



**SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO**  
MARÇO 2024



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 28.03.2024.

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

#### RENTA FIXA

84,44%

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%)	0,42	0,03	0,99	3,04	84.676.728,67	6,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,605000%)	4,01	-0,01	0,99	1,49	15.929.455,01	1,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,825500%)	2,93	0,08	1,00	3,09	53.107.158,94	4,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,56	0,03	1,01	3,10	117.896.313,53	8,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,410000%)	0,66	0,04	1,05	3,23	53.478.407,23	4,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,530000%)	0,36	0,03	0,98	3,02	51.890.764,71	3,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	0,48	0,03	0,99	3,04	97.757.418,78	7,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	0,62	0,05	1,00	3,07	44.893.531,85	3,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,855000%)	2,94	-0,03	1,01	3,09	50.883.359,55	3,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	0,60	0,03	1,01	3,10	44.793.817,00	3,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,151000%)	0,64	0,05	1,03	3,17	51.759.704,06	3,91
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,53	0,03	1,00	3,09	667.066.659,33	50,36

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	0,06	0,04	0,75	2,52	28.367.008,71	2,14	40.444.383.750,43	0,07

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,06	0,04	0,83	2,62	69.406.691,01	5,24	31.189.795.207,98	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,68	0,08	0,75	2,01	34.060.932,03	2,57	7.792.392.111,13	0,44
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,69	0,08	0,75	1,99	45.609.104,89	3,44	1.269.573.693,69	3,59
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,68	0,03	0,55	1,59	64.019.100,40	4,83	2.398.945.450,00	2,67
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,57</b>	<b>0,05</b>	<b>0,73</b>	<b>2,14</b>	<b>241.462.837,04</b>	<b>18,23</b>		

### 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	1,18	0,00	0,71	2,29	3.580.764,50	0,27	903.504.638,73	0,40
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,04	0,75	2,38	2.209.010,58	0,17	4.354.660.093,34	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,04	0,75	2,46	12.898.680,96	0,97	1.092.831.104,05	1,18
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	0,91	2,92	71.631.976,59	5,41	10.645.688.775,75	0,67
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,05	0,03	0,62	2,17	50.492.087,81	3,81	750.127.183,13	6,73
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,37</b>	<b>0,04</b>	<b>0,79</b>	<b>2,58</b>	<b>140.812.520,44</b>	<b>10,63</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a. a	0,56	0,09	1,11	3,10	6.042.445,48	0,46		
BRADERSCO	BRADERSCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADERSCO SA 6,23% a.a	0,27	0,07	1,07	3,19	11.797.349,86	0,89		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 6,25% a.a	0,27	0,08	1,08	3,22	11.792.903,82	0,89		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a. a	0,27	0,08	1,08	3,22	9.635.636,62	0,73		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a. a	16,07	0,11	1,12	3,28	9.674.510,27	0,73		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA	1,25	0,04	1,04	2,59	16.729.908,34	1,26		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		6,26% a.a								
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	0,58	0,08	1,15	3,23	3.460.789,19	0,26		
		<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>	<b>2,16</b>	<b>0,07</b>	<b>1,08</b>	<b>3,06</b>	<b>69.133.543,58</b>	<b>5,22</b>		
Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	111,75	0,30	0,30	1,74	111.740,46	0,01	60.439.905,56	0,18
		<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>	<b>111,75</b>	<b>0,30</b>	<b>0,30</b>	<b>1,74</b>	<b>111.740,46</b>	<b>0,01</b>		
		<b>Renda Fixa</b>	<b>0,54</b>	<b>0,04</b>	<b>0,92</b>	<b>2,82</b>	<b>1.118.587.300,85</b>	<b>84,44</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL

9,15%

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	16,21	0,24	0,22	-0,80	33.556.827,86	2,53	1.424.304.935,88	2,36
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	13,98	0,47	0,97	1,44	22.219.379,87	1,68	1.248.705.426,92	1,78
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	15,41	0,16	-0,59	-3,02	19.214.694,41	1,45	398.262.458,88	4,82
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	19,02	0,92	1,84	-2,30	19.595.441,74	1,48	357.933.959,90	5,47
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	16,79	0,89	1,32	-0,88	3.057.140,68	0,23	303.512.449,53	1,01
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	16,66	0,35	1,67	-2,12	23.608.153,45	1,78	419.858.313,43	5,62
Sub-total Artigo 8º I			15,33	0,42	0,79	-1,27	121.251.638,01	9,15		
Renda Variável			15,33	0,42	0,79	-1,27	121.251.638,01	9,15		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,03%

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	14,61	0,34	3,96	2,00	3.369.141,85	0,25	40.063.116,83	8,41
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	15,66	0,03	-0,65	5,12	17.373.746,34	1,31	235.599.510,69	7,37
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,82	1,35	2,16	15,24	21.552.004,24	1,63	769.263.355,99	2,80
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,17	0,83	3,86	11,90	24.358.386,69	1,84	646.788.412,13	3,77
Sub-total Artigo 9º II			11,78	0,76	2,11	10,54	66.653.279,12	5,03		
Investimentos no Exterior			11,78	0,76	2,11	10,54	66.653.279,12	5,03		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,38%

#### 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	0,34	0,05	0,75	2,23	3.693.660,40	0,28	602.198.642,96	0,61
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	11,50	0,14	3,44	11,26	13.940.565,71	1,05	648.677.226,01	2,15
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>8,85</b>	<b>0,12</b>	<b>2,86</b>	<b>9,24</b>	<b>17.634.226,11</b>	<b>1,33</b>		

#### Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	8,39	-2,38	-2,38	-6,87	582.792,84	0,04	122.656.310,27	0,48
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>8,39</b>	<b>-2,38</b>	<b>-2,38</b>	<b>-6,87</b>	<b>582.792,84</b>	<b>0,04</b>		

<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>8,54</b>	<b>0,04</b>	<b>2,69</b>	<b>8,64</b>	<b>18.217.018,95</b>	<b>1,38</b>		
-----------------------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-------------	----------------------	-------------	--	--

<b>Total</b>			<b>1,82</b>	<b>0,11</b>	<b>0,99</b>	<b>2,86</b>	<b>1.324.709.236,93</b>	<b>100,00</b>		
--------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-------------	-------------------------	---------------	--	--



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	667.066.659,33	50,36	30,00	53,00	85,00	52,68	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	241.462.837,04	18,23	5,00	10,15	30,00	1,65	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	140.812.520,44	10,63	5,00	15,00	30,00	15,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	69.133.543,58	5,22	3,00	5,76	10,00	5,76	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	111.740,46	0,01	0,00	0,01	0,10	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	1.118.587.300,85	84,44					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	121.251.638,01	9,15	3,00	9,48	15,00	4,92	30,00
	Total Renda Variável	121.251.638,01	9,15					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	66.653.279,12	5,03	3,00	5,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	66.653.279,12	5,03					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	17.634.226,11	1,33	0,50	1,50	3,00	10,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	582.792,84	0,04	0,10	0,10	1,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	18.217.018,95	1,38					15,00
Total		1.324.709.236,93	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	1,00 120,53	3,09 117,62	3,09 117,62	5,60 101,12	10,32 83,48	6.634.505,35	19.883.381,83
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,73 87,32	2,14 81,45	2,14 81,45	5,33 96,19	10,96 88,67	1.721.856,84	4.932.942,72
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,79 94,29	2,58 98,17	2,58 98,17	5,44 98,17	12,35 99,91	1.124.999,63	3.594.294,37
Artigo 7º IV % do CDI	1,08 129,57	3,06 116,53	3,06 116,53	5,62 101,44	10,70 86,54	738.610,64	2.051.713,53
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,30 36,06	1,74 66,35	1,74 66,35	232,37 4.196,44	278,07 2.249,35	334,83	1.912,66
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,79 1,50	-1,27 3,26	-1,27 3,26	11,14 1,24	24,38 -1,36	955.892,41	-1.554.007,21
Artigo 9º II % do CDI	2,11 252,89	10,54 401,43	10,54 401,43	22,39 404,40	27,75 224,50	1.375.922,37	6.353.428,03
Artigo 10º I % do CDI	2,86 343,34	9,24 351,90	9,24 351,90	20,92 377,83	30,38 245,71	490.592,03	1.491.038,74
Artigo 10º II % do CDI	-2,38 -285,89	-6,87 -261,58	-6,87 -261,58	-13,67 -246,89		-14.225,79	-42.963,49
<b>SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>13.028.488,31</b>	<b>36.711.741,18</b>

## RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,600000%)	83.848.567,42	0,00	0,00	0,00	84.676.728,67	828.161,25	2.494.490,66
NTN-B 150535 (5,605000%)	15.773.532,90	0,00	0,00	0,00	15.929.455,01	155.922,11	234.549,76
NTN-B 150545 (5,825500%)	52.578.942,88	0,00	0,00	0,00	53.107.158,94	528.216,06	1.590.706,21
NTN-B 150545 (5,890000%)	116.717.771,03	0,00	0,00	0,00	117.896.313,53	1.178.542,50	3.549.135,52
NTN-B 150555 (6,410000%)	52.923.265,70	0,00	0,00	0,00	53.478.407,23	555.141,53	1.671.338,65
NTN-B 150830 (5,530000%)	51.385.954,18	0,00	0,00	0,00	51.890.764,71	504.810,53	1.541.091,48
NTN-B 150840 (5,620000%)	96.799.828,34	0,00	0,00	0,00	97.757.418,78	957.590,44	2.922.575,37

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (5,761000%)	44.449.113,18	0,00	0,00	0,00	44.893.531,85	444.418,67	1.356.377,73
NTN-B 150850 (5,855000%)	50.375.839,50	0,00	0,00	0,00	50.883.359,55	507.520,05	1.549.105,93
NTN-B 150850 (5,860000%)	44.347.035,17	0,00	0,00	0,00	44.793.817,00	446.781,83	1.363.714,35
NTN-B 150850 (6,151000%)	51.232.303,68	0,00	0,00	0,00	51.759.704,06	527.400,38	1.610.296,17
	660.432.153,98	0,00	0,00	0,00	667.066.659,33	6.634.505,35	

### 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	68.834.904,48	0,00	0,00	0,00	69.406.691,01	571.786,53	1.769.771,19
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	33.806.474,24	0,00	0,00	0,00	34.060.932,03	254.457,79	669.982,32
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	63.667.350,61	0,00	0,00	0,00	64.019.100,40	351.749,79	1.002.213,75
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	22.804.500,03	5.358.459,02	0,00	0,00	28.367.008,71	204.049,66	599.807,96
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	45.269.291,82	0,00	0,00	0,00	45.609.104,89	339.813,07	891.167,50
	234.382.521,18	5.358.459,02	0,00	0,00	241.462.837,04	1.721.856,84	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	2.192.390,18	217.449,38	-217.449,38	0,00	2.209.010,58	16.620,40	51.620,12
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	70.985.688,65	0,00	0,00	0,00	71.631.976,59	646.287,94	2.033.021,10
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	3.555.652,75	0,00	0,00	0,00	3.580.764,50	25.111,75	80.330,18
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	11.183.822,88	10.205.163,80	-8.616.610,48	0,00	12.898.680,96	126.304,76	356.606,29
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	50.181.413,03	0,00	0,00	0,00	50.492.087,81	310.674,78	1.072.716,68
	138.098.967,49	10.422.613,18	-8.834.059,86	0,00	140.812.520,44	1.124.999,63	

### 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	11.672.034,84	0,00	0,00	0,00	11.797.349,86	125.315,02	365.241,17
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	9.532.753,91	0,00	0,00	0,00	9.635.636,62	102.882,71	300.385,64
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	5.976.242,62	0,00	0,00	0,00	6.042.445,48	66.202,86	181.419,90

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	11.667.103,88	0,00	0,00	0,00	11.792.903,82	125.799,94	367.418,49
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	16.558.085,26	0,00	0,00	0,00	16.729.908,34	171.823,08	421.854,89
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	9.567.151,91	0,00	0,00	0,00	9.674.510,27	107.358,36	307.111,92
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	3.421.560,52	0,00	0,00	0,00	3.460.789,19	39.228,67	108.281,52
	68.394.932,94	0,00	0,00	0,00	69.133.543,58	738.610,64	

### 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	111.405,63	0,00	0,00	0,00	111.740,46	334,83	1.912,66
	111.405,63	0,00	0,00	0,00	111.740,46	334,83	

### 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	19.329.559,28	0,00	0,00	0,00	19.214.694,41	-114.864,87	-598.558,28
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	33.483.391,67	0,00	0,00	0,00	33.556.827,86	73.436,19	-271.809,15
INDIE FIC FIA	19.240.579,09	0,00	0,00	0,00	19.595.441,74	354.862,65	-461.120,19
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	22.005.230,62	0,00	0,00	0,00	22.219.379,87	214.149,25	315.216,11
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	3.017.200,63	0,00	0,00	0,00	3.057.140,68	39.940,05	-27.063,87
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	23.219.784,31	0,00	0,00	0,00	23.608.153,45	388.369,14	-510.671,83
	120.295.745,60	0,00	0,00	0,00	121.251.638,01	955.892,41	

### 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	3.240.693,35	0,00	0,00	0,00	3.369.141,85	128.448,50	66.184,00
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	17.487.023,95	0,00	0,00	0,00	17.373.746,34	-113.277,61	845.778,45
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21.095.678,61	0,00	0,00	0,00	21.552.004,24	456.325,63	2.850.231,89
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	23.453.960,84	0,00	0,00	0,00	24.358.386,69	904.425,85	2.591.233,69

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	65.277.356,75	0,00	0,00	0,00	66.653.279,12	1.375.922,37	

### 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	13.477.416,85	0,00	0,00	0,00	13.940.565,71	463.148,86	1.410.456,91
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	3.666.217,23	0,00	0,00	0,00	3.693.660,40	27.443,17	80.581,83
	17.143.634,08	0,00	0,00	0,00	17.634.226,11	490.592,03	

### 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	597.018,63	0,00	0,00	0,00	582.792,84	-14.225,79	-42.963,49
	597.018,63	0,00	0,00	0,00	582.792,84	-14.225,79	

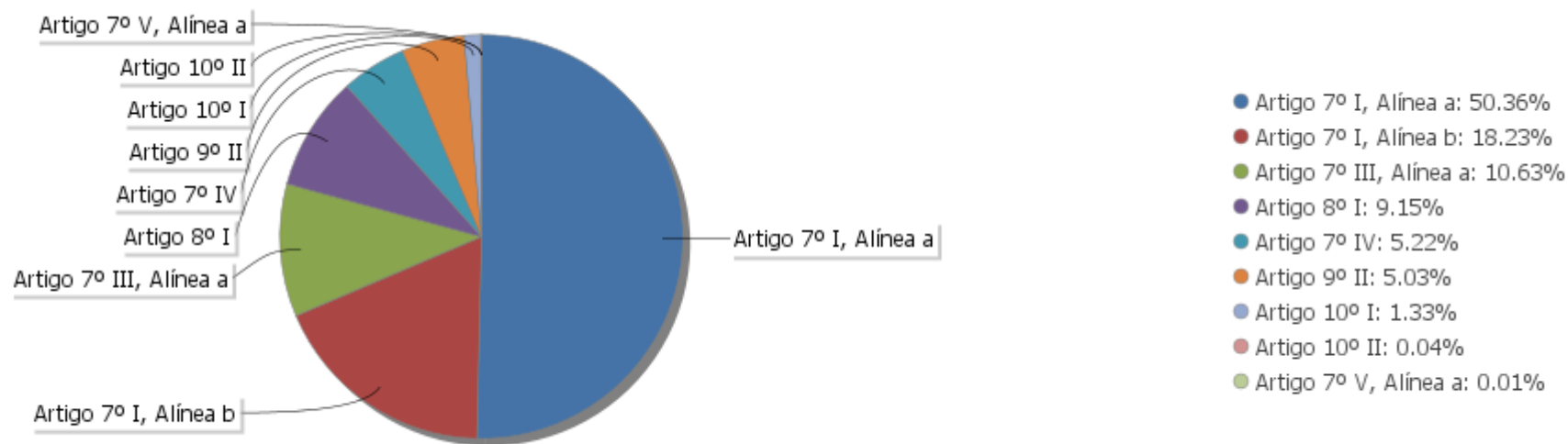
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

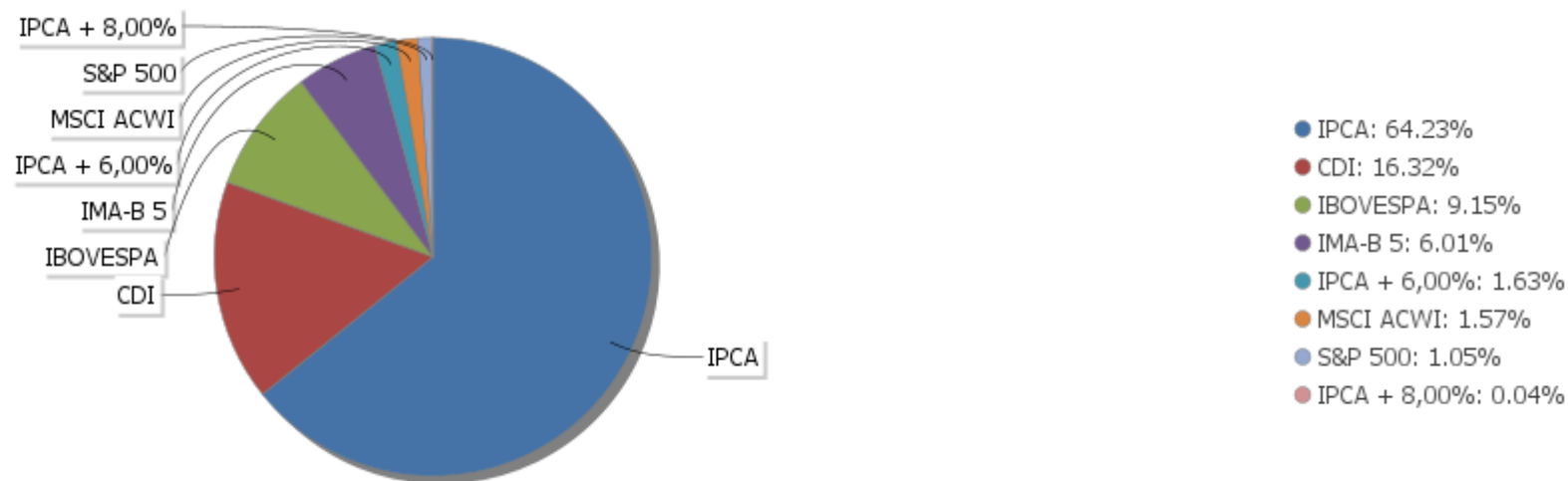
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	485.889.297,58	36,68		485.889.297,58	36,68	
de 31 a 365 dias	125.627.197,28	9,48		611.516.494,86	46,16	
de 1 a 5 anos	45.543.289,90	3,44		657.059.784,76	49,60	
de 5 a 10 anos	52.473.557,55	3,96		709.533.342,31	53,56	
de 10 a 20 anos	198.363.602,46	14,97		907.896.944,77	68,54	
acima de 20 anos	416.812.292,16	31,46		1.324.709.236,93	100,00	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

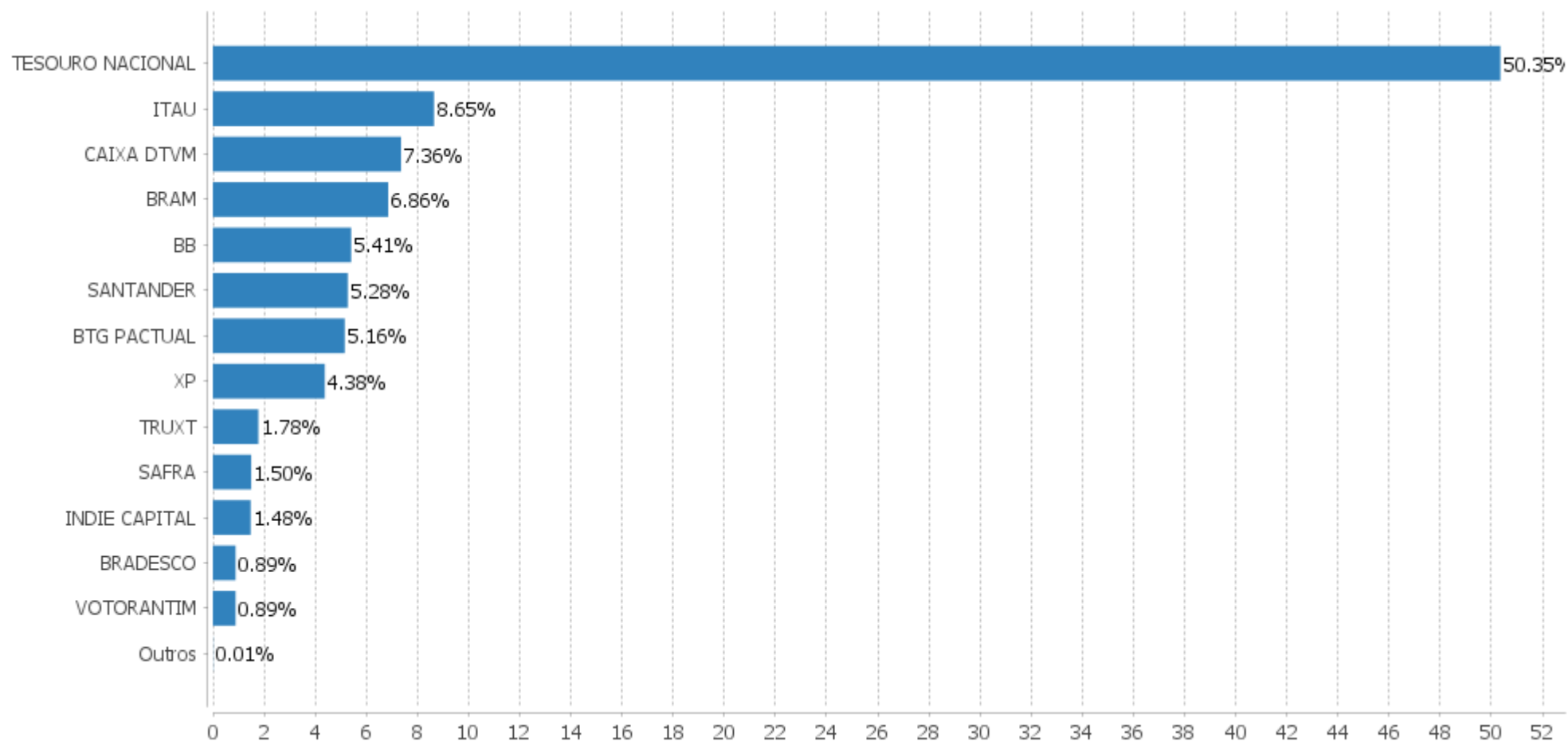


### Alocação Por Estratégia



## 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
2024	0,58	1,26	0,99										2,86
INPC + 5,10%	1,01	1,19	0,59										2,81
p.p. indexador	-0,42	0,07	0,41										0,05
2023	1,72	0,01	0,95	0,85	1,64	1,60	1,08	0,03	0,27	-0,14	2,39	1,68	12,72
INPC + 5,10%	0,90	1,13	1,10	0,89	0,80	0,31	0,33	0,66	0,51	0,54	0,50	0,95	8,93
p.p. indexador	0,82	-1,12	-0,15	-0,03	0,84	1,28	0,75	-0,63	-0,24	-0,67	1,89	0,73	3,78
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

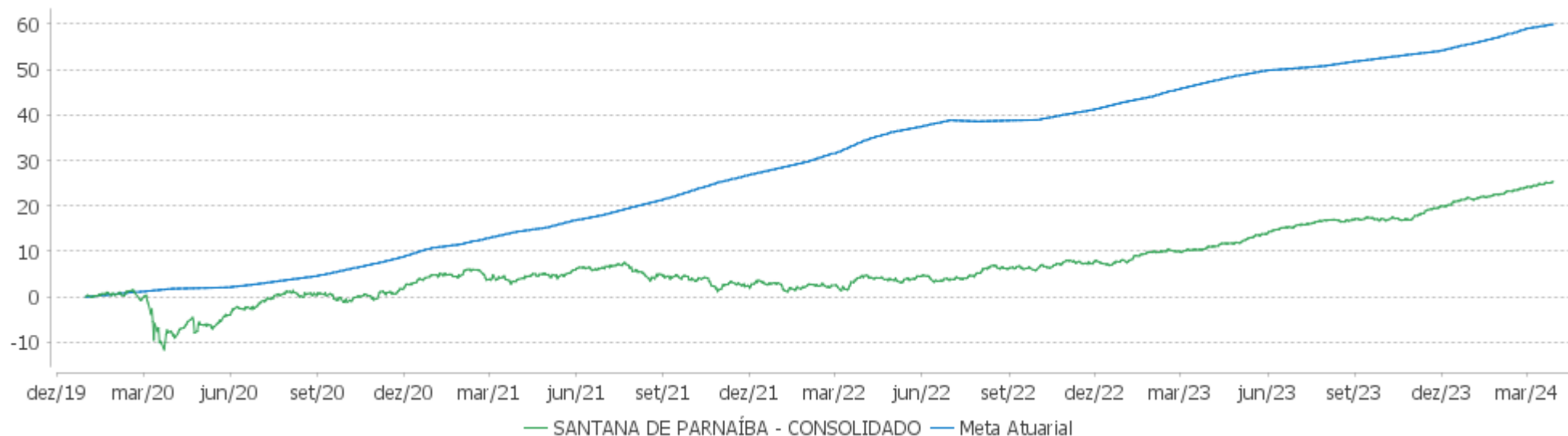
### Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	18	35,29
Meses abaixo - Meta Atuarial	33	64,71
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03

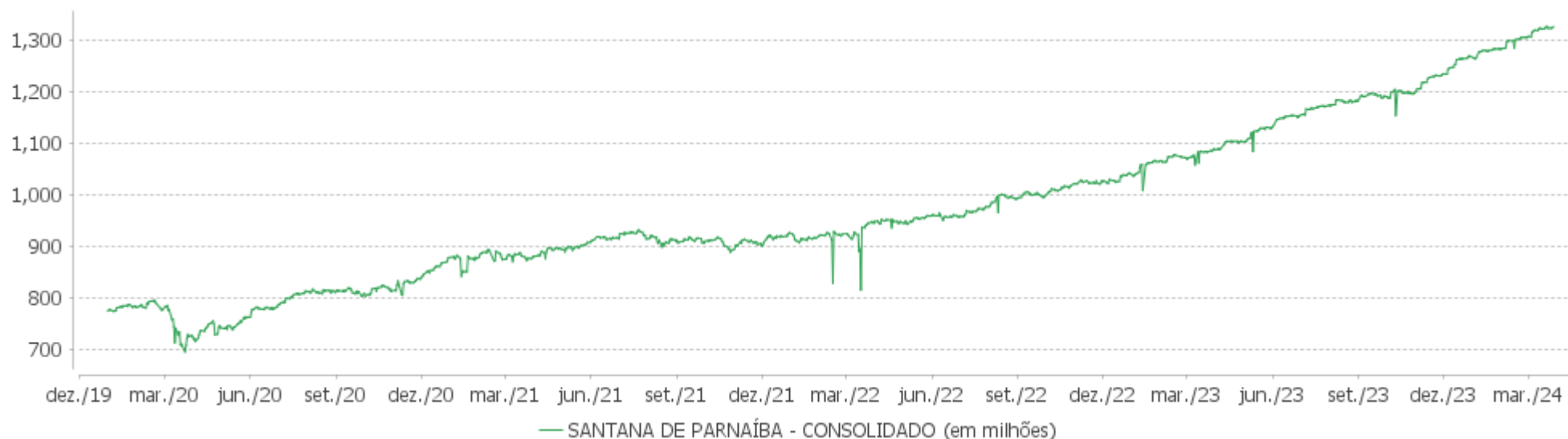
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,86	2,81	0,05	1,47
06 meses	6,94	4,86	2,08	1,85
12 meses	12,90	8,56	4,34	1,82
24 meses	20,15	18,94	1,21	2,46
36 meses	20,78	39,95	-19,17	3,27
48 meses	36,00	58,21	-22,21	4,22
Desde 31/12/2019	25,34	61,31	-35,97	6,03

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução

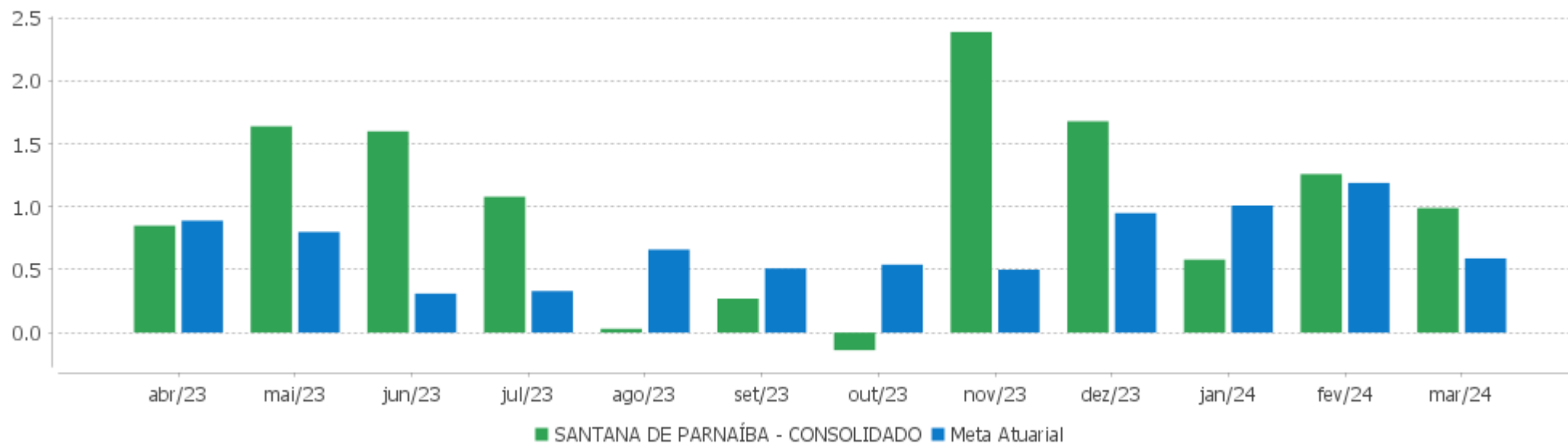


### Patrimônio Líquido



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a Var. IPCA p.p.	1,11 0,95	3,10 1,68	3,10 1,68	5,46 2,95	11,03 7,10		
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA p.p.	1,07 0,91	3,19 1,78	3,19 1,78	5,60 3,09	10,57 6,65	23,76 15,00	
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA p.p.	1,08 0,92	3,22 1,80	3,22 1,80	5,62 3,10	10,61 6,68	23,81 15,05	
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	1,08 0,92	3,22 1,80	3,22 1,80	5,60 3,08	10,56 6,64		
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a Var. IPCA p.p.	1,15 0,99	3,23 1,81	3,23 1,81	5,75 3,24	11,70 7,77		
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	1,12 0,96	15,51 14,10	15,51 14,10	18,17 15,66	10,77 6,85		
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	1,04 0,88	2,59 1,17	2,59 1,17	5,62 3,10	10,56 6,64	23,92 15,16	
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,07 1,66	3,07 1,66	5,61 3,10	10,29 6,37	22,88 14,13	35,94 14,89
NTN-B 150545 (5,825500%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,09 1,67	3,09 1,67	5,62 3,10	7,28 3,36	12,97 4,21	
NTN-B 150535 (5,605000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,00 1,58	3,00 1,58	2,34 -0,17	3,84 -0,09		
NTN-B 150840 (5,620000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,04 1,62	3,04 1,62	5,48 2,97	10,09 6,16	22,47 13,71	39,20 18,15
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,04 1,62	3,04 1,62	5,44 2,92	10,03 6,10	22,39 13,63	35,21 14,16
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,10 1,68	3,10 1,68	5,66 3,15	10,40 6,47	23,10 14,34	36,20 15,15
NTN-B 150555 (6,410000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,89	3,23 1,81	3,23 1,81	5,96 3,44	10,99 7,07	16,99 8,23	
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,10 1,69	3,10 1,69	5,65 3,14	10,40 6,48	23,14 14,38	36,24 15,19
NTN-B 150850 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,09 1,68	3,09 1,68	5,59 3,08	7,22 3,29		
NTN-B 150830 (5,530000%)	0,98	3,02	3,02	5,36	9,91	22,18	38,70

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,82	1,60	1,60	2,85	5,99	13,42	17,65
NTN-B 150850 (6,151000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,87	3,17 1,75	3,17 1,75	5,81 3,29	10,70 6,78	20,18 11,42	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,02	2,01 -0,05	2,01 -0,05	4,98 -0,10	9,48 -0,15	20,72 -0,29	30,95 -0,60
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,02	1,99 -0,06	1,99 -0,06	4,96 -0,13	9,37 -0,25	20,47 -0,54	30,69 -0,86
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,83 99,66	2,62 99,69	2,62 99,69	5,49 99,23	12,30 99,51	27,14 99,46	35,43 99,95
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,83 99,37	2,61 99,40	2,61 99,40	5,47 98,87	12,28 99,33	27,05 99,16	35,30 99,59
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,55 0,39	1,59 0,18	1,59 0,18	5,69 3,18	13,03 9,10	23,64 14,88	32,20 11,15
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,30 36,06	1,74 66,35	1,74 66,35	232,37 4.196,44	278,07 2.249,35	227,72 834,67	308,86 871,38
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,91 109,23	2,92 111,29	2,92 111,29	6,02 108,71	13,31 107,68	28,84 105,71	37,92 106,99
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 90,51	2,38 90,70	2,38 90,70	5,02 90,65	11,27 91,14	24,78 90,83	31,36 88,48
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP % do CDI	0,71 84,73	2,29 87,43	2,29 87,43	5,17 93,45	11,88 96,09		
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,62 0,46	2,17 0,76	2,17 0,76	4,77 2,25	11,55 7,63	24,47 15,71	28,70 7,66
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,75 90,22	2,37 90,41	2,37 90,41	5,02 90,73	11,13 90,06	23,79 87,18	30,10 84,93
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,22 0,93	-0,80 3,73	-0,80 3,73	11,91 2,01	23,98 -1,76	-0,33 -7,09	-24,19 -34,03
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-0,59 0,11	-3,02 1,51	-3,02 1,51	8,52 -1,38	18,22 -7,52	4,47 -2,28	1,93 -7,90
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,32 2,03	-0,88 3,65	-0,88 3,65	11,87 1,97	27,76 2,03	2,05 -4,70	-14,27 -24,10
INDIE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,84 2,55	-2,30 2,23	-2,30 2,23	7,33 -2,57	35,51 9,77	2,36 -4,39	-20,13 -29,96
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,67 2,38	-2,12 2,41	-2,12 2,41	9,37 -0,54	22,40 -3,33	1,19 -5,56	-2,51 -12,35
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	0,97	1,44	1,44	17,99	23,28	12,52	7,59

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	1,68	5,97	5,97	8,09	-2,46	5,76	-2,24
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-0,65	5,12	5,12	21,06	30,93	10,02	10,36
Var. MSCI ACWI p.p.	-3,79	-6,06	-6,06	2,09	11,85	-6,04	8,35
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	3,96	2,00	2,00	7,38	5,20	-2,59	-15,26
Var. MSCI ACWI p.p.	0,82	-9,17	-9,17	-11,59	-13,88	-18,66	-17,26
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,86	11,90	11,90	19,94	21,29	18,17	-0,60
% do CDI	462,66	453,54	453,54	360,02	172,21	66,60	-1,69
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2,16	15,24	15,24	29,37	37,99	27,89	-12,39
Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,54	12,38	12,38	23,92	27,96	5,83	-56,39
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,75	2,23	2,23	5,06	11,37	26,53	33,97
% do CDI	89,81	84,97	84,97	91,34	91,94	97,22	95,83
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	3,44	11,26	11,26	25,85	36,73	41,02	71,15
Var. S&P 500 p.p.	0,07	-2,43	-2,43	3,60	10,98	18,71	55,17
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	-2,38	-6,87	-6,87	-13,67			
Var. IPCA + 8,00% p.p.	-3,16	-10,19	-10,19	-20,08			
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO	0,99	2,86	2,86	6,94	12,90	20,15	20,78
Var. INPC + 5,10% p.p.	0,41	0,05	0,05	2,08	4,34	1,08	-19,05
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

## 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 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 cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice CDIE. A taxa de performance será paga no(s) mês(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 cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBX_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mês	1,34

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					(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	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

## 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	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

## 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%)	84.676.728,67	5,600000	83.082.640,26	5,847100	-1.594.088,41
NTN-B 150535 (5,605000%)	15.929.455,01	5,605000	15.641.625,92	5,847100	-287.829,09
NTN-B 150545 (5,825500%)	53.107.158,94	5,825500	52.688.095,10	5,891100	-419.063,84
NTN-B 150545 (5,890000%)	117.896.313,53	5,890000	117.881.443,75	5,891100	-14.869,78
NTN-B 150555 (6,410000%)	53.478.407,23	6,410000	57.412.963,97	5,874700	3.934.556,74
NTN-B 150830 (5,530000%)	51.890.764,71	5,530000	51.341.724,66	5,739900	-549.040,05
NTN-B 150840 (5,620000%)	97.757.418,78	5,620000	95.440.928,47	5,857500	-2.316.490,31
NTN-B 150850 (5,761000%)	44.893.531,85	5,761000	44.180.405,92	5,883900	-713.125,93
NTN-B 150850 (5,855000%)	50.883.359,55	5,855000	50.726.944,39	5,883900	-156.415,16
NTN-B 150850 (5,860000%)	44.793.817,00	5,860000	44.656.121,05	5,883900	-137.695,95
NTN-B 150850 (6,151000%)	51.759.704,06	6,151000	53.546.320,29	5,883900	1.786.616,23

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1663	05/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	8.864.410,50	0,00	3.633.949,99122700	2,4393320000
1655	05/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.000,00	409,94829100	2,4393320000
1656	06/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	612,53	251,01013300	2,4402600000
1664	06/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.804,19	2.378,51292400	2,4402600000
1642	07/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	728.570,04	0,00	298.449,45731200	2,4411840000
1665	07/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	64.354,71	26.362,08907500	2,4411840000
1662	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	609.213,34	0,00	249.462,18163200	2,4421070000
1666	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	760.919,09	311.583,02925200	2,4421070000
1667	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.279,82	0,00	933,19247000	2,4430330000
1668	14/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	690,10	0,00	282,15612900	2,4458090000
1657	15/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	40.789,53	16.670,99067200	2,4467370000
1669	15/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	34.573,78	14.130,56642000	2,4467370000
1658	19/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	924,81	377,69066500	2,4485910000
1630	19/03/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	5.358.459,02	0,00	81.025,54951612	66,1329550000
1670	19/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.358.459,02	2.188.384,67485000	2,4485910000
1659	22/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	84.891,64	34.630,80698200	2,4513330000
1631	22/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	217.449,38	0,00	78.226,91286700	2,7797259540
1671	22/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.957.968,84	798.736,37682600	2,4513330000
1660	25/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.069,93	436,31094000	2,4522190000
1632	25/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	207.128,15	74.487,31828300	2,7807169700
1672	25/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	24.567,01	10.018,27731400	2,4522190000
1633	26/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.321,23	3.710,39810600	2,7817042010
1673	26/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	274.290,00	111.813,39533200	2,4531050000
1661	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.385,40	2.602,04704300	2,4539910000
<b>Total</b>			<b>15.781.072,20</b>	<b>8.834.059,86</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 10.457.105,12

Value-At-Risk: 0,79%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,33	0,13	5,00	0,05	0,27	0,92	1.118.587.300,85	84,44
Artigo 8º	10,23	6,45	20,00	0,54	-0,00	0,79	121.251.638,01	9,15
Artigo 9º	10,50	5,82	20,00	0,16	0,12	2,11	66.653.279,12	5,03
Artigo 10º	7,64	3,88	20,00	0,04	0,24	2,69	18.217.018,95	1,38
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO		0,79		0,79			1.324.709.236,93	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,13%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,600000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,60	0,99	84.676.728,67	6,39
NTN-B 150535 (5,605000%)	0,36	0,27	-0,00	0,28	0,43	0,99	15.929.455,01	1,20
NTN-B 150545 (5,825500%)	0,29	0,18	0,00	0,20	0,59	1,00	53.107.158,94	4,01
NTN-B 150545 (5,890000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,69	1,01	117.896.313,53	8,90
NTN-B 150555 (6,410000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,84	1,05	53.478.407,23	4,04
NTN-B 150830 (5,530000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,58	0,98	51.890.764,71	3,92
NTN-B 150840 (5,620000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,61	0,99	97.757.418,78	7,38
NTN-B 150850 (5,761000%)	0,25	0,15	0,00	0,17	0,68	1,00	44.893.531,85	3,39
NTN-B 150850 (5,855000%)	0,47	0,25	0,00	0,26	0,37	1,01	50.883.359,55	3,84
NTN-B 150850 (5,860000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,68	1,01	44.793.817,00	3,38
NTN-B 150850 (6,151000%)	0,25	0,15	0,00	0,17	0,80	1,03	51.759.704,06	3,91
<b>Sub-total</b>	0,26	0,15	0,00		0,67	1,00	667.066.659,33	50,36

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,02	0,01	0,00	0,01	-0,30	0,83	28.367.008,71	2,14

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,02	0,01	0,00	0,00	-0,19	0,83	69.406.691,01	5,24
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,93	0,53	0,01	0,01	-0,09	0,75	34.060.932,03	2,57
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,93	0,54	0,01	0,00	-0,09	0,75	45.609.104,89	3,44
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,88	0,75	0,02	0,76	-0,32	0,55	64.019.100,40	4,83
<b>Sub-total</b>	0,53	0,36	0,04		-0,20	0,73	241.462.837,04	18,23

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,16	0,32	0,00	0,32	-0,11	0,71	3.580.764,50	0,27
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-3,99	0,75	2.209.010,58	0,17
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,01	0,01	0,00	0,00	-6,51	0,75	12.898.680,96	0,97
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	0,00	0,06	1,32	0,91	71.631.976,59	5,41
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,96	0,33	0,00	0,34	-0,22	0,62	50.492.087,81	3,81
<b>Sub-total</b>	0,36	0,13	0,01		-0,13	0,79	140.812.520,44	10,63

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	0,28	0,10	-0,00	0,15	0,99	1,11	6.042.445,48	0,46
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	0,26	0,11	-0,00	0,14	0,93	1,07	11.797.349,86	0,89
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	0,26	0,13	-0,00	0,16	0,93	1,08	11.792.903,82	0,89
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	0,27	0,08	-0,00	0,12	0,92	1,08	9.635.636,62	0,73
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	0,32	0,57	-0,00	0,56	0,91	1,12	9.674.510,27	0,73
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	0,26	0,12	-0,00	0,15	0,80	1,04	16.729.908,34	1,26
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	0,26	0,10	-0,00	0,15	1,18	1,15	3.460.789,19	0,26
<b>Sub-total</b>	0,26	0,10	-0,00		0,96	1,08	69.133.543,58	5,22

Artigo 7º V, Alínea a

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR	1,07	0,46	0,00	0,46	-0,50	0,30	111.740,46	0,01
<b>Sub-total</b>	1,07	0,46	0,00		-0,50	0,30	111.740,46	0,01

### Renda Variável

Value-At-Risk: 6,45%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10,69	6,93	0,15	3,77	-0,06	0,22	33.556.827,86	2,53
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	11,14	6,88	0,10	3,88	0,01	0,97	22.219.379,87	1,68
BRADESCO F I A SELECTION	12,72	6,12	0,07	1,88	-0,11	-0,59	19.214.694,41	1,45
INDIE FIC FIA	12,70	8,43	0,10	4,73	0,08	1,84	19.595.441,74	1,48
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	11,74	6,93	0,01	2,57	0,04	1,32	3.057.140,68	0,23
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	10,50	6,38	0,10	2,77	0,08	1,67	23.608.153,45	1,78
<b>Sub-total</b>	10,23	6,45	0,54		-0,00	0,79	121.251.638,01	9,15

### Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,82%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	11,12	6,05	0,01	6,14	0,28	3,96	3.369.141,85	0,25
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	12,64	6,61	0,07	5,68	-0,12	-0,65	17.373.746,34	1,31
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,55	10,03	0,06	10,02	0,07	2,16	21.552.004,24	1,63
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8,74	4,53	0,02	4,53	0,35	3,86	24.358.386,69	1,84
<b>Sub-total</b>	10,50	5,82	0,16		0,12	2,11	66.653.279,12	5,03

### Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,88%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,19	0,19	0,00	0,19	-0,44	0,75	3.693.660,40	0,28
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9,64	5,05	0,04	4,20	0,27	3,44	13.940.565,71	1,05
Sub-total	7,60	4,01	0,04		0,27	2,86	17.634.226,11	1,33

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	8,56	0,57	-0,00	0,58	-0,38	-2,38	582.792,84	0,04
Sub-total	8,56	0,57	-0,00		-0,38	-2,38	582.792,84	0,04

(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 (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)