



LDB
EMPRESAS

BERTIOGA
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

RENDA FIXA

91,47%

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	5,37	-0,05	-0,37	-0,96	117.406.952,09	13,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	4,16	0,32	1,22	3,05	11.426.207,55	1,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	7,50	-0,12	-0,80	-2,31	12.115.460,52	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,82	-1,32	-1,94	-3,03	9.357.300,68	1,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,201000%)	0,41	0,04	1,03	3,24	27.408.204,46	3,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,540000%)	0,50	0,03	0,98	3,08	17.053.774,03	2,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,670000%)	0,50	0,03	0,99	3,11	11.286.763,42	1,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,681500%)	2,86	0,03	0,99	3,11	20.562.422,62	2,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,51	0,03	1,00	3,12	11.343.900,32	1,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,816500%)	2,90	0,03	1,00	3,14	36.892.976,51	4,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,013000%)	0,52	0,03	1,02	3,19	22.885.058,22	2,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,054000%)	0,52	0,03	1,02	3,20	10.823.855,03	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,141000%)	0,53	0,04	1,03	3,22	26.647.256,38	3,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305000%)	0,53	0,04	1,04	3,26	16.195.376,45	1,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,360000%)	0,54	0,04	1,05	3,27	37.210.804,23	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	0,03	0,98	3,08	39.850.525,18	4,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	0,58	0,03	0,99	3,11	22.598.312,28	2,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,720000%)	0,59	0,03	1,00	3,12	39.754.112,98	4,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,750000%)	0,59	0,03	1,00	3,13	27.128.378,53	3,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,822000%)	0,28	0,03	1,00	3,15	7.323.002,48	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,858000%)	0,38	0,03	1,01	3,15	15.730.787,56	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,969000%)	0,38	0,03	1,02	3,18	22.205.124,28	2,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621000%)	0,44	0,03	0,99	3,10	10.958.004,89	1,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,45	0,03	0,99	3,12	16.526.325,98	1,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,759500%)	0,45	0,03	1,00	3,13	25.597.158,93	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,966000%)	0,46	0,03	1,02	3,18	10.506.056,66	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,540000%)	0,54	0,03	0,98	3,08	22.145.648,53	2,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	0,55	0,03	0,99	3,11	21.968.708,94	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,55	0,03	1,00	3,12	16.557.461,20	1,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,762000%)	4,02	0,03	0,37	0,37	40.142.344,42	4,76
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		1,25	0,00	0,71	2,25	727.608.265,35	86,21

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				
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,06	0,04	0,82	2,60	3.100.146,93	0,37	7.500.793.542,93	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	4,08	0,04	0,00	0,25	17.462.156,60	2,07	1.001.832.564,15	1,74
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,90	0,04	0,91	2,78	21.804.609,06	2,58	236.769.060,66	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,89	0,04	0,91	2,77	2.029.472,31	0,24	192.185.931,64	1,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,45	0,04	0,59	2,03	44.396.384,90	5,26		
Renda Fixa			1,25	0,01	0,69	2,22	772.004.650,25	91,47		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA 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	15,68	0,17	-0,22	-0,11	123.766,22	0,01	213.640.271,78	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,81	0,12	-1,01	-2,33	4.699.491,99	0,56	1.020.718.638,42	0,46
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	14,83	0,25	-0,27	-4,29	562.737,72	0,07	352.579.944,29	0,16
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,74	0,07	2,89	1,36	4.803.571,36	0,57	800.905.409,80	0,60
Sub-total Artigo 8º I			14,38	0,10	0,84	-0,71	10.189.567,29	1,21		
Renda Variável			14,38	0,10	0,84	-0,71	10.189.567,29	1,21		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 4,34%

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	11,18	0,90	4,31	12,18	5.650.601,37	0,67	363.358.117,15	1,56
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,82	1,35	2,16	15,24	9.159.142,71	1,09	769.263.355,99	1,19
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,17	0,83	3,86	11,90	10.050.299,39	1,19	646.788.412,13	1,55
Sub-total Artigo 9º II			12,89	1,04	3,33	13,17	24.860.043,47	2,95		

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	14,00	0,35	3,48	14,98	6.277.292,41	0,74	2.280.222.056,45	0,28
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	12,80	0,71	2,71	10,30	5.450.708,60	0,65	710.413.926,44	0,77
Sub-total Artigo 9º III			13,06	0,52	3,12	12,76	11.728.001,01	1,39		
Investimentos no Exterior			12,05	0,87	3,26	13,04	36.588.044,48	4,34		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,98%

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	7,02	0,00	0,00	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	29,68	0,11	0,11	2,98	23.158.689,87	2,74	369.381.113,95	6,27
Sub-total Artigo 10º II			26,83	0,10	0,10	2,75	25.177.204,60	2,98		
Investimentos Estruturados			26,83	0,10	0,10	2,75	25.177.204,60	2,98		
Total			1,49	0,05	0,79	2,63	843.959.466,62	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
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	727.608.265,35	86,21	65,00	83,00	97,50	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	44.396.384,90	5,26	2,50	5,00	10,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	772.004.650,25	91,47					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	10.189.567,29	1,21	0,00	5,00	15,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	10.189.567,29	1,21					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	24.860.043,47	2,95	0,00	2,60	5,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	11.728.001,01	1,39	0,00	1,30	5,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	36.588.044,48	4,34					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	25.177.204,60	2,98	0,00	3,10	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	25.177.204,60	2,98					15,00
Total		843.959.466,62	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	0,71 84,99	2,25 85,69	2,25 85,69	5,34 96,48	10,98 88,82	4.913.342,07	15.259.142,28
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,59 71,31	2,03 77,52	2,03 77,52	4,83 87,28	10,81 87,48	413.477,54	1.506.222,02
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,84 1,55	-0,71 3,82	-0,71 3,82	10,12 0,22	24,14 -1,60	85.199,95	-72.846,96
Artigo 9º II % do CDI	3,33 399,34	13,17 501,94	13,17 501,94	23,24 419,70	27,42 221,80	800.784,03	2.893.952,12
Artigo 9º III % do CDI	3,12 374,08	12,76 486,07	12,76 486,07	20,85 376,58	28,09 227,26	354.605,88	1.326.962,29
Artigo 10º II % do CDI	0,10 11,61	2,75 104,76	2,75 104,76	3,85 69,53	4,70 38,05	24.332,58	673.756,56
BERTIOGA (Total)						6.591.742,05	21.587.188,31

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	117.845.428,01	0,00	0,00	0,00	117.406.952,09	-438.475,92	-1.133.191,55
NTN-B 150535 (6,201000%)	27.127.895,10	0,00	0,00	0,00	27.408.204,46	280.309,36	858.991,13
NTN-B 150545	9.542.825,93	0,00	0,00	0,00	9.357.300,68	-185.525,25	-292.456,83
NTN-B 150545 (5,540000%)	16.887.728,36	0,00	0,00	0,00	17.053.774,03	166.045,67	509.493,20
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.175.771,87	0,00	0,00	0,00	11.286.763,42	110.991,55	340.456,48
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.360.042,76	0,00	0,00	0,00	20.562.422,62	202.379,86	620.792,79
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.231.842,11	0,00	0,00	0,00	11.343.900,32	112.058,21	343.693,82
NTN-B 150545 (5,816500%)	36.526.165,98	0,00	0,00	0,00	36.892.976,51	366.810,53	1.124.855,72
NTN-B 150545 (6,013000%)	22.654.192,00	0,00	0,00	0,00	22.885.058,22	230.866,22	707.734,56
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.714.337,85	0,00	0,00	0,00	10.823.855,03	109.517,18	335.709,58
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.375.901,62	0,00	0,00	0,00	26.647.256,38	271.354,76	831.604,92
NTN-B 150545 (6,305000%)	16.028.500,10	0,00	0,00	0,00	16.195.376,45	166.876,35	511.299,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (6,360000%)	36.825.849,26	0,00	0,00	0,00	37.210.804,23	384.954,97	1.179.282,88
NTN-B 150555 (5,540000%)	39.462.507,87	0,00	0,00	0,00	39.850.525,18	388.017,31	1.190.564,98
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.376.083,48	0,00	0,00	0,00	22.598.312,28	222.228,80	681.672,06
NTN-B 150555 (5,720000%)	39.361.723,73	0,00	0,00	0,00	39.754.112,98	392.389,25	1.203.594,18
NTN-B 150555 (5,750000%)	26.859.997,38	0,00	0,00	0,00	27.128.378,53	268.381,15	823.131,08
NTN-B 150824	11.288.104,80	0,00	0,00	0,00	11.426.207,55	138.102,75	352.162,81
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.250.167,49	0,00	0,00	0,00	7.323.002,48	72.834,99	226.514,79
NTN-B 150832 (5,858000%)	15.573.908,01	0,00	0,00	0,00	15.730.787,56	156.879,55	487.810,88
NTN-B 150832 (5,969000%)	21.981.850,50	0,00	0,00	0,00	22.205.124,28	223.273,78	694.187,20
NTN-B 150840 (5,621000%)	10.850.649,68	0,00	0,00	0,00	10.958.004,89	107.355,21	333.815,19
NTN-B 150840 (5,690000%)	16.363.573,88	0,00	0,00	0,00	16.526.325,98	162.752,10	506.062,81
NTN-B 150840 (5,759500%)	25.343.751,39	0,00	0,00	0,00	25.597.158,93	253.407,54	787.911,20
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.400.433,18	0,00	0,00	0,00	10.506.056,66	105.623,48	328.356,94
NTN-B 150850	12.213.047,07	0,00	0,00	0,00	12.115.460,52	-97.586,55	-291.662,48
NTN-B 150850 (5,540000%)	21.930.025,17	0,00	0,00	0,00	22.145.648,53	215.623,36	670.372,43
NTN-B 150850 (5,670000%)	21.752.677,23	0,00	0,00	0,00	21.968.708,94	216.031,71	671.605,97
NTN-B 150850 (5,730000%)	16.393.900,28	0,00	0,00	0,00	16.557.461,20	163.560,92	508.473,08
NTN-B 150850 (5,762000%)	0,00	39.996.041,19	0,00	0,00	40.142.344,42	146.303,22	146.303,22
	682.698.882,09	39.996.041,19	0,00	0,00	727.608.265,35	4.913.342,07	

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	2.011.165,06	0,00	0,00	0,00	2.029.472,31	18.307,25	55.616,60
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	21.606.975,78	0,00	0,00	0,00	21.804.609,06	197.633,28	598.521,15
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	17.461.891,18	0,00	0,00	0,00	17.462.156,60	265,42	43.654,35
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	40.848.916,53	4.110.000,00	-42.056.041,19	0,00	3.100.146,93	197.271,59	808.429,92
	81.928.948,55	4.110.000,00	-42.056.041,19	0,00	44.396.384,90	413.477,54	

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	124.043,35	0,00	0,00	0,00	123.766,22	-277,13	-134,73
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4.668.685,14	0,00	0,00	0,00	4.803.571,36	134.886,22	64.457,88
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.747.396,24	0,00	0,00	0,00	4.699.491,99	-47.904,25	-111.916,35
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	564.242,61	0,00	0,00	0,00	562.737,72	-1.504,89	-25.253,76
	10.104.367,34	0,00	0,00	0,00	10.189.567,29	85.199,95	

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	5.416.913,20	0,00	0,00	0,00	5.650.601,37	233.688,17	613.518,16
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8.965.214,04	0,00	0,00	0,00	9.159.142,71	193.928,67	1.211.287,84
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9.677.132,20	0,00	0,00	0,00	10.050.299,39	373.167,19	1.069.146,12
	24.059.259,44	0,00	0,00	0,00	24.860.043,47	800.784,03	

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	6.066.313,02	0,00	0,00	0,00	6.277.292,41	210.979,39	817.875,00
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.307.082,11	0,00	0,00	0,00	5.450.708,60	143.626,49	509.087,29
	11.373.395,13	0,00	0,00	0,00	11.728.001,01	354.605,88	

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	2.018.514,73	0,00	0,00	0,00	2.018.514,73	0,00	3.773,71
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	23.134.357,29	0,00	0,00	0,00	23.158.689,87	24.332,58	669.982,85
	25.152.872,02	0,00	0,00	0,00	25.177.204,60	24.332,58	

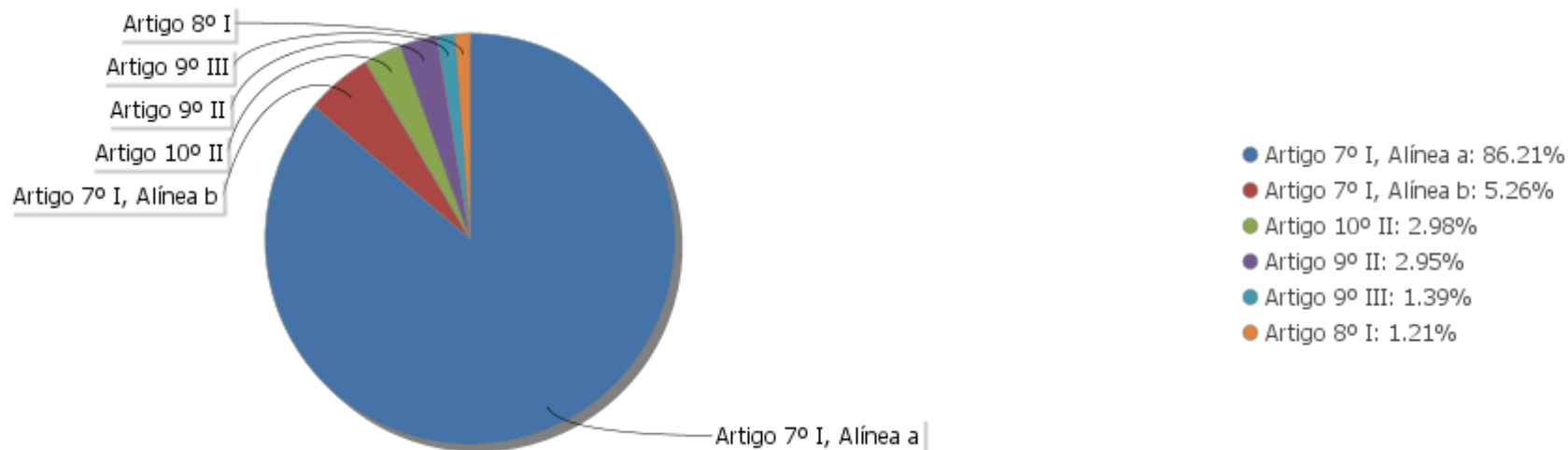
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

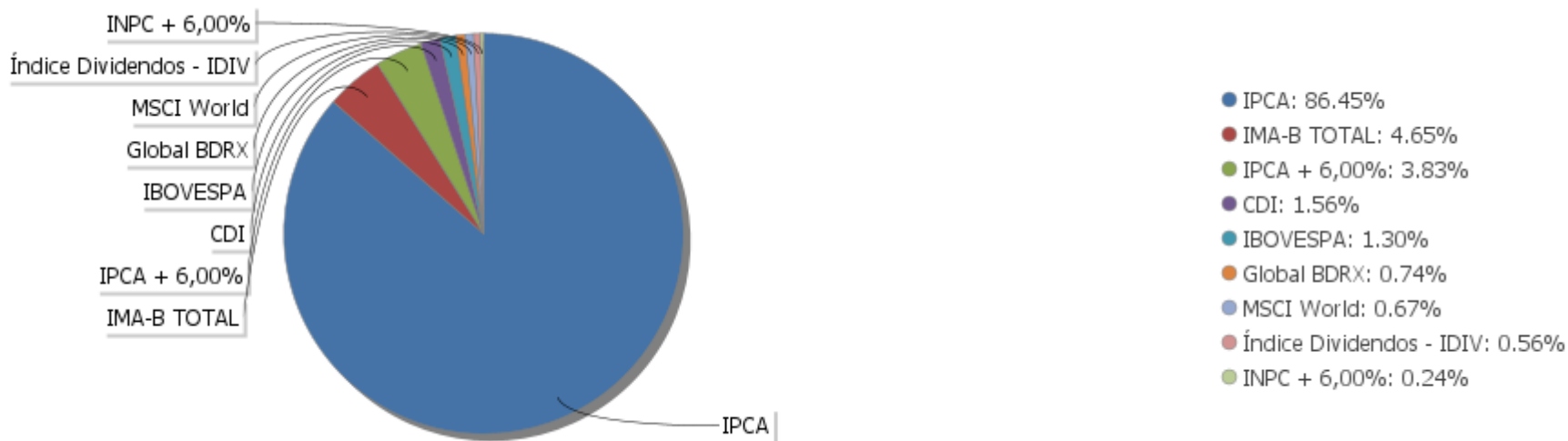
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	47.196.781,44	5,59	10,00	47.196.781,44	5,59	10,00
de 31 dias a 365 dias	39.959.780,91	4,73	1,00	87.156.562,35	10,33	11,00
acima de 365 dias	756.802.904,27	89,67	60,00	843.959.466,62	100,00	71,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

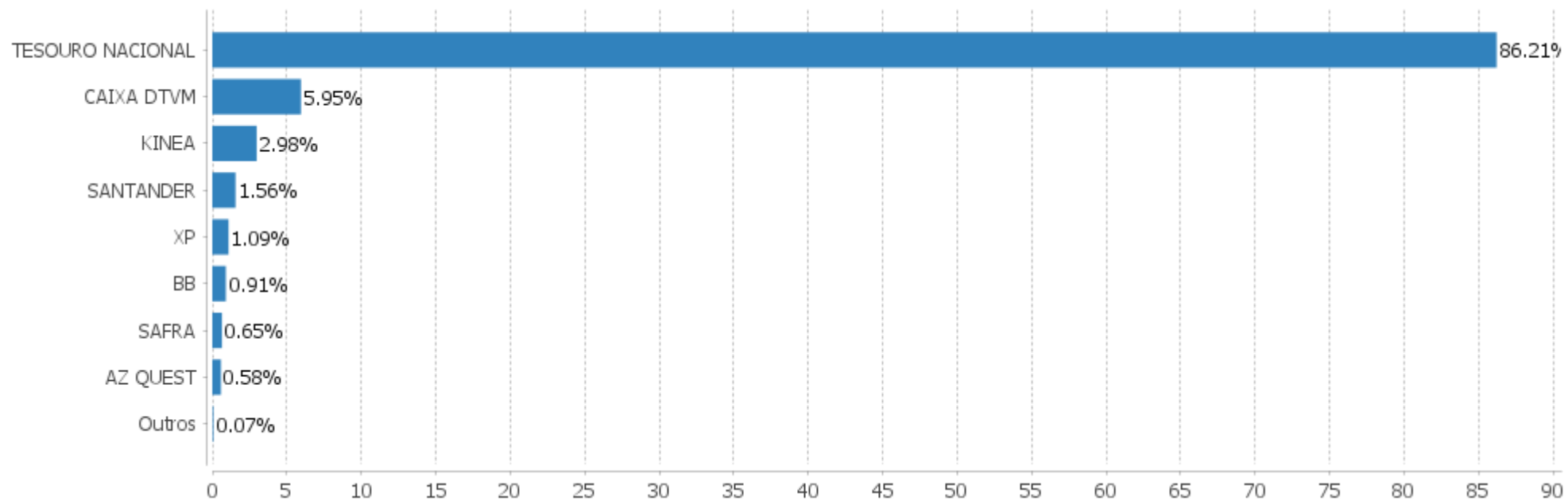


Alocação Por Estratégia



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	0,79										2,63
IPCA + 5,31%	0,87	1,22	0,57										2,69
p.p. indexador	-0,22	-0,06	0,21										-0,07
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	43	49,43	03 meses	2,63	2,69	-0,07	0,91
Meses abaixo - Meta Atuarial	44	50,57	06 meses	5,95	5,11	0,84	1,24
			12 meses	11,64	9,33	2,30	1,49
			24 meses	17,03	20,22	-3,18	2,93
			36 meses	18,37	40,95	-22,58	4,23
			48 meses	38,97	58,13	-19,16	5,74
			60 meses	43,52	73,19	-29,66	7,93

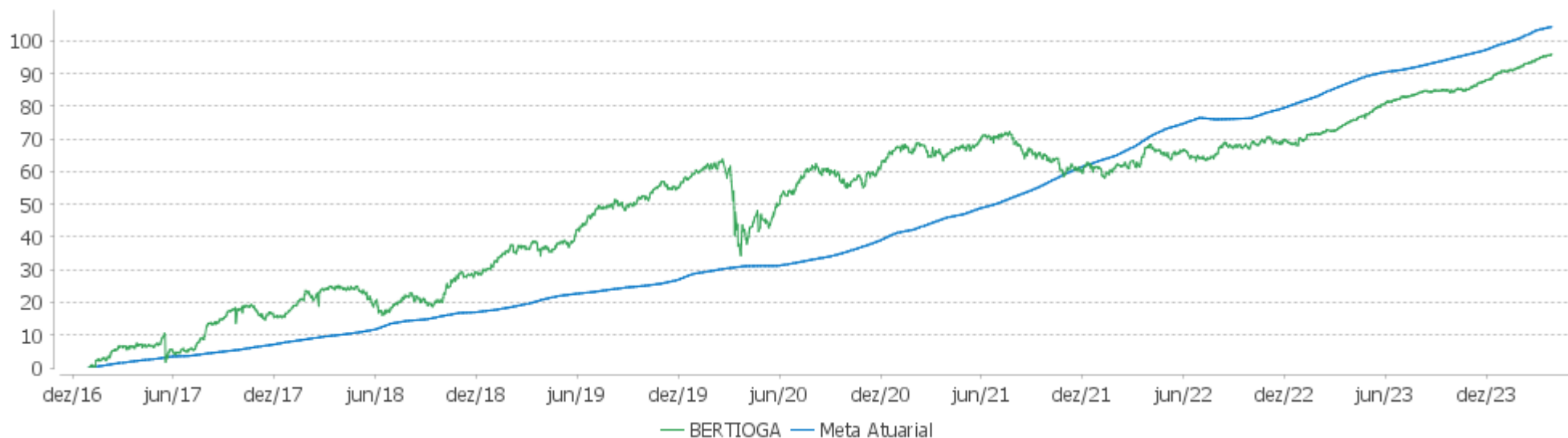
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	95,81	113,72	-17,91	8,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

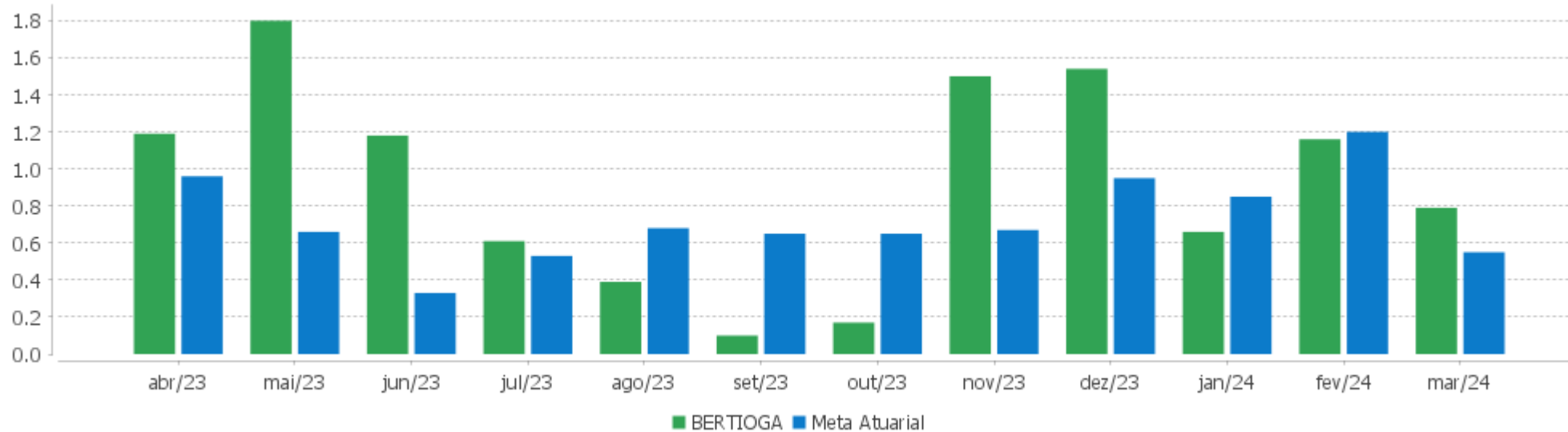


Patrimônio Líquido



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 150824 Var. IPCA p.p.	1,22 1,06	3,15 1,74	3,15 1,74	5,33 2,81	10,26 6,34	20,88 12,12	31,38 10,33
NTN-B 150545 (5,681500%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,11 1,70	3,11 1,70	5,54 3,03	7,14 3,22	12,78 4,02	
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,12 1,70	3,12 1,70	5,52 3,00	10,16 6,23	22,64 13,88	39,45 18,40
NTN-B 150840 (5,966000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,86	3,18 1,76	3,18 1,76	5,66 3,14	10,45 6,52	23,28 14,52	36,41 15,37
NTN-B 150545 (6,305000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,88	3,26 1,84	3,26 1,84	5,86 3,35	10,84 6,91	20,42 11,67	33,37 12,32
NTN-B 150535 Var. IPCA p.p.	-0,37 -0,53	-0,96 -2,37	-0,96 -2,37	4,18 1,66	12,75 8,82	19,16 10,40	20,36 -0,69
NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,11 1,69	3,11 1,69	5,56 3,05	10,20 6,27	22,66 13,90	39,49 18,44
NTN-B 150840 (5,759500%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,13 1,72	3,13 1,72	5,55 3,04	10,23 6,31	16,03 7,27	
NTN-B 150545 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,82	3,08 1,66	3,08 1,66	5,47 2,96	10,04 6,11	22,32 13,57	35,22 14,17
NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,12 1,71	3,12 1,71	5,59 3,08	10,26 6,34	22,80 14,04	39,69 18,64
NTN-B 150545 (6,013000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,86	3,19 1,78	3,19 1,78	5,71 3,20	10,53 6,61	16,45 7,69	
NTN-B 150555 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,11 1,69	3,11 1,69	5,58 3,07	10,22 6,29	22,68 13,92	35,70 14,66
NTN-B 150535 (6,201000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,87	3,24 1,82	3,24 1,82	5,74 3,23	10,66 6,73	20,18 11,42	
NTN-B 150826 (5,822000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,15 1,73	3,15 1,73	5,45 2,94	10,16 6,23	22,79 14,03	35,70 14,65
NTN-B 150545 (6,054000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,86	3,20 1,79	3,20 1,79	5,73 3,22	10,58 6,65	19,96 11,20	32,78 11,73
NTN-B 150545 (6,360000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,89	3,27 1,86	3,27 1,86	5,89 3,37	10,90 6,97	16,93 8,17	
NTN-B 150840 (5,621000%)	0,99	3,10	3,10	5,48	10,09	22,48	39,20

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.	0,83	1,68	1,68	2,97	6,16	13,72	18,15
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	-1,94 -2,10	-3,03 -4,45	-3,03 -4,45	3,48 0,97	13,63 9,70	17,98 9,22	16,41 -4,64
NTN-B 150850 Var. IPCA p.p.	-0,80 -0,96	-2,31 -3,73	-2,31 -3,73	5,18 2,66	15,56 11,63	19,24 10,48	16,66 -4,39
NTN-B 150555 (5,720000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,12 1,71	3,12 1,71	5,61 3,09	10,27 6,35	22,79 14,04	35,84 14,79
NTN-B 150832 (5,969000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,86	3,18 1,77	3,18 1,77	5,61 3,10	10,40 6,48	19,70 10,94	
NTN-B 150545 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,11 1,69	3,11 1,69	5,54 3,02	10,17 6,25	22,63 13,87	35,60 14,55
NTN-B 150850 (5,762000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	0,21 -1,20	0,21 -1,20	2,45 -0,06	4,03 0,11		
NTN-B 150850 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,82	3,08 1,66	3,08 1,66	5,50 2,98	10,06 6,14	22,35 13,60	39,04 17,99
NTN-B 150832 (5,858000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,15 1,74	3,15 1,74	5,55 3,04	10,29 6,36	22,97 14,21	35,99 14,94
NTN-B 150545 (6,141000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,87	3,22 1,81	3,22 1,81	5,78 3,26	10,67 6,74	20,02 11,26	
NTN-B 150555 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,13 1,71	3,13 1,71	5,62 3,11	10,30 6,38	22,86 14,11	35,93 14,88
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,12 1,71	3,12 1,71	5,57 3,05	10,24 6,31	22,77 14,01	35,77 14,73
NTN-B 150555 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,82	3,08 1,66	3,08 1,66	5,52 3,00	10,08 6,16	22,38 13,62	35,34 14,29
NTN-B 150545 (5,816500%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,14 1,73	3,14 1,73	5,61 3,10	7,23 3,31	12,91 4,15	
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,00 -0,08	0,25 0,07	0,25 0,07	4,46 -0,48	10,96 -0,85	15,86 -4,35	21,36 -4,26
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	0,91 0,26	2,77 -0,25	2,77 -0,25	4,98 -0,31	9,78 0,30	21,57 0,47	33,27 -10,16
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,91 0,84	2,78 2,60	2,78 2,60	4,99 0,05	9,77 -2,04	20,11 -0,10	30,21 4,59
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,82 98,92	2,60 98,94	2,60 98,94	5,45 98,38	12,21 98,79	26,94 98,74	35,11 99,04
AZ QUEST ACOES FIC FIA	-0,22	-0,11	-0,11	10,71	26,12	4,00	0,06

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.	0,48	4,42	4,42	0,81	0,38	-2,75	-9,78
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-1,01	-2,33	-2,33	10,04	26,45	13,34	20,66
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,19	1,48	1,48	-0,20	-0,75	-5,68	-12,24
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	2,89	1,36	1,36	10,39	23,62	0,40	-3,23
Var. IBOVESPA p.p.	3,60	5,89	5,89	0,49	-2,12	-6,36	-13,06
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-0,27	-4,29	-4,29	8,27	22,87	5,99	1,97
Var. IBOVESPA p.p.	0,44	0,24	0,24	-1,63	-2,87	-0,77	-7,87
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,48	14,98	14,98	23,77	32,44	27,69	18,24
Var. Global BDRX p.p.	-0,57	-0,90	-0,90	-1,11	-2,21	-2,86	-5,60
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	2,71	10,30	10,30	17,65	23,43	15,35	8,10
Var. IBOVESPA p.p.	3,41	14,83	14,83	7,75	-2,31	8,59	-1,74
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	4,31	12,18	12,18	19,91	23,19	21,15	13,69
Var. MSCI World p.p.							
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	3,86 462,66	11,90 453,54	11,90 453,54	19,94 360,02	21,29 172,21	18,17 66,60	-0,60 -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
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,11	2,98	2,98	4,06	5,24	-4,93	15,54
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,52	0,12	0,12	-1,39	-4,79	-26,99	-28,46
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	0,00	0,19	0,19	1,54	-2,69		
Var. IPCA p.p.	-0,16	-1,23	-1,23	-0,98	-6,62		
BERTIOGA	0,79	2,63	2,63	5,95	11,64	17,03	18,37
Var. IPCA + 4,99% p.p.	0,21	-0,07	-0,07	0,84	2,30	-3,46	-22,86
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
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 IBOVESA 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	0,84	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 (6,201000%)	27.408.204,46	6,201000	28.158.452,53	5,847100	750.248,07
NTN-B 150545 (5,540000%)	17.053.774,03	5,540000	16.377.819,71	5,891100	-675.954,32
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.286.763,42	5,670000	11.003.916,61	5,891100	-282.846,81
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.562.422,62	5,681500	20.073.757,99	5,891100	-488.664,63
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.343.900,32	5,730000	11.136.387,52	5,891100	-207.512,80
NTN-B 150545 (5,816500%)	36.892.976,51	5,816500	36.579.632,90	5,891100	-313.343,61
NTN-B 150545 (6,013000%)	22.885.058,22	6,013000	23.204.487,07	5,891100	319.428,85
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.823.855,03	6,054000	11.025.995,09	5,891100	202.140,06
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.647.256,38	6,141000	27.412.646,19	5,891100	765.389,81
NTN-B 150545 (6,305000%)	16.195.376,45	6,305000	16.969.523,09	5,891100	774.146,64
NTN-B 150545 (6,360000%)	37.210.804,23	6,360000	39.229.051,03	5,891100	2.018.246,80
NTN-B 150555 (5,540000%)	39.850.525,18	5,540000	38.057.785,52	5,874700	-1.792.739,66
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.598.312,28	5,670000	21.974.342,51	5,874700	-623.969,77
NTN-B 150555 (5,720000%)	39.754.112,98	5,720000	38.923.441,44	5,874700	-830.671,54
NTN-B 150555 (5,750000%)	27.128.378,53	5,750000	26.671.080,77	5,874700	-457.297,76
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.323.002,48	5,822000	7.345.084,21	5,680000	22.081,73
NTN-B 150832 (5,858000%)	15.730.787,56	5,858000	15.765.280,51	5,823200	34.492,95
NTN-B 150832 (5,969000%)	22.205.124,28	5,969000	22.409.684,84	5,823200	204.560,56
NTN-B 150840 (5,621000%)	10.958.004,89	5,621000	10.699.421,23	5,857500	-258.583,66
NTN-B 150840 (5,690000%)	16.526.325,98	5,690000	16.249.528,17	5,857500	-276.797,81
NTN-B 150840 (5,759500%)	25.597.158,93	5,759500	25.345.778,79	5,857500	-251.380,14
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.506.056,66	5,966000	10.621.005,28	5,857500	114.948,62
NTN-B 150850 (5,540000%)	22.145.648,53	5,540000	21.175.869,76	5,883900	-969.778,77
NTN-B 150850 (5,670000%)	21.968.708,94	5,670000	21.367.901,55	5,883900	-600.807,39
NTN-B 150850 (5,730000%)	16.557.461,20	5,730000	16.231.051,04	5,883900	-326.410,16
NTN-B 150850 (5,762000%)	40.142.344,42	5,762000	39.514.906,18	5,883900	-627.438,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
446	08/03/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	4.110.000,00	0,00	107.070,48519858	38,3859286000
447	14/03/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	39.996.041,19	1.040.224,06745605	38,4494480000
448	14/03/2024	NTN-B 150850 (5,762000%)	39.996.041,19	0,00	9.054,00000000	4.417,4995800000
450	27/03/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.060.000,00	53.381,44075685	38,5901911000
Total			44.106.041,19	42.056.041,19		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.970.724,86

Value-At-Risk: 0,47%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,66	0,41	10,00	0,32	-0,20	0,70	772.004.650,25	91,47
Artigo 8º	8,41	5,89	30,00	0,04	0,00	0,84	10.189.567,29	1,21
Artigo 9º	11,49	5,56	30,00	0,11	0,21	3,26	36.588.044,48	4,34
Artigo 10º	0,34	0,18	55,00	0,00	-2,15	0,10	25.177.204,60	2,98
BERTIOGA		0,47		0,47			843.959.466,62	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,41%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535	2,89	2,11	0,24	2,10	-0,42	-0,37	117.406.952,09	13,91
NTN-B 150824	1,07	0,44	0,00	0,45	0,36	1,22	11.426.207,55	1,35
NTN-B 150850	4,81	2,48	0,03	2,47	-0,34	-0,80	12.115.460,52	1,44
NTN-B 150545	5,85	2,31	0,02	2,30	-0,47	-1,94	9.357.300,68	1,11
NTN-B 150535 (6,201000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,78	1,03	27.408.204,46	3,25
NTN-B 150545 (5,540000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,59	0,98	17.053.774,03	2,02
NTN-B 150545 (5,670000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,63	0,99	11.286.763,42	1,34
NTN-B 150545 (5,681500%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,63	0,99	20.562.422,62	2,44
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,64	1,00	11.343.900,32	1,34
NTN-B 150545 (5,816500%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,67	1,00	36.892.976,51	4,37
NTN-B 150545 (6,013000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,73	1,02	22.885.058,22	2,71
NTN-B 150545 (6,054000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,74	1,02	10.823.855,03	1,28
NTN-B 150545 (6,141000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,77	1,03	26.647.256,38	3,16
NTN-B 150545 (6,305000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,81	1,04	16.195.376,45	1,92
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,83	1,05	37.210.804,23	4,41
NTN-B 150555 (5,540000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,59	0,98	39.850.525,18	4,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,63	0,99	22.598.312,28	2,68
NTN-B 150555 (5,720000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,64	1,00	39.754.112,98	4,71
NTN-B 150555 (5,750000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,65	1,00	27.128.378,53	3,21
NTN-B 150826 (5,822000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,67	1,00	7.323.002,48	0,87
NTN-B 150832 (5,858000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,68	1,01	15.730.787,56	1,86
NTN-B 150832 (5,969000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,71	1,02	22.205.124,28	2,63
NTN-B 150840 (5,621000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,61	0,99	10.958.004,89	1,30
NTN-B 150840 (5,690000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,63	0,99	16.526.325,98	1,96
NTN-B 150840 (5,759500%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,65	1,00	25.597.158,93	3,03
NTN-B 150840 (5,966000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,71	1,02	10.506.056,66	1,24
NTN-B 150850 (5,540000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,59	0,98	22.145.648,53	2,62
NTN-B 150850 (5,670000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,63	0,99	21.968.708,94	2,60
NTN-B 150850 (5,730000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,64	1,00	16.557.461,20	1,96
NTN-B 150850 (5,762000%)	0,26	0,21	-0,00	0,24	0,65	1,00	40.142.344,42	4,76
Sub-total	0,65	0,41	0,30		-0,19	0,71	727.608.265,35	86,21

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,02	0,01	0,00	0,01	-0,44	0,82	3.100.146,93	0,37
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	2,33	1,25	0,02	0,38	-0,36	0,00	17.462.156,60	2,07
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,42	0,33	0,00	1,29	0,19	0,91	21.804.609,06	2,58
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,42	0,33	-0,00	0,35	0,18	0,91	2.029.472,31	0,24
Sub-total	0,82	0,51	0,02		-0,29	0,59	44.396.384,90	5,26

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,56%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	9,34	4,77	0,01	4,77	0,37	4,31	5.650.601,37	0,67
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA	18,55	10,03	0,05	10,02	0,07	2,16	9.159.142,71	1,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INVESTIMENTO NO EXTERIOR								
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8,74	4,53	0,02	4,53	0,35	3,86	10.050.299,39	1,19
Sub-total	11,57	6,22	0,08		0,22	3,33	24.860.043,47	2,95

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,38	5,51	0,02	0,56	0,21	3,48	6.277.292,41	0,74
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	10,75	5,41	0,01	7,63	0,17	2,71	5.450.708,60	0,65
Sub-total	11,32	5,24	0,03		0,20	3,12	11.728.001,01	1,39

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	0,00	0,04	0,00	0,11	0,00	0,00	2.018.514,73	0,24
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,37	0,20	0,00	0,21	-1,95	0,11	23.158.689,87	2,74
Sub-total	0,34	0,18	0,00		-2,15	0,10	25.177.204,60	2,98

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,89%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA	11,93	7,22	0,00	3,03	-0,09	-0,22	123.766,22	0,01
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	8,55	5,14	0,02	1,87	-0,22	-1,01	4.699.491,99	0,56
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	10,16	5,64	0,00	1,03	-0,11	-0,27	562.737,72	0,07
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	9,06	6,97	0,02	3,46	0,23	2,89	4.803.571,36	0,57
Sub-total	8,41	5,89	0,04		0,00	0,84	10.189.567,29	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 (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

(5) Limite Política de Investimentos (%)