



LDB
EMPRESAS

BERTIOGA
JULHO 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 31.07.2024.

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

91,69%

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	4,10	0,04	1,00	6,81	11.842.810,23	1,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,822000%)	0,23	0,04	0,78	6,51	7.562.086,61	0,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,858000%)	0,34	0,04	0,78	6,53	16.246.269,13	1,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,969000%)	0,35	0,04	0,79	6,60	22.940.956,02	2,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	5,43	0,47	3,18	-0,35	114.701.818,65	13,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,201000%)	0,38	0,04	0,81	6,74	27.513.598,05	3,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621000%)	0,41	0,04	0,76	6,40	11.308.428,47	1,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,42	0,04	0,76	6,44	17.058.621,98	1,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,759500%)	0,42	0,04	0,77	6,48	26.427.532,64	3,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,966000%)	0,43	0,04	0,79	6,60	10.854.103,57	1,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,71	0,53	3,31	-2,83	9.103.465,76	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,540000%)	0,47	0,04	0,75	6,35	17.116.808,99	1,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,670000%)	0,48	0,04	0,76	6,42	11.328.493,55	1,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,681500%)	0,48	0,04	0,76	6,43	20.638.433,79	2,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,48	0,04	0,77	6,46	11.385.831,29	1,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,816500%)	0,48	0,04	0,78	6,51	37.029.219,32	4,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,013000%)	0,49	0,04	0,79	6,63	22.969.281,42	2,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,054000%)	0,49	0,04	0,80	6,65	10.863.646,28	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,141000%)	0,50	0,04	0,80	6,70	26.744.967,69	3,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305000%)	0,51	0,04	0,82	6,80	16.254.396,72	1,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,360000%)	0,51	0,04	0,82	6,83	37.346.069,75	4,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,540000%)	0,52	0,04	0,75	6,35	22.847.854,89	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	0,52	0,04	0,76	6,42	22.674.826,27	2,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,53	0,04	0,77	6,46	17.092.964,45	1,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,762000%)	3,99	0,04	0,77	3,62	41.444.920,98	4,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,160000%)	4,20	0,04	0,81	0,84	12.091.461,94	1,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,165000%)	4,20	0,04	0,81	1,86	20.372.204,45	2,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,540000%)	0,55	0,04	0,75	6,35	40.009.927,62	4,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	0,56	0,04	0,76	6,42	22.686.937,15	2,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,720000%)	0,56	0,04	0,77	6,45	39.908.799,81	4,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,750000%)	0,56	0,04	0,77	6,47	27.233.425,55	3,10
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		1,16	0,11	1,17	5,01	753.600.163,02	85,74

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	0,84	0,04	0,96	6,72	2.107.421,39	0,24	199.567.512,84	1,06
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,84	0,04	0,97	6,74	22.644.887,72	2,58	245.893.368,78	9,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	4,05	0,24	1,76	0,92	17.578.420,50	2,00	1.033.158.993,46	1,70
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,06	0,04	0,89	6,10	9.972.047,29	1,13	7.130.754.638,24	0,14
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,46	0,11	1,24	4,66	52.302.776,90	5,95		
Renda Fixa			1,16	0,11	1,17	4,98	805.902.939,92	91,69		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

0,62%

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	14,23	1,01	4,63	-1,68	121.819,13	0,01	183.743.510,61	0,07
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	15,87	0,00	4,92	-0,94	0,00	0,00	764.018.267,64	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,53	0,43	2,96	-0,53	4.785.942,81	0,54	1.041.382.903,24	0,46
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,24	1,03	3,28	-7,24	545.414,97	0,06	328.472.747,68	0,17
Sub-total Artigo 8º I			13,15	0,50	3,83	-1,18	5.453.176,91	0,62		
Renda Variável			13,15	0,50	3,83	-1,18	5.453.176,91	0,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 4,80%

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	11,23	1,76	2,29	31,57	6.627.475,30	0,75	419.830.759,71	1,58
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17,97	1,33	-2,20	24,29	9.878.096,46	1,12	756.611.993,89	1,31
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10,89	1,57	2,36	29,69	11.647.226,54	1,33	687.768.822,91	1,69
Sub-total Artigo 9º II			12,45	1,53	0,70	28,16	28.152.798,30	3,20		

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	14,92	4,01	0,51	40,23	7.655.477,87	0,87	2.714.087.550,41	0,28
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	12,93	2,27	0,62	28,86	6.367.803,93	0,72	761.918.431,79	0,84
Sub-total Artigo 9º III			13,62	3,21	0,56	34,83	14.023.281,80	1,60		
Investimentos no Exterior			11,95	2,08	0,65	30,31	42.176.080,10	4,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,89%

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	7,19	0,85	0,85	-1,84	1.977.767,11	0,23	164.824.295,15	1,20
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	3,36	0,24	0,24	2,18	23.430.843,08	2,67	373.721.952,14	6,27
Sub-total Artigo 10º II			30,86	0,29	0,29	1,90	25.408.610,19	2,89		
Investimentos Estruturados			30,86	0,29	0,29	1,90	25.408.610,19	2,89		
Total			1,47	0,21	1,16	5,81	878.940.807,12	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	753.600.163,02	85,74	65,00	83,00	97,50	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	52.302.776,90	5,95	2,50	5,00	10,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	805.902.939,92	91,69					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	5.453.176,91	0,62	0,00	5,00	15,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	5.453.176,91	0,62					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	28.152.798,30	3,20	0,00	2,60	5,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	14.023.281,80	1,60	0,00	1,30	5,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	42.176.080,10	4,80					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	25.408.610,19	2,89	0,00	3,10	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	25.408.610,19	2,89					15,00
Total		878.940.807,12	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	1,17 129,04	5,01 81,14	2,61 102,16	4,38 84,94	8,86 76,96	8.719.214,77	34.977.599,46
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,24 136,86	4,66 75,46	2,70 105,76	3,94 76,46	8,60 74,75	602.939,38	2.792.614,02
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,83 0,81	-1,18 3,69	2,33 0,95	2,02 2,10	3,87 -0,81	380.341,95	-114.679,59
Artigo 9º II % do CDI	0,70 76,64	28,16 456,06	13,58 532,57	23,91 463,38	37,88 329,09	194.372,77	6.186.706,95
Artigo 9º III % do CDI	0,56 61,73	34,83 563,91	19,45 762,53	30,02 581,96	44,51 386,69	78.090,48	3.622.243,08
Artigo 10º II % do CDI	0,29 31,73	1,90 30,69	-0,73 -28,48	1,97 38,20	3,63 31,57	72.929,75	547.795,15
BERTIOGA (Total)						10.047.889,10	48.012.279,07

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	111.165.824,04	0,00	0,00	0,00	114.701.818,65	3.535.994,61	-475.179,72
NTN-B 150535 (6,201000%)	27.292.794,94	0,00	0,00	0,00	27.513.598,05	220.803,11	1.770.989,14
NTN-B 150545	8.811.789,40	0,00	0,00	0,00	9.103.465,76	291.676,36	-275.361,54
NTN-B 150545 (5,540000%)	16.989.119,17	0,00	0,00	0,00	17.116.808,99	127.689,82	1.040.785,45
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.242.724,56	0,00	0,00	0,00	11.328.493,55	85.768,99	696.798,95
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.481.982,48	0,00	0,00	0,00	20.638.433,79	156.451,31	1.270.731,60
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.299.037,32	0,00	0,00	0,00	11.385.831,29	86.793,97	704.024,59
NTN-B 150545 (5,816500%)	36.744.221,18	0,00	0,00	0,00	37.029.219,32	284.998,14	2.306.944,67
NTN-B 150545 (6,013000%)	22.788.628,58	0,00	0,00	0,00	22.969.281,42	180.652,84	1.455.395,89
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.777.828,48	0,00	0,00	0,00	10.863.646,28	85.817,80	690.744,41
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.531.698,89	0,00	0,00	0,00	26.744.967,69	213.268,80	1.713.069,59
NTN-B 150545 (6,305000%)	16.122.520,96	0,00	0,00	0,00	16.254.396,72	131.875,76	1.055.494,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (6,360000%)	37.041.338,82	0,00	0,00	0,00	37.346.069,75	304.730,93	2.436.143,90
NTN-B 150555 (5,540000%)	39.711.468,82	0,00	0,00	0,00	40.009.927,62	298.458,80	2.432.299,51
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.515.182,16	0,00	0,00	0,00	22.686.937,15	171.754,99	1.395.229,14
NTN-B 150555 (5,720000%)	39.604.938,50	0,00	0,00	0,00	39.908.799,81	303.861,31	2.465.231,64
NTN-B 150555 (5,750000%)	27.025.374,16	0,00	0,00	0,00	27.233.425,55	208.051,39	1.686.681,68
NTN-B 150824	11.726.112,86	0,00	0,00	0,00	11.842.810,23	116.697,37	768.765,49
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.503.852,31	0,00	0,00	0,00	7.562.086,61	58.234,30	465.598,92
NTN-B 150832 (5,858000%)	16.120.655,76	0,00	0,00	0,00	16.246.269,13	125.613,37	1.003.292,45
NTN-B 150832 (5,969000%)	22.761.394,19	0,00	0,00	0,00	22.940.956,02	179.561,83	1.430.018,94
NTN-B 150840 (5,621000%)	11.223.287,87	0,00	0,00	0,00	11.308.428,47	85.140,60	684.238,77
NTN-B 150840 (5,690000%)	16.929.180,63	0,00	0,00	0,00	17.058.621,98	129.441,35	1.038.358,81
NTN-B 150840 (5,759500%)	26.225.444,06	0,00	0,00	0,00	26.427.532,64	202.088,58	1.618.284,91
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.769.177,41	0,00	0,00	0,00	10.854.103,57	84.926,16	676.403,85
NTN-B 150850 (5,540000%)	22.677.436,58	0,00	0,00	0,00	22.847.854,89	170.418,31	1.372.578,79
NTN-B 150850 (5,670000%)	22.503.163,94	0,00	0,00	0,00	22.674.826,27	171.662,33	1.377.723,30
NTN-B 150850 (5,730000%)	16.962.681,42	0,00	0,00	0,00	17.092.964,45	130.283,03	1.043.976,33
NTN-B 150850 (5,762000%)	41.127.863,89	0,00	0,00	0,00	41.444.920,98	317.057,09	1.448.879,78
NTN-B 150850 (6,160000%)	11.994.862,82	0,00	0,00	0,00	12.091.461,94	96.599,12	101.178,68
NTN-B 150850 (6,165000%)	20.209.362,05	0,00	0,00	0,00	20.372.204,45	162.842,40	372.888,35
	744.880.948,25	0,00	0,00	0,00	753.600.163,02	8.719.214,77	

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	2.087.383,49	0,00	0,00	0,00	2.107.421,39	20.037,90	133.565,68
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	22.426.802,58	0,00	0,00	0,00	22.644.887,72	218.085,14	1.438.799,81
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	17.274.992,44	0,00	0,00	0,00	17.578.420,50	303.428,06	159.918,25
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	2.560.659,01	10.950.000,00	-3.600.000,00	0,00	9.972.047,29	61.388,28	1.060.330,28
	44.349.837,52	10.950.000,00	-3.600.000,00	0,00	52.302.776,90	602.939,38	

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	116.423,07	0,00	0,00	0,00	121.819,13	5.396,06	-2.081,82
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4.474.571,26	0,00	-4.694.557,75	0,00	0,00	219.986,49	-44.555,73
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.648.313,63	0,00	0,00	0,00	4.785.942,81	137.629,18	-25.465,53
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESA ATIVO FICFI	528.084,75	0,00	0,00	0,00	545.414,97	17.330,22	-42.576,51
	9.767.392,71	0,00	-4.694.557,75	0,00	5.453.176,91	380.341,95	

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	6.479.169,83	0,00	0,00	0,00	6.627.475,30	148.305,47	1.590.392,09
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.100.756,53	0,00	0,00	0,00	9.878.096,46	-222.660,07	1.930.241,59
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11.378.499,17	0,00	0,00	0,00	11.647.226,54	268.727,37	2.666.073,27
	27.958.425,53	0,00	0,00	0,00	28.152.798,30	194.372,77	

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	7.616.785,10	0,00	0,00	0,00	7.655.477,87	38.692,77	2.196.060,46
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	6.328.406,22	0,00	0,00	0,00	6.367.803,93	39.397,71	1.426.182,62
	13.945.191,32	0,00	0,00	0,00	14.023.281,80	78.090,48	

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	1.961.077,23	0,00	0,00	0,00	1.977.767,11	16.689,88	-36.973,91
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	23.374.603,21	0,00	0,00	0,00	23.430.843,08	56.239,87	584.769,06
	25.335.680,44	0,00	0,00	0,00	25.408.610,19	72.929,75	

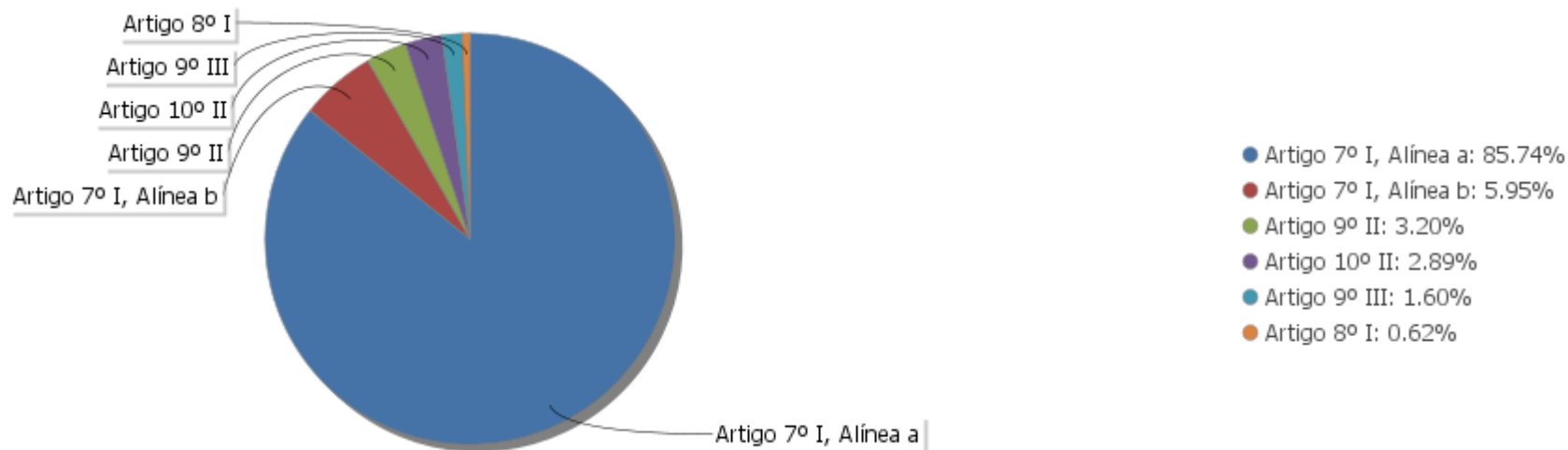
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

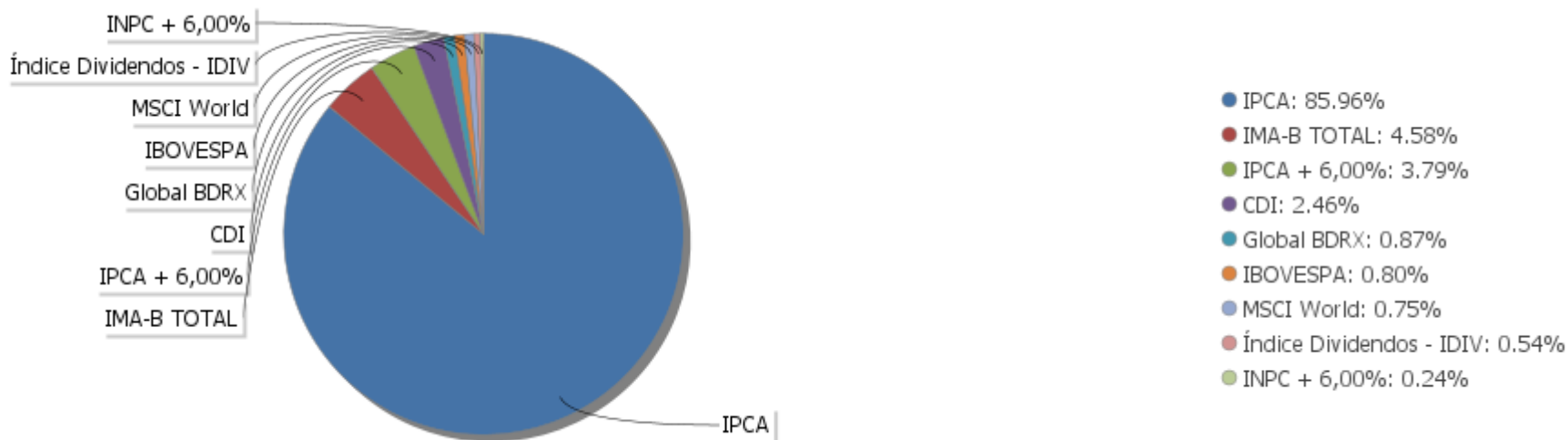
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	91.388.247,94	10,40	10,00	91.388.247,94	10,40	10,00
de 31 dias a 365 dias	4.785.942,81	0,54	1,00	96.174.190,75	10,94	11,00
acima de 365 dias	782.766.616,37	89,06	60,00	878.940.807,12	100,00	71,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

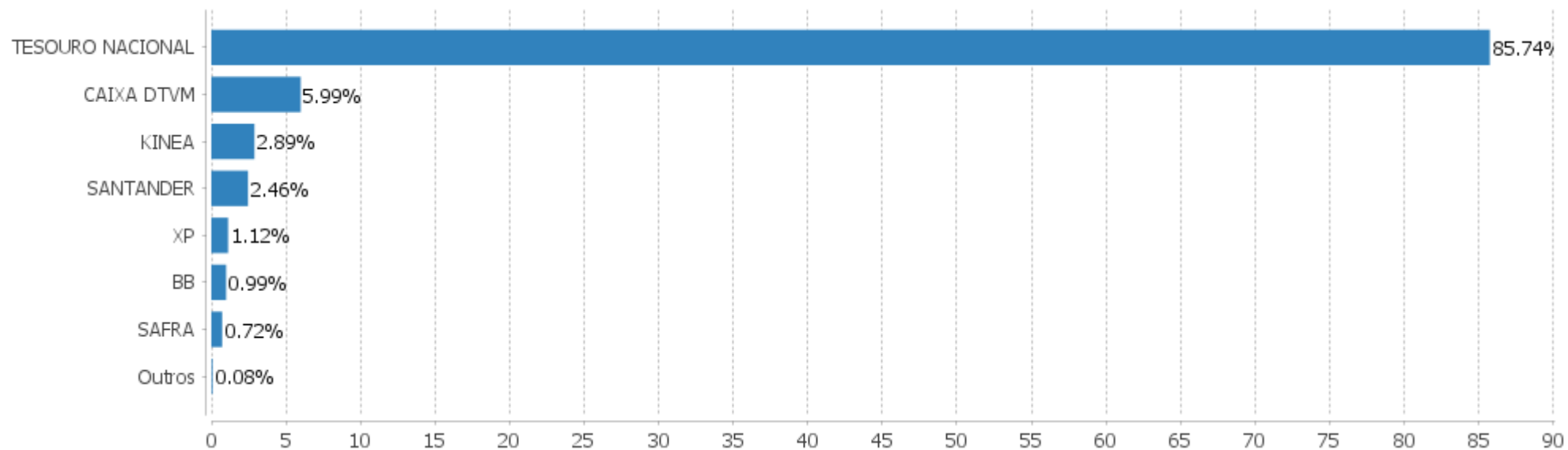


Alocação Por Estratégia



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	0,80	1,16						5,81
IPCA + 5,31%	0,87	1,22	0,57	0,83	0,89	0,62	0,86						6,03
p.p. indexador	-0,22	-0,06	0,23	-0,82	0,19	0,18	0,30						-0,21
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	46	50,55	03 meses	3,07	2,39	0,68	1,93
Meses abaixo - Meta Atuarial	45	49,45	06 meses	5,12	5,11	0,02	1,53
			12 meses	9,78	10,02	-0,25	1,47
			24 meses	22,10	20,31	1,79	2,36
			36 meses	19,85	39,27	-19,42	3,85
			48 meses	25,18	60,29	-35,11	4,75
			60 meses	35,29	73,76	-38,47	7,81

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

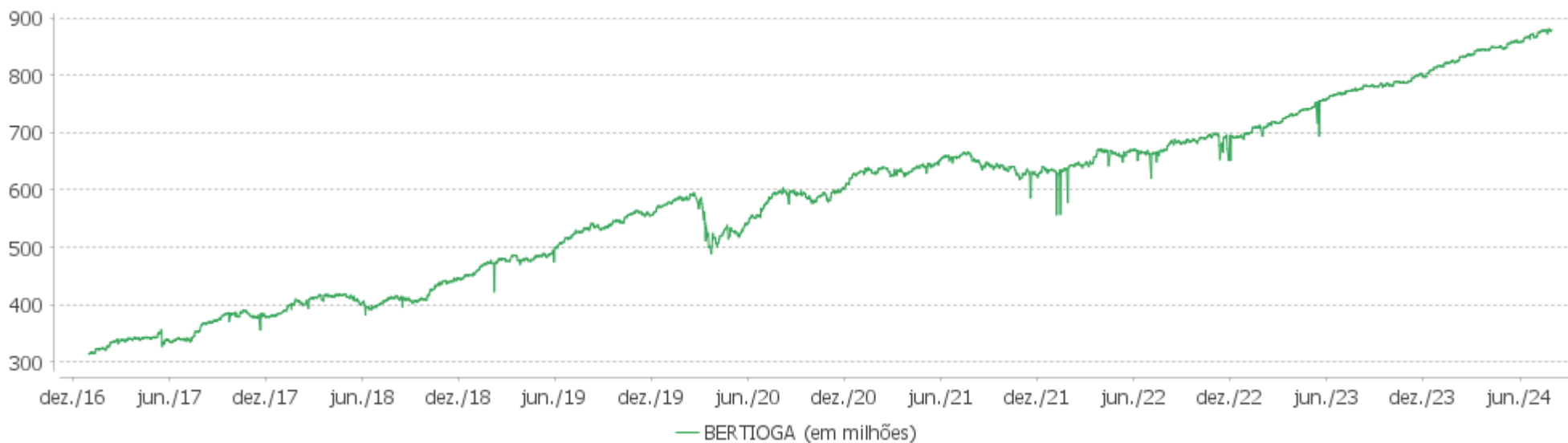
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	101,88	120,65	-18,77	8,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

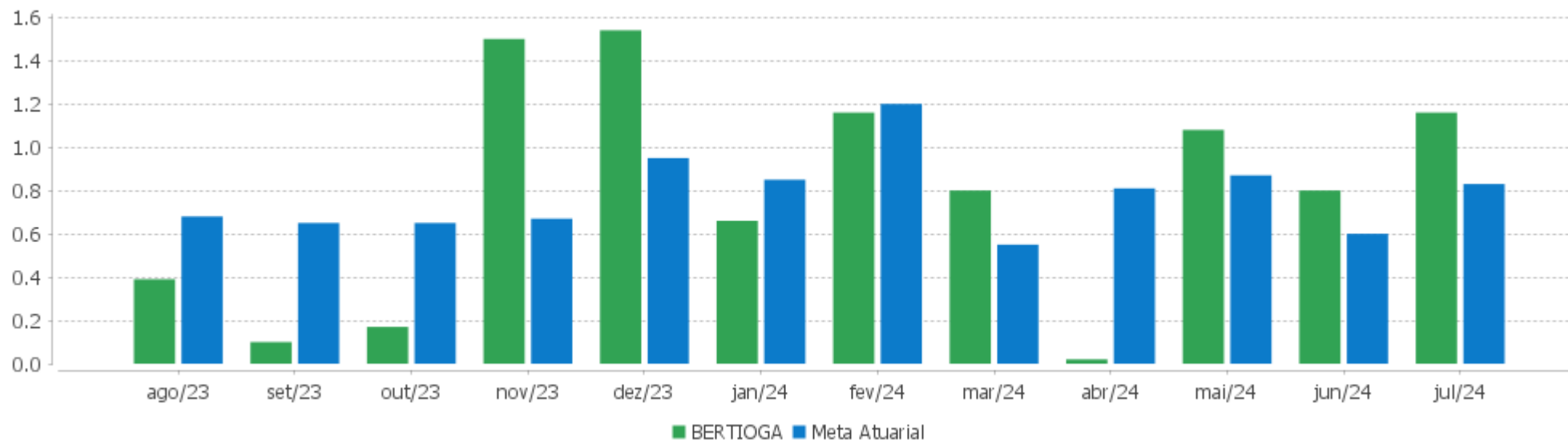


Patrimônio Líquido



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.	0,76 0,38	6,43 3,56	2,48 1,43	5,29 2,85	10,49 5,99	14,28 5,61	
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	1,00 0,62	6,91 4,04	3,11 2,05	5,62 3,17	11,41 6,91	22,69 14,02	34,04 14,43
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	6,44 3,56	2,48 1,43	5,29 2,85	10,47 5,97	20,84 12,17	37,83 18,22
NTN-B 150840 (5,966000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,41	6,60 3,72	2,55 1,50	5,43 2,99	10,76 6,26	21,48 12,81	34,84 15,23
NTN-B 150545 (6,305000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,44	6,80 3,92	2,63 1,58	5,60 3,15	11,16 6,66	22,30 13,63	35,87 16,25
NTN-B 150535 Var. IPCA p.p.	3,18 2,80	-0,35 -3,22	3,25 2,20	0,84 -1,60	2,48 -2,02	21,50 12,83	20,27 0,66
NTN-B 150840 (5,759500%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,48 3,60	2,50 1,45	5,33 2,89	10,54 6,04	14,33 5,66	
NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	6,42 3,55	2,48 1,42	5,28 2,84	10,51 6,01	20,86 12,19	37,87 18,26
NTN-B 150850 (6,165000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,43	3,54 0,67	2,60 1,55	2,45 0,01	4,41 -0,09		
NTN-B 150545 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	6,35 3,47	2,45 1,39	5,22 2,78	10,34 5,84	20,54 11,87	37,37 17,76
NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,46 3,59	2,49 1,44	5,31 2,87	10,57 6,07	21,00 12,33	38,08 18,46
NTN-B 150545 (6,013000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,41	6,63 3,75	2,56 1,51	5,45 3,01	10,85 6,35	18,14 9,47	31,15 11,54
NTN-B 150555 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	6,42 3,55	2,48 1,42	5,28 2,84	10,53 6,03	20,88 12,21	37,91 18,29
NTN-B 150826 (5,822000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,51 3,64	2,52 1,46	5,36 2,92	10,47 5,97	21,00 12,33	34,13 14,52
NTN-B 150535 (6,201000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,43	6,74 3,86	2,61 1,56	5,55 3,10	10,98 6,48	21,98 13,31	35,53 15,91
NTN-B 150545 (6,360000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,44	6,83 3,96	2,65 1,59	5,62 3,18	11,22 6,72	18,78 10,11	
NTN-B 150545 (6,054000%)	0,80	6,65	2,57	5,47	10,89	21,72	35,14

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.	0,42	3,78	1,52	3,03	6,39	13,05	15,53
NTN-B 150840 (5,621000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	6,40 3,52	2,47 1,41	5,26 2,82	10,39 5,90	20,68 12,01	37,59 17,98
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	3,31 2,93	-2,83 -5,71	1,96 0,91	-1,27 -3,71	0,08 -4,42	21,27 12,60	13,93 -5,68
NTN-B 150555 (5,720000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,45 3,58	2,49 1,44	5,31 2,87	10,58 6,08	21,00 12,33	38,07 18,46
NTN-B 150832 (5,969000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,41	6,60 3,73	2,55 1,50	5,43 2,99	10,72 6,22	17,96 9,29	30,92 11,30
NTN-B 150545 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	6,42 3,55	2,48 1,42	5,28 2,84	10,48 5,98	20,84 12,17	37,82 18,21
NTN-B 150850 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	6,35 3,47	2,45 1,39	5,22 2,78	10,37 5,87	20,56 11,89	37,43 17,82
NTN-B 150850 (5,762000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	3,47 0,59	2,50 1,45	2,41 -0,04	4,32 -0,17		
NTN-B 150832 (5,858000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,53 3,66	2,52 1,47	5,38 2,93	10,60 6,10	21,18 12,51	34,41 14,80
NTN-B 150545 (6,141000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,42	6,70 3,83	2,59 1,54	5,52 3,07	10,98 6,49	21,82 13,15	35,28 15,67
NTN-B 150555 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,47 3,60	2,50 1,44	5,32 2,88	10,61 6,11	21,07 12,40	38,18 18,56
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,46 3,59	2,49 1,44	5,31 2,87	10,54 6,05	20,97 12,30	38,03 18,42
NTN-B 150850 (6,160000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,43	3,54 0,67	2,60 1,55	2,45 0,00	4,41 -0,09		
NTN-B 150555 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	6,35 3,47	2,45 1,39	5,22 2,78	10,39 5,89	20,59 11,92	37,47 17,85
NTN-B 150545 (5,816500%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,51 3,64	2,51 1,46	5,36 2,91	10,64 6,14	14,47 5,80	
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,76 -0,34	0,92 -0,06	2,43 -0,02	1,27 -0,16	3,59 -0,79	15,71 -4,80	20,45 -3,98
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	0,96 0,17	6,72 0,21	3,03 0,55	5,55 0,19	11,20 0,92	22,17 1,18	35,70 -5,50
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,97 -1,12	6,74 5,76	3,04 0,59	5,57 4,14	11,22 6,84	22,26 1,75	33,23 8,80
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,89	6,10	2,51	5,09	11,35	26,35	38,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	98,57	98,70	98,54	98,65	98,62	98,87	99,02
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,63 1,61	-1,68 3,19	1,84 0,47	0,03 0,11	3,48 -1,20	17,97 -5,77	-6,77 -11,57
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,96 1,07	-0,53 1,05	3,23 0,33	2,62 0,62	8,79 -2,27	27,50 -4,36	18,92 -12,29
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,73 2,70	-0,18 4,69	2,58 1,21	2,98 3,06	0,86 -3,82	15,02 -8,71	-12,31 -17,11
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	3,28 0,26	-7,24 -2,37	0,42 -0,96	-2,90 -2,82	-0,40 -5,08	16,66 -7,08	-4,76 -9,57
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,51 0,22	40,23 -1,25	20,99 -0,40	34,11 -0,91	49,78 -2,21	60,78 -4,23	43,02 -4,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	0,62 -2,40	28,86 33,73	17,65 16,27	25,43 25,51	38,64 33,96	39,96 16,23	20,15 15,34
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI World p.p.	2,29	31,57	17,19	27,60	40,54	46,37	32,63
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	2,36 260,35	29,69 480,68	16,19 634,73	25,80 500,17	37,95 329,70	41,00 153,82	15,58 40,41
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,20 -3,12	24,29 17,86	8,47 5,91	19,46 14,01	36,07 25,32	58,79 36,75	-2,61 -44,97
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,24 -0,67	2,18 -4,25	-0,53 -3,09	2,35 -3,10	3,78 -6,96	-3,27 -25,31	17,62 -24,74
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II Var. IPCA p.p.	0,85 0,47	3,22 0,35	1,51 0,45	2,28 -0,16	6,60 2,11		
BERTIOGA Var. IPCA + 4,99% p.p.	1,16 0,30	5,81 -0,21	3,07 0,68	5,12 0,02	9,78 -0,25	22,10 1,63	19,85 -19,76
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36

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	0,94	5,49	2,37	4,62	10,81	26,14	36,37	39,08	46,74
IRF-M 1+	1,55	1,77	1,44	1,17	7,38	27,10	28,37	24,09	39,00
IRF-M TOTAL	1,34	2,87	1,71	2,19	8,37	26,19	30,49	28,67	41,29
IMA-B 5	0,91	4,27	2,37	3,56	8,16	20,37	32,46	39,16	51,45
IMA-B 5+	3,24	-1,97	2,52	-0,51	1,03	20,60	16,72	17,12	26,27
IMA-B TOTAL	2,09	0,97	2,45	1,43	4,38	20,51	24,43	27,57	37,98
IMA-GERAL TOTAL	1,36	3,81	2,36	3,33	8,64	24,49	31,89	34,10	43,92
IDKA 2	0,75	3,98	2,01	3,15	8,12	19,52	31,61	39,35	51,45
IDKA 20	6,19	-6,65	2,88	-3,43	-3,72	23,96	4,78	3,52	8,64
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80	24,04	25,38
IBRX 100	2,90	-4,51	1,13	0,00	5,15	22,39	2,42	23,65	26,33
IBRX 50	3,15	-3,17	1,57	1,02	6,82	24,69	4,81	28,10	28,40
SMALL CAP	1,49	-13,59	-2,33	-7,53	-13,35	1,79	-31,36	-17,55	-11,07
Índice Consumo - ICON	2,01	-12,31	0,40	-4,34	-15,32	-14,69	-47,16	-45,60	-38,99
Índice Dividendos - IDIV	1,89	-1,58	2,90	2,00	11,06	31,85	31,21	49,86	55,10

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	3,01	35,40	20,06	30,27	43,70	45,91	38,90	83,71	178,66

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,52	1,61	-0,50	0,94	5,24	19,57	19,14	23,11	26,52

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,40	30,98	17,81	27,34	37,49	39,32	24,28	60,53	133,51

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,38	2,87	1,05	2,44	4,50	8,67	19,61	30,37	33,38
INPC	0,26	2,95	0,97	2,36	4,06	7,73	18,64	30,33	33,84
IGPM	0,61	1,71	2,33	1,64	3,82	-4,19	5,46	41,14	54,22
SELIC	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,74	5,25	2,07	4,46	8,66	17,50	34,49	52,40	62,17
IPCA + 5,00%	0,83	5,84	2,31	4,95	9,70	19,76	38,39	58,31	70,09
IPCA + 5,50%	0,87	6,14	2,44	5,20	10,22	20,90	40,36	61,34	74,17
IPCA + 5,89%	0,91	6,37	2,53	5,39	10,63	21,79	41,92	63,72	77,40
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36	64,40	78,32
INPC + 4,00%	0,62	5,33	1,98	4,37	8,21	16,49	33,39	52,35	62,74
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20	64,35	78,94

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%)	27.513.598,05	6,201000	27.509.663,25	6,202900	-3.934,80
NTN-B 150545 (5,540000%)	17.116.808,99	5,540000	15.733.809,19	6,278700	-1.382.999,80
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.328.493,55	5,670000	10.571.219,33	6,278700	-757.274,22
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.638.433,79	5,681500	19.284.415,36	6,278700	-1.354.018,43
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.385.831,29	5,730000	10.698.481,20	6,278700	-687.350,09
NTN-B 150545 (5,816500%)	37.029.219,32	5,816500	35.141.244,35	6,278700	-1.887.974,97
NTN-B 150545 (6,013000%)	22.969.281,42	6,013000	22.292.037,55	6,278700	-677.243,87
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.863.646,28	6,054000	10.592.429,64	6,278700	-271.216,64
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.744.967,69	6,141000	26.334.722,95	6,278700	-410.244,74
NTN-B 150545 (6,305000%)	16.254.396,72	6,305000	16.302.245,54	6,278700	47.848,82
NTN-B 150545 (6,360000%)	37.346.069,75	6,360000	37.686.481,75	6,278700	340.412,00
NTN-B 150555 (5,540000%)	40.009.927,62	5,540000	36.362.400,50	6,242300	-3.647.527,12
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.686.937,15	5,670000	20.995.437,12	6,242300	-1.691.500,03
NTN-B 150555 (5,720000%)	39.908.799,81	5,720000	37.189.493,47	6,242300	-2.719.306,34
NTN-B 150555 (5,750000%)	27.233.425,55	5,750000	25.482.946,71	6,242300	-1.750.478,84
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.562.086,61	5,822000	7.456.254,45	6,609700	-105.832,16
NTN-B 150832 (5,858000%)	16.246.269,13	5,858000	15.871.077,89	6,250700	-375.191,24
NTN-B 150832 (5,969000%)	22.940.956,02	5,969000	22.560.071,38	6,250700	-380.884,64
NTN-B 150840 (5,621000%)	11.308.428,47	5,621000	10.741.995,31	6,149800	-566.433,16
NTN-B 150840 (5,690000%)	17.058.621,98	5,690000	16.314.186,69	6,149800	-744.435,29
NTN-B 150840 (5,759500%)	26.427.532,64	5,759500	25.446.632,22	6,149800	-980.900,42
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.854.103,57	5,966000	10.663.267,33	6,149800	-190.836,24
NTN-B 150850 (5,540000%)	22.847.854,89	5,540000	20.824.885,80	6,280200	-2.022.969,09
NTN-B 150850 (5,670000%)	22.674.826,27	5,670000	21.013.734,73	6,280200	-1.661.091,54
NTN-B 150850 (5,730000%)	17.092.964,45	5,730000	15.962.026,03	6,280200	-1.130.938,42
NTN-B 150850 (5,762000%)	41.444.920,98	5,762000	38.859.957,97	6,280200	-2.584.963,01
NTN-B 150850 (6,160000%)	12.091.461,94	6,160000	11.914.650,25	6,280200	-176.811,69
NTN-B 150850 (6,165000%)	20.372.204,45	6,165000	20.086.658,20	6,280200	-285.546,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
476	05/07/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	4.550.000,00	0,00	114.767,88642700	39,6452365000
480	23/07/2024	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	0,00	4.694.557,75	722.275,31202271	6,4996791000
477	25/07/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	6.120.000,00	0,00	153.538,47671100	39,8597155000
475	29/07/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	3.600.000,00	90.246,07781600	39,8909303000
479	31/07/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	280.000,00	0,00	7.013,70560500	39,9218353000
Total			10.950.000,00	8.294.557,75		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.998.619,10

Value-At-Risk: 0,45%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,09	0,50	10,00	0,39	0,25	1,18	805.902.939,92	91,69
Artigo 8º	9,02	5,51	30,00	0,02	0,32	3,83	5.453.176,91	0,62
Artigo 9º	14,51	5,47	30,00	0,05	-0,02	0,65	42.176.080,10	4,80
Artigo 10º	0,95	0,04	55,00	0,00	-0,65	0,29	25.408.610,19	2,89
BERTIOGA		0,45		0,45			878.940.807,12	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,50%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	0,54	0,31	0,00	0,32	0,16	1,00	11.842.810,23	1,35
NTN-B 150826 (5,822000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,58	0,78	7.562.086,61	0,86
NTN-B 150832 (5,858000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,57	0,78	16.246.269,13	1,85
NTN-B 150832 (5,969000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,52	0,79	22.940.956,02	2,61
NTN-B 150535	6,60	2,90	0,31	2,90	0,34	3,18	114.701.818,65	13,05
NTN-B 150535 (6,201000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,43	0,81	27.513.598,05	3,13
NTN-B 150840 (5,621000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,66	0,76	11.308.428,47	1,29
NTN-B 150840 (5,690000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,63	0,76	17.058.621,98	1,94
NTN-B 150840 (5,759500%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,61	0,77	26.427.532,64	3,01
NTN-B 150840 (5,966000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,53	0,79	10.854.103,57	1,23
NTN-B 150545	7,82	3,26	0,03	3,26	0,31	3,31	9.103.465,76	1,04
NTN-B 150545 (5,540000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,69	0,75	17.116.808,99	1,95
NTN-B 150545 (5,670000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,64	0,76	11.328.493,55	1,29
NTN-B 150545 (5,681500%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,63	0,76	20.638.433,79	2,35
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,62	0,77	11.385.831,29	1,30
NTN-B 150545 (5,816500%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,58	0,78	37.029.219,32	4,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (6,013000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,51	0,79	22.969.281,42	2,61
NTN-B 150545 (6,054000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,49	0,80	10.863.646,28	1,24
NTN-B 150545 (6,141000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,46	0,80	26.744.967,69	3,04
NTN-B 150545 (6,305000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,40	0,82	16.254.396,72	1,85
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,37	0,82	37.346.069,75	4,25
NTN-B 150850 (5,540000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,69	0,75	22.847.854,89	2,60
NTN-B 150850 (5,670000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,64	0,76	22.674.826,27	2,58
NTN-B 150850 (5,730000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,62	0,77	17.092.964,45	1,94
NTN-B 150850 (5,762000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,60	0,77	41.444.920,98	4,72
NTN-B 150850 (6,160000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,45	0,81	12.091.461,94	1,38
NTN-B 150850 (6,165000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,45	0,81	20.372.204,45	2,32
NTN-B 150555 (5,540000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,69	0,75	40.009.927,62	4,55
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,64	0,76	22.686.937,15	2,58
NTN-B 150555 (5,720000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,62	0,77	39.908.799,81	4,54
NTN-B 150555 (5,750000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,61	0,77	27.233.425,55	3,10
Sub-total	1,04	0,48	0,35		0,25	1,17	753.600.163,02	85,74

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	0,52	0,31	0,00	0,32	0,10	0,96	2.107.421,39	0,24
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,54	0,31	0,00	2,26	0,12	0,97	22.644.887,72	2,58
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	4,95	2,38	0,04	0,62	0,17	1,76	17.578.420,50	2,00
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	-0,00	0,01	-1,76	0,89	9.972.047,29	1,13
Sub-total	1,77	0,81	0,04		0,19	1,24	52.302.776,90	5,95

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	12,19	5,51	0,01	5,51	0,11	2,29	6.627.475,30	0,75

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	14,47	6,80	0,02	6,81	-0,21	-2,20	9.878.096,46	1,12
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,82	5,72	0,01	5,72	0,11	2,36	11.647.226,54	1,33
Sub-total	12,62	5,54	0,03		-0,02	0,70	28.152.798,30	3,20

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,18	7,37	0,01	1,06	-0,02	0,51	7.655.477,87	0,87
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	15,64	5,89	0,01	8,69	-0,02	0,62	6.367.803,93	0,72
Sub-total	18,31	6,54	0,02		-0,02	0,56	14.023.281,80	1,60

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,04%

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2,81	0,14	0,00	0,14	-0,02	0,85	1.977.767,11	0,23
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,80	0,03	0,00	0,04	-0,84	0,24	23.430.843,08	2,67
Sub-total	0,95	0,04	0,00		-0,65	0,29	25.408.610,19	2,89

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,51%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA	8,53	5,46	0,00	2,61	0,44	4,63	121.819,13	0,01
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	11,15	NaN	0,00	NaN	0,43	5,73	0,00	0,00
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	9,41	5,54	0,01	1,76	0,22	2,96	4.785.942,81	0,54
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	10,07	5,85	0,00	1,36	0,24	3,28	545.414,97	0,06
Sub-total	9,02	5,51	0,02		0,32	3,83	5.453.176,91	0,62

(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 (%)