



**LDB**  
EMPRESAS

**BERTIOGA**  
FEVEREIRO 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 29.02.2024.

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

91,54%

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	5,44	0,12	0,61	-0,59	117.845.428,01	14,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	4,16	0,01	0,67	1,80	11.288.104,80	1,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	7,58	0,17	0,44	-1,53	12.213.047,07	1,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,78	0,15	0,48	-1,11	9.542.825,93	1,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,201000%)	0,42	0,06	1,04	2,18	27.127.895,10	3,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,540000%)	0,50	0,06	0,99	2,08	16.887.728,36	2,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,670000%)	0,51	0,06	1,00	2,10	11.175.771,87	1,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,681500%)	2,84	0,06	1,00	2,10	20.360.042,76	2,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,51	0,06	1,01	2,11	11.231.842,11	1,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,816500%)	2,89	0,06	1,01	2,12	36.526.165,98	4,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,013000%)	0,53	0,06	1,03	2,15	22.654.192,00	2,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,054000%)	0,53	0,06	1,03	2,16	10.714.337,85	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,141000%)	0,53	0,06	1,04	2,17	26.375.901,62	3,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305000%)	0,54	0,06	1,05	2,20	16.028.500,10	1,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,360000%)	0,54	0,06	1,05	2,20	36.825.849,26	4,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,540000%)	0,58	0,06	0,99	2,08	39.462.507,87	4,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	0,59	0,06	1,00	2,10	22.376.083,48	2,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,720000%)	0,59	0,06	1,01	2,10	39.361.723,73	4,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,750000%)	0,59	0,06	1,01	2,11	26.859.997,38	3,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,822000%)	0,30	0,06	1,01	2,12	7.250.167,49	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,858000%)	0,39	0,06	1,02	2,13	15.573.908,01	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,969000%)	0,39	0,06	1,02	2,14	21.981.850,50	2,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621000%)	0,45	0,06	1,00	2,09	10.850.649,68	1,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,46	0,06	1,00	2,10	16.363.573,88	1,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,759500%)	0,46	0,06	1,01	2,11	25.343.751,39	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,966000%)	0,47	0,06	1,02	2,14	10.400.433,18	1,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,540000%)	0,55	0,06	0,99	2,08	21.930.025,17	2,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	0,56	0,06	1,00	2,10	21.752.677,23	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,56	0,06	1,01	2,11	16.393.900,28	1,96
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>1,28</b>	<b>0,07</b>	<b>0,92</b>	<b>1,53</b>	<b>682.698.882,09</b>	<b>81,73</b>

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				
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM	0,05	0,04	0,79	1,76	40.848.916,53	4,89	7.632.967.840,80	0,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
FIC FI										
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	4,22	0,20	0,60	0,25	17.461.891,18	2,09	997.345.488,00	1,75
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	1,05	0,01	0,73	1,84	21.606.975,78	2,59	234.623.025,61	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,05	0,01	0,73	1,84	2.011.165,06	0,24	190.452.280,62	1,06
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,51</b>	<b>0,07</b>	<b>0,74</b>	<b>1,43</b>	<b>81.928.948,55</b>	<b>9,81</b>		
Renda Fixa			1,28	0,07	0,90	1,52	764.627.830,64	91,54		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,21%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	15,69	-0,58	1,86	0,11	124.043,35	0,01	223.392.375,01	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13,26	-0,46	1,80	-1,33	4.747.396,24	0,57	981.220.828,10	0,48
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	15,49	-0,75	0,46	-4,04	564.242,61	0,07	352.167.909,31	0,16
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,74	-0,27	1,63	-1,49	4.668.685,14	0,56	789.752.289,29	0,59
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>14,74</b>	<b>-0,39</b>	<b>1,65</b>	<b>-1,54</b>	<b>10.104.367,34</b>	<b>1,21</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>14,74</b>	<b>-0,39</b>	<b>1,65</b>	<b>-1,54</b>	<b>10.104.367,34</b>	<b>1,21</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 4,24%

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				
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	11,74	0,11	4,30	7,54	5.416.913,20	0,65	383.180.605,36	1,41
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,50	1,52	8,42	12,80	8.965.214,04	1,07	763.217.450,44	1,17
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,50	0,49	4,53	7,75	9.677.132,20	1,16	623.544.203,19	1,55
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>13,34</b>	<b>0,79</b>	<b>5,89</b>	<b>9,53</b>	<b>24.059.259,44</b>	<b>2,88</b>		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,40	0,95	6,27	11,12	6.066.313,02	0,73	2.238.336.630,68	0,27
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,37	0,50	4,54	7,40	5.307.082,11	0,64	697.423.955,25	0,76
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>13,54</b>	<b>0,74</b>	<b>5,45</b>	<b>9,35</b>	<b>11.373.395,13</b>	<b>1,36</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>12,47</b>	<b>0,77</b>	<b>5,75</b>	<b>9,47</b>	<b>35.432.654,57</b>	<b>4,24</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,01%

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
KINEA	LIONS TRUST	FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	7,07	-0,72	-0,72	0,19	2.018.514,73	0,24	162.391.214,48	1,24
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	29,50	3,04	3,04	2,87	23.134.357,29	2,77	368.993.009,51	6,27
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>26,67</b>	<b>2,73</b>	<b>2,73</b>	<b>2,65</b>	<b>25.152.872,02</b>	<b>3,01</b>		
Investimentos Estruturados			26,67	2,73	2,73	2,65	25.152.872,02	3,01		
Total			1,50	0,17	1,16	1,83	835.317.724,57	100,00		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	682.698.882,09	81,73	65,00	83,00	97,50	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	81.928.948,55	9,81	2,50	5,00	10,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>764.627.830,64</b>	<b>91,54</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	10.104.367,34	1,21	0,00	5,00	15,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>10.104.367,34</b>	<b>1,21</b>					40,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	24.059.259,44	2,88	0,00	2,60	5,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	11.373.395,13	1,36	0,00	1,30	5,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>35.432.654,57</b>	<b>4,24</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	25.152.872,02	3,01	0,00	3,10	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>25.152.872,02</b>	<b>3,01</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>835.317.724,57</b>	<b>100,00</b>					

**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	0,92 114,92	1,53 86,12	3,02 112,21	4,82 84,85	12,32 96,70	6.260.672,57	10.345.800,21
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,74 92,07	1,43 80,59	2,70 100,47	4,57 80,47	11,95 93,78	582.595,43	1.092.744,48
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,65 0,65	-1,54 2,31	3,94 2,61	9,13 -2,34	19,51 -3,44	163.622,04	-158.046,91
Artigo 9º II % do CDI	5,89 734,40	9,53 536,41	13,84 514,87	15,67 275,57	23,40 183,68	1.338.251,85	2.093.168,09
Artigo 9º III % do CDI	5,45 680,08	9,35 526,25	12,14 451,39	13,44 236,46	27,51 215,86	588.252,54	972.356,41
Artigo 10º II % do CDI	2,73 339,96	2,65 149,19	3,06 113,78	3,71 65,23	4,24 33,29	667.590,38	649.423,98
<b>BERTIOGA (Total)</b>						<b>9.600.984,81</b>	<b>14.995.446,26</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	117.134.622,58	0,00	0,00	0,00	117.845.428,01	710.805,43	-694.715,63
NTN-B 150535 (6,201000%)	26.848.429,68	0,00	0,00	0,00	27.127.895,10	279.465,42	578.681,77
NTN-B 150545	9.496.862,20	0,00	0,00	0,00	9.542.825,93	45.963,73	-106.931,58
NTN-B 150545 (5,540000%)	16.721.625,64	0,00	0,00	0,00	16.887.728,36	166.102,72	343.447,53
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.064.826,25	0,00	0,00	0,00	11.175.771,87	110.945,62	229.464,93
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.157.771,28	0,00	0,00	0,00	20.360.042,76	202.271,48	418.412,93
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.119.867,68	0,00	0,00	0,00	11.231.842,11	111.974,43	231.635,61
NTN-B 150545 (5,816500%)	36.159.796,90	0,00	0,00	0,00	36.526.165,98	366.369,08	758.045,19
NTN-B 150545 (6,013000%)	22.423.807,61	0,00	0,00	0,00	22.654.192,00	230.384,39	476.868,34
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.605.074,03	0,00	0,00	0,00	10.714.337,85	109.263,82	226.192,40
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.105.301,43	0,00	0,00	0,00	26.375.901,62	270.600,19	560.250,16
NTN-B 150545 (6,305000%)	15.862.206,86	0,00	0,00	0,00	16.028.500,10	166.293,24	344.422,88

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (6,360000%)	36.442.408,78	0,00	0,00	0,00	36.825.849,26	383.440,48	794.327,91
NTN-B 150555 (5,540000%)	39.074.399,41	0,00	0,00	0,00	39.462.507,87	388.108,46	802.547,67
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.153.950,57	0,00	0,00	0,00	22.376.083,48	222.132,91	459.443,26
NTN-B 150555 (5,720000%)	38.969.584,53	0,00	0,00	0,00	39.361.723,73	392.139,20	811.204,93
NTN-B 150555 (5,750000%)	26.591.841,45	0,00	0,00	0,00	26.859.997,38	268.155,93	554.749,93
NTN-B 150824	11.536.167,86	0,00	0,00	333.633,62	11.288.104,80	85.570,56	214.060,06
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.388.766,20	0,00	0,00	212.210,40	7.250.167,49	73.611,69	153.679,80
NTN-B 150832 (5,858000%)	15.868.088,18	0,00	0,00	452.690,61	15.573.908,01	158.510,44	330.931,33
NTN-B 150832 (5,969000%)	22.399.833,08	0,00	0,00	643.480,71	21.981.850,50	225.498,13	470.913,42
NTN-B 150840 (5,621000%)	11.047.954,02	0,00	0,00	305.861,94	10.850.649,68	108.557,60	226.459,98
NTN-B 150840 (5,690000%)	16.663.567,38	0,00	0,00	464.521,59	16.363.573,88	164.528,09	343.310,71
NTN-B 150840 (5,759500%)	25.812.207,07	0,00	0,00	724.554,05	25.343.751,39	256.098,37	534.503,66
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.597.396,67	0,00	0,00	303.620,28	10.400.433,18	106.656,79	222.733,46
NTN-B 150850	12.503.287,05	0,00	0,00	345.713,65	12.213.047,07	55.473,67	-194.075,93
NTN-B 150850 (5,540000%)	22.316.194,08	0,00	0,00	604.251,68	21.930.025,17	218.082,77	454.749,07
NTN-B 150850 (5,670000%)	22.144.036,78	0,00	0,00	609.731,29	21.752.677,23	218.371,74	455.574,26
NTN-B 150850 (5,730000%)	16.691.755,78	0,00	0,00	463.151,69	16.393.900,28	165.296,19	344.912,16
	681.901.631,03	0,00	0,00	5.463.421,51	682.698.882,09	6.260.672,57	

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 PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2.055.484,60	0,00	-59.179,60	0,00	2.011.165,06	14.860,06	37.309,35
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	22.065.934,28	0,00	0,00	618.860,30	21.606.975,78	159.901,80	400.887,87
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	17.831.944,90	0,00	0,00	475.909,82	17.461.891,18	105.856,10	43.388,93
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	31.656.939,06	12.220.000,00	-3.330.000,00	0,00	40.848.916,53	301.977,47	611.158,33
	73.610.302,84	12.220.000,00	-3.389.179,60	1.094.770,12	81.928.948,55	582.595,43	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	121.782,94	0,00	0,00	0,00	124.043,35	2.260,41	142,40
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4.593.689,35	0,00	0,00	0,00	4.668.685,14	74.995,79	-70.428,34
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.663.595,53	0,00	0,00	0,00	4.747.396,24	83.800,71	-64.012,10
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	561.677,48	0,00	0,00	0,00	564.242,61	2.565,13	-23.748,87
	9.940.745,30	0,00	0,00	0,00	10.104.367,34	163.622,04	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	5.193.788,28	0,00	0,00	0,00	5.416.913,20	223.124,92	379.829,99
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8.269.027,03	0,00	0,00	0,00	8.965.214,04	696.187,01	1.017.359,17
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9.258.192,28	0,00	0,00	0,00	9.677.132,20	418.939,92	695.978,93
	22.721.007,59	0,00	0,00	0,00	24.059.259,44	1.338.251,85	

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.708.412,73	0,00	0,00	0,00	6.066.313,02	357.900,29	606.895,61
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.076.729,86	0,00	0,00	0,00	5.307.082,11	230.352,25	365.460,80
	10.785.142,59	0,00	0,00	0,00	11.373.395,13	588.252,54	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP MULTIESTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2.033.172,46	0,00	0,00	0,00	2.018.514,73	-14.657,73	3.773,71
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	22.452.109,18	0,00	0,00	0,00	23.134.357,29	682.248,11	645.650,27
	24.485.281,64	0,00	0,00	0,00	25.152.872,02	667.590,38	

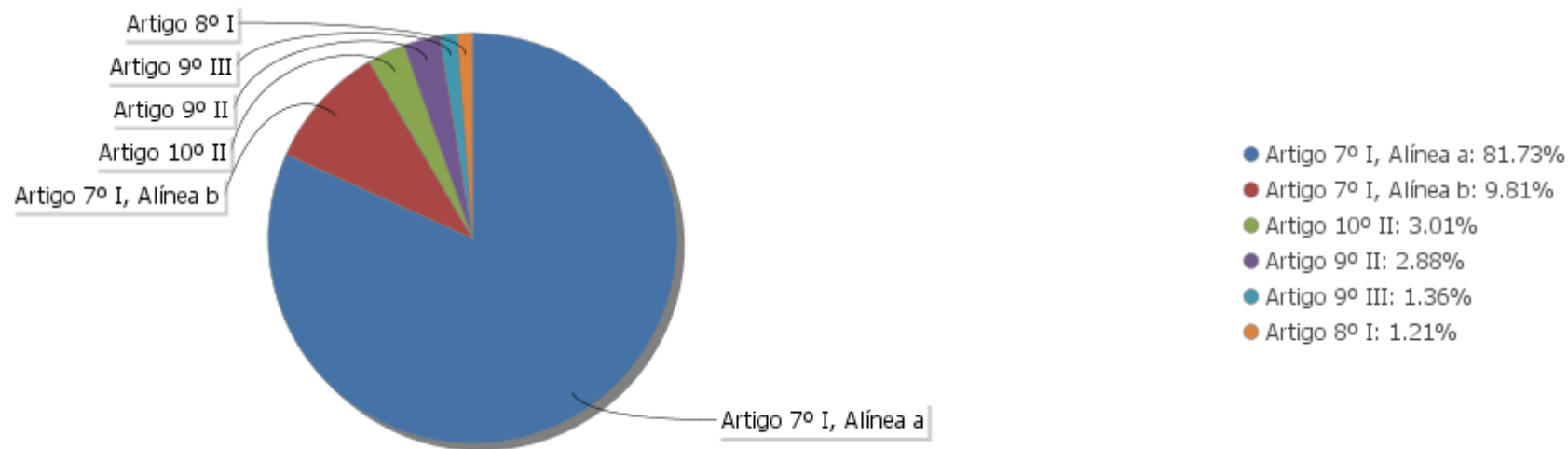
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

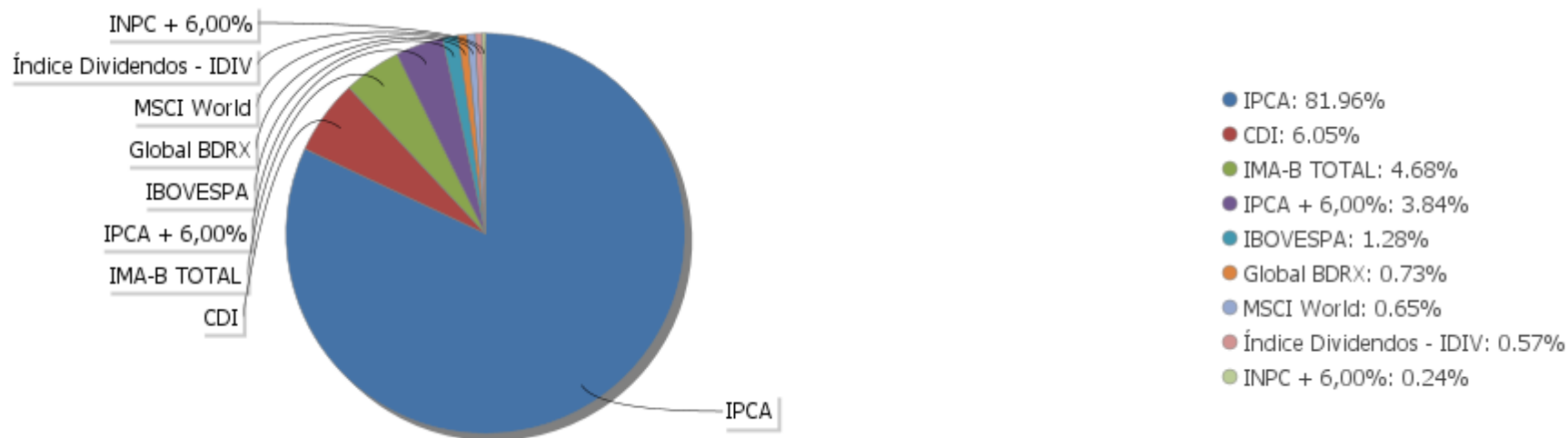
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	83.657.056,93	10,01	10,00	83.657.056,93	10,01	10,00
de 31 dias a 365 dias	39.653.641,88	4,75	1,00	123.310.698,81	14,76	11,00
acima de 365 dias	712.007.025,76	85,24	60,00	835.317.724,57	100,00	71,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

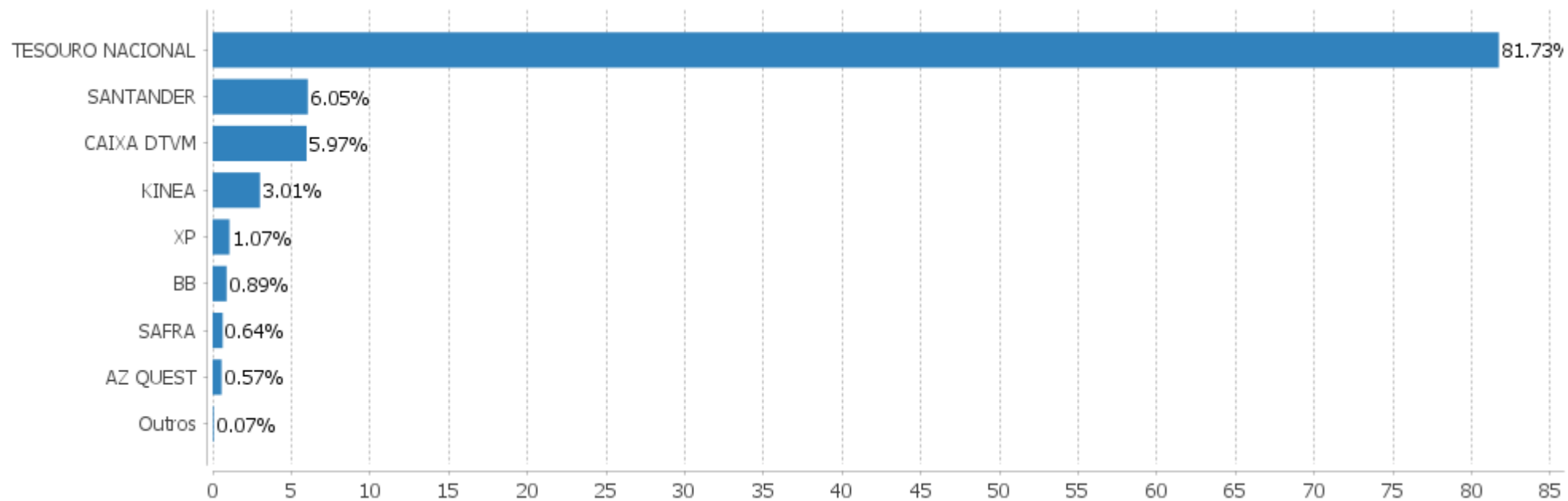


Alocação Por Estratégia



## 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	0,66	1,16											1,83
IPCA + 5,31%	0,87	1,22											2,11
p.p. indexador	-0,22	-0,06											-0,28
2023	0,67	0,69	1,69	1,19	1,80	1,18	0,61	0,39	0,10	0,17	1,50	1,54	12,13
IPCA + 5,31%	0,98	1,21	1,19	0,98	0,68	0,35	0,55	0,70	0,67	0,67	0,69	0,97	10,11
p.p. indexador	-0,32	-0,52	0,50	0,20	1,11	0,83	0,06	-0,32	-0,57	-0,50	0,80	0,57	2,02
2022	0,33	0,74	2,69	-1,28	0,73	-1,39	0,77	1,15	0,23	1,68	-0,43	0,27	5,55
IPCA + 4,99%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12	0,98	0,80	1,05	11,04
p.p. indexador	-0,62	-0,64	0,64	-2,71	-0,17	-2,46	1,05	1,07	0,11	0,70	-1,23	-0,78	-5,49
2021	-0,82	-0,86	0,46	1,08	1,44	0,49	-1,18	-1,50	-1,56	-2,74	0,82	0,65	-3,75
IPCA + 5,46%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,05
p.p. indexador	-1,49	-2,11	-0,96	0,35	0,17	-0,48	-2,61	-2,84	-3,17	-4,41	-0,56	-0,57	-19,79
2020	0,98	-1,02	-11,57	3,30	2,82	3,36	4,26	-1,37	-1,94	-0,52	3,57	4,22	5,06
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	0,27	-1,68	-12,15	3,15	2,75	2,62	3,37	-2,09	-3,06	-1,87	2,22	2,36	-5,59
2019	4,65	-0,50	0,16	1,38	2,73	3,38	1,58	0,31	1,87	2,49	-0,78	2,81	21,87
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	3,82	-1,39	-1,04	0,32	2,09	2,93	0,86	-0,31	1,42	1,86	-1,76	1,17	11,28
2018	4,47	0,74	0,98	-0,04	-4,30	-1,08	2,86	-1,15	0,17	6,78	0,37	1,36	11,27
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	3,67	-0,00	0,40	-0,75	-5,19	-2,83	2,02	-1,60	-0,75	5,82	0,11	0,75	1,35
2017	2,46	3,79	0,60	-0,18	-1,48	0,41	6,44	2,39	2,45	-0,71	-1,44	1,85	17,56
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	1,57	3,04	-0,19	-0,74	-2,30	0,16	5,71	1,67	1,83	-1,62	-2,18	0,95	8,52

**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	42	48,84	03 meses	3,40	3,10	0,29	1,06
Meses abaixo - Meta Atuarial	44	51,16	06 meses	5,23	5,22	0,01	1,42
			12 meses	12,64	10,00	2,64	1,50
			24 meses	19,24	21,99	-2,74	3,23
			36 meses	17,98	42,14	-24,16	4,46
			48 meses	21,93	58,13	-36,20	8,42
			60 meses	42,63	74,26	-31,63	8,02

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	94,28	112,50	-18,22	8,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

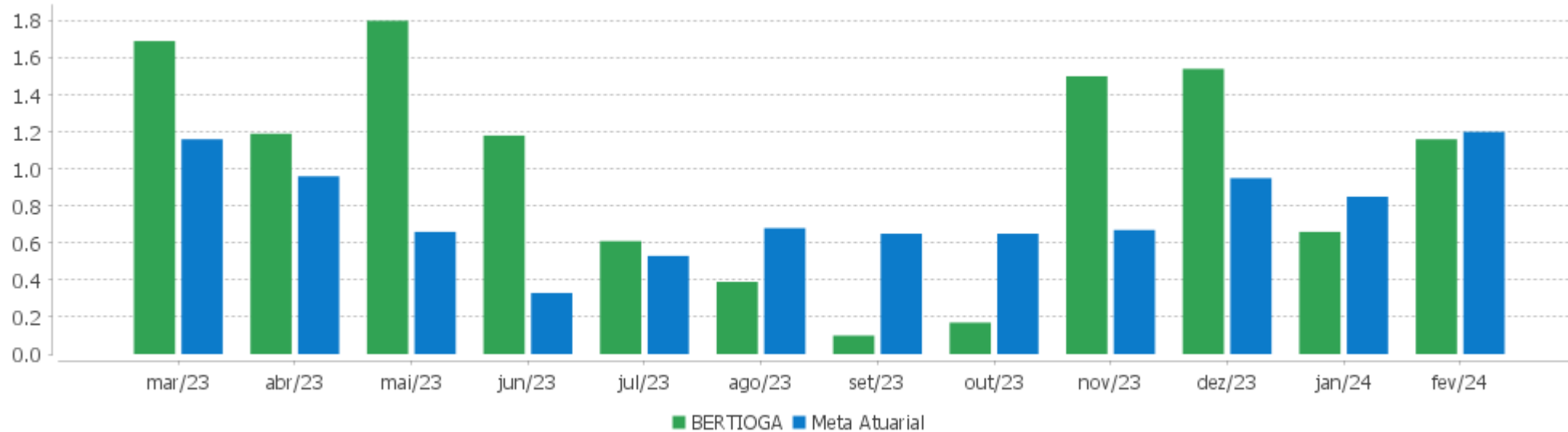


Patrimônio Líquido



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
NTN-B 150545 (5,681500%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,10 0,84	3,07 1,25	5,23 2,61	7,64 3,15		
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	0,67 -0,16	1,91 0,65	2,76 0,94	5,22 2,60	10,34 5,84	22,62 12,28	29,91 7,93
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,10 0,85	3,04 1,22	5,20 2,58	10,67 6,18	23,55 13,21	40,40 18,42
NTN-B 150840 (5,966000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,14 0,89	3,11 1,29	5,34 2,72	10,97 6,47	24,20 13,86	37,35 15,37
NTN-B 150545 (6,305000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,22	2,20 0,94	3,23 1,41	5,54 2,92	11,36 6,87	21,33 10,99	34,29 12,31
NTN-B 150535 Var. IPCA p.p.	0,61 -0,22	-0,59 -1,84	2,61 0,79	2,92 0,30	17,20 12,70	24,49 14,14	19,89 -2,09
NTN-B 150840 (5,759500%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,11 0,86	3,06 1,24	5,23 2,62	10,75 6,25	16,90 6,55	
NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,10 0,84	3,09 1,27	5,24 2,63	10,71 6,22	23,58 13,23	40,44 18,46
NTN-B 150545 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,16	2,08 0,82	3,03 1,21	5,15 2,54	10,55 6,05	23,24 12,90	36,14 14,16
NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,11 0,85	3,11 1,29	5,28 2,66	10,78 6,28	23,72 13,37	40,65 18,67
NTN-B 150545 (6,013000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,20	2,15 0,90	3,16 1,34	5,39 2,78	11,05 6,56	17,32 6,98	
NTN-B 150555 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,10 0,84	3,11 1,29	5,26 2,65	10,73 6,24	23,60 13,25	36,63 14,65
NTN-B 150826 (5,822000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,12 0,87	2,95 1,13	5,13 2,52	10,68 6,18	23,71 13,37	36,63 14,65
NTN-B 150535 (6,201000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,21	2,18 0,93	3,14 1,32	5,42 2,80	11,18 6,69	21,08 10,74	
NTN-B 150545 (6,360000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,22	2,20 0,95	3,25 1,43	5,57 2,95	11,42 6,93	17,81 7,47	
NTN-B 150545 (6,054000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,20	2,16 0,90	3,17 1,35	5,41 2,80	11,10 6,60	20,86 10,52	33,69 11,71
NTN-B 150840 (5,621000%)	1,00	2,09	3,02	5,16	10,60	23,39	40,15

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.	0,17	0,84	1,20	2,55	6,10	13,05	18,17
NTN-B 150545	0,48	-1,11	2,75	3,47	20,50	24,34	17,41
Var. IPCA p.p.	-0,35	-2,36	0,93	0,85	16,00	13,99	-4,57
NTN-B 150850	0,44	-1,53	3,25	3,76	21,44	24,18	15,71
Var. IPCA p.p.	-0,39	-2,78	1,43	1,15	16,94	13,84	-6,26
NTN-B 150555 (5,720000%)	1,01	2,10	3,12	5,29	10,79	23,71	36,77
Var. IPCA p.p.	0,18	0,85	1,30	2,67	6,29	13,37	14,79
NTN-B 150832 (5,969000%)	1,02	2,14	3,07	5,29	10,92	20,60	
Var. IPCA p.p.	0,19	0,89	1,25	2,67	6,43	10,26	
NTN-B 150545 (5,670000%)	1,00	2,10	3,07	5,22	10,69	23,55	36,52
Var. IPCA p.p.	0,17	0,84	1,25	2,60	6,19	13,20	14,54
NTN-B 150850 (5,540000%)	0,99	2,08	3,06	5,18	10,58	23,27	39,98
Var. IPCA p.p.	0,16	0,82	1,24	2,56	6,08	12,92	18,01
NTN-B 150832 (5,858000%)	1,02	2,13	3,04	5,24	10,80	23,89	36,92
Var. IPCA p.p.	0,19	0,87	1,22	2,62	6,31	13,55	14,94
NTN-B 150545 (6,141000%)	1,04	2,17	3,19	5,46	11,19	20,92	
Var. IPCA p.p.	0,21	0,92	1,37	2,84	6,69	10,58	
NTN-B 150545 (5,730000%)	1,01	2,11	3,08	5,25	10,75	23,69	36,70
Var. IPCA p.p.	0,18	0,85	1,26	2,63	6,26	13,34	14,72
NTN-B 150555 (5,750000%)	1,01	2,11	3,13	5,30	10,82	23,78	36,85
Var. IPCA p.p.	0,18	0,86	1,31	2,69	6,32	13,44	14,88
NTN-B 150555 (5,540000%)	0,99	2,08	3,08	5,20	10,59	23,29	36,26
Var. IPCA p.p.	0,16	0,82	1,26	2,58	6,10	12,95	14,28
NTN-B 150545 (5,816500%)	1,01	2,12	3,11	5,29	7,73	13,76	
Var. IPCA p.p.	0,18	0,87	1,29	2,68	3,24	3,41	
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	0,60	0,25	2,56	3,19	14,04	20,05	19,90
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,05	0,15	-0,29	-0,68	-0,66	-3,76	-5,05
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,73	1,84	2,78	5,18	10,17	23,37	32,45
Var. INPC + 6,00% p.p.	-0,52	-0,51	-0,61	-0,03	0,13	0,37	-12,04
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,73	1,84	2,78	5,18	10,16	22,19	29,12
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,18	1,75	-0,07	1,31	-4,54	-1,62	4,17
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,79	1,76	2,66	5,60	12,57	27,04	34,24
% do CDI	98,89	98,96	99,09	98,46	98,62	98,69	98,99
AZ QUEST ACOES FIC FIA	1,86	0,11	5,57	12,27	21,32	9,02	2,21
Var. IBOVESA p.p.	0,86	3,96	4,24	0,80	-1,64	-5,02	-15,04
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	1,80	-1,33	4,50	11,77	25,83	22,59	28,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,89	1,31	0,42	-1,30	-0,32	-9,93	-15,96
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,63 0,64	-1,49 2,36	3,67 2,35	6,16 -5,31	16,93 -6,03	2,55 -11,49	-5,25 -22,51
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	0,46 -0,54	-4,04 -0,19	1,11 -0,22	8,64 -2,84	18,76 -4,19	11,20 -2,83	6,22 -11,03
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	6,27 -0,03	11,12 -0,26	13,99 -0,55	15,34 -0,54	32,07 -1,21	18,33 -2,16	18,18 -4,51
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	4,54 3,55	7,40 11,24	10,09 8,76	11,35 -0,12	22,66 -0,30	7,22 -6,81	8,44 -8,82
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI World p.p.	4,30	7,54	11,47	12,32	17,55	11,40	13,39
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	4,53 564,22	7,75 436,23	12,09 449,66	12,26 215,67	15,11 118,60	5,93 21,63	-1,83 -5,28
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	8,42 7,15	12,80 10,58	17,34 14,07	21,85 16,30	38,33 27,61	14,96 -8,94	-16,08 -61,29
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	3,04 1,76	2,87 0,65	3,28 0,02	3,82 -1,74	4,61 -6,10	-4,49 -28,39	15,68 -29,53
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II Var. IPCA p.p.	-0,72 -1,55	0,19 -1,07	0,56 -1,26	2,49 -0,12	-1,57 -6,07		
BERTIOGA Var. IPCA + 4,99% p.p.	1,16 -0,06	1,83 -0,28	3,40 0,29	5,23 0,01	12,64 2,64	19,24 -3,06	17,98 -24,42
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST ACOES FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,07
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II						
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Não se aplica	Não se aplica				
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+8 du		1,00
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

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	0,76	1,61	2,53	5,52	12,71	27,14	32,56	36,64	45,55
IRF-M 1+	0,34	0,94	2,69	5,87	17,85	28,53	26,35	29,91	48,38
IRF-M TOTAL	0,46	1,13	2,63	5,74	15,85	27,58	28,20	32,06	47,72
IMA-B 5	0,59	1,28	2,76	4,42	10,44	23,21	31,00	39,16	56,09
IMA-B 5+	0,51	-0,96	2,94	3,37	18,26	24,00	18,75	19,88	46,30
IMA-B TOTAL	0,55	0,10	2,85	3,87	14,70	23,81	24,95	28,90	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,64	1,11	2,75	5,15	14,09	26,08	29,72	34,01	49,13
IDKA 2	0,42	1,23	2,70	4,46	10,12	22,51	30,72	39,80	55,45
IDKA 20	0,22	-3,13	3,25	3,06	28,07	25,16	9,21	7,12	36,25
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59	37,78	45,48

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25	23,85	34,98
IBRX 100	0,96	-3,59	1,70	11,76	22,23	12,17	15,38	23,37	37,13
IBRX 50	0,91	-3,27	1,87	12,03	21,50	12,09	17,44	26,99	35,38
SMALL CAP	0,47	-6,11	0,51	1,70	19,40	-4,74	-17,42	-15,61	14,52
Índice Consumo - ICON	0,09	-8,26	-2,77	-1,10	5,65	-26,51	-42,10	-41,50	-21,16
Índice Dividendos - IDIV	0,91	-2,64	4,09	13,07	26,16	32,52	44,70	39,59	69,79



**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	5,80	9,98	12,65	14,47	22,83	12,70	20,50	91,09	143,96

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,79	1,47	5,77	4,58	19,64	22,58	16,40	13,37	38,01

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,79	7,79	10,70	12,33	15,81	5,67	4,39	64,46	101,55

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,83	1,25	1,82	2,62	4,50	10,34	21,98	28,32	33,45
INPC	0,81	1,38	1,94	2,28	3,86	9,54	21,37	28,92	33,97
IGPM	-0,52	-0,45	0,29	1,76	-3,76	-1,97	13,83	46,78	56,79
SELIC	0,80	1,78	2,69	5,68	12,74	27,39	34,59	37,78	45,47

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,13	1,90	2,79	4,58	8,64	19,29	37,17	49,99	62,22
IPCA + 5,00%	1,20	2,06	3,03	5,07	9,68	21,58	41,15	55,82	70,13
IPCA + 5,50%	1,24	2,14	3,15	5,31	10,20	22,74	43,17	58,79	74,20
IPCA + 5,89%	1,27	2,20	3,24	5,50	10,60	23,64	44,76	61,14	77,43
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21	61,81	78,34
INPC + 4,00%	1,11	2,03	2,91	4,24	7,98	18,43	36,48	50,70	62,84
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49	62,57	79,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (6,201000%)	27.127.895,10	6,201000	28.263.614,98	5,670000	1.135.719,88
NTN-B 150545 (5,540000%)	16.887.728,36	5,540000	16.493.169,35	5,743100	-394.559,01
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.175.771,87	5,670000	11.081.417,64	5,743100	-94.354,23
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.360.042,76	5,681500	20.215.138,27	5,743100	-144.904,49
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.231.842,11	5,730000	11.214.821,54	5,743100	-17.020,57
NTN-B 150545 (5,816500%)	36.526.165,98	5,816500	36.837.264,72	5,743100	311.098,74
NTN-B 150545 (6,013000%)	22.654.192,00	6,013000	23.367.917,21	5,743100	713.725,21
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.714.337,85	6,054000	11.103.651,62	5,743100	389.313,77
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.375.901,62	6,141000	27.605.714,56	5,743100	1.229.812,94
NTN-B 150545 (6,305000%)	16.028.500,10	6,305000	17.089.040,12	5,743100	1.060.540,02
NTN-B 150545 (6,360000%)	36.825.849,26	6,360000	39.505.342,81	5,743100	2.679.493,55
NTN-B 150555 (5,540000%)	39.462.507,87	5,540000	38.384.452,98	5,739200	-1.078.054,89
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.376.083,48	5,670000	22.162.958,39	5,739200	-213.125,09
NTN-B 150555 (5,720000%)	39.361.723,73	5,720000	39.257.539,22	5,739200	-104.184,51
NTN-B 150555 (5,750000%)	26.859.997,38	5,750000	26.900.010,91	5,739200	40.013,53
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.250.167,49	5,822000	7.279.940,74	5,635400	29.773,25
NTN-B 150832 (5,858000%)	15.573.908,01	5,858000	15.792.114,02	5,640000	218.206,01
NTN-B 150832 (5,969000%)	21.981.850,50	5,969000	22.447.827,55	5,640000	465.977,05
NTN-B 150840 (5,621000%)	10.850.649,68	5,621000	10.779.125,20	5,685800	-71.524,48
NTN-B 150840 (5,690000%)	16.363.573,88	5,690000	16.370.576,95	5,685800	7.003,07
NTN-B 150840 (5,759500%)	25.343.751,39	5,759500	25.534.588,93	5,685800	190.837,54
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.400.433,18	5,966000	10.700.125,10	5,685800	299.691,92
NTN-B 150850 (5,540000%)	21.930.025,17	5,540000	21.346.435,30	5,745000	-583.589,87
NTN-B 150850 (5,670000%)	21.752.677,23	5,670000	21.540.013,85	5,745000	-212.663,38
NTN-B 150850 (5,730000%)	16.393.900,28	5,730000	16.361.787,48	5,745000	-32.112,80

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
433	06/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	500.000,00	0,00	13.140,13235545	38,0513671000
445	08/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	3.950.000,00	0,00	103.720,67869000	38,0830520000
435	15/02/2024	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	59.179,60	19.456,06395900	3,0417046390
436	15/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	5.460.000,00	0,00	143.189,62301800	38,1312548000
437	20/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	950.000,00	0,00	24.882,95190400	38,1787500000
441	23/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.360.000,00	0,00	35.577,74946725	38,2261391000
442	28/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.015.936,71	26.543,89179500	38,2738416000
443	28/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	952.366,15	24.882,95190400	38,2738416000
444	28/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.361.697,14	35.577,74946800	38,2738416000
<b>Total</b>			<b>12.220.000,00</b>	<b>3.389.179,60</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.430.262,18

Value-At-Risk: 0,53%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,82	0,48	10,00	0,38	0,12	0,90	764.627.830,64	91,54
Artigo 8º	12,87	6,98	30,00	0,05	0,07	1,65	10.104.367,34	1,21
Artigo 9º	14,83	5,98	30,00	0,10	0,33	5,75	35.432.654,57	4,24
Artigo 10º	9,80	0,16	55,00	0,00	0,20	2,73	25.152.872,02	3,01
BERTIOGA		0,53		0,53			835.317.724,57	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,48%

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	2,41	2,29	0,28	2,30	-0,08	0,61	117.845.428,01	14,11
NTN-B 150824	14,98	0,44	0,00	0,45	-0,01	0,67	11.288.104,80	1,35
NTN-B 150850	3,19	2,94	0,04	2,95	-0,11	0,44	12.213.047,07	1,46
NTN-B 150545	2,82	2,65	0,03	2,65	-0,11	0,48	9.542.825,93	1,14
NTN-B 150535 (6,201000%)	0,86	0,11	0,00	0,13	0,28	1,04	27.127.895,10	3,25
NTN-B 150545 (5,540000%)	1,11	0,11	0,00	0,13	0,17	0,99	16.887.728,36	2,02
NTN-B 150545 (5,670000%)	1,13	0,11	0,00	0,13	0,18	1,00	11.175.771,87	1,34
NTN-B 150545 (5,681500%)	1,13	0,11	0,00	0,13	0,18	1,00	20.360.042,76	2,44
NTN-B 150545 (5,730000%)	1,14	0,11	0,00	0,13	0,18	1,01	11.231.842,11	1,34
NTN-B 150545 (5,816500%)	1,15	0,11	0,00	0,13	0,18	1,01	36.526.165,98	4,37
NTN-B 150545 (6,013000%)	1,17	0,11	0,00	0,13	0,19	1,03	22.654.192,00	2,71
NTN-B 150545 (6,054000%)	1,18	0,11	0,00	0,14	0,19	1,03	10.714.337,85	1,28
NTN-B 150545 (6,141000%)	1,19	0,11	0,00	0,14	0,20	1,04	26.375.901,62	3,16
NTN-B 150545 (6,305000%)	1,21	0,11	0,00	0,14	0,20	1,05	16.028.500,10	1,92
NTN-B 150545 (6,360000%)	1,21	0,11	0,00	0,14	0,21	1,05	36.825.849,26	4,41
NTN-B 150555 (5,540000%)	1,33	0,11	0,00	0,14	0,14	0,99	39.462.507,87	4,72

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
NTN-B 150555 (5,670000%)	1,34	0,11	0,00	0,14	0,15	1,00	22.376.083,48	2,68
NTN-B 150555 (5,720000%)	1,35	0,11	0,00	0,14	0,15	1,01	39.361.723,73	4,71
NTN-B 150555 (5,750000%)	1,35	0,11	0,00	0,14	0,15	1,01	26.859.997,38	3,22
NTN-B 150826 (5,822000%)	0,35	0,10	0,00	0,11	0,61	1,01	7.250.167,49	0,87
NTN-B 150832 (5,858000%)	0,76	0,11	0,00	0,13	0,28	1,02	15.573.908,01	1,86
NTN-B 150832 (5,969000%)	0,77	0,11	0,00	0,13	0,29	1,02	21.981.850,50	2,63
NTN-B 150840 (5,621000%)	0,96	0,11	0,00	0,13	0,21	1,00	10.850.649,68	1,30
NTN-B 150840 (5,690000%)	0,97	0,11	0,00	0,13	0,21	1,00	16.363.573,88	1,96
NTN-B 150840 (5,759500%)	0,98	0,11	0,00	0,13	0,21	1,01	25.343.751,39	3,03
NTN-B 150840 (5,966000%)	1,00	0,11	0,00	0,13	0,22	1,02	10.400.433,18	1,25
NTN-B 150850 (5,540000%)	1,24	0,11	0,00	0,14	0,15	0,99	21.930.025,17	2,63
NTN-B 150850 (5,670000%)	1,25	0,11	0,00	0,14	0,16	1,00	21.752.677,23	2,60
NTN-B 150850 (5,730000%)	1,26	0,11	0,00	0,14	0,16	1,01	16.393.900,28	1,96
<b>Sub-total</b>	<b>0,87</b>	<b>0,49</b>	<b>0,35</b>		<b>0,14</b>	<b>0,92</b>	<b>682.698.882,09</b>	<b>81,73</b>

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
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	0,00	0,01	-1,12	0,79	40.848.916,53	4,89
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	1,91	2,03	0,04	0,55	-0,11	0,60	17.461.891,18	2,09
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,53	0,37	0,00	1,79	-0,13	0,73	21.606.975,78	2,59
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,52	0,37	0,00	0,37	-0,13	0,73	2.011.165,06	0,24
<b>Sub-total</b>	<b>0,43</b>	<b>0,46</b>	<b>0,04</b>		<b>-0,15</b>	<b>0,74</b>	<b>81.928.948,55</b>	<b>9,81</b>

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,98%

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
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	12,60	4,91	0,01	4,91	0,28	4,30	5.416.913,20	0,65
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,18	10,22	0,04	10,21	0,40	8,42	8.965.214,04	1,07

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
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,58	5,29	0,02	5,29	0,30	4,53	9.677.132,20	1,16
<b>Sub-total</b>	14,54	6,64	0,07		0,35	5,89	24.059.259,44	2,88

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,21	5,75	0,02	0,48	0,30	6,27	6.066.313,02	0,73
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	12,78	5,77	0,01	9,22	0,29	4,54	5.307.082,11	0,64
<b>Sub-total</b>	15,46	5,56	0,03		0,30	5,45	11.373.395,13	1,36

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,16%

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
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2,64	0,07	0,00	0,13	-0,58	-0,72	2.018.514,73	0,24
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	10,90	0,18	0,00	0,19	0,21	3,04	23.134.357,29	2,77
<b>Sub-total</b>	9,80	0,16	0,00		0,20	2,73	25.152.872,02	3,01

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,98%

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
AZ QUEST ACOES FIC FIA	13,91	7,30	0,00	2,81	0,08	1,86	124.043,35	0,01
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,87	6,25	0,02	1,78	0,08	1,80	4.747.396,24	0,57
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	14,03	6,64	0,00	1,33	-0,02	0,46	564.242,61	0,07
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	13,28	8,19	0,03	4,05	0,06	1,63	4.668.685,14	0,56
<b>Sub-total</b>	12,87	6,98	0,05		0,07	1,65	10.104.367,34	1,21

(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 (%)