



LDB
EMPRESAS

SANTA MARIA DE JETIBÁ
JANEIRO 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 31.01.2024.

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

95,93%

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				
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,04	0,03	0,71	0,71	78.627,82	0,07	1.565.396.963,09	0,01
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,30	0,05	0,85	0,85	9.487.615,16	8,83	6.413.203.187,61	0,15
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	4,46	0,27	-0,35	-0,35	11.931.627,02	11,11	952.445.373,20	1,25
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,43	0,17	0,66	0,66	1.603.174,28	1,49	4.127.932.079,70	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,08	0,05	0,95	0,95	5.449.975,49	5,07	12.594.877.640,69	0,04
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	4,33	0,21	-0,65	-0,65	3.450.663,30	3,21	233.444.270,25	1,48
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,15	0,20	-0,47	-0,47	11.210.984,63	10,44	5.008.664.499,36	0,22
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,87	0,11	0,66	0,66	8.394.489,59	7,82	5.294.436.148,21	0,16
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,29	0,05	0,89	0,89	1.424.854,12	1,33	176.655.080,93	0,81
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,05	0,04	0,95	0,95	561.653,88	0,52	5.578.840.271,53	0,01
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,61	0,15	0,19	0,19	53.593.665,29	49,90		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,04	0,04	0,87	0,87	4.684.394,06	4,36	183.948.115,80	2,55
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4,28	0,21	-0,49	-0,49	10.992.371,16	10,23	1.285.884.378,15	0,85
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4,49	0,22	-0,66	-0,66	4.298.741,59	4,00	167.158.643,66	2,57
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,04	0,88	0,88	3.725.331,26	3,47	4.198.417.498,27	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,03	0,04	0,88	0,88	2.108.282,80	1,96	908.439.964,55	0,23
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,46	0,05	1,02	1,02	1.864.030,23	1,74	2.955.720.024,80	0,06
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,83	0,04	0,97	0,97	6.195.895,93	5,77	284.246.703,69	2,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,80	0,08	0,64	0,64	12.472.943,06	11,61	145.865.617,87	8,55
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,81	0,11	0,35	0,35	46.341.990,09	43,15		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a. a	1,13	0,02	1,06	1,06	1.071.415,88	1,00		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 5,85 % a. a	2,94	1,00	1,00	1,00	2.031.848,99	1,89		
Sub-total Artigo 7º IV			1,41	0,66	1,02	1,02	3.103.264,87	2,89		
Renda Fixa			2,23	0,15	0,29	0,29	103.038.920,25	95,93		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,42%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	18,93	3,30	-6,11	-6,11	165.804,00	0,15	369.461.265,08	0,04
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,73	1,24	-3,07	-3,07	164.586,80	0,15	790.497.665,44	0,02
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	16,74	0,35	-4,59	-4,59	896.179,46	0,83	125.944.593,53	0,71
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	18,45	0,56	-1,49	-1,49	170.915,65	0,16	483.893.890,15	0,04
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	16,20	0,72	-4,94	-4,94	130.519,96	0,12	134.010.666,17	0,10
Sub-total Artigo 8º I			16,21	0,81	-4,29	-4,29	1.528.005,87	1,42		
Renda Variável			16,21	0,81	-4,29	-4,29	1.528.005,87	1,42		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,65%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,81	0,24	-4,85	-4,85	1.125.054,60	1,05	142.000.741,84	0,79
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5,46	0,30	-0,96	-0,96	1.716.870,71	1,60	340.439.675,78	0,50
Sub-total Artigo 10º I			6,09	0,28	-2,54	-2,54	2.841.925,31	2,65		
Investimentos Estruturados			6,09	0,28	-2,54	-2,54	2.841.925,31	2,65		
Total			2,35	0,16	0,14	0,14	107.408.851,43	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	53.593.665,29	49,90	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	46.341.990,09	43,15	0,00	33,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	3.103.264,87	2,89	0,00	6,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	103.038.920,25	95,93					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	1.528.005,87	1,42	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	1.528.005,87	1,42					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	2.841.925,31	2,65	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	2.841.925,31	2,65					15,00
Total		107.408.851,43	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 b % do CDI	0,19 19,40	0,19 19,40	4,05 144,20	3,95 65,48	14,03 108,96	101.067,66	101.067,66
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,35 36,46	0,35 36,46	3,67 130,61	4,57 75,62	13,14 102,09	163.436,62	163.436,62
Artigo 7º IV % do CDI	1,02 105,80	1,02 105,80	2,53 90,14	4,76 78,79		31.418,21	31.418,21
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,29 0,50	-4,29 0,50	14,05 1,14	3,32 -1,44	8,85 -3,77	-68.508,39	-68.508,39
Artigo 10º I % do CDI	-2,54 -262,59	-2,54 -262,59	6,83 243,30	3,83 63,46	11,90 92,42	-74.020,32	-74.020,32
SANTA MARIA DE JETIBÁ (Total)						153.393,78	153.393,78

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	306.710,15	475.206,10	-706.612,61	0,00	78.627,82	3.324,18	3.324,18
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	3.473.259,35	0,00	0,00	0,00	3.450.663,30	-22.596,05	-22.596,05
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.412.319,77	0,00	0,00	0,00	1.424.854,12	12.534,35	12.534,35
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	9.407.728,08	0,00	0,00	0,00	9.487.615,16	79.887,08	79.887,08
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	8.339.431,35	0,00	0,00	0,00	8.394.489,59	55.058,24	55.058,24
BB PREV RF IRF M	1.592.691,22	0,00	0,00	0,00	1.603.174,28	10.483,06	10.483,06
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	11.973.447,89	0,00	0,00	0,00	11.931.627,02	-41.820,87	-41.820,87
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.263.388,04	0,00	0,00	0,00	11.210.984,63	-52.403,41	-52.403,41
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.398.664,54	0,00	0,00	0,00	5.449.975,49	51.310,95	51.310,95
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	556.363,75	0,00	0,00	0,00	561.653,88	5.290,13	5.290,13
	53.724.004,14	475.206,10	-706.612,61	0,00	53.593.665,29	101.067,66	

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	12.393.799,57	0,00	0,00	0,00	12.472.943,06	79.143,49	79.143,49
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4.327.136,14	0,00	0,00	0,00	4.298.741,59	-28.394,55	-28.394,55
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	1.845.156,24	0,00	0,00	0,00	1.864.030,23	18.873,99	18.873,99
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	6.349.673,79	0,00	-215.000,00	0,00	6.195.895,93	61.222,14	61.222,14
BB PREV RF FLUXO FIC	3.354.967,81	338.542,18	0,00	0,00	3.725.331,26	31.821,27	31.821,27
FI BANESTES INVEST MONEY RF	3.719.965,62	928.209,13	0,00	0,00	4.684.394,06	36.219,31	36.219,31
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.138.627,50	0,00	-48.987,00	0,00	2.108.282,80	18.642,30	18.642,30
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	11.046.462,49	0,00	0,00	0,00	10.992.371,16	-54.091,33	-54.091,33
	45.175.789,16	1.266.751,31	-263.987,00	0,00	46.341.990,09	163.436,62	

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 5,85 % a.a	2.011.676,44	0,00	0,00	0,00	2.031.848,99	20.172,55	20.172,55
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	1.060.170,22	0,00	0,00	0,00	1.071.415,88	11.245,66	11.245,66
	3.071.846,66	0,00	0,00	0,00	3.103.264,87	31.418,21	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	939.318,04	0,00	0,00	0,00	896.179,46	-43.138,58	-43.138,58
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	169.797,18	0,00	0,00	0,00	164.586,80	-5.210,38	-5.210,38
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	173.501,32	0,00	0,00	0,00	170.915,65	-2.585,67	-2.585,67
SCHRODER BEST IDEAS FIA	137.302,89	0,00	0,00	0,00	130.519,96	-6.782,93	-6.782,93
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	176.594,83	0,00	0,00	0,00	165.804,00	-10.790,83	-10.790,83
	1.596.514,26	0,00	0,00	0,00	1.528.005,87	-68.508,39	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	1.733.586,23	0,00	0,00	0,00	1.716.870,71	-16.715,52	-16.715,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1.182.359,40	0,00	0,00	0,00	1.125.054,60	-57.304,80	-57.304,80
	2.915.945,63	0,00	0,00	0,00	2.841.925,31	-74.020,32	

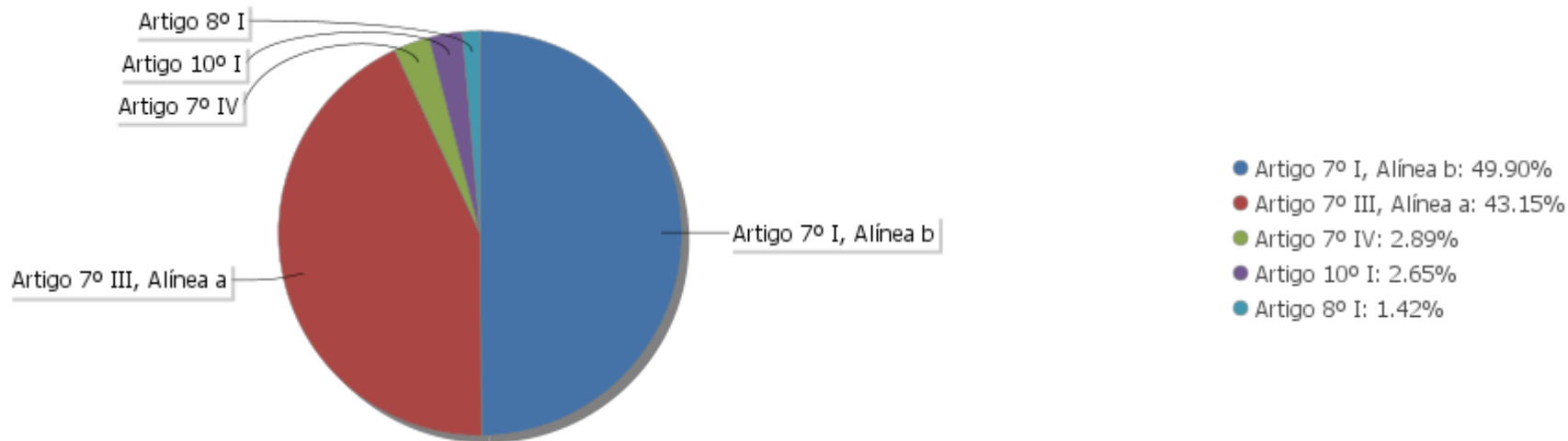
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

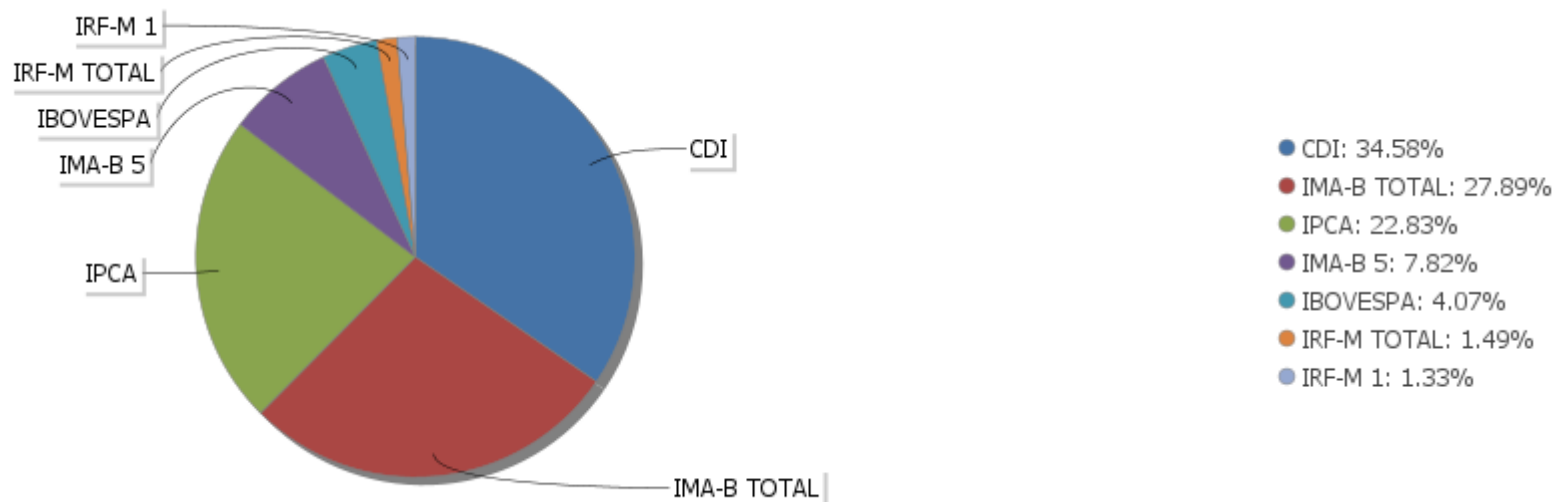
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	90.320.369,18	84,09	80,00	90.320.369,18	84,09	80,00
de 31 dias a 365 dias	2.053.590,36	1,91	10,00	92.373.959,54	86,00	90,00
acima de 365 dias	15.034.891,89	14,00	10,00	107.408.851,43	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

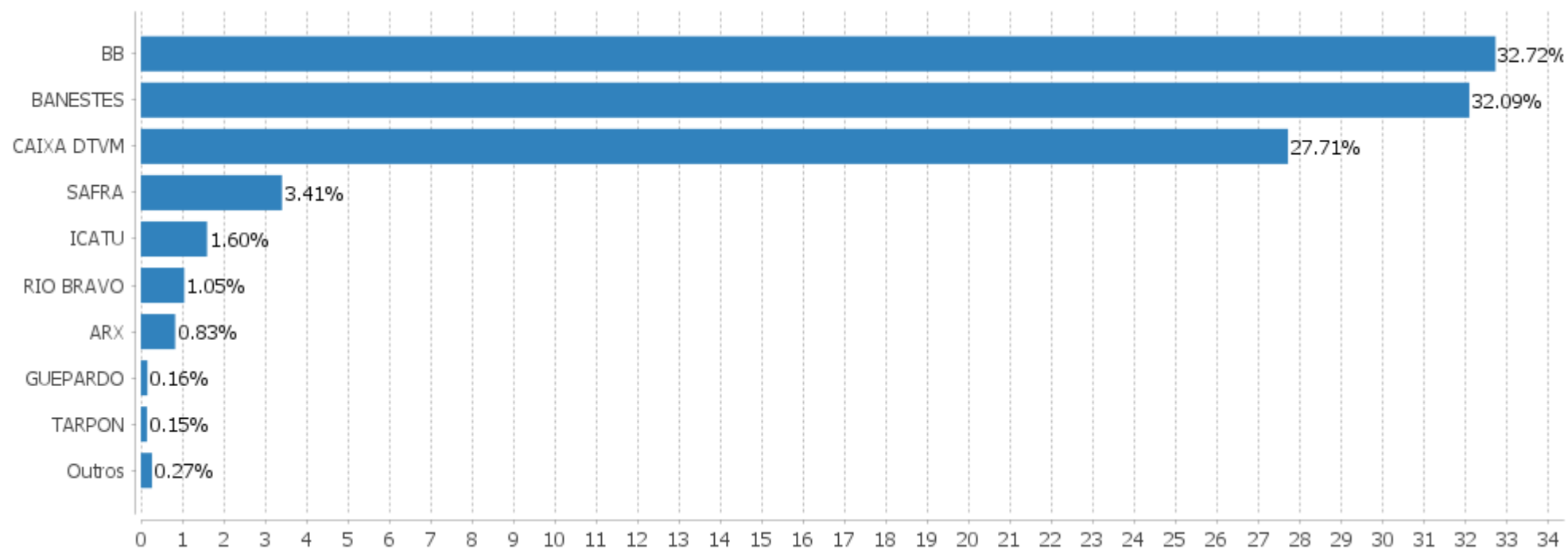


Alocação Por Estratégia



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	0,14												0,14
IPCA + 5,17%	0,86												0,86
p.p. indexador	-0,72												-0,72
2023	0,49	0,75	1,82	1,38	1,95	1,83	0,93	0,24	-0,07	-0,02	2,06	1,83	13,98
IPCA + 5,20%	0,98	1,21	1,18	0,97	0,67	0,34	0,54	0,69	0,66	0,66	0,68	0,97	9,99
p.p. indexador	-0,49	-0,45	0,64	0,40	1,28	1,49	0,39	-0,45	-0,73	-0,69	1,37	0,87	3,98
2022	-0,19	0,58	2,11	0,55	0,93	-0,08	0,11	1,21	1,20	1,25	-0,38	0,29	7,83
IPCA + 4,89%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,08	0,11	0,97	0,79	1,04	10,94
p.p. indexador	-1,13	-0,79	0,06	-0,88	0,04	-1,15	0,40	1,14	1,09	0,28	-1,17	-0,75	-3,11
2021	-0,96	-1,27	-0,61	0,68	0,71	0,31	-0,31	-0,77	-0,10	-1,90	2,33	0,68	-1,27
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,00
p.p. indexador	-1,63	-2,51	-2,03	-0,05	-0,56	-0,66	-1,74	-2,11	-1,71	-3,57	0,96	-0,53	-17,27
2020	0,57	0,42	-5,52	1,12	1,19	1,38	3,19	-1,47	-1,66	0,19	1,16	3,72	4,04
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,14	-0,24	-6,09	0,98	1,11	0,64	2,31	-2,19	-2,78	-1,15	-0,19	1,86	-6,59
2019	2,80	0,64	0,45	1,04	3,06	3,20	1,49	-0,53	2,61	2,73	-1,95	1,42	18,17
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	1,97	-0,25	-0,75	-0,02	2,42	2,75	0,76	-1,15	2,16	2,10	-2,93	-0,23	7,58

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	25	40,98	03 meses	4,08	2,53	1,54	1,91
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	59,02	06 meses	4,23	4,62	-0,39	2,42
			12 meses	13,59	9,87	3,71	2,35
			24 meses	23,31	21,93	1,38	3,12
			36 meses	22,69	41,82	-19,13	3,47
			48 meses	25,70	56,83	-31,14	5,02
			60 meses	45,31	73,23	-27,92	4,68
			Desde 31/12/2018	49,39	74,67	-25,29	4,65

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,72	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-5,52	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

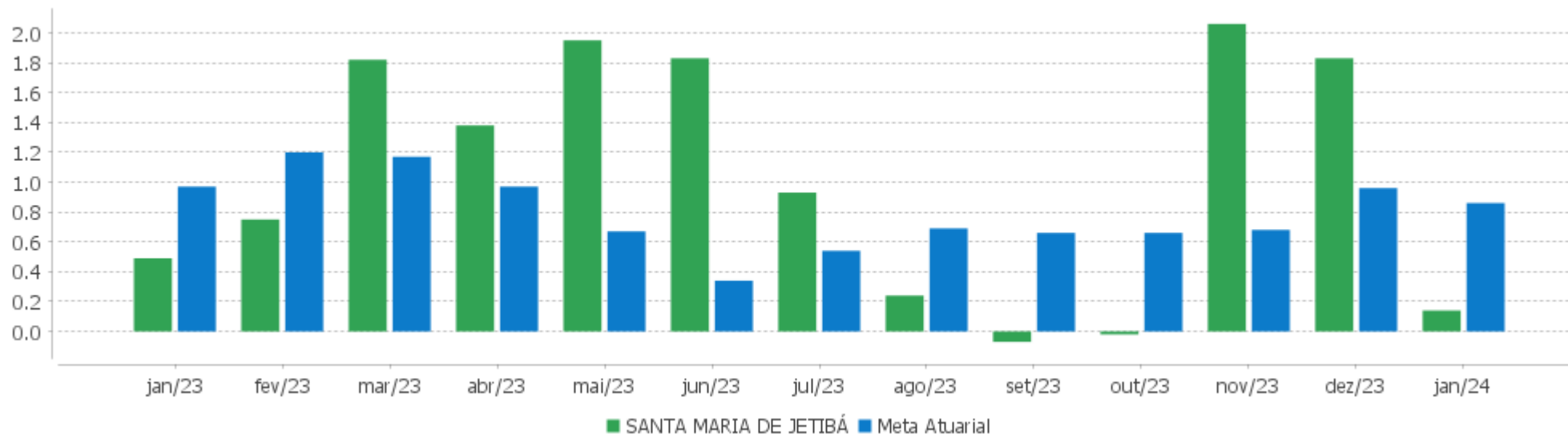


Patrimônio Líquido



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
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	1,06 0,64	1,06 0,64	2,59 1,32	4,82 2,81			
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 5,85 % a.a Var. IPCA p.p.	1,00 0,58	1,00 0,58					
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA % do CDI	0,71 73,08	0,71 73,08	2,06 73,32	4,47 74,08	9,56 74,24	20,02 73,25	23,43 69,52
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,65 -0,20	-0,65 -0,20	4,97 0,00	2,72 -0,19	15,33 -0,20	22,94 -0,86	15,94 -6,44
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,89 0,05	0,89 0,05	2,78 0,01	5,85 -0,07	12,87 -0,08	27,01 -0,11	30,73 -0,88
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,47 -0,02	-0,47 -0,02	4,92 -0,06	2,84 -0,07	15,36 -0,18	23,40 -0,40	21,65 -0,73
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,66 -0,02	0,66 -0,02	3,94 -0,05	4,32 -0,12	11,14 -0,19	23,30 -0,49	28,53 -0,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,85 0,43	0,85 0,43	2,92 1,65	5,79 3,79	15,22 10,71	26,51 15,96	28,02 6,01
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,66 -0,01	0,66 -0,01	4,64 -0,04	5,92 -0,13	15,88 -0,43	27,01 -0,72	24,96 -1,15
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,95 98,32	0,95 98,32	2,78 99,19	5,94 98,32	12,79 99,39	27,22 99,58	33,52 99,47
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI Var. IPCA p.p.	-0,35 -0,77	-0,35 -0,77	4,72 3,45	2,28 0,27	14,81 10,30		
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	0,95 98,36	0,95 98,36	2,75 97,95	5,94 98,45	12,67 98,40	26,98 98,70	33,23 98,62
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,97 100,04	0,97 100,04	2,79 99,41	6,00 99,30	11,64 90,44	24,79 90,69	31,81 94,38
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,66 -0,21	-0,66 -0,21	5,04 0,07	2,61 -0,30	15,82 0,29	23,08 -0,72	18,54 -3,84
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,02 105,81	1,02 105,81	2,95 105,09	6,33 104,85	11,59 90,04	25,55 93,50	33,19 98,49
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,64 66,06	0,64 66,06	3,23 115,09	5,48 90,75	11,11 86,27	23,53 86,08	26,36 78,22
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	-0,49	-0,49	5,00	2,86	15,52	23,30	21,60

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.	-0,04	-0,04	0,02	-0,05	-0,02	-0,50	-0,78
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,88 91,04	0,88 91,04	2,55 91,03	5,51 91,20	11,76 91,36	24,82 90,80	29,63 87,93
FI BANESTES INVEST MONEY RF % do CDI	0,87 90,50	0,87 90,50	2,54 90,59	5,49 90,88	11,72 91,04	24,72 90,44	29,59 87,79
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,88 90,76	0,88 90,76	2,55 90,92	5,51 91,31	11,49 89,26	23,72 86,77	28,46 84,44
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-6,11 -1,32	-6,11 -1,32	11,40 -1,51	10,26 5,49	42,45 29,82	65,39 51,47	99,65 88,63
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,49 3,30	-1,49 3,30	14,31 1,40	8,75 3,99	40,63 28,01	37,57 23,65	63,46 52,44
SCHRODER BEST IDEAS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,94 -0,15	-4,94 -0,15	12,90 -0,01	2,49 -2,27	9,52 -3,11	14,91 0,99	9,38 -1,64
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,59 0,20	-4,59 0,20	14,93 2,02	5,06 0,29	9,33 -3,30	2,48 -11,44	5,71 -5,31
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,07 1,73	-3,07 1,73	12,67 -0,24	-2,06 -6,83	8,87 -3,76	-0,59 -14,51	-6,02 -17,05
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-4,85 -0,05	-4,85 -0,05	5,91 -7,00	2,28 -2,48	8,27 -4,36	12,43 -1,49	
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,96 3,83	-0,96 3,83	7,44 -5,47	4,87 0,11	17,05 4,42	34,50 20,58	32,98 21,95
SANTA MARIA DE JETIBÁ Var. IPCA + 5,17% p.p.	0,14 -0,72	0,14 -0,72	4,08 1,55	4,23 -0,38	13,59 3,74	23,31 1,11	22,69 -19,16
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du	-	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,50
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA			D+0	D+0		3,50
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,15
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		
FI BANESTES INVEST MONEY RF	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+2		
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+30	D+32	-	2,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		1,20
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI			D+0	D+0		0,10
SCHRODER BEST IDEAS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	-	1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	D+1	D+1	D+90	D+90	O fundo cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro	2,00

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	0,83	0,83	2,77	5,92	12,95	27,12	31,60	36,12	45,12
IRF-M 1+	0,60	0,60	5,55	6,14	18,37	28,70	23,39	30,51	48,22
IRF-M TOTAL	0,67	0,67	4,68	6,05	16,31	27,74	26,10	32,31	47,48
IMA-B 5	0,68	0,68	3,99	4,44	11,33	23,79	29,45	39,23	56,02
IMA-B 5+	-1,47	-1,47	5,89	1,54	19,03	23,38	15,40	19,65	46,36
IMA-B TOTAL	-0,45	-0,45	4,97	2,91	15,53	23,80	22,38	28,77	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,47	0,47	3,98	5,14	14,53	26,21	28,00	33,76	48,90
IDKA 2	0,81	0,81	4,15	4,81	11,43	23,53	29,55	40,17	55,62
IDKA 20	-3,34	-3,34	7,85	-0,30	28,79	24,16	6,04	6,79	36,82
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02	12,30	31,17
IBRX 100	-4,51	-4,51	13,20	5,15	11,88	12,72	10,34	12,15	33,43
IBRX 50	-4,15	-4,15	13,07	5,74	11,32	13,01	11,95	14,94	31,89
SMALL CAP	-6,55	-6,55	12,50	-6,30	6,34	-10,11	-19,32	-22,95	11,91
Índice Consumo - ICON	-8,33	-8,33	13,01	-11,48	-4,76	-28,41	-45,21	-47,39	-24,62
Índice Dividendos - IDIV	-3,51	-3,51	14,18	8,88	15,58	28,28	35,93	29,79	64,85

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	3,94	3,94	13,17	10,31	15,47	-0,78	18,02	74,30	143,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,67	0,67	5,63	4,26	18,16	20,04	15,77	8,33	38,34

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,86	2,86	12,43	7,98	9,50	-5,80	2,83	51,79	101,82

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,42	0,42	1,27	2,01	4,51	10,54	22,01	27,58	32,93
INPC	0,57	0,57	1,22	1,66	3,82	9,75	21,38	28,10	33,61
IGPM	0,07	0,07	1,41	2,15	-3,32	0,35	17,32	47,48	59,00
SELIC	0,97	0,97	2,80	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,76	0,76	2,25	4,03	8,64	19,51	37,19	49,11	61,60
IPCA + 5,00%	0,85	0,85	2,49	4,53	9,67	21,80	41,17	54,89	69,49
IPCA + 5,50%	0,89	0,89	2,61	4,77	10,18	22,96	43,18	57,84	73,54
IPCA + 5,89%	0,92	0,92	2,70	4,97	10,59	23,86	44,77	60,18	76,76
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22	60,84	77,68
INPC + 4,00%	0,91	0,91	2,21	3,67	7,92	18,65	36,48	49,72	62,43
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47	61,50	78,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
718	02/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	104,97	43,75706200	2,3989270000
725	03/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	395,11	164,63746400	2,3998790000
729	04/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	2.800,00	0,00	285,01378191	9,8240863300
737	04/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	11.500,77	4.790,32483800	2,4008330000
734	05/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	9,96	1,01350481	9,8272843600
742	08/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	226,20	0,00	23,01001273	9,8305030300
733	08/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	3.698,03	0,00	376,17912196	9,8305030300
741	08/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	338.542,18	0,00	124.262,00862159	2,7244222410
756	09/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	256,20	0,00	26,05323500	9,8337116300
755	10/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	904,80	0,00	91,98031129	9,8368877800
754	11/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	324,30	0,00	32,95727107	9,8400137400
714	11/01/2024	FI BANESTES INVEST MONEY RF	395.033,75	0,00	15.334,02703737	25,7619051400
723	12/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	156.825,86	0,00	15.932,48295289	9,8431525400
752	15/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	256,20	0,00	26,01995102	9,8462906300
730	15/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	52.343,74	5.316,08724052	9,8462906300
732	15/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.419,72	245,74907205	9,8462906300
738	15/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.156,64	2.141,89232100	2,4075160000
751	16/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	648,60	0,00	65,85185903	9,8493802500
721	16/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	54.763,46	0,00	5.560,09196444	9,8493802500
750	17/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	422,40	0,00	42,87248395	9,8524732200
749	18/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	550,50	0,00	55,85640442	9,8556290100
715	18/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	237.292,40	0,00	24.076,83970934	9,8556290100
753	19/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	354,30	0,00	35,93727112	9,8588454000
747	22/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	226,20	0,00	22,93650882	9,8620065400
736	22/01/2024	FI BANESTES INVEST MONEY RF	533.175,38	0,00	20.639,00728838	25,8333830000
746	23/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	708,60	0,00	71,82849014	9,8651663000
731	23/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	29.099,06	2.949,67759567	9,8651663000
745	24/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	256,20	0,00	25,96174501	9,8683659300

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
728	24/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	11,10	1,12480628	9,8683659300
748	25/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	98,10	0,00	9,93776667	9,8714332200
743	26/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	256,20	0,00	25,94540311	9,8745815900
744	29/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	226,20	0,00	22,89977534	9,8778261700
717	29/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	13.116,55	0,00	1.327,87819707	9,8778261700
735	29/01/2024	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	215.000,00	8.156,36430354	26,3597838400
757	30/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	640,50	0,00	64,82111225	9,8810399500
719	30/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	108.567,70	10.987,47707842	9,8810399500
720	30/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	54.939,49	5.560,09196444	9,8810399500
722	30/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	157.429,50	15.932,48295289	9,8810399500
724	30/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.717,04	376,17912196	9,8810399500
726	30/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.816,23	285,01378191	9,8810399500
727	30/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	224.656,82	22.736,15161667	9,8810399500
739	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	13.791,51	5.703,55756200	2,4180540000
758	31/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	354,30	0,00	35,84535689	9,8841253300
716	31/01/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	70.602,25	7.142,99420875	9,8841253300
740	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	18.038,00	7.456,75107000	2,4190160000
Total			1.741.957,41	970.599,61		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.257.020,36

Value-At-Risk: 1,17%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,40	1,08	5,00	1,03	-0,49	0,29	103.038.920,25	95,93
Artigo 8º	14,01	7,81	20,00	0,08	-0,38	-4,29	1.528.005,87	1,42
Artigo 10º	6,73	3,14	20,00	0,06	-0,52	-2,54	2.841.925,31	2,65
SANTA MARIA DE JETIBÁ		1,17		1,17			107.408.851,43	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,08%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA		0,01	-0,00	0,01			78.627,82	0,07
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,20	0,02	0,20			9.487.615,16	8,83
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI		2,21	0,24	2,20			11.931.627,02	11,11
BB PREV RF IRF M		1,48	0,02	0,04			1.603.174,28	1,49
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,02	0,00	0,02			5.449.975,49	5,07
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		2,24	0,07	0,09			3.450.663,30	3,21
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,16	0,22	0,03			11.210.984,63	10,44
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,23	0,09	0,01			8.394.489,59	7,82
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,10	0,00	0,04			1.424.854,12	1,33
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	-0,00	0,01			561.653,88	0,52
Sub-total	1,60	1,34	0,66		-0,49	0,19	53.593.665,29	49,90

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI BANESTES INVEST MONEY RF		0,01	-0,00	0,01			4.684.394,06	4,36
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,23	0,23	0,06			10.992.371,16	10,23
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		2,30	0,09	0,14			4.298.741,59	4,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			3.725.331,26	3,47
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,02	-0,00	0,02			2.108.282,80	1,96
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,03	0,00	0,03			1.864.030,23	1,74
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,03	0,00	0,03			6.195.895,93	5,77
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,44	0,05	0,44			12.472.943,06	11,61
Sub-total	1,11	0,86	0,37		-0,56	0,35	46.341.990,09	43,15

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		0,10	-0,00	0,11			1.071.415,88	1,00
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 5,85 % a.a		0,34	0,00	0,34			2.031.848,99	1,89
Sub-total	2,17	0,21	0,00		0,03	1,02	3.103.264,87	2,89

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,14%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		4,04	0,03	3,11			1.125.054,60	1,05
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO		2,98	0,03	4,17			1.716.870,71	1,60
Sub-total	6,73	3,14	0,06		-0,52	-2,54	2.841.925,31	2,65

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,81%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES		8,30	0,01	5,40			165.804,00	0,15
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		9,28	0,01	4,58			164.586,80	0,15
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		8,16	0,05	3,09			896.179,46	0,83
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		7,95	0,01	4,11			170.915,65	0,16
SCHRODER BEST IDEAS FIA		6,80	0,01	1,64			130.519,96	0,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	14,01	7,81	0,08		-0,38	-4,29	1.528.005,87	1,42

(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 (%)