



LDB
EMPRESAS

BERTIOGA
MAIO 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 31.05.2024.

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 91,52%

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 150824	4,12	0,08	0,90	4,52	11.589.605,26	1,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,822000%)	0,26	0,04	0,88	4,82	7.441.548,81	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,858000%)	0,36	0,04	0,88	4,83	15.986.364,98	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,969000%)	0,37	0,04	0,89	4,88	22.569.922,77	2,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	5,25	0,32	1,72	-1,83	112.997.112,69	13,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,201000%)	0,40	0,04	0,91	4,97	27.058.490,32	3,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621000%)	0,43	0,04	0,87	4,73	11.131.775,69	1,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,43	0,04	0,87	4,76	16.790.276,51	1,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,759500%)	0,44	0,04	0,88	4,79	26.008.903,64	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,966000%)	0,45	0,04	0,89	4,87	10.678.605,67	1,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,51	0,40	1,53	-3,25	9.064.932,44	1,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,540000%)	0,49	0,04	0,86	4,70	16.851.623,10	1,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,670000%)	0,49	0,04	0,87	4,75	11.150.641,31	1,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,681500%)	0,49	0,04	0,87	4,76	20.314.047,67	2,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,50	0,04	0,87	4,78	11.205.987,10	1,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,816500%)	0,50	0,04	0,88	4,81	36.439.290,01	4,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,013000%)	0,51	0,04	0,90	4,89	22.596.179,55	2,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,054000%)	0,51	0,04	0,90	4,91	10.686.481,13	1,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,141000%)	0,51	0,04	0,91	4,95	26.305.127,95	3,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305000%)	0,52	0,04	0,92	5,01	15.982.863,63	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,360000%)	0,52	0,04	0,92	5,04	36.718.989,66	4,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	7,33	0,44	1,60	-4,33	11.865.308,03	1,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,540000%)	0,53	0,04	0,86	4,70	22.493.898,92	2,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	0,54	0,04	0,87	4,75	22.318.854,96	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,54	0,04	0,87	4,78	16.822.991,30	1,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,762000%)	4,00	0,04	0,88	1,98	40.788.198,16	4,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,165000%)	4,21	0,04	0,19	0,19	20.036.397,39	2,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,540000%)	0,57	0,04	0,86	4,70	39.390.088,80	4,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	0,57	0,04	0,87	4,75	22.330.763,95	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,720000%)	0,58	0,04	0,87	4,77	39.279.075,12	4,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,750000%)	0,58	0,04	0,88	4,79	26.802.416,21	3,13
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		1,20	0,10	1,04	3,40	741.696.762,73	86,49

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 PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,86	0,08	0,88	4,50	2.063.531,06	0,24	195.411.208,96	1,06
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,86	0,08	0,88	4,50	22.170.324,02	2,59	240.740.238,11	9,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	3,95	0,19	1,38	-0,11	17.399.167,24	2,03	1.010.421.816,77	1,72
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,07	0,04	0,82	4,34	1.439.324,93	0,17	7.328.166.843,37	0,02
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,47	0,12	1,04	2,97	43.072.347,25	5,02		
Renda Fixa			1,20	0,10	1,04	3,37	784.769.109,98	91,52		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,13%

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	15,71	-0,24	-3,86	-7,18	115.001,51	0,01	184.113.831,21	0,06
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	17,01	-0,58	-3,56	-6,16	4.447.332,54	0,52	730.564.070,51	0,61
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,35	-0,71	-1,49	-5,08	4.567.181,58	0,53	997.864.463,39	0,46
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,93	-0,51	-3,84	-11,17	522.299,94	0,06	321.251.863,45	0,16
Sub-total Artigo 8º I			14,14	-0,64	-2,61	-5,95	9.651.815,57	1,13		
Renda Variável			14,14	-0,64	-2,61	-5,95	9.651.815,57	1,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,43%

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	10,61	0,73	4,76	17,62	5.924.796,59	0,69	429.100.132,32	1,38
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,35	-1,27	-0,58	13,92	9.053.933,54	1,06	739.157.547,45	1,22
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10,40	0,97	4,67	16,83	10.492.840,76	1,22	656.690.005,40	1,60
Sub-total Artigo 9º II			12,25	0,11	2,76	15,96	25.471.570,89	2,97		

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	13,53	-0,46	6,78	23,76	6.756.515,43	0,79	2.462.872.316,84	0,27
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	12,22	0,20	5,86	15,95	5.729.846,87	0,67	733.091.092,91	0,78
Sub-total Artigo 9º III			12,51	-0,16	6,35	20,05	12.486.362,30	1,46		
Investimentos no Exterior			11,43	0,02	3,92	17,27	37.957.933,19	4,43		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,93%

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	6,91	0,15	0,15	1,84	2.051.899,34	0,24	165.077.034,56	1,24
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	3,34	-0,12	-0,12	2,60	23.073.843,14	2,69	368.027.808,83	6,27
Sub-total Artigo 10º II			3,09	-0,10	-0,10	2,54	25.125.742,48	2,93		
Investimentos Estruturados			3,09	-0,10	-0,10	2,54	25.125.742,48	2,93		
Total			1,23	0,08	1,08	3,77	857.504.601,22	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	741.696.762,73	86,49	65,00	83,00	97,50	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	43.072.347,25	5,02	2,50	5,00	10,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	784.769.109,98	91,52					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.651.815,57	1,13	0,00	5,00	15,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	9.651.815,57	1,13					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	25.471.570,89	2,97	0,00	2,60	5,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	12.486.362,30	1,46	0,00	1,30	5,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	37.957.933,19	4,43					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	25.125.742,48	2,93	0,00	3,10	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	25.125.742,48	2,93					15,00
Total		857.504.601,22	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,04 124,27	3,40 77,41	1,85 71,69	4,92 92,23	8,85 73,75	7.510.787,07	23.451.970,39
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,04 124,85	2,97 67,57	1,52 58,94	4,26 79,88	9,38 78,10	545.012,05	1.992.184,37
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,61 0,42	-5,95 3,06	-4,48 0,89	-0,72 3,39	11,04 -1,66	-259.041,31	-610.598,68
Artigo 9º II % do CDI	2,76 331,67	15,96 362,84	5,87 227,87	20,53 384,81	27,67 230,43	685.071,87	3.505.479,54
Artigo 9º III % do CDI	6,35 762,52	20,05 455,84	9,79 379,87	23,11 433,26	31,33 260,94	746.028,15	2.085.323,58
Artigo 10º II % do CDI	-0,10 -11,82	2,54 57,74	-0,11 -4,19	2,95 55,27	4,52 37,65	-24.774,00	622.294,44
BERTIOGA (Total)						9.203.083,83	31.046.653,64

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	114.402.319,52	0,00	0,00	3.363.145,27	112.997.112,69	1.957.938,44	-2.179.885,68
NTN-B 150535 (6,201000%)	27.617.137,66	0,00	0,00	806.604,42	27.058.490,32	247.957,08	1.315.881,41
NTN-B 150545	9.195.893,86	0,00	0,00	270.930,21	9.064.932,44	139.968,79	-313.894,86
NTN-B 150545 (5,540000%)	17.174.415,12	0,00	0,00	468.257,29	16.851.623,10	145.465,27	775.599,56
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.367.831,60	0,00	0,00	314.612,34	11.150.641,31	97.422,05	518.946,71
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.710.307,14	0,00	0,00	573.927,64	20.314.047,67	177.668,17	946.345,48
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.425.939,74	0,00	0,00	318.399,80	11.205.987,10	98.447,16	524.180,40
NTN-B 150545 (5,816500%)	37.162.450,27	0,00	0,00	1.045.846,14	36.439.290,01	322.685,88	1.717.015,36
NTN-B 150545 (6,013000%)	23.055.949,27	0,00	0,00	663.438,13	22.596.179,55	203.668,41	1.082.294,02
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.905.046,38	0,00	0,00	315.243,58	10.686.481,13	96.678,33	513.579,26
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.849.059,50	0,00	0,00	783.753,36	26.305.127,95	239.821,81	1.273.229,85
NTN-B 150545 (6,305000%)	16.320.225,65	0,00	0,00	485.174,64	15.982.863,63	147.812,62	783.961,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (6,360000%)	37.499.355,71	0,00	0,00	1.121.595,50	36.718.989,66	341.229,45	1.809.063,81
NTN-B 150555 (5,540000%)	40.132.439,25	0,00	0,00	1.082.332,09	39.390.088,80	339.981,64	1.812.460,69
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.760.622,58	0,00	0,00	624.932,21	22.330.763,95	195.073,58	1.039.055,94
NTN-B 150555 (5,720000%)	40.041.307,56	0,00	0,00	1.106.950,63	39.279.075,12	344.718,19	1.835.506,95
NTN-B 150555 (5,750000%)	27.325.013,96	0,00	0,00	758.503,58	26.802.416,21	235.905,83	1.255.672,34
NTN-B 150824	11.485.783,70	0,00	0,00	0,00	11.589.605,26	103.821,56	515.560,52
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.376.521,77	0,00	0,00	0,00	7.441.548,81	65.027,04	345.061,12
NTN-B 150832 (5,858000%)	15.846.234,20	0,00	0,00	0,00	15.986.364,98	140.130,78	743.388,30
NTN-B 150832 (5,969000%)	22.370.123,65	0,00	0,00	0,00	22.569.922,77	199.799,12	1.058.985,69
NTN-B 150840 (5,621000%)	11.036.258,94	0,00	0,00	0,00	11.131.775,69	95.516,75	507.585,99
NTN-B 150840 (5,690000%)	16.645.300,41	0,00	0,00	0,00	16.790.276,51	144.976,10	770.013,34
NTN-B 150840 (5,759500%)	25.782.907,62	0,00	0,00	0,00	26.008.903,64	225.996,02	1.199.655,91
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.584.099,73	0,00	0,00	0,00	10.678.605,67	94.505,94	500.905,95
NTN-B 150850	11.678.024,99	0,00	0,00	0,00	11.865.308,03	187.283,04	-541.814,97
NTN-B 150850 (5,540000%)	22.302.315,72	0,00	0,00	0,00	22.493.898,92	191.583,20	1.018.622,82
NTN-B 150850 (5,670000%)	22.126.485,99	0,00	0,00	0,00	22.318.854,96	192.368,97	1.021.751,99
NTN-B 150850 (5,730000%)	16.677.206,10	0,00	0,00	0,00	16.822.991,30	145.785,20	774.003,18
NTN-B 150850 (5,762000%)	40.433.728,80	0,00	0,00	0,00	40.788.198,16	354.469,36	792.156,96
NTN-B 150850 (6,165000%)	0,00	19.999.316,10	0,00	0,00	20.036.397,39	37.081,29	37.081,29
	728.290.306,39	19.999.316,10	0,00	14.103.646,83	741.696.762,73	7.510.787,07	

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	2.045.454,28	0,00	0,00	0,00	2.063.531,06	18.076,78	89.675,35
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	21.976.285,76	0,00	0,00	0,00	22.170.324,02	194.038,26	964.236,11
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	17.161.494,62	0,00	0,00	0,00	17.399.167,24	237.672,62	-19.335,01
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	4.704.100,54	18.860.000,00	-22.220.000,00	0,00	1.439.324,93	95.224,39	957.607,92
	45.887.335,20	18.860.000,00	-22.220.000,00	0,00	43.072.347,25	545.012,05	

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	119.615,05	0,00	0,00	0,00	115.001,51	-4.613,54	-8.899,44
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4.611.725,29	0,00	0,00	0,00	4.447.332,54	-164.392,75	-291.780,94
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.636.361,95	0,00	0,00	0,00	4.567.181,58	-69.180,37	-244.226,76
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESA ATIVO FICFI	543.154,59	0,00	0,00	0,00	522.299,94	-20.854,65	-65.691,54
	9.910.856,88	0,00	0,00	0,00	9.651.815,57	-259.041,31	

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	5.655.444,70	0,00	0,00	0,00	5.924.796,59	269.351,89	887.713,38
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9.106.448,96	0,00	0,00	0,00	9.053.933,54	-52.515,42	1.106.078,67
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.024.605,36	0,00	0,00	0,00	10.492.840,76	468.235,40	1.511.687,49
	24.786.499,02	0,00	0,00	0,00	25.471.570,89	685.071,87	

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	6.327.619,40	0,00	0,00	0,00	6.756.515,43	428.896,03	1.297.098,02
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.412.714,75	0,00	0,00	0,00	5.729.846,87	317.132,12	788.225,56
	11.740.334,15	0,00	0,00	0,00	12.486.362,30	746.028,15	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2.048.757,80	0,00	0,00	0,00	2.051.899,34	3.141,54	37.158,32
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	23.101.758,68	0,00	0,00	0,00	23.073.843,14	-27.915,54	585.136,12
	25.150.516,48	0,00	0,00	0,00	25.125.742,48	-24.774,00	

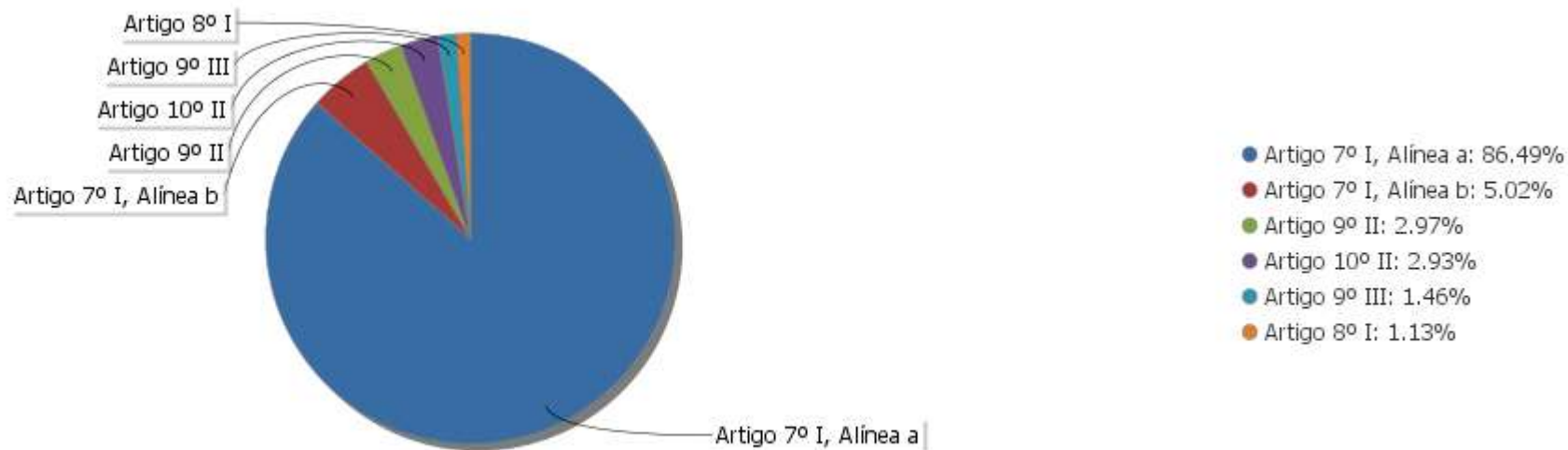
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

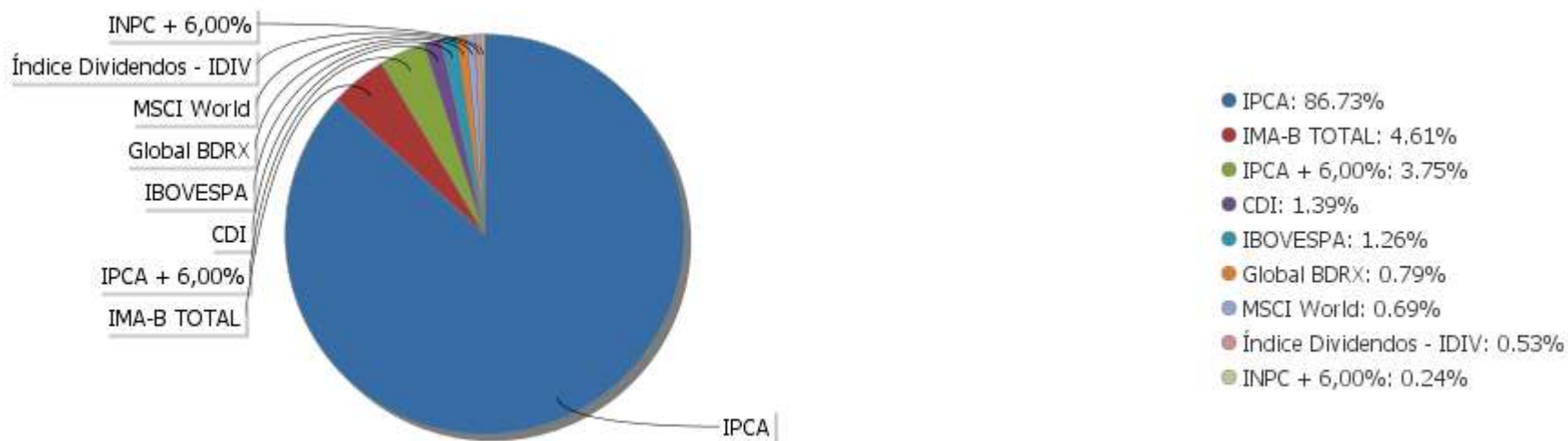
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	46.533.791,45	5,43	10,00	46.533.791,45	5,43	10,00
de 31 dias a 365 dias	40.390.641,92	4,71	1,00	86.924.433,37	10,14	11,00
acima de 365 dias	770.580.167,85	89,86	60,00	857.504.601,22	100,00	71,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

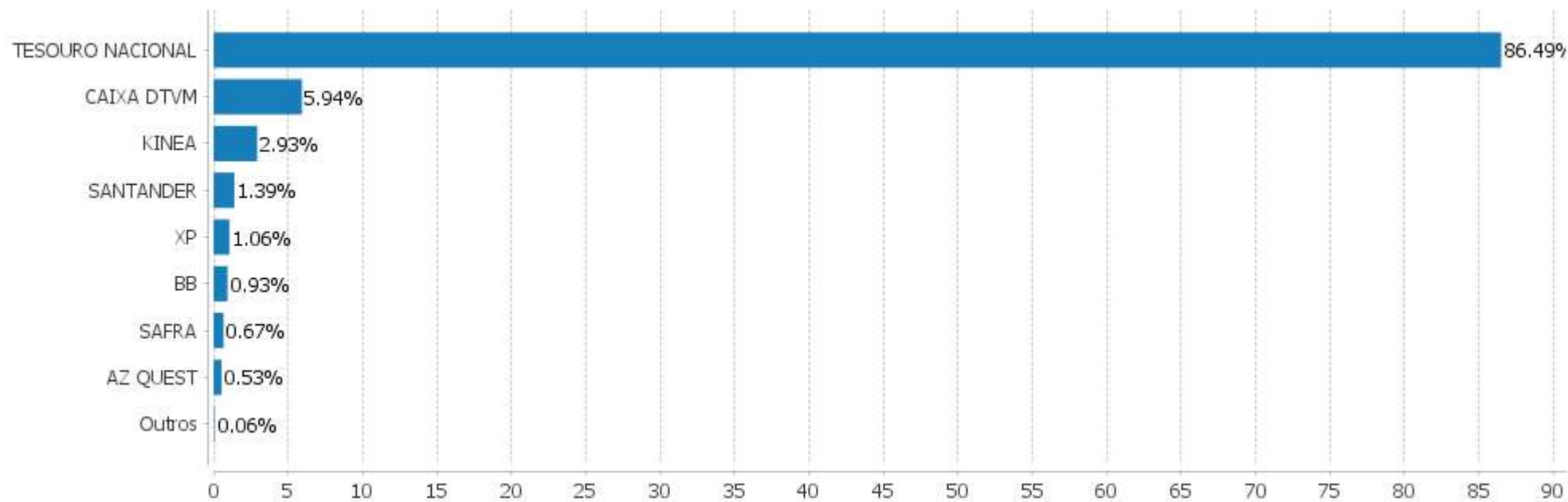


Alocação Por Estratégia



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	0,80	0,02	1,08								3,77
IPCA + 5,31%	0,87	1,22	0,57	0,83	0,89								4,48
p.p. indexador	-0,22	-0,06	0,23	-0,82	0,19								-0,70
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%	0,99	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	44	49,44	03 meses	1,91	2,32	-0,41	0,86
Meses abaixo - Meta Atuarial	45	50,56	06 meses	5,37	5,49	-0,12	0,98
			12 meses	9,59	9,40	0,19	1,23
			24 meses	18,99	19,50	-0,51	2,60
			36 meses	16,72	40,56	-23,83	4,07
			48 meses	32,30	60,53	-28,23	4,94
			60 meses	39,34	73,24	-33,90	7,85

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

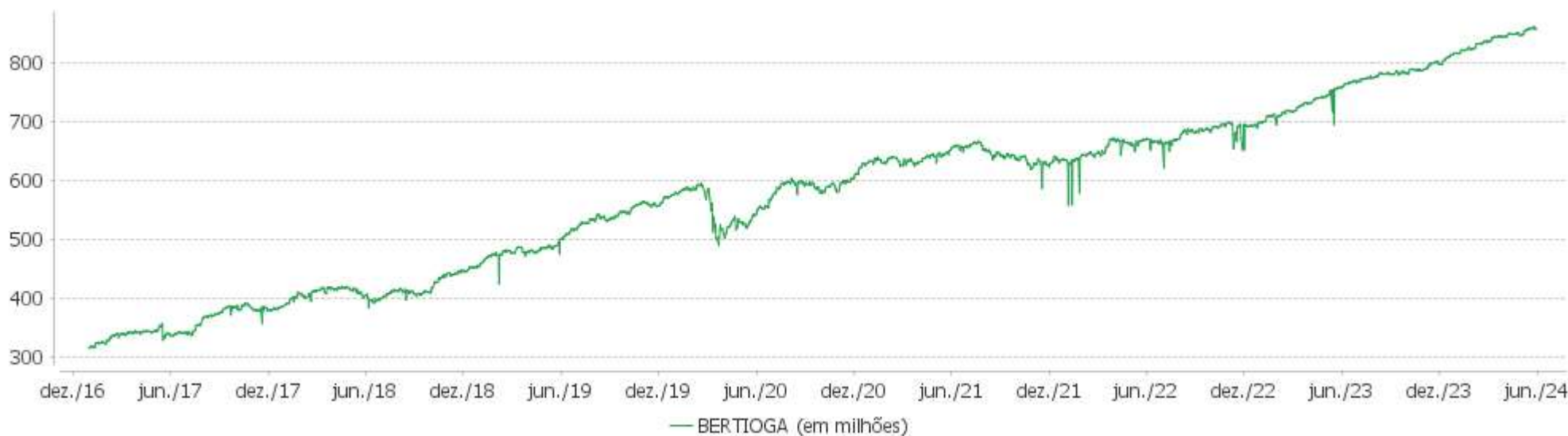
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	97,99	117,43	-19,44	8,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

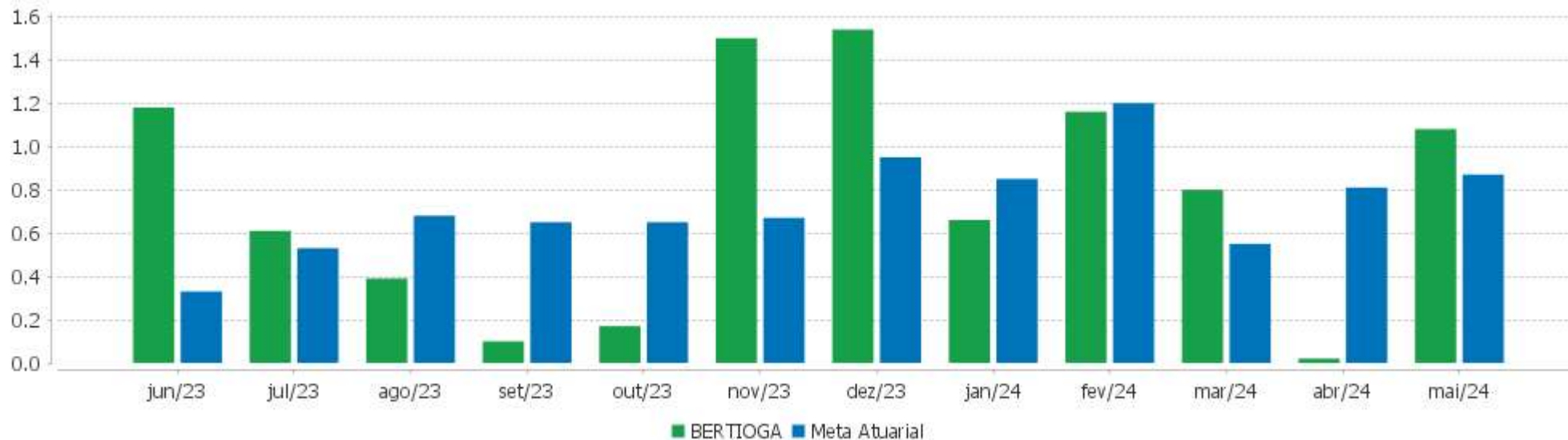


Patrimônio Líquido



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.	0,87 0,41	4,76 2,49	2,61 1,60	5,76 2,92	9,75 5,83	14,13 6,11	
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	4,63 2,36	2,67 1,67	5,50 2,66	11,24 7,32	19,98 11,97	30,56 9,87
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,76 2,49	2,61 1,60	5,73 2,89	9,73 5,80	20,68 12,66	38,97 18,28
NTN-B 150840 (5,966000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,87 2,61	2,67 1,67	5,87 3,03	10,02 6,09	21,31 13,30	35,95 15,26
NTN-B 150545 (6,305000%) Var. IPCA p.p.	0,92 0,46	5,01 2,74	2,76 1,75	6,08 3,24	10,41 6,49	22,14 14,12	36,99 16,30
NTN-B 150535 Var. IPCA p.p.	1,72 1,26	-1,83 -4,10	-1,25 -2,26	1,32 -1,52	4,52 0,59	16,54 8,53	18,47 -2,22
NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,75 2,48	2,60 1,60	5,78 2,94	9,77 5,84	20,70 12,68	39,01 18,32
NTN-B 150840 (5,759500%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,79 2,52	2,62 1,62	5,76 2,92	9,80 5,88	14,18 6,16	
NTN-B 150850 (6,165000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,45	1,83 -0,43	2,72 1,72	2,70 -0,14	3,71 -0,22		
NTN-B 150545 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,40	4,70 2,43	2,57 1,57	5,68 2,84	9,60 5,68	20,37 12,36	38,51 17,82
NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,78 2,51	2,62 1,61	5,81 2,97	9,83 5,90	20,84 12,82	39,22 18,53
NTN-B 150555 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,75 2,48	2,60 1,60	5,80 2,95	9,79 5,86	20,72 12,70	39,05 18,36
NTN-B 150545 (6,013000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	4,89 2,62	2,69 1,68	5,93 3,09	10,10 6,18	17,98 9,96	
NTN-B 150826 (5,822000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,82 2,55	2,64 1,64	5,67 2,82	9,73 5,80	20,83 12,82	35,24 14,55
NTN-B 150535 (6,201000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,45	4,97 2,70	2,73 1,73	5,96 3,12	10,23 6,30	21,82 13,80	36,65 15,96
NTN-B 150545 (6,054000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	4,91 2,64	2,70 1,69	5,95 3,11	10,15 6,22	21,56 13,54	36,26 15,57
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,92	5,04	2,77	6,11	10,47	18,61	

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.	0,46	2,77	1,77	3,27	6,54	10,60	
NTN-B 150840 (5,621000%)	0,87	4,73	2,59	5,69	9,66	20,52	38,73
Var. IPCA p.p.	0,41	2,46	1,59	2,85	5,73	12,50	18,04
NTN-B 150545	1,53	-3,25	-2,16	0,53	4,54	16,35	13,56
Var. IPCA p.p.	1,07	-5,51	-3,16	-2,31	0,61	8,34	-7,13
NTN-B 150850	1,60	-4,33	-2,85	0,31	3,58	15,85	11,64
Var. IPCA p.p.	1,14	-6,60	-3,85	-2,53	-0,35	7,83	-9,05
NTN-B 150555 (5,720000%)	0,87	4,77	2,61	5,82	9,84	20,84	39,22
Var. IPCA p.p.	0,41	2,51	1,61	2,98	5,91	12,82	18,53
NTN-B 150832 (5,969000%)	0,89	4,88	2,68	5,83	9,97	17,80	
Var. IPCA p.p.	0,43	2,61	1,67	2,98	6,05	9,78	
NTN-B 150545 (5,670000%)	0,87	4,75	2,60	5,75	9,74	20,67	38,96
Var. IPCA p.p.	0,41	2,48	1,60	2,91	5,82	12,65	18,27
NTN-B 150850 (5,762000%)	0,88	1,83	2,63	2,66	3,63		
Var. IPCA p.p.	0,42	-0,44	1,62	-0,18	-0,30		
NTN-B 150850 (5,540000%)	0,86	4,70	2,57	5,71	9,63	20,40	38,56
Var. IPCA p.p.	0,40	2,43	1,57	2,87	5,70	12,38	17,88
NTN-B 150832 (5,858000%)	0,88	4,83	2,65	5,77	9,86	21,01	35,53
Var. IPCA p.p.	0,42	2,56	1,65	2,93	5,93	13,00	14,84
NTN-B 150545 (6,141000%)	0,91	4,95	2,72	6,00	10,24	21,65	36,40
Var. IPCA p.p.	0,45	2,68	1,71	3,15	6,31	13,64	15,71
NTN-B 150555 (5,750000%)	0,88	4,79	2,62	5,84	9,87	20,90	39,32
Var. IPCA p.p.	0,42	2,52	1,62	2,99	5,94	12,89	18,63
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,87	4,78	2,62	5,78	9,80	20,81	39,17
Var. IPCA p.p.	0,41	2,51	1,61	2,94	5,88	12,79	18,48
NTN-B 150555 (5,540000%)	0,86	4,70	2,57	5,73	9,65	20,42	38,60
Var. IPCA p.p.	0,40	2,43	1,57	2,89	5,72	12,41	17,91
NTN-B 150545 (5,816500%)	0,88	4,81	2,64	5,83	9,90	14,32	
Var. IPCA p.p.	0,42	2,54	1,64	2,99	5,97	6,30	
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	1,38	-0,11	-0,36	2,20	5,52	13,22	19,38
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06	0,02	-0,13	-0,42	-1,04	-4,50	-3,75
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,88	4,50	2,60	5,46	11,06	20,55	33,60
Var. INPC + 6,00% p.p.	-0,07	-0,42	0,10	-0,52	1,57	0,18	-9,17
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,88	4,50	2,61	5,46	11,06	19,56	29,77
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,45	4,63	2,84	2,85	4,50	1,85	6,65
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,82	4,34	2,54	5,27	11,85	26,81	36,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	97,92	98,66	98,47	98,77	98,69	98,92	99,17
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,86 -0,82	-7,18 1,83	-7,29 -1,92	-2,13 1,98	12,44 -0,26	2,29 -7,36	-16,00 -12,74
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,49 -0,50	-5,08 0,22	-3,80 -1,07	0,53 -0,71	15,29 -4,27	14,39 -4,15	7,96 -13,44
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,56 -0,53	-6,16 2,85	-4,74 0,62	-1,24 2,87	7,57 -5,13	-0,30 -9,96	-19,96 -16,70
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-3,84 -0,80	-11,17 -2,16	-7,43 -2,07	-6,41 -2,30	6,58 -6,13	5,47 -4,18	-12,44 -9,18
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	6,78 -0,54	23,76 -1,31	11,38 -0,92	26,96 -1,66	35,62 -2,28	54,35 -3,94	31,48 -6,18
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	5,86 8,90	15,95 24,96	7,97 13,33	18,86 22,97	26,60 13,90	36,89 27,24	14,59 17,85
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI World p.p.	4,76	17,62	9,38	21,92	28,22	39,05	21,16
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	4,67 560,50	16,83 382,69	8,43 327,22	21,54 403,79	25,50 212,40	34,92 128,86	6,44 17,35
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,58 -1,53	13,92 9,16	0,99 -1,50	18,50 12,66	29,89 19,78	58,02 36,73	-10,73 -54,38
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,12 -1,07	2,60 -2,16	-0,26 -2,75	3,01 -2,82	4,98 -5,14	-4,41 -25,69	15,04 -28,60
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II Var. IPCA p.p.	0,15 -0,31	1,84 -0,42	1,65 0,65	2,22 -0,62	-0,41 -4,34		
BERTIOGA Var. IPCA + 4,99% p.p.	1,08 0,19	3,77 -0,70	1,91 -0,41	5,37 -0,12	9,59 0,19	18,99 -0,72	16,72 -24,14
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64

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	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO ÍNDICE SMALL CAP - SMLL, APURADO PELA B3.	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				2,00
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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	0,78	3,85	2,21	4,80	11,56	26,65	34,79	37,63	46,34
IRF-M 1+	0,60	0,94	-0,00	2,69	10,22	27,67	26,53	26,17	43,40
IRF-M TOTAL	0,66	1,81	0,67	3,32	10,51	26,78	28,81	29,73	44,40
IMA-B 5	1,05	2,92	1,62	4,42	8,94	19,23	30,62	40,27	53,54
IMA-B 5+	1,59	-2,85	-1,91	0,98	4,24	16,02	15,73	28,10	33,44
IMA-B TOTAL	1,33	-0,13	-0,23	2,62	6,56	17,72	23,13	34,41	43,39
IMA-GERAL TOTAL	0,95	2,37	1,25	4,04	10,06	23,87	30,39	35,87	46,18
IDKA 2	1,07	3,03	1,78	4,53	9,23	18,78	29,76	40,74	53,45
IDKA 20	2,01	-7,44	-4,45	-1,34	1,87	15,01	3,51	19,85	17,13
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13	40,12	46,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26	39,70	25,83
IBRX 100	-3,18	-8,57	-5,17	-3,56	13,24	8,19	-5,26	39,86	27,37
IBRX 50	-3,11	-7,63	-4,50	-2,72	14,94	9,84	-3,24	44,50	28,06
SMALL CAP	-3,38	-14,52	-8,96	-8,50	-4,39	-11,41	-35,21	2,20	0,47
Índice Consumo - ICON	-2,26	-14,63	-6,94	-9,52	-7,70	-22,28	-50,93	-37,26	-32,43
Índice Dividendos - IDIV	-0,99	-5,29	-2,73	1,24	19,55	18,54	21,40	67,35	58,14

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	6,22	19,79	8,92	22,70	29,87	41,57	25,76	67,46	155,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,02	2,14	0,66	6,48	12,24	19,92	20,09	27,27	32,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	5,22	16,99	8,53	20,14	25,00	33,38	10,61	48,94	112,32

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,46	2,27	1,00	2,84	3,93	8,02	20,69	30,41	32,86
INPC	0,46	2,42	1,02	2,99	3,34	7,20	19,96	30,63	33,31
IGPM	0,89	0,28	0,73	1,02	-0,34	-4,79	5,42	44,47	53,87
SELIC	0,83	4,40	2,58	5,33	12,00	27,10	37,13	40,12	46,96

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,79	3,94	2,00	4,85	8,05	16,78	35,69	52,47	61,52
IPCA + 5,00%	0,87	4,35	2,24	5,34	9,08	19,02	39,63	58,39	69,40
IPCA + 5,50%	0,91	4,55	2,36	5,59	9,60	20,15	41,63	61,42	73,46
IPCA + 5,89%	0,94	4,71	2,46	5,78	10,00	21,03	43,20	63,81	76,67
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64	64,49	77,59
INPC + 4,00%	0,79	4,09	2,02	4,99	7,44	15,90	34,87	52,72	62,06
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77	64,76	78,19

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%)	27.058.490,32	6,201000	27.100.812,83	6,180600	42.322,51
NTN-B 150545 (5,540000%)	16.851.623,10	5,540000	15.667.210,83	6,168300	-1.184.412,27
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.150.641,31	5,670000	10.526.473,28	6,168300	-624.168,03
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.314.047,67	5,681500	19.202.787,93	6,168300	-1.111.259,74
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.205.987,10	5,730000	10.653.196,47	6,168300	-552.790,63
NTN-B 150545 (5,816500%)	36.439.290,01	5,816500	34.992.497,84	6,168300	-1.446.792,17
NTN-B 150545 (6,013000%)	22.596.179,55	6,013000	22.197.679,40	6,168300	-398.500,15
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.686.481,13	6,054000	10.547.593,81	6,168300	-138.887,32
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.305.127,95	6,141000	26.223.252,85	6,168300	-81.875,10
NTN-B 150545 (6,305000%)	15.982.863,63	6,305000	16.233.241,09	6,168300	250.377,46
NTN-B 150545 (6,360000%)	36.718.989,66	6,360000	37.526.961,71	6,168300	807.972,05
NTN-B 150555 (5,540000%)	39.390.088,80	5,540000	36.155.043,92	6,160200	-3.235.044,88
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.330.763,95	5,670000	20.875.710,65	6,160200	-1.455.053,30
NTN-B 150555 (5,720000%)	39.279.075,12	5,720000	36.977.420,40	6,160200	-2.301.654,72
NTN-B 150555 (5,750000%)	26.802.416,21	5,750000	25.337.630,22	6,160200	-1.464.785,99
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.441.548,81	5,822000	7.387.618,36	6,194200	-53.930,45
NTN-B 150832 (5,858000%)	15.986.364,98	5,858000	15.680.132,33	6,174300	-306.232,65
NTN-B 150832 (5,969000%)	22.569.922,77	5,969000	22.288.650,28	6,174300	-281.272,49
NTN-B 150840 (5,621000%)	11.131.775,69	5,621000	10.575.311,45	6,140000	-556.464,24
NTN-B 150840 (5,690000%)	16.790.276,51	5,690000	16.061.038,97	6,140000	-729.237,54
NTN-B 150840 (5,759500%)	26.008.903,64	5,759500	25.051.776,07	6,140000	-957.127,57
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.678.605,67	5,966000	10.497.805,10	6,140000	-180.800,57
NTN-B 150850 (5,540000%)	22.493.898,92	5,540000	20.738.643,58	6,178200	-1.755.255,34
NTN-B 150850 (5,670000%)	22.318.854,96	5,670000	20.926.710,42	6,178200	-1.392.144,54
NTN-B 150850 (5,730000%)	16.822.991,30	5,730000	15.895.922,40	6,178200	-927.068,90
NTN-B 150850 (5,762000%)	40.788.198,16	5,762000	38.699.027,00	6,178200	-2.089.171,16
NTN-B 150850 (6,165000%)	20.036.397,39	6,165000	20.003.473,20	6,178200	-32.924,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
455	08/05/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	4.710.000,00	0,00	120.706,39875600	39,0203009000
456	15/05/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	14.150.000,00	0,00	361.927,60216200	39,0962168000
459	24/05/2024	NTN-B 150850 (6,165000%)	19.999.316,10	0,00	4.680,00000000	4.273,3581420000
457	24/05/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	4.472.471,59	114.093,93311100	39,1999072000
458	24/05/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	14.187.528,41	361.927,60216200	39,1999072000
461	28/05/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.404.862,95	35.810,55769000	39,2304125000
462	28/05/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	307.271,09	7.832,47156500	39,2304125000
463	28/05/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.588.456,21	40.490,42856500	39,2304125000
464	28/05/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	259.409,75	6.612,46564500	39,2304125000
Total			38.859.316,10	22.220.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.178.264,46

Value-At-Risk: 0,37%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,78	0,36	10,00	0,26	0,26	1,04	784.769.109,98	91,52
Artigo 8º	10,88	5,66	30,00	0,02	-0,32	-2,61	9.651.815,57	1,13
Artigo 9º	10,61	5,47	30,00	0,09	0,29	3,94	37.957.933,19	4,43
Artigo 10º	0,34	0,10	55,00	0,00	-2,73	-0,10	25.125.742,48	2,93
BERTIOGA		0,37		0,37			857.504.601,22	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,36%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	1,37	0,33	0,00	0,35	0,05	0,90	11.589.605,26	1,35
NTN-B 150826 (5,822000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,35	0,88	7.441.548,81	0,87
NTN-B 150832 (5,858000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,37	0,88	15.986.364,98	1,86
NTN-B 150832 (5,969000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,44	0,89	22.569.922,77	2,63
NTN-B 150535	4,09	1,84	0,19	1,83	0,22	1,72	112.997.112,69	13,18
NTN-B 150535 (6,201000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,57	0,91	27.058.490,32	3,16
NTN-B 150840 (5,621000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,23	0,87	11.131.775,69	1,30
NTN-B 150840 (5,690000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,27	0,87	16.790.276,51	1,96
NTN-B 150840 (5,759500%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,32	0,88	26.008.903,64	3,03
NTN-B 150840 (5,966000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,43	0,89	10.678.605,67	1,25
NTN-B 150545	4,72	1,98	0,02	1,97	0,15	1,53	9.064.932,44	1,06
NTN-B 150545 (5,540000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,19	0,86	16.851.623,10	1,97
NTN-B 150545 (5,670000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,26	0,87	11.150.641,31	1,30
NTN-B 150545 (5,681500%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,27	0,87	20.314.047,67	2,37
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,30	0,87	11.205.987,10	1,31
NTN-B 150545 (5,816500%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,35	0,88	36.439.290,01	4,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (6,013000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,46	0,90	22.596.179,55	2,64
NTN-B 150545 (6,054000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,49	0,90	10.686.481,13	1,25
NTN-B 150545 (6,141000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,54	0,91	26.305.127,95	3,07
NTN-B 150545 (6,305000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,63	0,92	15.982.863,63	1,86
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,66	0,92	36.718.989,66	4,28
NTN-B 150850	5,25	2,31	0,02	2,30	0,15	1,60	11.865.308,03	1,38
NTN-B 150850 (5,540000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,19	0,86	22.493.898,92	2,62
NTN-B 150850 (5,670000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,26	0,87	22.318.854,96	2,60
NTN-B 150850 (5,730000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,30	0,87	16.822.991,30	1,96
NTN-B 150850 (5,762000%)	0,14	0,21	-0,00	0,25	0,32	0,88	40.788.198,16	4,76
NTN-B 150850 (6,165000%)	0,14	0,22	-0,00	0,26	0,55	0,91	20.036.397,39	2,34
NTN-B 150555 (5,540000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,19	0,86	39.390.088,80	4,59
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,26	0,87	22.330.763,95	2,60
NTN-B 150555 (5,720000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,29	0,87	39.279.075,12	4,58
NTN-B 150555 (5,750000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,31	0,88	26.802.416,21	3,13
Sub-total	0,75	0,35	0,24		0,27	1,04	741.696.762,73	86,49

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,37	0,31	0,00	0,33	0,04	0,88	2.063.531,06	0,24
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	1,37	0,31	0,00	1,19	0,04	0,88	22.170.324,02	2,59
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	2,82	1,23	0,02	0,39	0,20	1,38	17.399.167,24	2,03
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	0,00	0,00	-1,21	0,82	1.439.324,93	0,17
Sub-total	1,27	0,54	0,02		0,16	1,04	43.072.347,25	5,02

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,47%

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	10,63	5,07	0,01	5,07	0,37	4,76	5.924.796,59	0,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17,48	9,18	0,04	9,17	-0,08	-0,58	9.053.933,54	1,06
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9,99	5,12	0,02	5,12	0,38	4,67	10.492.840,76	1,22
Sub-total	11,37	6,07	0,07		0,17	2,76	25.471.570,89	2,97

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	9,51	5,64	0,01	0,82	0,63	6,78	6.756.515,43	0,79
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	9,04	5,54	0,01	9,11	0,56	5,86	5.729.846,87	0,67
Sub-total	9,05	5,42	0,02		0,61	6,35	12.486.362,30	1,46

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,10%

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	0,53	0,08	-0,00	0,14	-1,28	0,15	2.051.899,34	0,24
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,42	0,12	0,00	0,14	-2,28	-0,12	23.073.843,14	2,69
Sub-total	0,34	0,10	0,00		-2,73	-0,10	25.125.742,48	2,93

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,66%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA	10,70	5,57	0,00	2,92	-0,44	-3,86	115.001,51	0,01
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	11,89	6,10	0,01	3,50	-0,37	-3,56	4.447.332,54	0,52
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,99	5,71	0,01	2,09	-0,21	-1,49	4.567.181,58	0,53
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	10,35	6,09	0,00	1,39	-0,45	-3,84	522.299,94	0,06
Sub-total	10,88	5,66	0,02		-0,32	-2,61	9.651.815,57	1,13

(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 (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
- (5) Limite Política de Investimentos (%)