



LDB
EMPRESAS

BERTIOGA
AGOSTO 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 30.08.2024.

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

92,16%

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 | 8,00 | 0,00 | 0,51 | 7,35 | 0,00 | 0,00 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150826 (5,822000%) | 4,04 | 0,02 | 0,62 | 7,18 | 7.397.358,02 | 0,83 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150832 (5,858000%) | 0,34 | 0,02 | 0,71 | 7,29 | 15.896.156,49 | 1,79 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150832 (5,969000%) | 0,35 | 0,02 | 0,72 | 7,36 | 22.444.285,04 | 2,53 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 | 5,65 | -0,42 | 0,46 | 0,11 | 115.231.421,58 | 12,98 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (6,201000%) | 0,38 | 0,02 | 0,74 | 7,52 | 27.715.843,64 | 3,12 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,621000%) | 0,41 | 0,02 | 0,69 | 7,13 | 11.072.020,93 | 1,25 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,690000%) | 0,42 | 0,02 | 0,69 | 7,17 | 16.699.745,03 | 1,88 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,759500%) | 0,42 | 0,02 | 0,70 | 7,22 | 25.868.040,47 | 2,91 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,966000%) | 0,43 | 0,02 | 0,72 | 7,36 | 10.619.941,79 | 1,20 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 | 6,96 | -0,56 | 1,14 | -1,72 | 9.207.435,27 | 1,04 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,540000%) | 0,47 | 0,02 | 0,68 | 7,07 | 17.233.246,80 | 1,94 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,670000%) | 0,48 | 0,02 | 0,69 | 7,16 | 11.406.777,72 | 1,28 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,681500%) | 0,48 | 0,02 | 0,69 | 7,17 | 20.781.264,29 | 2,34 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,730000%) | 0,48 | 0,02 | 0,70 | 7,20 | 11.465.078,96 | 1,29 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Emissor | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira |
|--|--------------------------|------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|
| | | | Dia | Mês | Ano | | |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,816500%) | 1,01 | 0,92 | 1,61 | 8,23 | 37.625.556,82 | 4,24 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (6,013000%) | 0,49 | 0,02 | 0,72 | 7,39 | 23.134.564,47 | 2,61 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (6,054000%) | 0,50 | 0,02 | 0,72 | 7,42 | 10.942.186,08 | 1,23 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (6,141000%) | 0,50 | 0,02 | 0,73 | 7,48 | 26.940.246,91 | 3,03 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (6,305000%) | 0,51 | 0,02 | 0,74 | 7,59 | 16.375.286,55 | 1,84 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (6,360000%) | 1,05 | -0,87 | -0,15 | 6,67 | 37.289.650,49 | 4,20 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,540000%) | 0,52 | 0,02 | 0,68 | 7,07 | 22.382.788,85 | 2,52 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,670000%) | 0,52 | 0,02 | 0,69 | 7,16 | 22.205.366,85 | 2,50 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,730000%) | 0,53 | 0,02 | 0,70 | 7,20 | 16.736.300,50 | 1,88 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,762000%) | 2,83 | 0,02 | 0,70 | 4,35 | 40.576.498,79 | 4,57 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (6,160000%) | 2,98 | 0,02 | 0,73 | 1,58 | 11.824.844,72 | 1,33 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (6,160010%) | 4,20 | 0,02 | 0,12 | 0,12 | 50.055.385,56 | 5,64 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (6,165000%) | 2,98 | 0,02 | 0,73 | 2,61 | 19.922.714,27 | 2,24 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,540000%) | 0,55 | 0,02 | 0,68 | 7,07 | 40.282.096,73 | 4,54 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,670000%) | 0,56 | 0,02 | 0,69 | 7,16 | 22.843.717,40 | 2,57 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,720000%) | 0,56 | 0,02 | 0,70 | 7,19 | 40.186.235,11 | 4,53 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,750000%) | 0,56 | 0,02 | 0,70 | 7,21 | 27.423.425,05 | 3,09 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 1,17 | -0,05 | 0,68 | 5,73 | 789.785.481,18 | 88,94 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|-----------|--|------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| BB | BB | BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI | 0,76 | 0,00 | 0,50 | 7,25 | 0,00 | 0,00 | 1.149.680,03 | 0,00 |
| CAIXA DTVM | CEF | CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. | 0,76 | 0,00 | 0,53 | 7,30 | 0,00 | 0,00 | 247.115.203,00 | 0,00 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF | 4,15 | -0,31 | 0,68 | 1,61 | 17.193.409,24 | 1,94 | 1.025.673.316,42 | 1,68 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 0,05 | 0,04 | 0,86 | 7,01 | 11.400.937,42 | 1,28 | 7.436.483.772,61 | 0,15 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 1,51 | -0,17 | 0,72 | 5,42 | 28.594.346,66 | 3,22 | | |
| Renda Fixa | | | 1,18 | -0,05 | 0,69 | 5,70 | 818.379.827,84 | 92,16 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

0,08%

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 | 13,92 | 0,16 | 5,51 | 3,74 | 128.531,93 | 0,01 | 191.537.701,34 | 0,07 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 11,46 | 0,00 | 0,78 | 0,25 | 0,00 | 0,00 | 1.095.515.178,29 | 0,00 |
| ITAU | ITAU | ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 13,16 | -0,18 | 4,80 | -2,79 | 571.612,65 | 0,06 | 306.902.959,84 | 0,19 |
| Sub-total Artigo 8º I | | | 12,97 | -0,12 | 4,22 | 3,00 | 700.144,58 | 0,08 | | |
| Renda Variável | | | 12,97 | -0,12 | 4,22 | 3,00 | 700.144,58 | 0,08 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 4,89%

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 | 11,69 | 0,40 | 2,34 | 34,66 | 6.782.761,80 | 0,76 | 429.419.989,02 | 1,58 |
| XP | BNP PARIBAS | MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 19,31 | 0,47 | 6,56 | 32,44 | 10.525.948,48 | 1,19 | 788.344.730,75 | 1,34 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 11,65 | 1,05 | 2,53 | 32,97 | 11.941.967,51 | 1,34 | 672.241.352,02 | 1,78 |
| Sub-total Artigo 9º II | | | 13,32 | 0,69 | 3,90 | 33,16 | 29.250.677,79 | 3,29 | | |

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 | 15,12 | 0,65 | 0,57 | 41,02 | 7.698.767,53 | 0,87 | 2.663.493.555,95 | 0,29 |
| SAFRA | SAFRA | SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB | 13,32 | 1,31 | 2,16 | 31,65 | 6.505.665,14 | 0,73 | 764.869.925,79 | 0,85 |
| Sub-total Artigo 9º III | | | 13,90 | 0,95 | 1,29 | 36,57 | 14.204.432,67 | 1,60 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 12,56 | 0,78 | 3,03 | 34,26 | 43.455.110,46 | 4,89 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,87%

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 | 7,17 | 0,60 | 0,60 | -1,25 | 1.989.612,34 | 0,22 | 160.065.992,29 | 1,24 |
| KINEA | LIONS TRUST | KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME | 3,32 | 0,31 | 0,31 | 2,50 | 23.503.405,63 | 2,65 | 374.879.327,24 | 6,27 |
| Sub-total Artigo 10º II | | | 30,92 | 0,33 | 0,33 | 2,23 | 25.493.017,97 | 2,87 | | |
| Investimentos Estruturados | | | 30,92 | 0,33 | 0,33 | 2,23 | 25.493.017,97 | 2,87 | | |
| Total | | | 1,47 | -0,00 | 0,79 | 6,65 | 888.028.100,85 | 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 | 789.785.481,18 | 88,94 | 65,00 | 83,00 | 97,50 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 28.594.346,66 | 3,22 | 2,50 | 5,00 | 10,00 | 0,00 | 100,00 |
| | Total Renda Fixa | 818.379.827,84 | 92,16 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 700.144,58 | 0,08 | 0,00 | 5,00 | 15,00 | 0,00 | 40,00 |
| | Total Renda Variável | 700.144,58 | 0,08 | | | | | 40,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º II | Fundos de Investimento no Exterior | 29.250.677,79 | 3,29 | 0,00 | 2,60 | 5,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º III | Fundos de Ações - BDR Nível I | 14.204.432,67 | 1,60 | 0,00 | 1,30 | 5,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 43.455.110,46 | 4,89 | | | | | 10,00 |
| Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 10º II | Fundo de Participação | 25.493.017,97 | 2,87 | 0,00 | 3,10 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Investimentos Estruturados | 25.493.017,97 | 2,87 | | | | | 15,00 |
| Total | | 888.028.100,85 | 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 | 0,68 78,46 | 5,73 80,68 | 2,24 86,84 | 4,13 79,06 | 9,16 81,68 | 5.099.328,19 | 40.076.927,65 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 0,72 83,35 | 5,42 76,33 | 2,37 91,86 | 3,93 75,16 | 8,68 77,46 | 447.549,22 | 3.240.163,24 |
| Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p. | 4,22 -2,32 | 3,00 1,64 | 9,51 -1,88 | 4,61 -0,81 | 14,15 -3,35 | 70.264,94 | -44.414,65 |
| Artigo 9º II % do CDI | 3,90 449,53 | 33,16 467,29 | 14,84 573,98 | 21,58 412,77 | 40,62 362,40 | 1.097.879,49 | 7.284.586,44 |
| Artigo 9º III % do CDI | 1,29 148,91 | 36,57 515,27 | 13,76 532,31 | 24,89 476,17 | 41,68 371,83 | 181.150,87 | 3.803.393,95 |
| Artigo 10º II % do CDI | 0,33 38,29 | 2,23 31,48 | -0,30 -11,54 | -0,41 -7,76 | 3,29 29,33 | 84.407,78 | 632.202,93 |
| BERTIOGA (Total) | | | | | | 6.980.580,49 | 54.992.859,56 |

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 | 114.701.818,65 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 115.231.421,58 | 529.602,93 | 54.423,21 |
| NTN-B 150535 (6,201000%) | 27.513.598,05 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 27.715.843,64 | 202.245,59 | 1.973.234,73 |
| NTN-B 150545 | 9.103.465,76 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.207.435,27 | 103.969,51 | -171.392,03 |
| NTN-B 150545 (5,540000%) | 17.116.808,99 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 17.233.246,80 | 116.437,81 | 1.157.223,26 |
| NTN-B 150545 (5,670000%) | 11.328.493,55 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 11.406.777,72 | 78.284,17 | 775.083,12 |
| NTN-B 150545 (5,681500%) | 20.638.433,79 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20.781.264,29 | 142.830,50 | 1.413.562,10 |
| NTN-B 150545 (5,730000%) | 11.385.831,29 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 11.465.078,96 | 79.247,67 | 783.272,26 |
| NTN-B 150545 (5,816500%) | 37.029.219,32 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 37.625.556,82 | 596.337,50 | 2.903.282,17 |
| NTN-B 150545 (6,013000%) | 22.969.281,42 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 23.134.564,47 | 165.283,05 | 1.620.678,94 |
| NTN-B 150545 (6,054000%) | 10.863.646,28 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.942.186,08 | 78.539,80 | 769.284,21 |
| NTN-B 150545 (6,141000%) | 26.744.967,69 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 26.940.246,91 | 195.279,22 | 1.908.348,81 |
| NTN-B 150545 (6,305000%) | 16.254.396,72 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 16.375.286,55 | 120.889,83 | 1.176.383,97 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------|----------------|---------------|----------------|--------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| NTN-B 150545 (6,360000%) | 37.346.069,75 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 37.289.650,49 | -56.419,26 | 2.379.724,64 |
| NTN-B 150555 (5,540000%) | 40.009.927,62 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 40.282.096,73 | 272.169,11 | 2.704.468,62 |
| NTN-B 150555 (5,670000%) | 22.686.937,15 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 22.843.717,40 | 156.780,25 | 1.552.009,39 |
| NTN-B 150555 (5,720000%) | 39.908.799,81 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 40.186.235,11 | 277.435,30 | 2.742.666,94 |
| NTN-B 150555 (5,750000%) | 27.233.425,55 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 27.423.425,05 | 189.999,50 | 1.876.681,18 |
| NTN-B 150824 | 11.842.810,23 | 0,00 | -11.903.004,63 | 0,00 | 0,00 | 60.194,40 | 828.959,89 |
| NTN-B 150826 (5,822000%) | 7.562.086,61 | 0,00 | 0,00 | 217.394,81 | 7.397.358,02 | 52.666,22 | 518.265,14 |
| NTN-B 150832 (5,858000%) | 16.246.269,13 | 0,00 | 0,00 | 463.750,07 | 15.896.156,49 | 113.637,43 | 1.116.929,88 |
| NTN-B 150832 (5,969000%) | 22.940.956,02 | 0,00 | 0,00 | 659.201,27 | 22.444.285,04 | 162.530,29 | 1.592.549,23 |
| NTN-B 150840 (5,621000%) | 11.308.428,47 | 0,00 | 0,00 | 313.334,30 | 11.072.020,93 | 76.926,76 | 761.165,53 |
| NTN-B 150840 (5,690000%) | 17.058.621,98 | 0,00 | 0,00 | 475.870,09 | 16.699.745,03 | 116.993,14 | 1.155.351,95 |
| NTN-B 150840 (5,759500%) | 26.427.532,64 | 0,00 | 0,00 | 742.255,27 | 25.868.040,47 | 182.763,10 | 1.801.048,01 |
| NTN-B 150840 (5,966000%) | 10.854.103,57 | 0,00 | 0,00 | 311.037,87 | 10.619.941,79 | 76.876,09 | 753.279,94 |
| NTN-B 150850 (5,540000%) | 22.847.854,89 | 0,00 | 0,00 | 619.013,85 | 22.382.788,85 | 153.947,81 | 1.526.526,60 |
| NTN-B 150850 (5,670000%) | 22.674.826,27 | 0,00 | 0,00 | 624.627,33 | 22.205.366,85 | 155.167,91 | 1.532.891,21 |
| NTN-B 150850 (5,730000%) | 17.092.964,45 | 0,00 | 0,00 | 474.466,72 | 16.736.300,50 | 117.802,77 | 1.161.779,10 |
| NTN-B 150850 (5,762000%) | 41.444.920,98 | 0,00 | 0,00 | 1.155.101,28 | 40.576.498,79 | 286.679,09 | 1.735.558,87 |
| NTN-B 150850 (6,160000%) | 12.091.461,94 | 0,00 | 0,00 | 354.159,61 | 11.824.844,72 | 87.542,39 | 188.721,07 |
| NTN-B 150850 (6,160010%) | 0,00 | 49.996.277,31 | 0,00 | 0,00 | 50.055.385,56 | 59.108,25 | 59.108,25 |
| NTN-B 150850 (6,165000%) | 20.372.204,45 | 0,00 | 0,00 | 597.070,24 | 19.922.714,27 | 147.580,06 | 520.468,41 |
| | 753.600.163,02 | 49.996.277,31 | -11.903.004,63 | 7.007.282,71 | 789.785.481,18 | 5.099.328,19 | |

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 | 2.107.421,39 | 0,00 | -2.117.905,57 | 0,00 | 0,00 | 10.484,18 | 144.049,86 |
| CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. | 22.644.887,72 | 0,00 | -22.764.795,69 | 0,00 | 0,00 | 119.907,97 | 1.558.707,78 |
| FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF | 17.578.420,50 | 0,00 | 0,00 | 510.427,36 | 17.193.409,24 | 125.416,10 | 285.334,35 |
| SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 9.972.047,29 | 53.513.426,47 | -52.276.277,31 | 0,00 | 11.400.937,42 | 191.740,97 | 1.252.071,25 |
| | 52.302.776,90 | 53.513.426,47 | -77.158.978,57 | 510.427,36 | 28.594.346,66 | 447.549,22 | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|---------------|-------------|------------|-----------------------------|-----------------------------|
| AZ QUEST ACOES FIC FIA | 121.819,13 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 128.531,93 | 6.712,80 | 4.630,98 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 4.785.942,81 | 0,00 | -4.823.297,27 | 0,00 | 0,00 | 37.354,46 | 11.888,93 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 545.414,97 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 571.612,65 | 26.197,68 | -16.378,83 |
| | 5.453.176,91 | 0,00 | -4.823.297,27 | 0,00 | 700.144,58 | 70.264,94 | |

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 | 6.627.475,30 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.782.761,80 | 155.286,50 | 1.745.678,59 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 9.878.096,46 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.525.948,48 | 647.852,02 | 2.578.093,61 |
| SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 11.647.226,54 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 11.941.967,51 | 294.740,97 | 2.960.814,24 |
| | 28.152.798,30 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 29.250.677,79 | 1.097.879,49 | |

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 | 7.655.477,87 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.698.767,53 | 43.289,66 | 2.239.350,12 |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB | 6.367.803,93 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.505.665,14 | 137.861,21 | 1.564.043,83 |
| | 14.023.281,80 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 14.204.432,67 | 181.150,87 | |

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 | 1.977.767,11 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.989.612,34 | 11.845,23 | -25.128,68 |
| KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME | 23.430.843,08 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 23.503.405,63 | 72.562,55 | 657.331,61 |
| | 25.408.610,19 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 25.493.017,97 | 84.407,78 | |

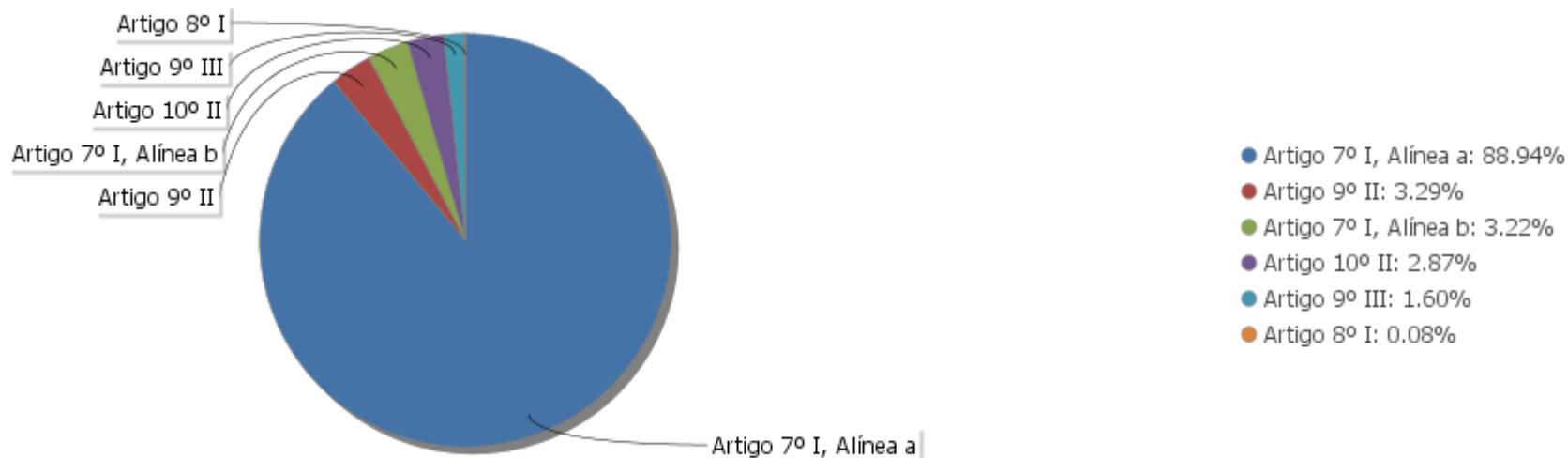
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

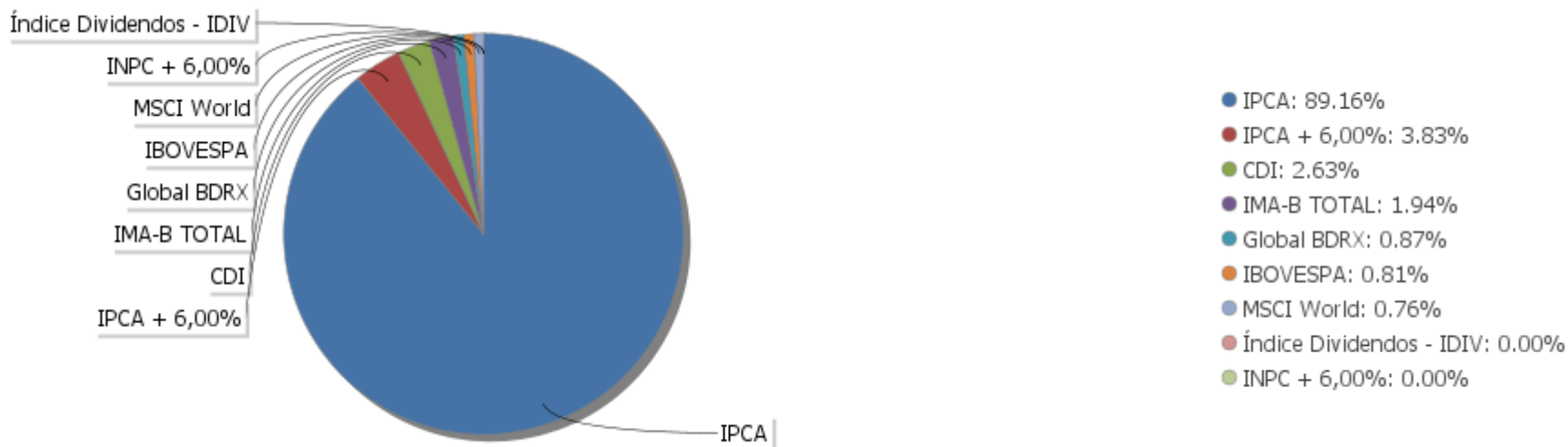
| Período | Valor (R\$) | (%) | (%) Limite Mínimo P.I. | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo Acum. |
|-----------------------|----------------|-------|------------------------|-----------------------|-----------|-------------------------|
| de 0 a 30 dias | 57.545.804,80 | 6,48 | 10,00 | 57.545.804,80 | 6,48 | 10,00 |
| de 31 dias a 365 dias | 0,00 | 0,00 | 1,00 | 57.545.804,80 | 6,48 | 11,00 |
| acima de 365 dias | 830.482.296,05 | 93,52 | 60,00 | 888.028.100,85 | 100,00 | 71,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

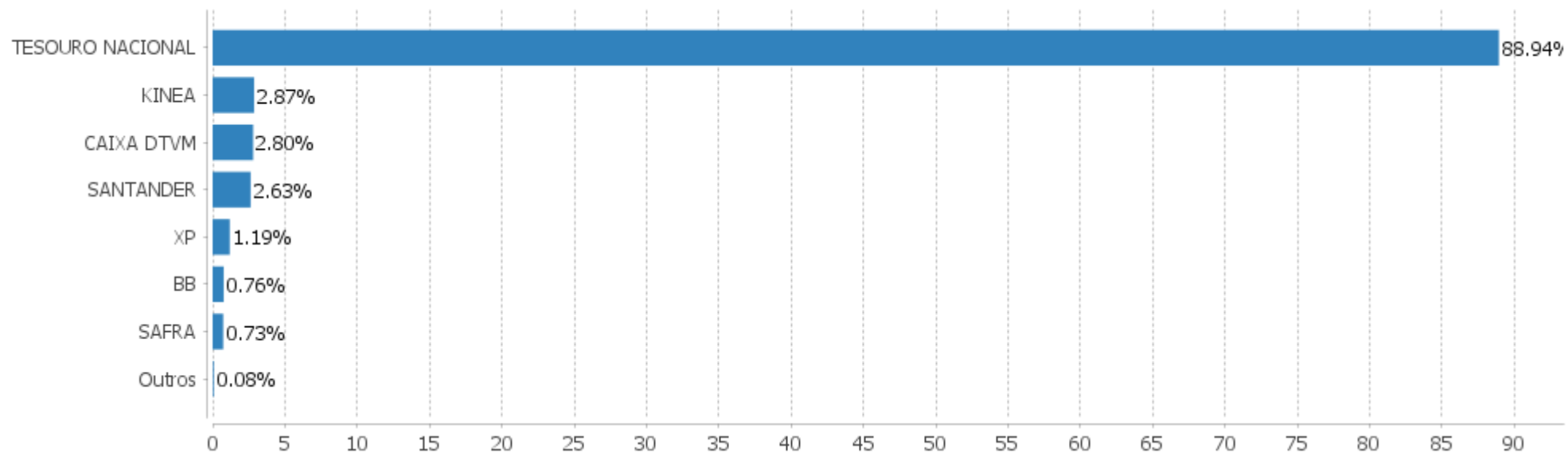


Alocação Por Estratégia



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 | 0,79 | | | | | 6,65 |
| IPCA + 5,31% | 0,87 | 1,22 | 0,57 | 0,83 | 0,89 | 0,62 | 0,86 | 0,43 | | | | | 6,48 |
| p.p. indexador | -0,22 | -0,06 | 0,23 | -0,82 | 0,19 | 0,18 | 0,30 | 0,36 | | | | | 0,17 |
| 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 | 47 | 51,09 | 03 meses | 2,78 | 1,92 | 0,85 | 1,96 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 45 | 48,91 | 06 meses | 4,74 | 4,28 | 0,46 | 1,52 |
| | | | 12 meses | 10,22 | 9,73 | 0,49 | 1,47 |
| | | | 24 meses | 21,67 | 20,73 | 0,94 | 2,19 |
| | | | 36 meses | 22,64 | 38,03 | -15,38 | 3,69 |
| | | | 48 meses | 27,93 | 59,83 | -31,91 | 4,59 |
| | | | 60 meses | 35,95 | 73,44 | -37,49 | 7,75 |

| | 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 | 103,48 | 121,60 | -18,12 | 8,37 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

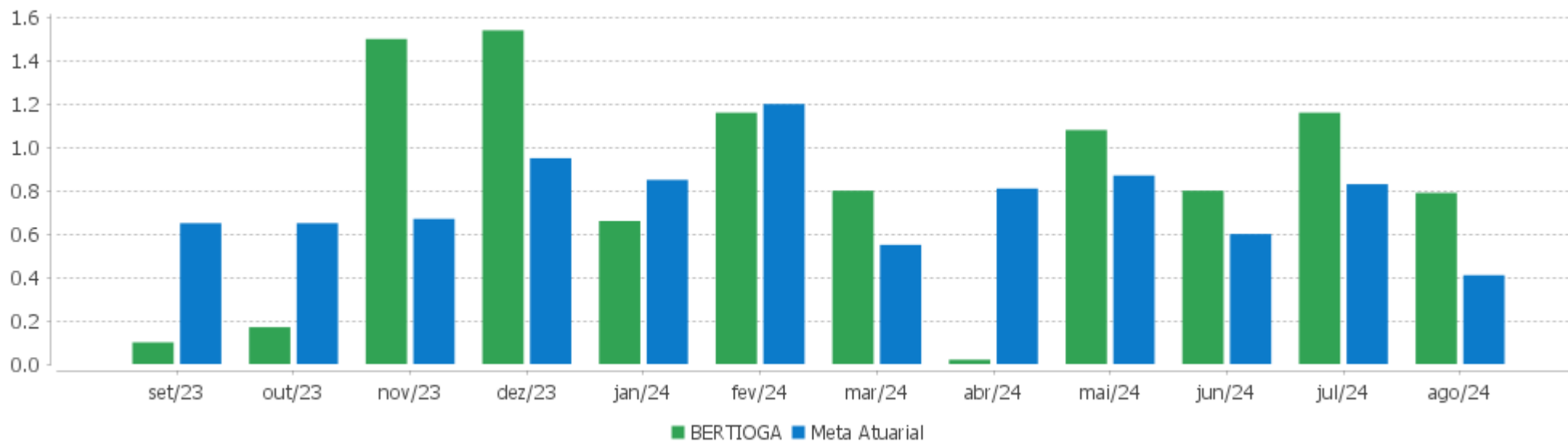


Patrimônio Líquido



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. | 0,69 0,71 | 7,17 4,32 | 2,30 1,73 | 4,97 3,39 | 10,45 6,21 | 15,12 6,08 | |
| NTN-B 150824 Var. IPCA p.p. | 7,59 7,61 | 15,03 12,17 | 9,94 9,37 | 12,87 11,29 | 18,76 14,52 | 32,21 23,17 | 44,21 25,65 |
| NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p. | 0,69 0,71 | 7,17 4,32 | 2,30 1,73 | 4,97 3,39 | 10,43 6,19 | 21,73 12,69 | 40,87 22,32 |
| NTN-B 150840 (5,966000%) Var. IPCA p.p. | 0,72 0,74 | 7,36 4,51 | 2,37 1,80 | 5,11 3,53 | 10,72 6,48 | 22,37 13,33 | 37,93 19,37 |
| NTN-B 150545 (6,305000%) Var. IPCA p.p. | 0,74 0,76 | 7,59 4,74 | 2,46 1,88 | 5,28 3,70 | 11,11 6,88 | 23,20 14,16 | 35,01 16,46 |
| NTN-B 150535 Var. IPCA p.p. | 0,46 0,48 | 0,11 -2,74 | 1,98 1,41 | 0,70 -0,88 | 3,64 -0,60 | 19,55 10,51 | 22,81 4,25 |
| NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p. | 0,69 0,71 | 7,16 4,31 | 2,30 1,73 | 4,96 3,38 | 10,46 6,23 | 21,75 12,71 | 40,87 22,31 |
| NTN-B 150840 (5,759500%) Var. IPCA p.p. | 0,70 0,72 | 7,22 4,37 | 2,32 1,75 | 5,00 3,43 | 10,50 6,26 | 18,49 9,45 | |
| NTN-B 150850 (6,165000%) Var. IPCA p.p. | 0,73 0,75 | 4,30 1,45 | 2,42 1,85 | 5,21 3,63 | 7,50 3,27 | | |
| NTN-B 150850 (6,160010%) Var. IPCA p.p. | -2,20 -2,18 | 1,26 -1,60 | -0,57 -1,14 | 2,14 0,56 | 4,37 0,13 | | |
| NTN-B 150545 (5,540000%) Var. IPCA p.p. | 0,68 0,70 | 7,07 4,22 | 2,26 1,69 | 4,89 3,31 | 10,30 6,06 | 21,42 12,38 | 36,51 17,95 |
| NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p. | 0,70 0,72 | 7,20 4,35 | 2,31 1,74 | 4,99 3,41 | 10,53 6,29 | 21,89 12,85 | 41,11 22,55 |
| NTN-B 150555 (5,670000%) Var. IPCA p.p. | 0,69 0,71 | 7,16 4,31 | 2,30 1,73 | 4,96 3,38 | 10,48 6,25 | 21,77 12,73 | 37,04 18,48 |
| NTN-B 150545 (6,013000%) Var. IPCA p.p. | 0,72 0,74 | 7,39 4,54 | 2,38 1,81 | 5,13 3,55 | 10,80 6,57 | 19,01 9,96 | 30,32 11,77 |
| NTN-B 150535 (6,201000%) Var. IPCA p.p. | 0,74 0,76 | 7,52 4,67 | 2,43 1,86 | 5,23 3,65 | 10,93 6,69 | 22,88 13,84 | 34,67 16,12 |
| NTN-B 150826 (5,822000%) Var. IPCA p.p. | 0,62 0,64 | 7,18 4,32 | 2,25 1,68 | 4,95 3,37 | 10,34 6,10 | 21,79 12,75 | 37,09 18,53 |
| NTN-B 150545 (6,054000%) | 0,72 | 7,42 | 2,39 | 5,15 | 10,85 | 22,62 | 34,29 |

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. | 0,74 | 4,57 | 1,82 | 3,57 | 6,61 | 13,58 | 15,73 |
| NTN-B 150545 (6,360000%) Var. IPCA p.p. | -0,15 -0,13 | 6,67 3,82 | 1,55 0,98 | 4,37 2,79 | 10,18 5,94 | 18,58 9,54 | |
| NTN-B 150840 (5,621000%) Var. IPCA p.p. | 0,69 0,71 | 7,13 4,27 | 2,28 1,71 | 4,93 3,36 | 10,35 6,11 | 21,57 12,53 | 40,60 22,04 |
| NTN-B 150545 Var. IPCA p.p. | 1,14 1,16 | -1,72 -4,58 | 1,57 1,00 | -0,62 -2,20 | 2,82 -1,42 | 19,00 9,96 | 18,71 0,15 |
| NTN-B 150555 (5,720000%) Var. IPCA p.p. | 0,70 0,72 | 7,19 4,34 | 2,31 1,74 | 4,98 3,41 | 10,54 6,30 | 21,89 12,85 | 37,21 18,65 |
| NTN-B 150832 (5,969000%) Var. IPCA p.p. | 0,72 0,74 | 7,36 4,51 | 2,37 1,80 | 5,11 3,53 | 10,67 6,43 | 22,32 13,28 | 33,93 15,37 |
| NTN-B 150545 (5,670000%) Var. IPCA p.p. | 0,69 0,71 | 7,16 4,31 | 2,30 1,73 | 4,96 3,38 | 10,44 6,20 | 21,72 12,68 | 36,96 18,40 |
| NTN-B 150850 (5,540000%) Var. IPCA p.p. | 0,68 0,70 | 7,07 4,22 | 2,26 1,69 | 4,89 3,31 | 10,33 6,09 | 21,45 12,41 | 40,35 21,79 |
| NTN-B 150850 (5,762000%) Var. IPCA p.p. | 0,70 0,72 | 4,19 1,34 | 2,32 1,75 | 5,01 3,43 | 7,26 3,02 | | |
| NTN-B 150832 (5,858000%) Var. IPCA p.p. | 0,71 0,73 | 7,29 4,44 | 2,34 1,77 | 5,05 3,47 | 10,55 6,32 | 22,07 13,03 | 37,47 18,91 |
| NTN-B 150545 (6,141000%) Var. IPCA p.p. | 0,73 0,75 | 7,48 4,63 | 2,41 1,84 | 5,20 3,62 | 10,94 6,70 | 22,72 13,67 | 34,43 15,87 |
| NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p. | 0,70 0,72 | 7,20 4,35 | 2,31 1,74 | 4,99 3,41 | 10,50 6,26 | 21,86 12,82 | 37,16 18,61 |
| NTN-B 150555 (5,750000%) Var. IPCA p.p. | 0,70 0,72 | 7,21 4,36 | 2,32 1,75 | 5,00 3,42 | 10,57 6,33 | 21,96 12,92 | 37,31 18,75 |
| NTN-B 150850 (6,160000%) Var. IPCA p.p. | 0,73 0,75 | 4,30 1,45 | 2,42 1,85 | 5,21 3,63 | 7,50 3,26 | | |
| NTN-B 150555 (5,540000%) Var. IPCA p.p. | 0,68 0,70 | 7,07 4,22 | 2,26 1,69 | 4,89 3,31 | 10,35 6,11 | 21,47 12,43 | 36,60 18,05 |
| NTN-B 150545 (5,816500%) Var. IPCA p.p. | 1,61 1,63 | 8,23 5,37 | 3,26 2,68 | 5,98 4,40 | 11,59 7,35 | 16,35 7,31 | |
| FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,68 0,17 | 1,61 0,11 | 1,72 0,09 | 1,36 -0,04 | 4,59 -0,73 | 15,33 -4,48 | 22,36 -4,09 |
| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p. | 0,48 0,11 | 7,23 0,33 | 2,62 0,73 | 5,29 0,85 | 10,74 0,86 | 22,98 1,81 | 35,93 -3,84 |
| CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. | 0,53 | 7,30 | 2,68 | 5,36 | 10,81 | 23,06 | 33,90 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,01 | 5,81 | 1,05 | 3,96 | 5,50 | 3,24 | 7,45 |
| SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI | 0,86 99,57 | 7,01 98,81 | 2,56 99,10 | 5,16 98,77 | 11,05 98,57 | 25,97 98,82 | 38,79 99,04 |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p. | 5,51 -1,03 | 3,74 2,38 | 11,77 0,38 | 3,62 -1,79 | 16,34 -1,17 | 16,51 -7,67 | 3,83 -10,67 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 5,73 -0,95 | 5,17 0,17 | 10,80 -0,08 | 6,59 -1,26 | 19,13 -2,81 | 30,18 -4,74 | 27,42 -13,27 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p. | 4,80 -1,74 | -2,79 -4,14 | 9,44 -1,95 | 1,31 -4,11 | 10,06 -7,45 | 14,96 -9,22 | 3,04 -11,46 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p. | 0,57 0,02 | 41,02 -1,23 | 13,95 0,21 | 26,91 -0,81 | 46,38 -1,62 | 68,28 -2,86 | 40,40 -4,54 |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p. | 2,16 -4,38 | 31,65 30,30 | 13,54 2,15 | 22,58 17,17 | 36,50 18,99 | 49,59 25,41 | 20,06 5,56 |
| BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI World p.p. | 2,34 | 34,66 | 14,48 | 25,21 | 40,64 | 53,63 | 32,93 |
| SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI | 2,53 291,71 | 32,97 464,53 | 13,81 534,29 | 23,40 447,71 | 38,53 343,76 | 49,25 187,38 | 16,97 43,33 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p. | 6,56 6,07 | 32,44 25,49 | 16,26 14,16 | 17,41 12,78 | 43,06 32,62 | 68,48 46,05 | 2,30 -38,81 |
| KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p. | 0,31 -0,18 | 2,50 -4,45 | -0,10 -2,19 | -0,36 -4,99 | 3,44 -7,00 | -3,80 -26,24 | 19,12 -21,99 |
| FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II Var. IPCA p.p. | 0,60 0,62 | 3,84 0,98 | 1,96 1,39 | 3,64 2,06 | 6,23 1,99 | | |
| BERTIOGA Var. IPCA + 4,99% p.p. | 0,79 0,36 | 6,65 0,17 | 2,78 0,85 | 4,74 0,46 | 10,22 0,49 | 21,67 0,81 | 22,64 -15,74 |
| CDI | 0,87 | 7,10 | 2,58 | 5,23 | 11,21 | 26,28 | 39,16 |
| IBOVESPA | 6,54 | 1,36 | 11,39 | 5,41 | 17,51 | 24,18 | 14,50 |
| INPC + 6,00% | 0,37 | 6,90 | 1,89 | 4,44 | 9,88 | 21,17 | 39,78 |
| IPCA + 6,00% | 0,49 | 6,95 | 2,09 | 4,63 | 10,44 | 22,43 | 41,11 |

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 |
| 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 MULTIESTRATEGIA 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 |
| 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 | 0,77 | 6,30 | 2,36 | 4,62 | 10,39 | 25,57 | 36,92 | 39,98 | 47,06 |
| IRF-M 1+ | 0,60 | 2,39 | 1,43 | 1,43 | 7,39 | 24,61 | 30,60 | 26,26 | 39,69 |
| IRF-M TOTAL | 0,66 | 3,54 | 1,70 | 2,39 | 8,26 | 24,46 | 32,14 | 30,49 | 41,85 |
| IMA-B 5 | 0,59 | 4,88 | 1,91 | 3,56 | 8,14 | 21,08 | 33,04 | 39,39 | 52,27 |
| IMA-B 5+ | 0,77 | -1,21 | 1,69 | -0,25 | 3,11 | 18,58 | 20,29 | 22,46 | 28,23 |
| IMA-B TOTAL | 0,52 | 1,49 | 1,63 | 1,40 | 5,32 | 19,81 | 26,45 | 30,58 | 39,25 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,79 | 4,63 | 2,21 | 3,49 | 8,81 | 23,74 | 33,48 | 35,98 | 44,83 |
| IDKA 2 | 0,60 | 4,60 | 1,53 | 3,33 | 7,94 | 20,67 | 32,05 | 38,75 | 52,22 |
| IDKA 20 | 0,42 | -6,26 | 1,27 | -3,24 | -0,28 | 18,04 | 10,08 | 10,85 | 10,58 |
| CDI | 0,87 | 7,10 | 2,58 | 5,23 | 11,21 | 26,28 | 39,16 | 42,92 | 48,46 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | 6,54 | 1,36 | 11,39 | 5,41 | 17,51 | 24,18 | 14,50 | 36,87 | 34,48 |
| IBRX 100 | 6,60 | 1,79 | 11,34 | 5,58 | 18,00 | 22,90 | 12,85 | 36,41 | 34,88 |
| IBRX 50 | 6,51 | 3,14 | 11,66 | 6,63 | 19,46 | 24,91 | 15,69 | 41,27 | 38,19 |
| SMALL CAP | 4,51 | -9,69 | 5,65 | -3,81 | -2,18 | -4,07 | -25,42 | -12,75 | -7,50 |
| Índice Consumo - ICON | 6,25 | -6,83 | 9,13 | 1,55 | 0,43 | -15,02 | -41,58 | -41,33 | -37,96 |
| Índice Dividendos - IDIV | 6,69 | 5,00 | 10,87 | 7,85 | 21,94 | 34,91 | 40,69 | 67,98 | 61,87 |

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 | 2,18 | 38,35 | 15,49 | 25,80 | 44,00 | 55,98 | 37,34 | 66,82 | 163,79 |

Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX | 0,86 | 2,48 | 0,33 | 1,00 | 5,63 | 14,02 | 23,41 | 21,98 | 27,74 |

Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | 2,29 | 33,98 | 14,52 | 24,30 | 39,63 | 48,51 | 23,68 | 47,36 | 123,03 |

Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA | -0,02 | 2,85 | 0,57 | 1,58 | 4,24 | 9,04 | 18,56 | 30,03 | 33,20 |
| INPC | -0,14 | 2,80 | 0,37 | 1,40 | 3,71 | 7,92 | 17,44 | 29,68 | 33,49 |
| IGPM | 0,29 | 2,00 | 1,72 | 2,46 | 4,26 | -3,24 | 5,07 | 37,76 | 55,70 |
| SELIC | 0,87 | 7,10 | 2,58 | 5,23 | 11,21 | 26,28 | 39,16 | 42,92 | 48,46 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,32 | 5,59 | 1,59 | 3,62 | 8,37 | 17,88 | 33,30 | 52,03 | 61,96 |
| IPCA + 5,00% | 0,41 | 6,27 | 1,84 | 4,13 | 9,41 | 20,15 | 37,17 | 57,93 | 69,87 |
| IPCA + 5,50% | 0,45 | 6,61 | 1,97 | 4,38 | 9,92 | 21,29 | 39,13 | 60,95 | 73,94 |
| IPCA + 5,89% | 0,48 | 6,88 | 2,07 | 4,58 | 10,33 | 22,18 | 40,67 | 63,33 | 77,17 |
| IPCA + 6,00% | 0,49 | 6,95 | 2,09 | 4,63 | 10,44 | 22,43 | 41,11 | 64,01 | 78,09 |
| INPC + 4,00% | 0,20 | 5,54 | 1,39 | 3,44 | 7,82 | 16,67 | 32,04 | 51,61 | 62,31 |
| INPC + 6,00% | 0,37 | 6,90 | 1,89 | 4,44 | 9,88 | 21,17 | 39,78 | 63,57 | 78,48 |

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%) | 27.715.843,64 | 6,201000 | 27.636.681,28 | 6,239600 | -79.162,36 |
| NTN-B 150545 (5,540000%) | 17.233.246,80 | 5,540000 | 15.913.503,00 | 6,243000 | -1.319.743,80 |
| NTN-B 150545 (5,670000%) | 11.406.777,72 | 5,670000 | 10.691.951,87 | 6,243000 | -714.825,85 |
| NTN-B 150545 (5,681500%) | 20.781.264,29 | 5,681500 | 19.504.660,19 | 6,243000 | -1.276.604,10 |
| NTN-B 150545 (5,730000%) | 11.465.078,96 | 5,730000 | 10.820.667,18 | 6,243000 | -644.411,78 |
| NTN-B 150545 (5,816500%) | 37.625.556,82 | 5,816500 | 35.542.588,00 | 6,243000 | -2.082.968,82 |
| NTN-B 150545 (6,013000%) | 23.134.564,47 | 6,013000 | 22.546.632,05 | 6,243000 | -587.932,42 |
| NTN-B 150545 (6,054000%) | 10.942.186,08 | 6,054000 | 10.713.404,42 | 6,243000 | -228.781,66 |
| NTN-B 150545 (6,141000%) | 26.940.246,91 | 6,141000 | 26.635.488,45 | 6,243000 | -304.758,46 |
| NTN-B 150545 (6,305000%) | 16.375.286,55 | 6,305000 | 16.488.431,39 | 6,243000 | 113.144,84 |
| NTN-B 150545 (6,360000%) | 37.289.650,49 | 6,360000 | 38.116.894,22 | 6,243000 | 827.243,73 |
| NTN-B 150555 (5,540000%) | 40.282.096,73 | 5,540000 | 36.643.985,67 | 6,239600 | -3.638.111,06 |
| NTN-B 150555 (5,670000%) | 22.843.717,40 | 5,670000 | 21.158.022,75 | 6,239600 | -1.685.694,65 |
| NTN-B 150555 (5,720000%) | 40.186.235,11 | 5,720000 | 37.477.483,54 | 6,239600 | -2.708.751,57 |
| NTN-B 150555 (5,750000%) | 27.423.425,05 | 5,750000 | 25.680.282,97 | 6,239600 | -1.743.142,08 |
| NTN-B 150826 (5,822000%) | 7.397.358,02 | 5,822000 | 7.284.415,65 | 6,697100 | -112.942,37 |
| NTN-B 150832 (5,858000%) | 15.896.156,49 | 5,858000 | 15.510.617,51 | 6,264400 | -385.538,98 |
| NTN-B 150832 (5,969000%) | 22.444.285,04 | 5,969000 | 22.047.692,08 | 6,264400 | -396.592,96 |
| NTN-B 150840 (5,621000%) | 11.072.020,93 | 5,621000 | 10.526.279,34 | 6,130500 | -545.741,59 |
| NTN-B 150840 (5,690000%) | 16.699.745,03 | 5,690000 | 15.986.572,44 | 6,130500 | -713.172,59 |
| NTN-B 150840 (5,759500%) | 25.868.040,47 | 5,759500 | 24.935.624,26 | 6,130500 | -932.416,21 |
| NTN-B 150840 (5,966000%) | 10.619.941,79 | 5,966000 | 10.449.132,34 | 6,130500 | -170.809,45 |
| NTN-B 150850 (5,540000%) | 22.382.788,85 | 5,540000 | 20.416.767,73 | 6,257400 | -1.966.021,12 |
| NTN-B 150850 (5,670000%) | 22.205.366,85 | 5,670000 | 20.601.915,67 | 6,257400 | -1.603.451,18 |
| NTN-B 150850 (5,730000%) | 16.736.300,50 | 5,730000 | 15.649.208,41 | 6,257400 | -1.087.092,09 |
| NTN-B 150850 (5,762000%) | 40.576.498,79 | 5,762000 | 38.098.395,52 | 6,257400 | -2.478.103,27 |
| NTN-B 150850 (6,160000%) | 11.824.844,72 | 6,160000 | 11.681.151,53 | 6,257400 | -143.693,19 |
| NTN-B 150850 (6,160010%) | 50.055.385,56 | 6,160010 | 49.447.122,35 | 6,257400 | -608.263,21 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Financeiro Curva (R\$) | Taxa Curva (%) | Financeiro Mercado (R\$) | Taxa Mercado (%) | Diferença (R\$) |
|--------------------------|------------------------|----------------|--------------------------|------------------|-----------------|
| NTN-B 150850 (6,165000%) | 19.922.714,27 | 6,165000 | 19.693.007,62 | 6,257400 | -229.706,65 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|--|-----------------------|----------------------|---------------------|------------------|
| 495 | 08/08/2024 | FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 0,00 | 4.823.297,27 | 1.825.646,38836026 | 2,6419668700 |
| 483 | 09/08/2024 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 4.100.000,00 | 0,00 | 102.420,12868700 | 40,0311936000 |
| 484 | 13/08/2024 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 4.920.000,00 | 0,00 | 122.810,62141700 | 40,0616815000 |
| 497 | 15/08/2024 | NTN-B 150824 | 0,00 | 11.903.004,63 | 2.678,99999900 | 4.443,0775044600 |
| 481 | 15/08/2024 | BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI | 0,00 | 2.117.905,57 | 659.182,13875500 | 3,2129292400 |
| 485 | 15/08/2024 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 18.910.297,85 | 0,00 | 471.669,64633700 | 40,0922510000 |
| 482 | 16/08/2024 | CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. | 0,00 | 22.764.795,69 | 13.000.000,00000000 | 1,7511381300 |
| 486 | 16/08/2024 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 2.117.905,57 | 0,00 | 52.805,58575600 | 40,1076049000 |
| 487 | 19/08/2024 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 23.275.223,05 | 0,00 | 580.096,27985700 | 40,1230345000 |
| 488 | 22/08/2024 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 0,00 | 4.334.792,04 | 107.909,11701700 | 40,1707674000 |
| 489 | 22/08/2024 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 0,00 | 18.947.331,65 | 471.669,64633700 | 40,1707674000 |
| 490 | 22/08/2024 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 0,00 | 2.121.240,90 | 52.805,58575600 | 40,1707674000 |
| 491 | 22/08/2024 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 0,00 | 23.302.912,72 | 580.096,27985700 | 40,1707674000 |
| 496 | 23/08/2024 | NTN-B 150850 (6,160010%) | 49.996.277,31 | 0,00 | 11.751,00000000 | 4.254,6402272150 |
| 492 | 29/08/2024 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 0,00 | 2.970.201,07 | 73.792,16942600 | 40,2508978000 |
| 493 | 29/08/2024 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 0,00 | 599.798,93 | 14.901,50440000 | 40,2508978000 |
| 494 | 30/08/2024 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 190.000,00 | 0,00 | 4.718,54201200 | 40,2666755000 |
| Total | | | 103.509.703,78 | 93.885.280,47 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.927.209,31

Value-At-Risk: 0,44%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | Limite ⁽⁵⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| Artigo 7º | 1,30 | 0,50 | 10,00 | 0,34 | -0,14 | 0,68 | 818.379.827,84 | 92,16 |
| Artigo 8º | 12,04 | 5,66 | 30,00 | 0,00 | 0,28 | 4,22 | 700.144,58 | 0,08 |
| Artigo 9º | 20,81 | 6,69 | 30,00 | 0,10 | 0,10 | 3,05 | 43.455.110,46 | 4,89 |
| Artigo 10º | 1,12 | 0,03 | 55,00 | 0,00 | -0,48 | 0,33 | 25.493.017,97 | 2,87 |
| BERTIOGA | | 0,44 | | 0,44 | | | 888.028.100,85 | 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 | 23,24 | NaN | 0,00 | NaN | 0,29 | 7,59 | 0,00 | 0,00 |
| NTN-B 150826 (5,822000%) | 13,88 | 0,06 | 0,00 | 0,09 | -0,02 | 0,62 | 7.397.358,02 | 0,83 |
| NTN-B 150832 (5,858000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,89 | 0,71 | 15.896.156,49 | 1,79 |
| NTN-B 150832 (5,969000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,84 | 0,72 | 22.444.285,04 | 2,53 |
| NTN-B 150535 | 7,03 | 2,98 | 0,29 | 2,98 | -0,06 | 0,46 | 115.231.421,58 | 12,98 |
| NTN-B 150535 (6,201000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,73 | 0,74 | 27.715.843,64 | 3,12 |
| NTN-B 150840 (5,621000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -1,00 | 0,69 | 11.072.020,93 | 1,25 |
| NTN-B 150840 (5,690000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,96 | 0,69 | 16.699.745,03 | 1,88 |
| NTN-B 150840 (5,759500%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,93 | 0,70 | 25.868.040,47 | 2,91 |
| NTN-B 150840 (5,966000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,84 | 0,72 | 10.619.941,79 | 1,20 |
| NTN-B 150545 | 8,97 | 3,37 | 0,03 | 3,37 | 0,03 | 1,14 | 9.207.435,27 | 1,04 |
| NTN-B 150545 (5,540000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -1,03 | 0,68 | 17.233.246,80 | 1,94 |
| NTN-B 150545 (5,670000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,97 | 0,69 | 11.406.777,72 | 1,28 |
| NTN-B 150545 (5,681500%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,97 | 0,69 | 20.781.264,29 | 2,34 |
| NTN-B 150545 (5,730000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,95 | 0,70 | 11.465.078,96 | 1,29 |
| NTN-B 150545 (5,816500%) | 3,01 | 0,10 | -0,00 | 0,13 | 0,25 | 1,61 | 37.625.556,82 | 4,24 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------|-------------|-----------------------|--------------|
| NTN-B 150545 (6,013000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,82 | 0,72 | 23.134.564,47 | 2,61 |
| NTN-B 150545 (6,054000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,80 | 0,72 | 10.942.186,08 | 1,23 |
| NTN-B 150545 (6,141000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,76 | 0,73 | 26.940.246,91 | 3,03 |
| NTN-B 150545 (6,305000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,68 | 0,74 | 16.375.286,55 | 1,84 |
| NTN-B 150545 (6,360000%) | 3,07 | 0,07 | 0,00 | 0,08 | -0,33 | -0,15 | 37.289.650,49 | 4,20 |
| NTN-B 150850 (5,540000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -1,03 | 0,68 | 22.382.788,85 | 2,52 |
| NTN-B 150850 (5,670000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,97 | 0,69 | 22.205.366,85 | 2,50 |
| NTN-B 150850 (5,730000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,95 | 0,70 | 16.736.300,50 | 1,88 |
| NTN-B 150850 (5,762000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,93 | 0,70 | 40.576.498,79 | 4,57 |
| NTN-B 150850 (6,160000%) | 0,40 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,34 | 0,73 | 11.824.844,72 | 1,33 |
| NTN-B 150850 (6,160010%) | 9,99 | 0,16 | 0,00 | 0,17 | -0,31 | -2,20 | 50.055.385,56 | 5,64 |
| NTN-B 150850 (6,165000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,75 | 0,73 | 19.922.714,27 | 2,24 |
| NTN-B 150555 (5,540000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -1,03 | 0,68 | 40.282.096,73 | 4,54 |
| NTN-B 150555 (5,670000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,97 | 0,69 | 22.843.717,40 | 2,57 |
| NTN-B 150555 (5,720000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,95 | 0,70 | 40.186.235,11 | 4,53 |
| NTN-B 150555 (5,750000%) | 0,18 | 0,06 | 0,00 | 0,08 | -0,94 | 0,70 | 27.423.425,05 | 3,09 |
| Sub-total | 1,28 | 0,48 | 0,31 | | -0,15 | 0,68 | 789.785.481,18 | 88,94 |

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 | 0,44 | NaN | 0,00 | NaN | -0,88 | 0,48 | 0,00 | 0,00 |
| CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. | 0,40 | NaN | 0,00 | NaN | -0,85 | 0,53 | 0,00 | 0,00 |
| FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF | 4,68 | 2,22 | 0,03 | 0,57 | -0,04 | 0,68 | 17.193.409,24 | 1,94 |
| SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 0,02 | 0,01 | -0,00 | 0,00 | -0,24 | 0,86 | 11.400.937,42 | 1,28 |
| Sub-total | 1,83 | 1,34 | 0,03 | | -0,08 | 0,72 | 28.594.346,66 | 3,22 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,69%

Artigo 9º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI | 17,38 | 6,53 | 0,01 | 6,53 | 0,08 | 2,34 | 6.782.761,80 | 0,76 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 31,42 | 9,23 | 0,02 | 9,24 | 0,18 | 6,56 | 10.525.948,48 | 1,19 |
| SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 18,93 | 6,36 | 0,02 | 6,36 | 0,09 | 2,53 | 11.941.967,51 | 1,34 |
| Sub-total | 21,66 | 6,86 | 0,06 | | 0,14 | 3,90 | 29.250.677,79 | 3,29 |

Artigo 9º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 19,49 | 9,37 | 0,02 | 1,21 | -0,02 | 0,57 | 7.698.767,53 | 0,87 |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB | 19,22 | 6,77 | 0,02 | 8,99 | 0,07 | 2,16 | 6.505.665,14 | 0,73 |
| Sub-total | 19,06 | 8,00 | 0,04 | | 0,02 | 1,29 | 14.204.432,67 | 1,60 |

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,03%

Artigo 10º II

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II | 2,02 | 0,13 | 0,00 | 0,14 | -0,13 | 0,60 | 1.989.612,34 | 0,22 |
| KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME | 1,05 | 0,02 | 0,00 | 0,07 | -0,53 | 0,31 | 23.503.405,63 | 2,65 |
| Sub-total | 1,12 | 0,03 | 0,00 | | -0,48 | 0,33 | 25.493.017,97 | 2,87 |

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 | 14,13 | 5,92 | 0,00 | 2,73 | 0,33 | 5,51 | 128.531,93 | 0,01 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 11,21 | NaN | 0,00 | NaN | 0,43 | 5,73 | 0,00 | 0,00 |
| ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 11,94 | 5,68 | 0,00 | 1,54 | 0,33 | 4,80 | 571.612,65 | 0,06 |
| Sub-total | 12,04 | 5,66 | 0,00 | | 0,28 | 4,22 | 700.144,58 | 0,08 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)
- (2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
- (3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
- (4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
- (5) Limite Política de Investimentos (%)