084.413,03	0,00	0,00	0,00	11.165.738,58	81.325,55	887.520,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	15.724.757,18	0,00	0,00	0,00	15.839.935,85	115.178,67	1.257.718,47
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	9.086.330,40	0,00	0,00	0,00	9.152.877,12	66.546,72	736.040,96
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	3.249.112,21	0,00	0,00	0,00	3.272.467,00	23.354,79	282.388,96
					65.456.769,96	471.113,74	

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	35.759,17	0,00	0,00	0,00	39.965,89	4.206,72	-1.140,06
					39.965,89	4.206,72	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRDESCO F I A SELECTION	17.877.205,26	0,00	0,00	0,00	17.705.406,38	-171.798,88	93.929,81
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	29.800.162,06	0,00	0,00	0,00	29.985.988,02	185.825,96	777.701,90
INDIE FIC FIA	18.075.506,67	0,00	0,00	0,00	18.256.903,76	181.397,09	2.397.372,47
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18.869.447,14	0,00	0,00	0,00	18.831.178,82	-38.268,32	-822.992,74
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.765.980,22	0,00	0,00	0,00	2.732.734,26	-33.245,96	197.007,92
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	21.908.261,96	0,00	0,00	0,00	21.586.548,98	-321.712,98	3.949,73
					109.098.760,22	-197.803,09	

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	3.227.615,45	0,00	0,00	0,00	3.137.591,58	-90.023,87	154.183,10
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	15.221.464,45	0,00	0,00	0,00	14.351.549,19	-869.915,26	2.737.547,47
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17.312.681,87	0,00	0,00	0,00	16.659.763,88	-652.917,99	3.109.466,32
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20.892.358,01	0,00	0,00	0,00	20.309.617,22	-582.740,79	406.426,34
					54.458.521,87	-2.195.597,91	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13.605.285,04	0,00	0,00	0,00	13.008.476,96	-596.808,08	1.512.021,56
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	3.480.770,48	0,00	0,00	0,00	3.515.836,57	35.066,09	289.322,47
					16.524.313,53	-561.741,99	

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	689.056,91	0,00	0,00	0,00	675.084,43	-13.972,48	-75.672,38
					675.084,43	-13.972,48	

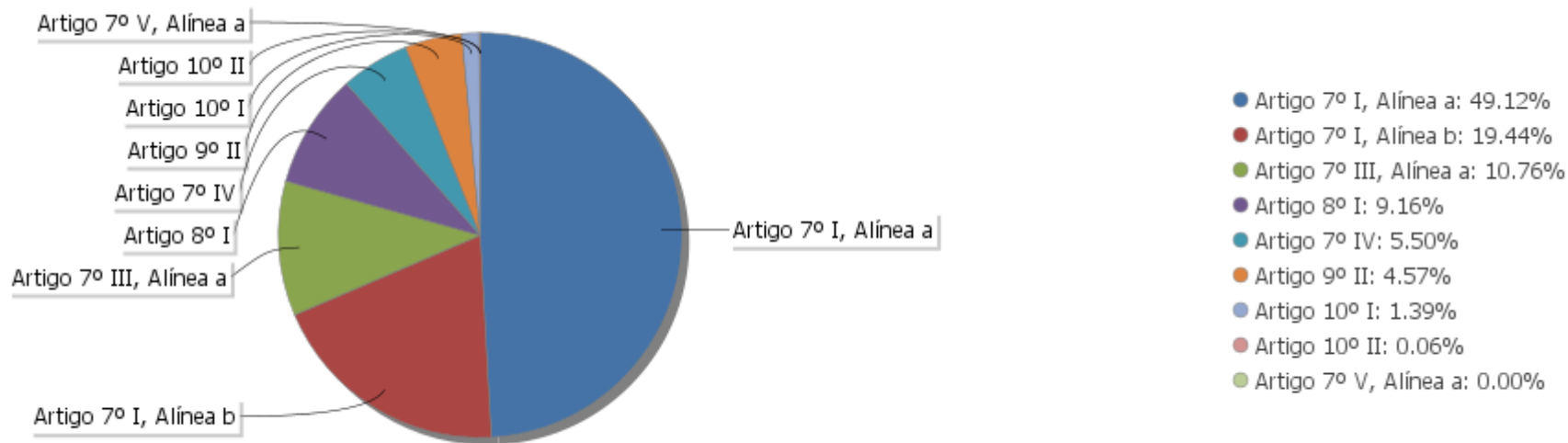
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

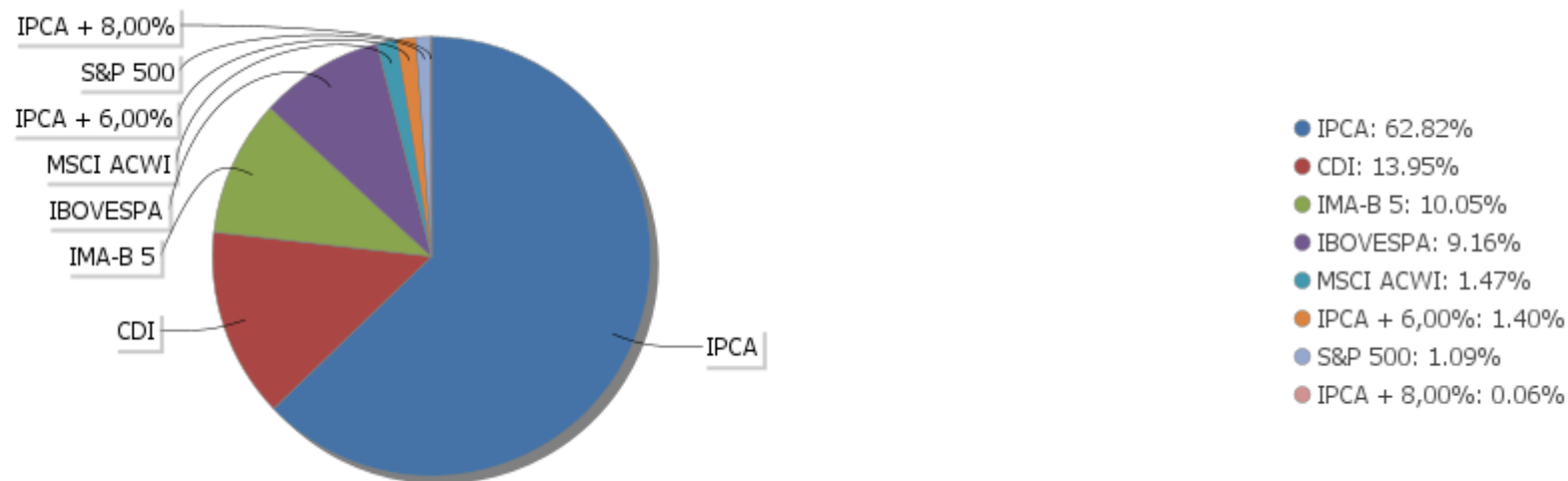
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	448.263.382,12	37,65	448.263.382,12	37,65	
de 31 a 365 dias	91.393.353,84	7,68	539.656.735,96	45,32	
de 1 a 5 anos	65.456.769,96	5,50	605.113.505,92	50,82	
de 5 a 10 anos	51.344.660,27	4,31	656.458.166,19	55,13	
de 10 a 20 anos	177.911.641,75	14,94	834.369.807,94	70,07	
acima de 20 anos	356.348.950,47	29,93	1.190.718.758,41	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

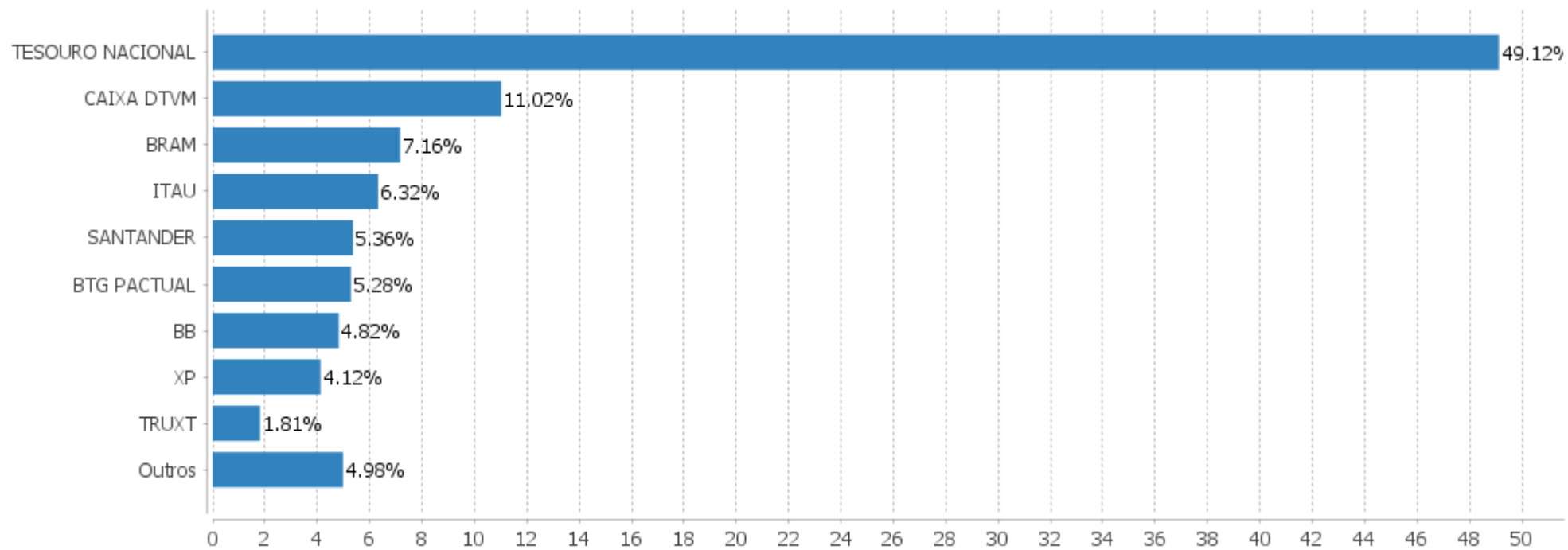


Alocação Por Estratégia



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	0,27				8,42
INPC + 5,10%	0,90	1,13	1,10	0,89	0,80	0,31	0,33	0,66	0,51				6,80
p.p. indexador	0,82	-1,12	-0,15	-0,03	0,84	1,28	0,75	-0,63	-0,24				1,61
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

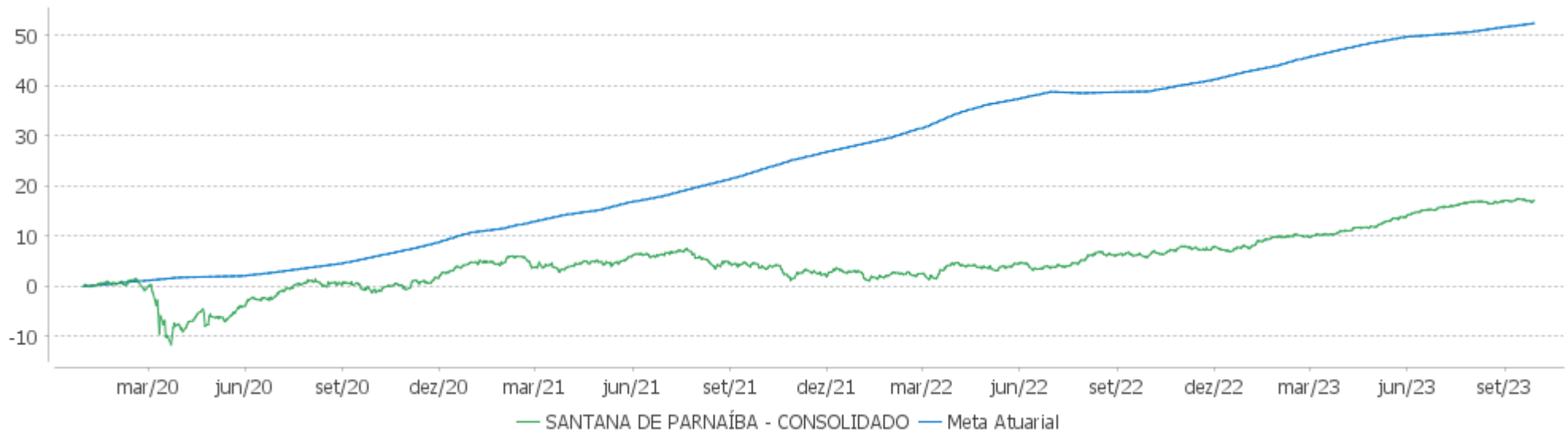
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

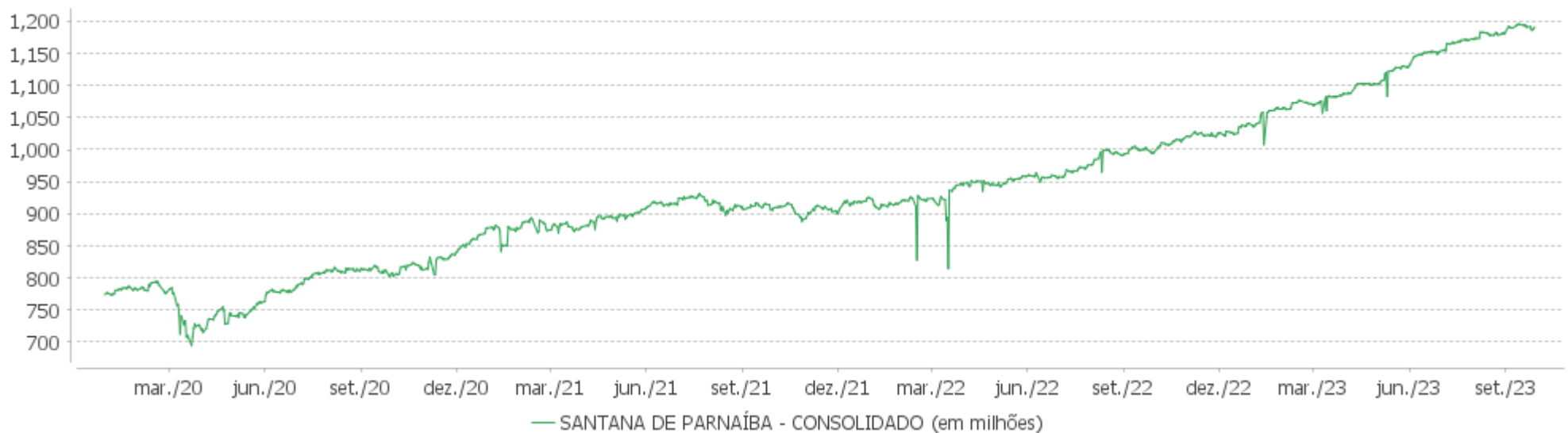
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	31,11	03 meses	1,38	1,49	-0,12	1,77
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	68,89	06 meses	5,58	3,54	2,04	1,78
			12 meses	10,57	9,75	0,82	2,29
			24 meses	13,03	23,60	-10,57	3,25
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12	36 meses	18,10	44,48	-26,38	3,71
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03	Desde 31/12/2019	17,21	53,84	-36,63	6,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

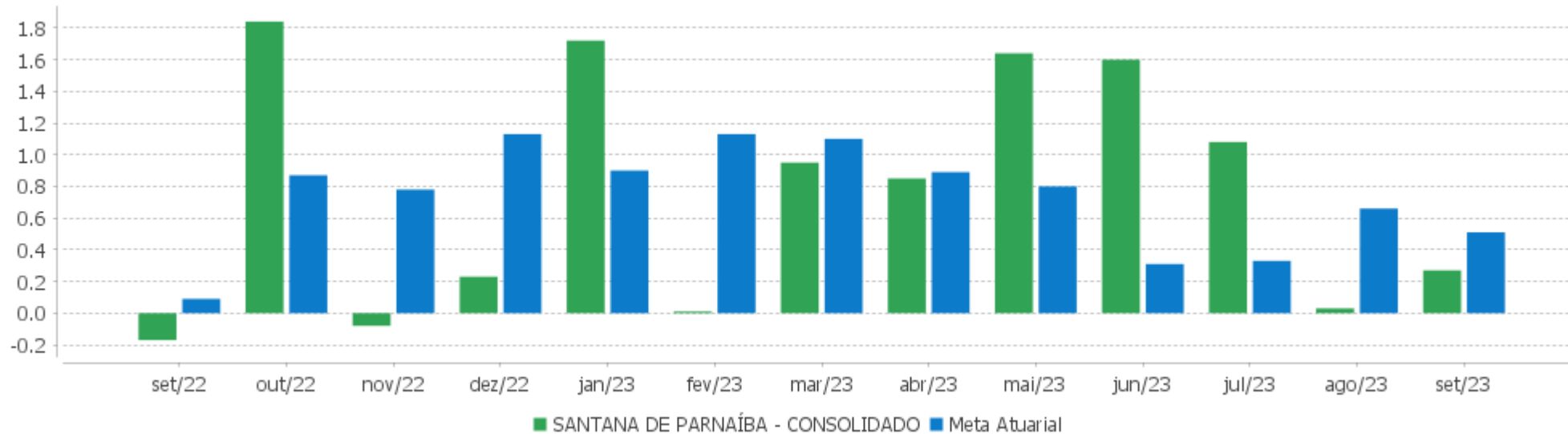


Patrimônio Líquido



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.	0,68 0,42	8,95 5,45	1,88 1,27	5,28 3,90	11,09 5,90		
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA p.p.	0,72 0,46	8,61 5,11	1,99 1,38	4,71 3,33	11,37 6,18		
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	8,63 5,14	2,00 1,39	4,73 3,35	11,41 6,22		
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	8,59 5,09	1,98 1,36	4,70 3,33	11,33 6,14		
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a Var. IPCA p.p.	0,72 0,46	9,44 5,95	2,03 1,42	5,62 4,24	11,71 6,53		
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	8,74 5,25	2,00 1,39	4,80 3,42	11,50 6,32		
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	8,63 5,13	2,04 1,43	4,68 3,30	11,47 6,28		
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,43	8,24 4,75	1,92 1,30	4,44 3,06	10,95 5,76	23,06 10,33	35,42 11,14
NTN-B 150545 (5,825500%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	5,30 1,80	1,93 1,32	1,58 0,20	4,91 -0,27		
NTN-B 150840 (5,620000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,42	8,14 4,64	1,88 1,27	4,37 2,99	10,80 5,62	26,22 13,49	38,79 14,51
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,42	8,12 4,62	1,88 1,26	4,36 2,98	10,78 5,60	22,68 9,95	34,83 10,55
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,32 4,82	1,94 1,33	4,48 3,11	11,05 5,87	23,22 10,50	35,63 11,35
NTN-B 150555 (6,410000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,48	8,74 5,24	2,07 1,46	4,75 3,38	8,25 3,06	16,83 4,10	
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,34 4,84	1,95 1,34	4,50 3,12	11,08 5,90	23,27 10,55	35,68 11,40
NTN-B 150830 (5,530000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,42	8,07 4,57	1,86 1,25	4,32 2,95	10,71 5,52	26,00 13,28	38,35 14,08
NTN-B 150850 (6,151000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,46	8,56 5,06	2,01 1,40	4,63 3,25	11,37 6,18	20,16 7,44	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	8,79	1,67	4,28	11,46	21,66	28,58

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	-0,10	-0,06	-0,04	-0,19	-0,31	-0,64
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,11	8,70	1,67	4,20	11,40	21,46	28,40
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,19	-0,06	-0,11	-0,25	-0,51	-0,82
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,97	9,90	3,21	6,45	13,41	25,83	29,62
% do CDI	99,97	99,74	99,62	99,78	99,73	100,11	100,17
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,97	9,89	3,21	6,45	13,38	25,76	29,40
% do CDI	100,03	99,64	99,65	99,76	99,51	99,82	99,43
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	-0,30	11,35	0,97	6,94	10,76	22,65	25,99
Var. IPCA p.p.	-0,56	7,85	0,36	5,56	5,57	9,93	1,71
FIDC ITALIA SENIOR	11,76	-2,77	13,22	13,75	-1,64	27,91	68,88
% do CDI	1.206,96	-27,94	410,48	212,62	-12,24	108,18	232,98
BB INSTITUCIONAL FI RF	1,00	9,45	3,30	6,60	12,99	25,78	30,12
% do CDI	102,19	95,15	102,61	102,11	96,65	99,91	101,86
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,05	10,30	3,54	6,88	13,98	27,19	31,34
% do CDI	107,67	103,80	109,96	106,36	104,03	105,36	105,99
BB PREV RF FLUXO FIC	0,90	9,12	2,96	5,95	12,33	23,32	25,64
% do CDI	91,93	91,85	91,98	91,99	91,75	90,39	86,73
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	-0,03	10,08	2,19	6,37			
% do CDI	-2,75	101,49	68,15	98,58			
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,90	8,77	2,96	5,82	11,77	22,06	24,55
% do CDI	92,03	88,30	91,98	89,95	87,52	85,49	83,03
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,45	10,01	2,08	6,48	12,18	23,72	24,63
Var. IPCA p.p.	0,19	6,51	1,47	5,10	6,99	10,99	0,36
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	0,62	2,66	-3,74	10,79	-1,41	-21,17	-24,97
Var. IBOVESPA p.p.	-0,09	-3,56	-2,45	-3,62	-7,34	-26,20	-48,19
BRADESCO F I A SELECTION	-0,96	0,53	-4,77	8,93	-0,40	-1,54	7,08
Var. IBOVESPA p.p.	-1,67	-5,69	-3,48	-5,48	-6,33	-6,58	-16,14
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	-1,20	7,77	-1,54	14,21	-0,24	-19,93	-9,47
Var. IBOVESPA p.p.	-1,91	1,54	-0,25	-0,20	-6,17	-24,96	-32,69
INDIE FIC FIA	1,00	15,12	-2,12	26,25	9,41	-20,62	-13,28
Var. IBOVESPA p.p.	0,29	8,89	-0,83	11,84	3,47	-25,65	-36,50
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	-1,47	0,02	-5,38	11,92	-1,90	-14,12	3,21
Var. IBOVESPA p.p.	-2,18	-6,21	-4,09	-2,49	-7,84	-19,16	-20,00
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-0,20	-4,19	-2,66	4,48	-1,31	-7,29	10,57
Var. IBOVESPA p.p.	-0,91	-10,41	-1,37	-9,93	-7,25	-12,32	-12,64
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-5,72	23,57	-0,38	8,15	26,65	-18,22	2,39

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.	-3,11	19,44	-0,33	8,05	16,72	-3,44	-0,78
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	-2,79	5,17	-2,41	-2,03	15,30	-13,95	-1,78
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,18	1,04	-2,36	-2,13	5,36	0,83	-4,96
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-2,79	2,04	1,01	1,13	10,84	-19,00	-2,11
% do CDI	-286,17	20,57	31,38	17,45	80,64	-73,63	-7,13
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-3,77	22,95	1,01	6,67	25,17	-31,61	-25,87
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-4,50	14,85	-1,11	2,32	13,72	-58,21	-73,78
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,01	8,97	2,96	6,00	11,95	25,57	29,40
% do CDI	103,36	90,32	92,01	92,85	88,87	99,08	99,43
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-4,39	18,26	-1,76	8,64	30,05	23,09	62,53
Var. S&P 500 p.p.	-1,17	11,08	-1,88	5,79	19,28	31,44	49,33
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	-2,03	-10,08	-5,82				
Var. IPCA + 8,00% p.p.	-2,90	-14,02	-8,42				
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO	0,27	8,42	1,38	5,58	10,57	13,03	18,10
Var. INPC + 5,10% p.p.	-0,24	1,61	-0,12	2,04	0,78	-10,66	-25,88
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91

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
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 EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	D+0	D+0	D+0	D+1	O fundo cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o indice CDIE. A taxa de performance sera paga no(s) mes (es) de Janeiro e Julho	0,40
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 cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o indice IBX_FEC. A taxa de	1,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro e Julho	
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	1,90
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	0,93	10,06	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	12,82	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	11,62	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	8,89	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	10,59	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	8,97	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	15,28	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	5,50	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	4,92	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	5,06	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-4,75	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	10,67	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

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	-3,22	7,19	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	12,28	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	4,13	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	3,50	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	2,91	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-4,93	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	6,57	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	7,34	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	7,72	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	8,01	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	5,97	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70	62,65	77,41

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%)	82.605.411,91	5,600000	82.038.565,81	5,686500	-566.846,10
NTN-B 150545 (5,825500%)	51.735.602,00	5,825500	51.715.171,62	5,825200	-20.430,38
NTN-B 150545 (5,890000%)	114.839.733,76	5,890000	115.704.678,31	5,825200	864.944,55
NTN-B 150555 (6,410000%)	52.045.380,21	6,410000	55.995.273,40	5,862000	3.949.893,19
NTN-B 150830 (5,530000%)	50.669.575,84	5,530000	50.510.540,98	5,588200	-159.034,86
NTN-B 150840 (5,620000%)	95.306.229,84	5,620000	93.772.067,97	5,777400	-1.534.161,87
NTN-B 150850 (5,761000%)	43.721.915,10	5,761000	43.192.609,74	5,853300	-529.305,36
NTN-B 150850 (5,860000%)	43.619.637,72	5,860000	43.657.688,71	5,853300	38.050,99
NTN-B 150850 (6,151000%)	50.386.681,68	6,151000	52.349.118,73	5,853300	1.962.437,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1459	01/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.200,62	1.380,94068100	2,3177100000
1460	04/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	9.007.347,99	0,00	3.884.558,83475500	2,3187570000
1474	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	586.068,65	0,00	252.636,59637400	2,3198090000
1461	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	674.813,71	290.891,92773900	2,3198090000
1475	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	29.082,38	12.530,88562000	2,3208560000
1462	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	108.026,13	46.545,81318200	2,3208560000
1463	08/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	484,36	0,00	208,60439200	2,3219070000
1473	11/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	647.617,81	0,00	278.790,63037800	2,3229540000
1476	11/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	34.030,63	14.649,72041800	2,3229540000
1464	11/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	11.825,58	0,00	5.090,75082800	2,3229540000
1477	13/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.141,20	1.781,12110800	2,3250520000
1465	13/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	921,50	0,00	396,33522100	2,3250520000
1455	14/09/2023	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,00	38.615.340,68	3.287.206,20990537	11,7471610280
1456	14/09/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	34.732.010,36	0,00	10.639.345,68220000	3,2644874410
1482	14/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.883.330,32	0,00	1.472.260,58928900	2,6376650630
1466	14/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	59.993,16	25.791,28494300	2,3261020000
1457	15/09/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	9.019.583,23	0,00	2.761.619,43033700	3,2660485840
1478	15/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	25.108,59	10.789,41713500	2,3271500000
1483	15/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.883.330,32	1.471.610,32217500	2,6388305800
1458	15/09/2023	BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	3.424.168,61	0,00	3.066.821,35857100	1,1165204000
1467	15/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	8.567.019,97	3.681.335,52491300	2,3271500000
1468	18/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.708,39	733,78052800	2,3282030000
1479	19/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.670,57	717,21307500	2,3292520000
1469	19/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	62.763,21	26.945,65035600	2,3292520000
1470	26/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	231.422,17	0,00	99.135,61086300	2,3344000000
1480	26/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.303.133,24	986.606,08226200	2,3344000000
1471	27/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	236.120,80	0,00	101.104,60214400	2,3354110000
1484	27/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	10.263,27	0,00	3.875,48635700	2,6482534200

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1472	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	164.176,42	70.268,24674300	2,3364240000
1481	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.420,00	2.747,78881500	2,3364240000
1485	28/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.263,27	3.873,77021800	2,6494266370
Total			61.791.164,65	54.554.222,49		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.822.969,00

Value-At-Risk: 0,82%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO		0,82		0,82			1.190.718.758,41	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%)		0,07	0,00	0,07			82.605.411,91	6,94
NTN-B 150545 (5,825500%)		0,31	-0,00	0,31			51.735.602,00	4,34
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,07	0,00	0,07			114.839.733,76	9,64
NTN-B 150555 (6,410000%)		0,07	0,00	0,07			52.045.380,21	4,37
NTN-B 150830 (5,530000%)		0,07	0,00	0,07			50.669.575,84	4,26
NTN-B 150840 (5,620000%)		0,07	0,00	0,07			95.306.229,84	8,00
NTN-B 150850 (5,761000%)		0,10	0,00	0,09			43.721.915,10	3,67
NTN-B 150850 (5,860000%)		0,07	0,00	0,07			43.619.637,72	3,66
NTN-B 150850 (6,151000%)		0,10	0,00	0,09			50.386.681,68	4,23
Sub-total	0,14	0,07	0,00		-1,98	0,70	584.930.168,06	49,12

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		0,02	0,00	0,02			7.025.394,52	0,59
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO		0,01	0,00	0,01			55.287.984,13	4,64
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,78	0,02	0,03			76.235.751,71	6,40
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		0,78	0,01	0,01			43.454.106,00	3,65
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,29	0,03	1,30			49.450.193,34	4,15
Sub-total	1,80	0,65	0,07		-0,40	0,26	231.453.429,70	19,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP		0,61	0,00	0,61			3.404.597,08	0,29
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			2.102.879,96	0,18
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	0,00	0,01			6.814.881,80	0,57
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,02	-0,00	0,02			67.564.747,86	5,67
BB INSTITUCIONAL FI RF		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,58	0,01	0,60			48.194.638,05	4,05
Sub-total	0,49	0,23	0,01		-0,38	0,79	128.081.744,75	10,76

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	0,14			5.729.549,95	0,48
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a		0,10	0,00	0,10			11.171.359,27	0,94
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a		0,10	0,00	0,10			11.165.738,58	0,94
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a		0,12	0,00	0,11			9.124.842,19	0,77
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		0,12	0,00	0,12			9.152.877,12	0,77
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a		0,07	0,00	0,07			15.839.935,85	1,33
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a		0,13	0,00	0,14			3.272.467,00	0,27
Sub-total	0,14	0,09	0,00		-1,83	0,72	65.456.769,96	5,50

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		0,58	0,00	0,58			39.965,89	0,00
Sub-total	39,48	0,58	0,00		0,27	11,76	39.965,89	0,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,23%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,28	0,17	3,79			29.985.988,02	2,52
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,46	0,08	2,87			18.831.178,82	1,58
BRDESCO F I A SELECTION		7,66	0,11	2,69			17.705.406,38	1,49
INDIE FIC FIA		8,79	0,12	4,68			18.256.903,76	1,53
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		7,35	0,02	2,09			2.732.734,26	0,23
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		7,96	0,13	3,95			21.586.548,98	1,81
Sub-total	16,25	7,23	0,62		-0,07	-0,18	109.098.760,22	9,16

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,52%

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		7,26	0,01	7,85			3.137.591,58	0,26
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		7,78	0,05	6,63			14.351.549,19	1,21
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,21	0,02	9,21			16.659.763,88	1,40
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		5,10	0,01	5,10			20.309.617,22	1,71
Sub-total	9,13	5,52	0,09		-0,53	-3,88	54.458.521,87	4,57

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,97%

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			3.515.836,57	0,30
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		5,24	0,03	5,31			13.008.476,96	1,09
Sub-total	8,46	4,13	0,03		-0,50	-3,29	16.524.313,53	1,39

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA		5,10	-0,00	5,10			675.084,43	0,06
Sub-total	7,27	5,10	-0,00		-0,41	-2,03	675.084,43	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 (%)