



LDB
EMPRESAS

SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO
JUNHO 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 28.06.2024.

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

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 150830 (5,530000%)	0,32	0,04	0,82	5,49	53.135.609,60	3,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,600000%)	0,40	0,04	0,82	5,52	84.312.391,00	6,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,605000%)	2,85	-0,00	0,82	3,95	15.860.934,30	1,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,620000%)	0,46	0,04	0,82	5,53	100.123.897,06	7,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,825500%)	0,63	0,08	0,84	5,63	52.892.819,57	3,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,53	0,04	0,84	5,67	117.413.104,79	8,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,100500%)	4,18	0,04	0,86	1,21	15.161.245,45	1,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,380000%)	4,31	0,04	0,40	0,40	59.231.511,92	4,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,761000%)	0,60	0,05	0,83	5,60	45.995.545,68	3,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,855000%)	2,93	-0,03	0,84	5,65	52.144.688,83	3,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	0,58	0,04	0,84	5,65	45.904.194,79	3,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,151000%)	0,62	0,05	0,86	5,79	53.079.040,92	3,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,410000%)	0,64	0,04	0,88	5,92	53.220.067,16	3,89
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,51	0,04	0,84	5,64	748.475.051,07	54,73

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

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	0,79	5,20	71.151.574,10	5,20	31.640.362.924,77	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,72	-0,18	0,37	3,21	34.462.924,66	2,52	7.303.046.549,52	0,47
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,70	0,00	-0,50	1,60	0,00	0,00	2.052.875.038,41	0,00
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,06	-0,04	0,79	5,10	35.310.362,24	2,58	39.814.056.241,78	0,09
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,72	-0,18	0,37	3,19	46.145.882,34	3,37	1.312.208.437,83	3,52
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,43	-0,05	0,44	3,72	187.070.743,34	13,68		

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	0,06	0,04	0,71	4,71	1.840.576,49	0,13	5.048.562.747,13	0,04
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	0,83	5,69	73.556.200,23	5,38	11.692.368.410,92	0,63
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,55	-0,14	0,26	2,56	3.589.889,21	0,26	602.545.981,31	0,60
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,06	0,11	0,78	4,70	17.828.698,27	1,30	976.883.009,20	1,83
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,98	-0,03	0,60	3,80	51.295.594,81	3,75	672.683.891,15	7,63
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,37	0,01	0,71	4,81	148.110.959,01	10,83		

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				
BRASESCO	BRASESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRASESCO SA 6,23% a.a	0,22	0,06	0,89	5,85	12.101.351,66	0,88		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a. a	0,22	0,05	0,88	5,85	9.881.631,89	0,72		
XP	XP	LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a. a	0,44	0,04	0,89	5,98	6.211.302,41	0,45		
VOTORANTIM	VOTORANTIM	LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S. A. 6,25% a.a	0,22	0,05	0,89	5,87	12.095.725,86	0,88		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	1,23	0,04	0,87	5,23	17.160.794,98	1,25		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a. a	11,27	0,04	0,89	5,96	9.925.895,80	0,73		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	0,46	0,05	0,94	6,28	3.563.085,96	0,26		
Sub-total Artigo 7º IV			2,15	0,05	0,88	5,75	70.939.788,56	5,19		

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	111,30	0,66	0,66	3,72	108.315,31	0,01	58.208.969,73	0,19
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			111,30	0,66	0,66	3,72	108.315,31	0,01		
Renda Fixa			0,51	0,02	0,74	5,12	1.154.704.857,29	84,43		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

8,12%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	14,89	-0,75	-0,13	-13,33	17.172.131,11	1,26	305.744.233,44	5,62
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15,38	-0,97	2,15	-9,73	30.536.780,13	2,23	1.149.355.348,82	2,66
INDIE CAPITAL	BTG PACTUAL	INDIE FIC FIA	17,93	-1,14	0,87	-11,11	17.829.243,28	1,30	276.234.140,06	6,45
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	12,89	-0,20	1,80	-0,81	21.726.222,98	1,59	1.114.262.445,89	1,95
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	15,44	-0,84	-0,17	-10,33	2.765.687,46	0,20	253.881.602,83	1,09
TRUXT	INTRAG	TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	16,34	-0,96	0,13	-13,02	20.978.898,03	1,53	306.132.547,92	6,85
Sub-total Artigo 8º I			14,63	-0,81	1,08	-9,61	111.008.962,99	8,12		
Renda Variável			14,63	-0,81	1,08	-9,61	111.008.962,99	8,12		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,04%

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	14,62	-0,27	3,11	5,15	3.472.994,51	0,25	37.128.499,08	9,35
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	15,45	-0,25	4,72	4,05	17.197.054,24	1,26	218.678.201,69	7,86
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,09	1,17	11,56	27,09	29.055.977,58	2,12	820.358.590,52	3,54
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10,55	1,01	8,44	26,69	32.811.631,87	2,40	710.330.934,42	4,62
Sub-total Artigo 9º II			11,49	0,75	8,38	19,57	82.537.658,20	6,04		
Investimentos no Exterior			11,49	0,75	8,38	19,57	82.537.658,20	6,04		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,42%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	11,07	-0,28	3,99	17,03	14.663.808,45	1,07	705.926.006,88	2,08
SAFRA	SAFRA	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,36	0,07	0,91	4,81	3.786.747,91	0,28	957.822.936,32	0,40
Sub-total Artigo 10º I			8,65	-0,21	3,34	14,29	18.450.556,36	1,35		

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	45,22	8,69	8,69	-4,03	933.785,92	0,07	123.084.987,73	0,76
Sub-total Artigo 10º II			45,22	8,69	8,69	-4,03	933.785,92	0,07		

Investimentos Estruturados			8,56	0,19	3,04	13,10	19.384.342,28	1,42		
-----------------------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

Total			1,76	-0,00	1,20	4,53	1.367.635.820,76	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	748.475.051,07	54,73	30,00	53,00	85,00	60,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	187.070.743,34	13,68	5,00	10,15	30,00	6,82	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	148.110.959,01	10,83	5,00	15,00	30,00	4,38	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	70.939.788,56	5,19	3,00	5,76	10,00	5,24	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	108.315,31	0,01	0,00	0,01	0,10	0,01	5,00
	Total Renda Fixa	1.154.704.857,29	84,43					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	111.008.962,99	8,12	3,00	9,48	15,00	3,55	30,00
	Total Renda Variável	111.008.962,99	8,12					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	82.537.658,20	6,04	3,00	5,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	82.537.658,20	6,04					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	18.450.556,36	1,35	0,50	1,50	3,00	9,96	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	933.785,92	0,07	0,10	0,10	1,00	0,04	5,00
	Total Investimentos Estruturados	19.384.342,28	1,42					15,00
Total		1.367.635.820,76	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	0,84 106,48	5,64 107,94	2,47 97,71	5,64 107,94	10,30 88,09	5.960.336,47	36.652.398,74
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,44 55,90	3,72 71,24	1,55 61,21	3,72 71,24	8,86 75,78	808.353,81	8.466.490,23
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,71 90,40	4,81 92,21	2,18 86,22	4,81 92,21	10,92 93,43	1.129.494,85	6.861.801,94
Artigo 7º IV % do CDI	0,88 112,12	5,75 110,15	2,61 103,26	5,75 110,15	10,54 90,16	621.508,30	3.857.958,51
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,66 84,19	3,72 71,16	1,94 76,68	3,72 71,16	283,60 2.425,65	714,14	4.017,25
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,08 -0,40	-9,61 -1,95	-8,45 -5,17	-9,61 -1,95	-2,05 -6,98	1.182.231,41	-11.796.682,23
Artigo 9º II % do CDI	8,38 1.062,90	19,57 374,78	8,17 322,95	19,57 374,78	32,97 282,01	6.012.413,13	12.237.807,11
Artigo 10º I % do CDI	3,34 424,05	14,29 273,75	4,63 182,97	14,29 273,75	25,65 219,40	596.838,01	2.307.368,99
Artigo 10º II % do CDI	8,69 1.102,83	-4,03 -77,28	3,04 120,14	-4,03 -77,28	-16,22 -138,76	-35.356,03	-108.637,03
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO (Total)						16.276.534,09	58.482.523,51

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%)	83.626.220,07	0,00	0,00	0,00	84.312.391,00	686.170,93	4.510.071,58
NTN-B 150535 (5,605000%)	15.731.737,87	0,00	0,00	0,00	15.860.934,30	129.196,43	614.086,50
NTN-B 150545 (5,825500%)	52.453.628,87	0,00	0,00	0,00	52.892.819,57	439.190,70	2.882.769,08
NTN-B 150545 (5,890000%)	116.432.212,81	0,00	0,00	0,00	117.413.104,79	980.891,98	6.436.268,24
NTN-B 150545 (6,100500%)	15.032.226,16	0,00	0,00	0,00	15.161.245,45	129.019,29	181.429,55
NTN-B 150545 (6,380000%)	0,00	58.997.056,09	0,00	0,00	59.231.511,92	234.455,83	234.455,83
NTN-B 150555 (6,410000%)	52.754.998,02	0,00	0,00	0,00	53.220.067,16	465.069,14	3.045.776,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150830 (5,530000%)	52.705.960,91	0,00	0,00	0,00	53.135.609,60	429.648,69	2.785.936,37
NTN-B 150840 (5,620000%)	99.307.552,27	0,00	0,00	0,00	100.123.897,06	816.344,79	5.289.053,65
NTN-B 150850 (5,761000%)	45.615.730,77	0,00	0,00	0,00	45.995.545,68	379.814,91	2.458.391,56
NTN-B 150850 (5,855000%)	51.710.257,22	0,00	0,00	0,00	52.144.688,83	434.431,61	2.810.435,21
NTN-B 150850 (5,860000%)	45.521.754,44	0,00	0,00	0,00	45.904.194,79	382.440,35	2.474.092,14
NTN-B 150850 (6,151000%)	52.625.379,10	0,00	0,00	0,00	53.079.040,92	453.661,82	2.929.633,03
	683.517.658,51	58.997.056,09	0,00	0,00	748.475.051,07	5.960.336,47	

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	70.596.079,52	0,00	0,00	0,00	71.151.574,10	555.494,58	3.514.654,28
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	34.335.074,05	0,00	0,00	0,00	34.462.924,66	127.850,61	1.071.974,95
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	64.347.190,29	0,00	-64.025.641,21	0,00	0,00	-321.549,08	1.008.754,56
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	35.034.043,73	0,00	0,00	0,00	35.310.362,24	276.318,51	1.443.161,49
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	45.975.643,15	0,00	0,00	0,00	46.145.882,34	170.239,19	1.427.944,95
	250.288.030,74	0,00	-64.025.641,21	0,00	187.070.743,34	808.353,81	

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	2.243.355,05	16.407,55	-433.074,17	0,00	1.840.576,49	13.888,06	99.852,65
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	72.947.204,45	0,00	0,00	0,00	73.556.200,23	608.995,78	3.957.244,74
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	3.580.528,96	0,00	0,00	0,00	3.589.889,21	9.360,25	89.454,89
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	16.617.543,58	75.062.909,11	-74.043.619,34	0,00	17.828.698,27	191.864,92	839.025,98
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	50.990.208,97	0,00	0,00	0,00	51.295.594,81	305.385,84	1.876.223,68
	146.378.841,01	75.079.316,66	-74.476.693,51	0,00	148.110.959,01	1.129.494,85	

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	11.995.021,57	0,00	0,00	0,00	12.101.351,66	106.330,09	669.242,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	9.795.774,72	0,00	0,00	0,00	9.881.631,89	85.857,17	546.380,91
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	6.156.610,01	0,00	0,00	0,00	6.211.302,41	54.692,40	350.276,83
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	11.989.539,61	0,00	0,00	0,00	12.095.725,86	106.186,25	670.240,53
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	17.012.722,47	0,00	0,00	0,00	17.160.794,98	148.072,51	852.741,53
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	9.838.782,85	0,00	0,00	0,00	9.925.895,80	87.112,95	558.497,45
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	3.529.829,03	0,00	0,00	0,00	3.563.085,96	33.256,93	210.578,29
	70.318.280,26	0,00	0,00	0,00	70.939.788,56	621.508,30	

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	107.601,17	0,00	0,00	0,00	108.315,31	714,14	4.017,25
	107.601,17	0,00	0,00	0,00	108.315,31	714,14	

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	17.194.183,43	0,00	0,00	0,00	17.172.131,11	-22.052,32	-2.641.121,58
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	29.893.085,07	0,00	0,00	0,00	30.536.780,13	643.695,06	-3.291.856,88
INDIE FIC FIA	17.676.159,42	0,00	0,00	0,00	17.829.243,28	153.083,86	-2.227.318,65
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	21.342.136,37	0,00	0,00	0,00	21.726.222,98	384.086,61	-177.940,78
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	2.770.396,96	0,00	0,00	0,00	2.765.687,46	-4.709,50	-318.517,09
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	20.950.770,33	0,00	0,00	0,00	20.978.898,03	28.127,70	-3.139.927,25
	109.826.731,58	0,00	0,00	0,00	111.008.962,99	1.182.231,41	

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	3.368.254,40	0,00	0,00	0,00	3.472.994,51	104.740,11	170.036,66
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	16.421.598,68	0,00	0,00	0,00	17.197.054,24	775.455,56	669.086,35
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21.304.440,84	5.000.000,00	0,00	0,00	29.055.977,58	2.751.536,74	5.354.205,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	25.430.951,15	5.000.000,00	0,00	0,00	32.811.631,87	2.380.680,72	6.044.478,87
	66.525.245,07	10.000.000,00	0,00	0,00	82.537.658,20	6.012.413,13	

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	14.101.283,11	0,00	0,00	0,00	14.663.808,45	562.525,34	2.133.699,65
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	3.752.435,24	0,00	0,00	0,00	3.786.747,91	34.312,67	173.669,34
	17.853.718,35	0,00	0,00	0,00	18.450.556,36	596.838,01	

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	552.475,33	416.666,62	0,00	0,00	933.785,92	-35.356,03	-108.637,03
	552.475,33	416.666,62	0,00	0,00	933.785,92	-35.356,03	

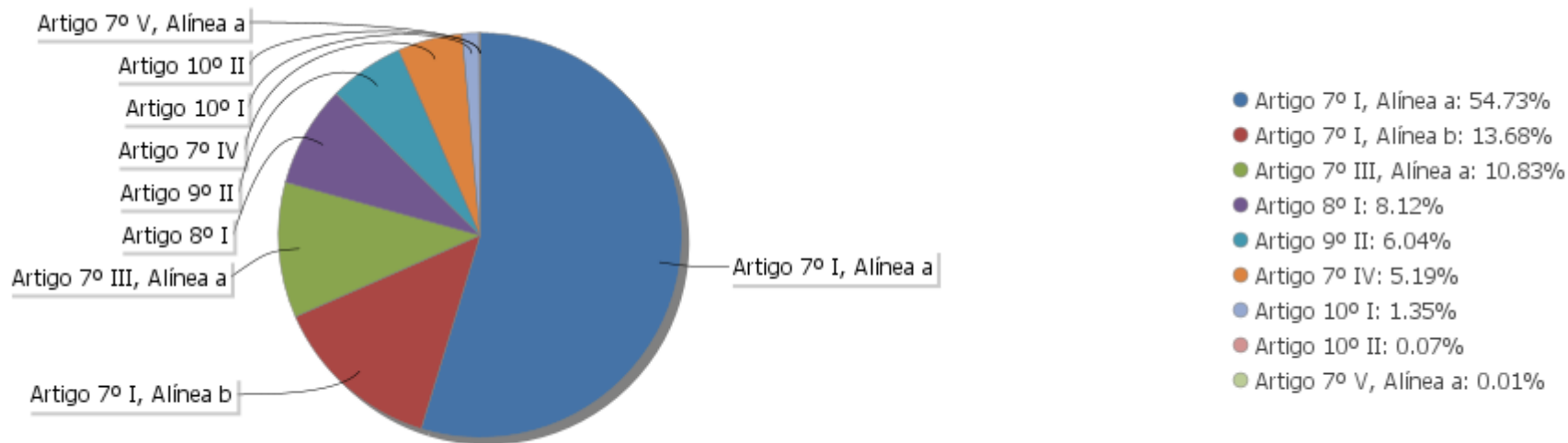
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

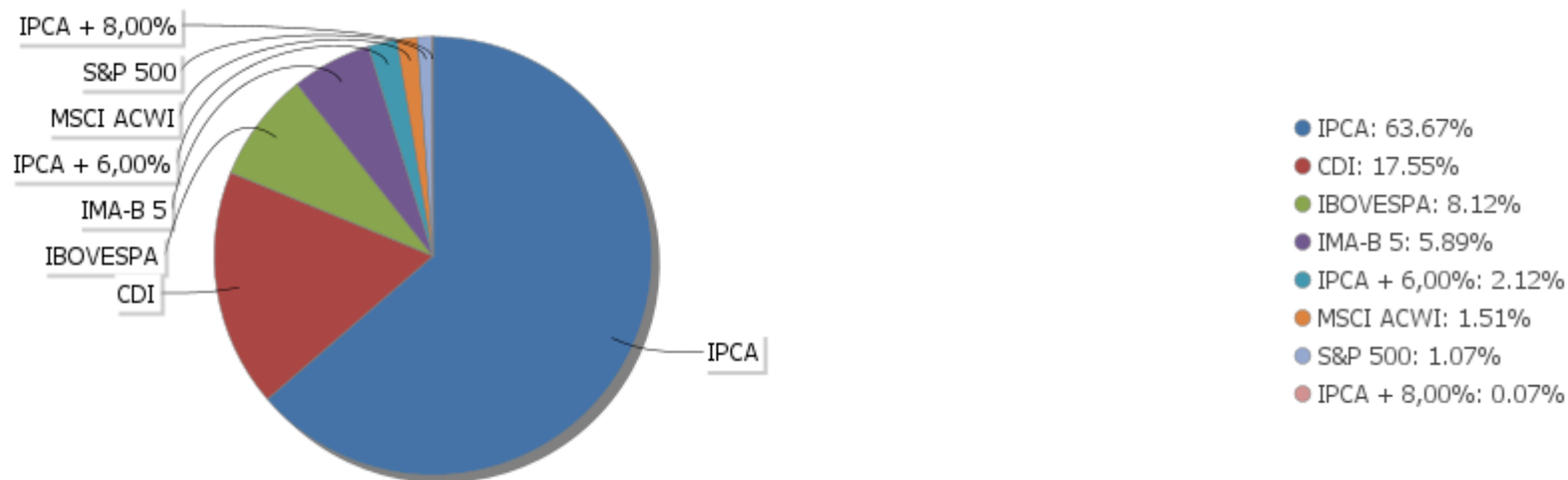
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	453.450.363,33	33,16		453.450.363,33	33,16	
de 31 a 365 dias	124.245.211,81	9,08		577.695.575,14	42,24	
de 1 a 5 anos	40.531.408,63	2,96		618.226.983,77	45,20	
de 5 a 10 anos	54.069.395,52	3,95		672.296.379,29	49,16	
de 10 a 20 anos	200.297.222,36	14,65		872.593.601,65	63,80	
acima de 20 anos	495.042.219,11	36,20		1.367.635.820,76	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

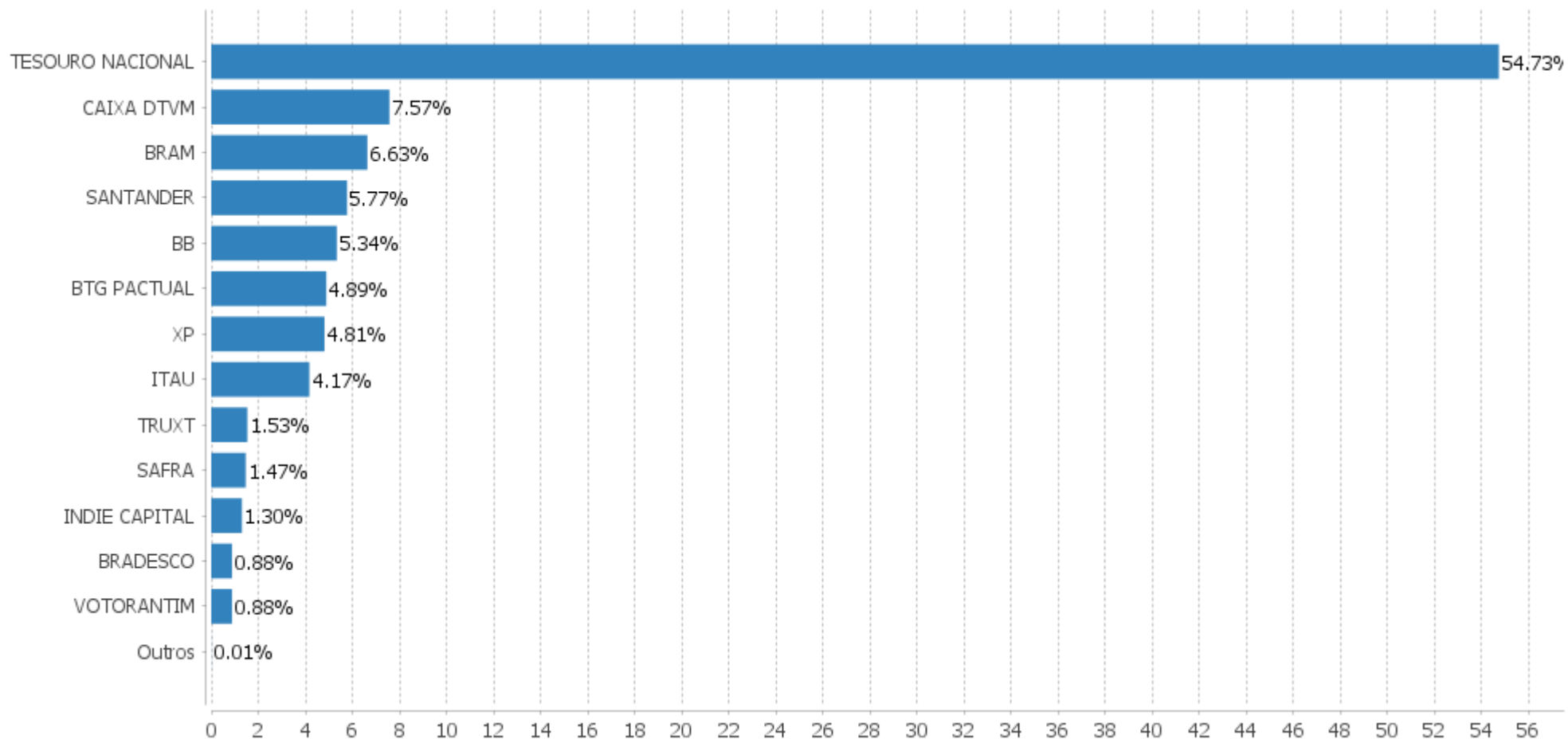


Alocação Por Estratégia



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	-0,16	0,57	1,20							4,53
INPC + 5,10%	1,01	1,19	0,59	0,81	0,88	0,65							5,22
p.p. indexador	-0,42	0,07	0,41	-0,96	-0,31	0,56							-0,70
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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	19	35,19
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	64,81

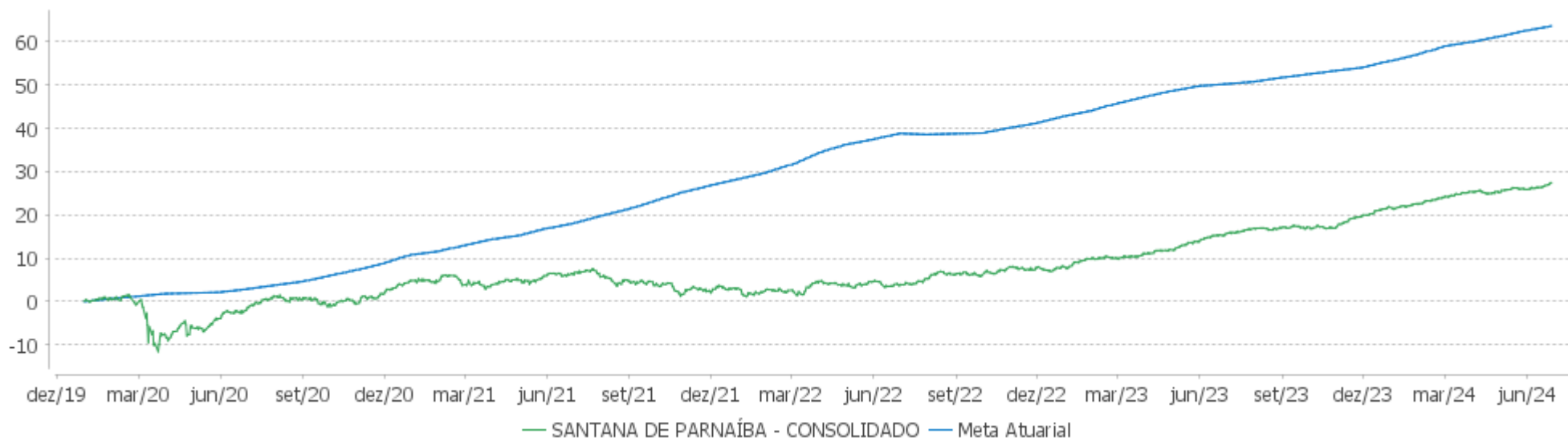
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,11	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-7,26	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,62	2,35	-0,73	1,49
06 meses	4,53	5,22	-0,70	1,48
12 meses	10,17	8,92	1,24	1,76
24 meses	22,86	17,80	5,06	2,22
36 meses	19,81	38,68	-18,87	3,13
48 meses	29,85	60,00	-30,15	3,57
Desde 31/12/2019	27,37	65,10	-37,73	5,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

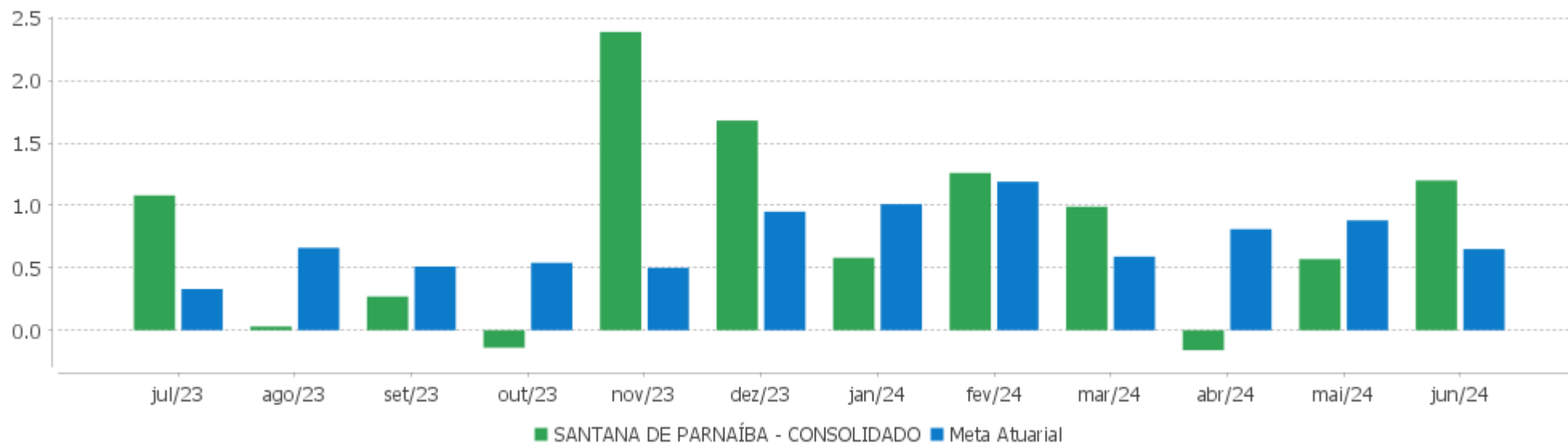


Patrimônio Líquido



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.	0,89 0,68	5,98 3,49	2,79 1,74	5,98 3,49	10,45 6,22	22,36 14,83	
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a Var. IPCA p.p.	0,89 0,68	5,85 3,37	2,58 1,52	5,85 3,37	10,48 6,25	21,52 14,00	
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a Var. IPCA p.p.	0,89 0,68	5,87 3,38	2,57 1,51	5,87 3,38	10,50 6,27	21,60 14,07	
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	5,85 3,37	2,55 1,50	5,85 3,37	10,43 6,21	21,48 13,96	
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a Var. IPCA p.p.	0,94 0,73	6,28 3,80	2,96 1,90	6,28 3,80	11,10 6,87		
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	0,89 0,68	18,51 16,03	2,60 1,54	18,51 16,03	23,49 19,26	21,94 14,42	
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	5,23 2,75	2,58 1,52	5,23 2,75	10,55 6,32	21,73 14,21	
NTN-B 150850 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,60 3,12	2,45 1,40	5,60 3,12	10,27 6,05	20,73 13,21	34,93 14,63
NTN-B 150535 (5,605000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	5,49 3,00	2,42 1,36	5,49 3,00	6,78 2,55		
NTN-B 150545 (5,825500%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	5,63 3,15	2,47 1,42	5,63 3,15	10,32 6,09	14,19 6,67	
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	5,65 3,17	2,48 1,43	5,65 3,17	10,38 6,15	20,94 13,42	35,20 14,89
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	5,67 3,18	2,49 1,43	5,67 3,18	10,38 6,16	20,98 13,46	39,17 18,87
NTN-B 150850 (5,855000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	5,65 3,17	2,48 1,43	5,65 3,17	7,20 2,97	10,95 3,42	
NTN-B 150830 (5,530000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	5,49 3,01	2,40 1,35	5,49 3,01	9,89 5,66	20,04 12,51	37,68 17,38
NTN-B 150850 (6,151000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	5,79 3,31	2,55 1,50	5,79 3,31	10,69 6,46	18,08 10,55	
NTN-B 150545 (6,100500%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	2,72 0,23	-0,42 -1,48	2,72 0,23	4,09 -0,13		
NTN-B 150840 (5,620000%)	0,82	5,53	2,42	5,53	10,07	20,33	38,17

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.	0,61	3,05	1,37	3,05	5,84	12,81	17,87
NTN-B 150535 (5,600000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	5,52 3,04	2,42 1,36	5,52 3,04	10,01 5,78	20,24 12,72	38,03 17,72
NTN-B 150545 (6,380000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	2,75 0,26	-0,46 -1,51	2,75 0,26	4,16 -0,06		
NTN-B 150555 (6,410000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	5,92 3,44	2,61 1,56	5,92 3,44	10,98 6,75	18,53 11,01	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,02	3,21 -0,11	1,18 -0,06	3,21 -0,11	8,00 -0,23	18,98 -0,31	30,69 -0,61
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,02	3,19 -0,13	1,18 -0,06	3,19 -0,13	7,97 -0,26	18,76 -0,54	30,43 -0,87
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,79 99,81	5,20 99,52	2,51 99,36	5,20 99,52	11,62 99,35	26,72 99,62	37,80 100,03
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,79 100,05	5,19 99,32	2,51 99,26	5,19 99,32	11,59 99,16	26,62 99,28	37,68 99,70
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,20 -0,41	1,91 -0,57	0,31 -0,74	1,91 -0,57	7,05 2,82	20,92 13,39	31,73 11,43
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,66 84,19	3,71 71,08	1,94 76,68	3,71 71,08	283,60 2.425,65	234,85 875,74	362,16 958,25
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,83 105,90	5,69 108,90	2,69 106,17	5,69 108,90	12,72 108,82	28,36 105,76	40,37 106,82
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,71 90,20	4,71 90,16	2,27 89,82	4,71 90,16	10,59 90,55	24,34 90,76	33,64 89,02
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP % do CDI	0,26 33,16	2,56 48,94	0,25 10,07	2,56 48,94	7,76 66,34		
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,71 89,74	4,70 90,00	2,27 89,81	4,70 90,00	10,59 90,59	23,51 87,67	32,30 85,47
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,60 0,39	3,80 1,31	1,59 0,54	3,80 1,31	8,65 4,42	23,59 16,06	29,68 9,37
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,15 0,67	-9,73 -2,07	-9,00 -5,72	-9,73 -2,07	-1,98 -6,90	14,83 -10,91	-34,93 -32,64
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-0,13 -1,61	-13,33 -5,67	-10,63 -7,35	-13,33 -5,67	-7,64 -12,57	10,00 -15,74	-18,58 -16,29
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,17 -1,65	-10,33 -2,67	-9,53 -6,26	-10,33 -2,67	-0,35 -5,28	17,20 -8,54	-31,12 -28,84
INDIE FIC FIA	0,87	-11,11	-9,01	-11,11	-4,42	20,90	-33,98

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.	-0,62	-3,45	-5,74	-3,45	-9,34	-4,84	-31,70
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1,80	-0,81	-2,22	-0,81	12,30	27,30	-5,22
Var. IBOVESPA p.p.	0,32	6,85	1,06	6,85	7,37	1,56	-2,94
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	0,13	-13,02	-11,14	-13,02	-8,04	5,69	-24,46
Var. IBOVESPA p.p.	-1,35	-5,36	-7,86	-5,36	-12,97	-20,05	-22,17
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	4,72	4,05	-1,02	4,05	19,37	41,49	-2,76
Var. MSCI ACWI p.p.	-3,56	-22,62	-14,96	-22,62	-16,11	-1,13	-26,55
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	3,11	5,15	3,08	5,15	8,02	13,06	-14,24
Var. MSCI ACWI p.p.	-5,17	-21,52	-10,86	-21,52	-27,46	-29,57	-38,03
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8,44	26,69	13,22	26,69	37,16	47,09	18,78
% do CDI	1.070,70	511,24	522,33	511,24	317,81	175,59	49,69
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,56	27,09	10,28	27,09	44,10	81,41	0,75
Var. IPCA + 6,00% p.p.	10,89	21,62	7,74	21,62	33,70	60,71	-42,41
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,91	4,81	2,52	4,81	10,90	25,00	35,99
% do CDI	115,99	92,06	99,61	92,06	93,20	93,23	95,22
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	3,99	17,03	5,19	17,03	30,05	74,59	65,17
Var. S&P 500 p.p.	-5,74	-14,42	-10,44	-14,42	-11,48	21,50	23,97
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	8,69	-4,03	3,04	-4,03	-16,22		
Var. IPCA + 8,00% p.p.	7,87	-10,47	0,02	-10,47	-28,69		
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO	1,20	4,53	1,62	4,53	10,17	22,86	19,81
Var. INPC + 5,10% p.p.	0,56	-0,70	-0,73	-0,70	1,24	4,97	-18,86
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

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
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 - 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 IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
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 performance sera	1,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	paga no(s) mes (es) de Janeiro e Julho O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIACÃO DO IBOVÉSPA, 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	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-7,20	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-6,12	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-14,85	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-14,03	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	-3,41	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43

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	9,73	31,45	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	26,67	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	2,68	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	1,10	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

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%)	84.312.391,00	5,600000	78.666.126,70	6,510700	-5.646.264,30
NTN-B 150535 (5,605000%)	15.860.934,30	5,605000	14.810.147,14	6,510700	-1.050.787,16
NTN-B 150545 (5,825500%)	52.892.819,57	5,825500	48.994.534,54	6,496800	-3.898.285,03
NTN-B 150545 (5,890000%)	117.413.104,79	5,890000	109.617.674,66	6,496800	-7.795.430,13
NTN-B 150545 (6,100500%)	15.161.245,45	6,100500	14.498.801,66	6,496800	-662.443,79
NTN-B 150545 (6,380000%)	59.231.511,92	6,380000	58.463.307,30	6,496800	-768.204,62
NTN-B 150555 (6,410000%)	53.220.067,16	6,410000	52.750.389,61	6,477700	-469.677,55
NTN-B 150830 (5,530000%)	53.135.609,60	5,530000	50.813.699,83	6,460000	-2.321.909,77
NTN-B 150840 (5,620000%)	100.123.897,06	5,620000	92.435.864,19	6,439600	-7.688.032,87
NTN-B 150850 (5,761000%)	45.995.545,68	5,761000	41.934.884,61	6,504300	-4.060.661,07
NTN-B 150850 (5,855000%)	52.144.688,83	5,855000	48.148.687,52	6,504300	-3.996.001,31
NTN-B 150850 (5,860000%)	45.904.194,79	5,860000	42.386.420,95	6,504300	-3.517.773,84
NTN-B 150850 (6,151000%)	53.079.040,92	6,151000	50.824.765,31	6,504300	-2.254.275,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1755	04/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	2.530,94	1.014,49313100	2,4947790000
1746	04/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	232,54	93,21041300	2,4947790000
1756	05/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	1.125,54	0,00	450,99893400	2,4956600000
1757	06/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	71.785,51	28.753,98780500	2,4965410000
1758	07/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	9.619.762,58	0,00	3.851.880,17233700	2,4974200000
1745	07/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	728.570,04	0,00	291.729,08041000	2,4974200000
1759	10/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	782.988,16	313.408,38077000	2,4983000000
1741	10/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	416.666,62	147.081,80457900	2,8328903170
1742	10/06/2024	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIELSTRATÉGIA	416.666,62	0,00	416.666,62000000	1,0000000000
1747	10/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	607.466,48	0,00	243.151,93531600	2,4983000000
1738	11/06/2024	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	64.025.641,21	2.677.366,87775941	23,9136600000
1760	12/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	64.025.641,21	0,00	25.609.631,60898800	2,5000610000
1761	13/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	9.999.278,84	3.998.205,01293100	2,5009420000
1748	13/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	231,98	92,75704500	2,5009420000
1739	14/06/2024	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.000.000,00	0,00	98.130,43446800	50,9525921000
1740	14/06/2024	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.000.000,00	0,00	26.074,15756577	191,7607496000
1762	14/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	59.161.375,67	23.647.297,19735100	2,5018240000
1737	14/06/2024	NTN-B 150545 (6,380000%)	58.997.056,09	0,00	14.238,00000000	4.143,6336630000
1749	14/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	36.093,32	14.426,80231300	2,5018240000
1763	17/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	48.424,70	19.348,92895100	2,5027070000
1750	19/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	500,00	199,64288600	2,5044720000
1764	25/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	26.985,13	10.759,59110200	2,5080070000
1751	25/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	4.874,87	1.943,72271600	2,5080070000
1765	26/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	3.315.195,21	1.321.378,20733600	2,5088920000
1743	26/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.407,55	0,00	5.767,21248900	2,8449706040
1752	26/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	127.400,68	50.779,66087800	2,5088920000
1766	27/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	461.249,15	183.781,00231000	2,5097760000
1744	27/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.407,55	5.765,22063500	2,8459535270

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1753	27/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	4.472,64	1.782,08732800	2,5097760000
1767	28/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	80.049,88	0,00	31.883,99862900	2,5106600000
1754	28/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	293,38	0,00	116,85373500	2,5106600000
Total			144.493.039,37	138.502.334,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.062.456,99

Value-At-Risk: 0,66%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,36	0,11	5,00	0,04	-0,08	0,76	1.154.704.857,29	84,43
Artigo 8º	13,90	6,31	20,00	0,44	0,02	1,08	111.008.962,99	8,12
Artigo 9º	8,50	4,92	20,00	0,15	0,89	8,38	82.537.658,20	6,04
Artigo 10º	12,47	3,63	20,00	0,03	0,23	3,60	19.384.342,28	1,42
SANTANA DE PARNAÍBA - CONSOLIDADO		0,66		0,66			1.367.635.820,76	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,11%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830 (5,530000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,16	0,82	53.135.609,60	3,89
NTN-B 150535 (5,600000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,19	0,82	84.312.391,00	6,16
NTN-B 150535 (5,605000%)	0,27	0,15	0,00	0,18	0,12	0,82	15.860.934,30	1,16
NTN-B 150840 (5,620000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,20	0,82	100.123.897,06	7,32
NTN-B 150545 (5,825500%)	0,27	0,16	0,00	0,17	0,18	0,84	52.892.819,57	3,87
NTN-B 150545 (5,890000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,32	0,84	117.413.104,79	8,59
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,41	0,86	15.161.245,45	1,11
NTN-B 150545 (6,380000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,54	0,88	59.231.511,92	4,33
NTN-B 150850 (5,761000%)	0,18	0,12	0,00	0,14	0,25	0,83	45.995.545,68	3,36
NTN-B 150850 (5,855000%)	0,38	0,23	0,00	0,24	0,14	0,84	52.144.688,83	3,81
NTN-B 150850 (5,860000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,31	0,84	45.904.194,79	3,36
NTN-B 150850 (6,151000%)	0,18	0,12	0,00	0,14	0,42	0,86	53.079.040,92	3,88
NTN-B 150555 (6,410000%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,55	0,88	53.220.067,16	3,89
Sub-total	0,17	0,09	0,00		0,30	0,84	748.475.051,07	54,73

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,01	0,01	0,00	0,00	-0,21	0,79	71.151.574,10	5,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	0,91	0,01	0,01	-0,24	0,37	34.462.924,66	2,52
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,46	NaN	0,00	NaN	-0,29	-0,20	0,00	0,00
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,01	0,01	0,00	0,00	0,03	0,79	35.310.362,24	2,58
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,71	0,91	0,02	0,00	-0,24	0,37	46.145.882,34	3,37
Sub-total	1,24	0,39	0,03		-0,28	0,44	187.070.743,34	13,68

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	0,01	0,00	0,01	-5,87	0,71	1.840.576,49	0,13
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	-0,00	0,04	0,98	0,83	73.556.200,23	5,38
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,90	0,74	0,00	0,74	-0,28	0,26	3.589.889,21	0,26
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	0,01	0,00	0,00	-119,43	0,71	17.828.698,27	1,30
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,72	0,52	0,01	0,53	-0,26	0,60	51.295.594,81	3,75
Sub-total	0,28	0,19	0,01		-0,27	0,71	148.110.959,01	10,83

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,23% a.a	0,18	0,13	0,00	0,16	0,56	0,89	12.101.351,66	0,88
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,20% a.a	0,17	0,13	0,00	0,16	0,52	0,88	9.881.631,89	0,72
LETRA FINANCEIRA - BCXP - BANCO XP S.A 6,50% a.a	0,17	0,14	-0,00	0,18	0,59	0,89	6.211.302,41	0,45
LETRA FINANCEIRA - BEVE - BANCO VOTORANTIM S.A. 6,25% a.a	0,17	0,13	0,00	0,16	0,56	0,89	12.095.725,86	0,88
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,26% a.a	0,17	0,09	0,00	0,13	0,48	0,87	17.160.794,98	1,25
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	0,17	0,58	0,00	0,56	0,57	0,89	9.925.895,80	0,73
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 7,1328 % a.a	0,17	0,14	-0,00	0,18	0,91	0,94	3.563.085,96	0,26
Sub-total	0,17	0,11	0,00		0,56	0,88	70.939.788,56	5,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR	2,35	0,13	-0,00	0,13	-0,05	0,66	108.315,31	0,01
Sub-total	2,35	0,13	-0,00		-0,05	0,66	108.315,31	0,01

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,31%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO F I A SELECTION	15,33	7,72	0,08	3,26	-0,06	-0,13	17.172.131,11	1,26
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,64	6,46	0,12	3,79	0,09	2,15	30.536.780,13	2,23
INDIE FIC FIA	17,70	8,12	0,08	4,70	0,00	0,87	17.829.243,28	1,30
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	10,88	5,37	0,06	3,73	0,09	1,80	21.726.222,98	1,59
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	16,37	7,61	0,01	3,04	-0,06	-0,17	2.765.687,46	0,20
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	16,40	6,96	0,09	3,70	-0,04	0,13	20.978.898,03	1,53
Sub-total	13,90	6,31	0,44		0,02	1,08	111.008.962,99	8,12

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 4,92%

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	11,84	6,62	0,01	7,62	0,20	3,11	3.472.994,51	0,25
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	8,98	6,82	0,06	6,93	0,44	4,72	17.197.054,24	1,26
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9,60	7,45	0,06	7,45	1,12	11,56	29.055.977,58	2,12
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,95	4,89	0,02	4,89	0,64	8,44	32.811.631,87	2,40
Sub-total	8,50	4,92	0,15		0,89	8,38	82.537.658,20	6,04

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,63%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6,25	4,80	0,03	4,84	0,51	3,99	14.663.808,45	1,07
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,41	0,13	-0,00	0,13	0,31	0,91	3.786.747,91	0,28
Sub-total	4,97	3,81	0,03		0,51	3,34	18.450.556,36	1,35

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIELABORADORA	160,70	0,43	-0,00	0,45	0,05	8,69	933.785,92	0,07
Sub-total	160,70	0,43	-0,00		0,05	8,69	933.785,92	0,07

(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 (%)