



**LDB**  
EMPRESAS

**SANTA MARIA DE JETIBÁ**  
FEVEREIRO 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 29.02.2024.

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 94,98%

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	0,05	0,03	0,58	1,29	179.017,92	0,16	1.512.234.815,89	0,01
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,12	0,04	0,77	1,63	9.560.999,15	8,79	6.585.276.803,86	0,15
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	4,23	0,20	0,60	0,25	12.001.475,59	11,04	933.738.227,25	1,29
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,31	0,16	0,44	1,10	1.610.194,20	1,48	4.190.498.364,43	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,09	0,05	0,79	1,74	5.492.839,54	5,05	13.568.473.477,14	0,04
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	4,12	0,13	0,54	-0,11	3.469.450,24	3,19	234.189.159,32	1,48
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,94	0,13	0,54	0,07	10.268.348,62	9,44	5.024.622.442,53	0,20
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,76	0,10	0,58	1,24	7.438.923,24	6,84	5.237.322.277,24	0,14
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,27	0,05	0,75	1,64	1.435.493,97	1,32	172.732.636,30	0,83
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,05	0,04	0,80	1,76	566.145,62	0,52	5.563.372.662,26	0,01
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,45</b>	<b>0,11</b>	<b>0,63</b>	<b>0,82</b>	<b>52.022.888,09</b>	<b>47,83</b>		

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	0,05	0,04	0,72	1,60	5.252.526,32	4,83	184.177.225,52	2,85
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4,06	0,13	0,59	0,10	10.816.961,10	9,95	1.284.256.890,00	0,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4,27	0,13	0,57	-0,09	4.323.336,89	3,98	167.715.454,56	2,58
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,04	0,73	1,61	3.851.982,84	3,54	4.488.445.035,86	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,04	0,04	0,73	1,61	2.276.006,56	2,09	1.070.041.866,60	0,21
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,15	0,05	0,84	1,88	1.879.755,94	1,73	3.014.112.159,80	0,06
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,70	0,04	0,79	1,77	6.175.063,93	5,68	289.255.516,59	2,13

**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	0,71	0,06	0,75	1,39	12.566.006,75	11,55	146.727.747,01	8,56
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,04	0,56	0,56	1.005.571,91	0,92	10.050.564.520,10	0,01
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>1,71</b>	<b>0,08</b>	<b>0,70</b>	<b>1,06</b>	<b>48.147.212,24</b>	<b>44,27</b>		

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	1,09	-0,10	0,92	1,99	1.081.244,32	0,99		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 5,85 % a. a	2,98	0,87	0,87	1,88	2.049.488,89	1,88		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>1,45</b>	<b>0,53</b>	<b>0,89</b>	<b>1,92</b>	<b>3.130.733,21</b>	<b>2,88</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>2,10</b>	<b>0,11</b>	<b>0,67</b>	<b>0,96</b>	<b>103.300.833,54</b>	<b>94,98</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

2,37%

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	18,37	0,34	2,20	-4,04	169.459,67	0,16	379.320.337,70	0,04
BAYES	BEM	AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES - FIA	15,04	-0,53	2,18	2,18	1.021.785,26	0,94	180.865.895,96	0,56
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,74	-0,27	1,63	-1,49	167.273,81	0,15	789.752.289,29	0,02
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	16,40	-0,54	2,29	-2,41	916.716,22	0,84	128.830.727,55	0,71
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	17,68	-0,83	2,90	1,37	175.878,97	0,16	516.851.657,29	0,03
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	15,83	-0,50	0,06	-4,88	130.602,50	0,12	138.974.604,70	0,09
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>15,88</b>	<b>-0,48</b>	<b>2,19</b>	<b>-2,20</b>	<b>2.581.716,43</b>	<b>2,37</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>15,88</b>	<b>-0,48</b>	<b>2,19</b>	<b>-2,20</b>	<b>2.581.716,43</b>	<b>2,37</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,64%

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	8,14	0,52	1,35	-3,56	1.140.285,74	1,05	134.701.203,42	0,85
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5,27	-0,12	0,89	-0,09	1.732.086,37	1,59	370.031.066,87	0,47
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>6,02</b>	<b>0,13</b>	<b>1,07</b>	<b>-1,49</b>	<b>2.872.372,11</b>	<b>2,64</b>		
Investimentos Estruturados			6,02	0,13	1,07	-1,49	2.872.372,11	2,64		
<b>Total</b>			<b>2,21</b>	<b>0,10</b>	<b>0,72</b>	<b>0,86</b>	<b>108.754.922,08</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	52.022.888,09	47,83	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	48.147.212,24	44,27	0,00	33,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	3.130.733,21	2,88	0,00	6,00	20,00	0,00	20,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>103.300.833,54</b>	<b>94,98</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	2.581.716,43	2,37	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>2.581.716,43</b>	<b>2,37</b>					30,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	2.872.372,11	2,64	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>2.872.372,11</b>	<b>2,64</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>108.754.922,08</b>	<b>100,00</b>					

**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	0,63 78,89	0,82 46,24	2,65 98,70	4,32 76,06	13,41 105,25	333.248,62	434.316,28
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,70 87,80	1,06 59,62	2,74 101,81	4,79 84,25	13,32 104,51	330.847,70	494.284,32
Artigo 7º IV % do CDI	0,89 110,37	1,92 107,91	2,68 99,76	4,99 87,69		27.468,34	58.886,55
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,19 1,19	-2,20 1,65	3,07 1,74	12,07 0,60	21,95 -1,01	53.710,56	-14.797,83
Artigo 10º I % do CDI	1,07 133,58	-1,49 -84,12	2,56 95,10	6,74 118,64	14,81 116,21	30.446,80	-43.573,52
<b>SANTA MARIA DE JETIBÁ (Total)</b>						<b>775.722,02</b>	<b>929.115,80</b>

**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	78.627,82	848.511,94	-751.468,41	0,00	179.017,92	3.346,57	6.670,75
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	3.450.663,30	0,00	0,00	0,00	3.469.450,24	18.786,94	-3.809,11
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.424.854,12	0,00	0,00	0,00	1.435.493,97	10.639,85	23.174,20
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	9.487.615,16	0,00	0,00	0,00	9.560.999,15	73.383,99	153.271,07
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	8.394.489,59	0,00	-1.000.000,00	0,00	7.438.923,24	44.433,65	99.491,89
BB PREV RF IRF M	1.603.174,28	0,00	0,00	0,00	1.610.194,20	7.019,92	17.502,98
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	11.931.627,02	319.000,00	-320.069,35	0,00	12.001.475,59	70.917,92	29.097,05
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.210.984,63	0,00	-1.000.000,00	0,00	10.268.348,62	57.363,99	4.960,58
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.449.975,49	0,00	0,00	0,00	5.492.839,54	42.864,05	94.175,00
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	561.653,88	0,00	0,00	0,00	566.145,62	4.491,74	9.781,87
	53.593.665,29	1.167.511,94	-3.071.537,76	0,00	52.022.888,09	333.248,62	

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	12.472.943,06	0,00	0,00	0,00	12.566.006,75	93.063,69	172.207,18
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4.298.741,59	0,00	0,00	0,00	4.323.336,89	24.595,30	-3.799,25
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	1.864.030,23	0,00	0,00	0,00	1.879.755,94	15.725,71	34.599,70
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	6.195.895,93	0,00	-70.000,00	0,00	6.175.063,93	49.168,00	110.390,14
BB PREV RF FLUXO FIC	3.725.331,26	99.053,22	0,00	0,00	3.851.982,84	27.598,36	59.419,63
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	1.000.000,00	0,00	0,00	1.005.571,91	5.571,91	5.571,91
FI BANESTES INVEST MONEY RF	4.684.394,06	533.281,44	0,00	0,00	5.252.526,32	34.850,82	71.070,13
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.108.282,80	240.236,00	-87.960,21	0,00	2.276.006,56	15.447,97	34.090,27
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	10.992.371,16	0,00	-240.236,00	0,00	10.816.961,10	64.825,94	10.734,61
	46.341.990,09	1.872.570,66	-398.196,21	0,00	48.147.212,24	330.847,70	

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	2.031.848,99	0,00	0,00	0,00	2.049.488,89	17.639,90	37.812,45
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	1.071.415,88	0,00	0,00	0,00	1.081.244,32	9.828,44	21.074,10
	3.103.264,87	0,00	0,00	0,00	3.130.733,21	27.468,34	

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	896.179,46	0,00	0,00	0,00	916.716,22	20.536,76	-22.601,82
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES - FIA	0,00	1.000.000,00	0,00	0,00	1.021.785,26	21.785,26	21.785,26
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	164.586,80	0,00	0,00	0,00	167.273,81	2.687,01	-2.523,37
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	170.915,65	0,00	0,00	0,00	175.878,97	4.963,32	2.377,65
SCHRODER BEST IDEAS FIA	130.519,96	0,00	0,00	0,00	130.602,50	82,54	-6.700,39
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	165.804,00	0,00	0,00	0,00	169.459,67	3.655,67	-7.135,16
	1.528.005,87	1.000.000,00	0,00	0,00	2.581.716,43	53.710,56	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	1.716.870,71	0,00	0,00	0,00	1.732.086,37	15.215,66	-1.499,86
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1.125.054,60	0,00	0,00	0,00	1.140.285,74	15.231,14	-42.073,66
	2.841.925,31	0,00	0,00	0,00	2.872.372,11	30.446,80	

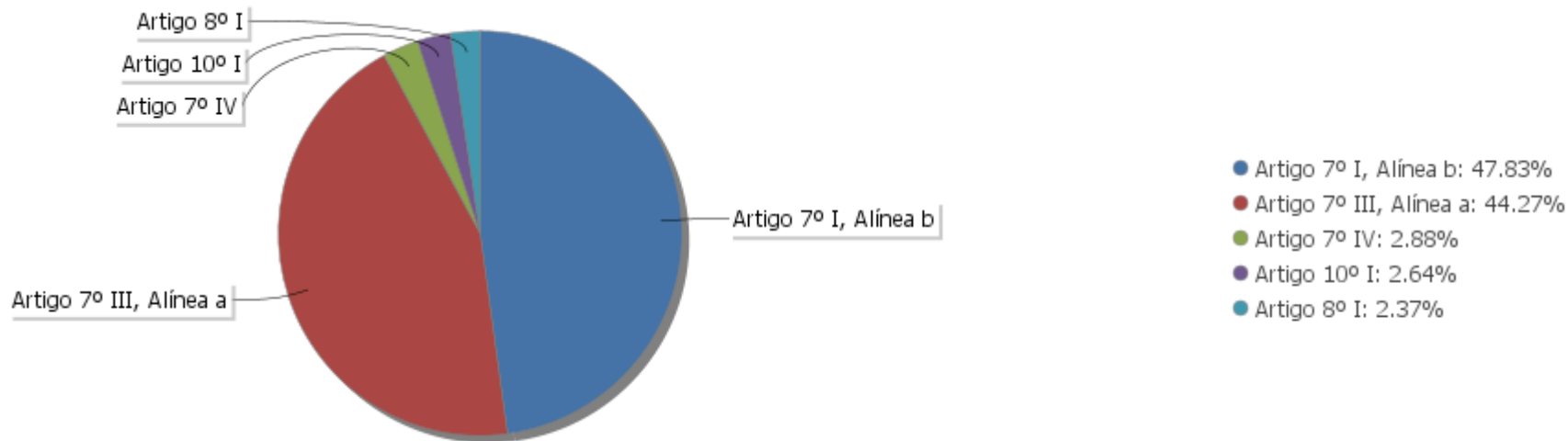
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

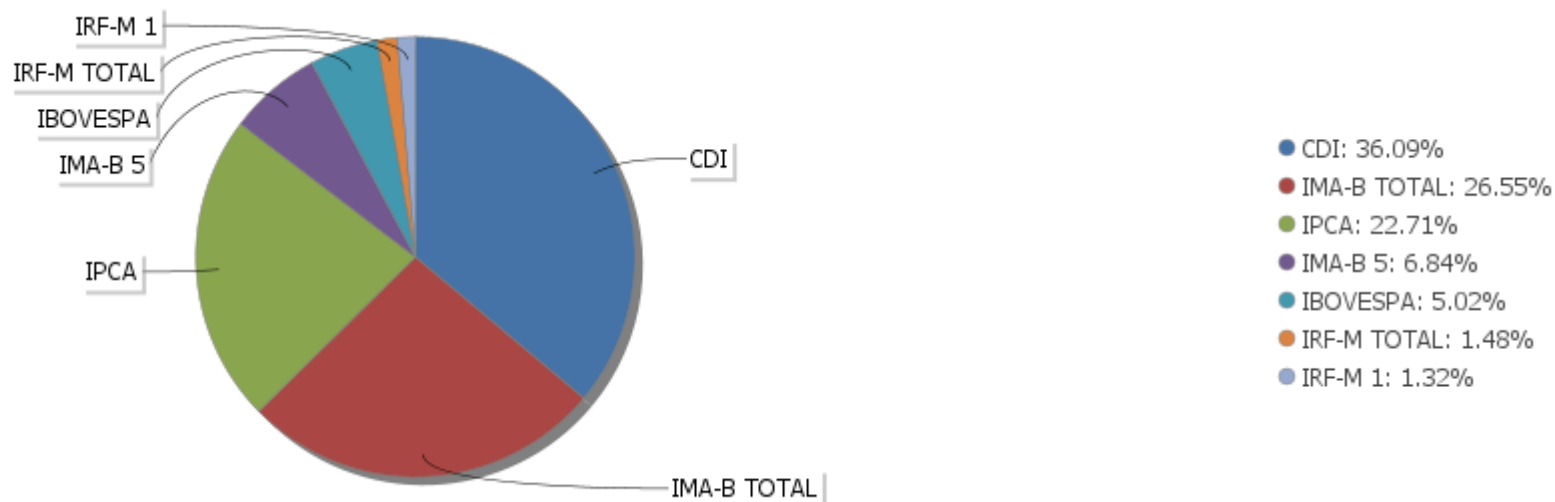
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	91.545.288,27	84,18	80,00	91.545.288,27	84,18	80,00
de 31 dias a 365 dias	2.077.425,01	1,91	10,00	93.622.713,28	86,09	90,00
acima de 365 dias	15.132.208,80	13,91	10,00	108.754.922,08	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

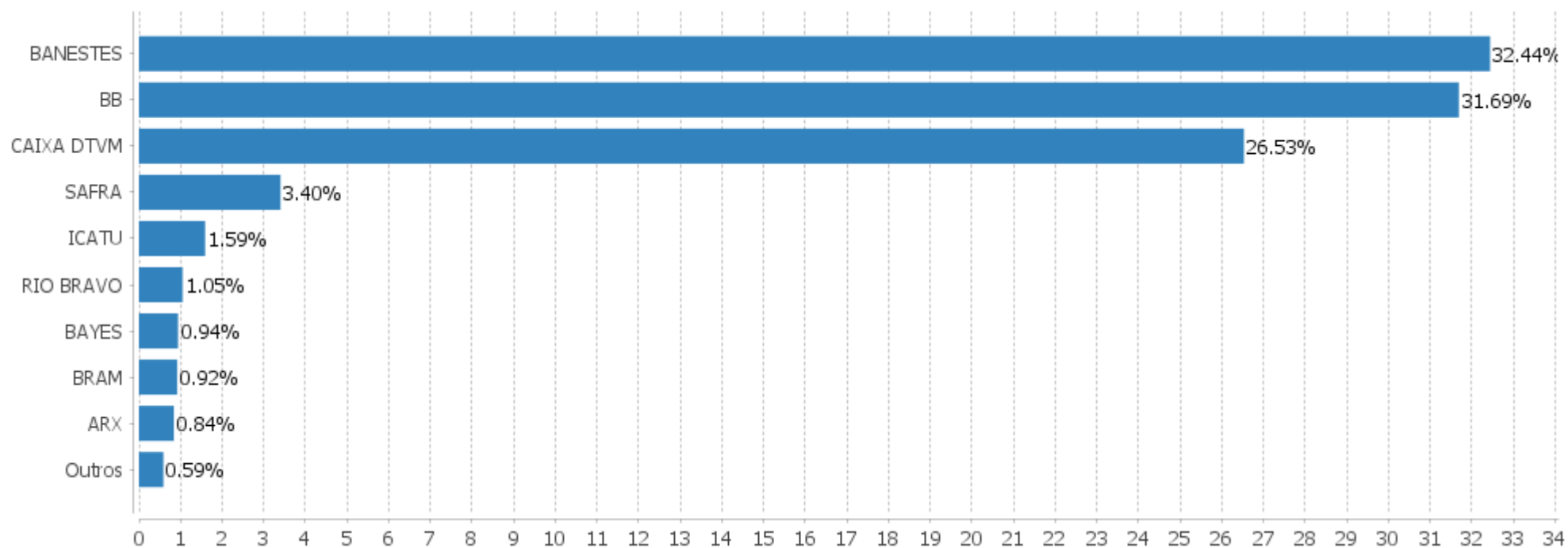


Alocação Por Estratégia



## 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	0,72											0,86
IPCA + 5,17%	0,86	1,21											2,09
p.p. indexador	-0,72	-0,49											-1,22
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**

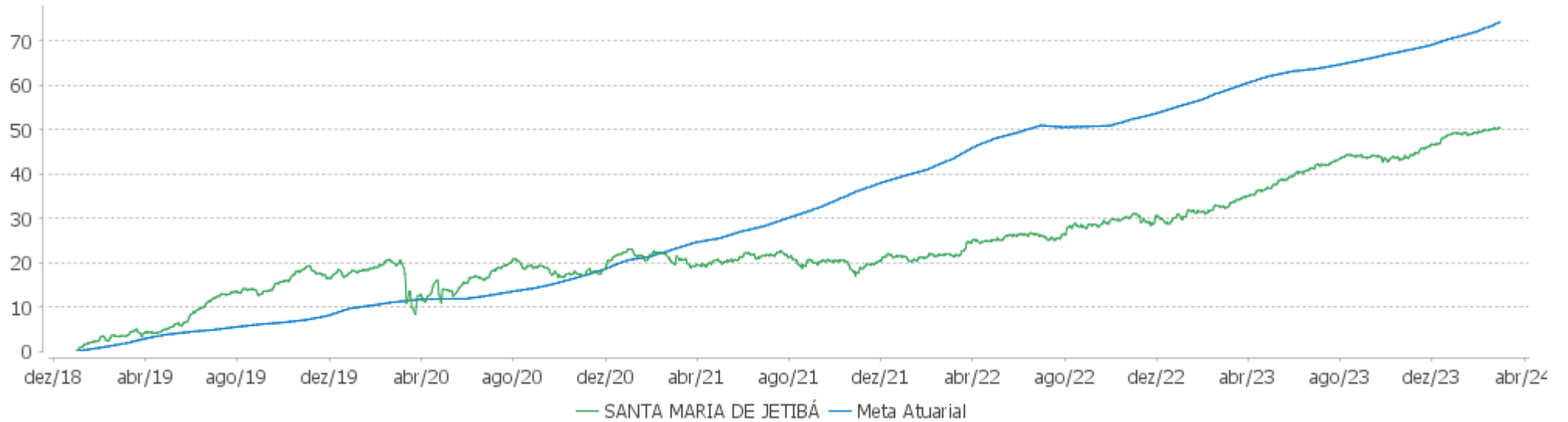
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	25	40,32
Meses abaixo - Meta Atuarial	37	59,68
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,72	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-5,52	2020-03

**Relatório**

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,71	3,07	-0,36	1,53
06 meses	4,73	5,16	-0,43	2,35
12 meses	13,55	9,88	3,67	2,21
24 meses	23,47	21,74	1,74	3,09
36 meses	25,16	41,78	-16,62	3,42
48 meses	26,07	57,70	-31,62	5,01
60 meses	45,43	73,78	-28,35	4,67
Desde 31/12/2018	50,46	76,79	-26,33	4,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

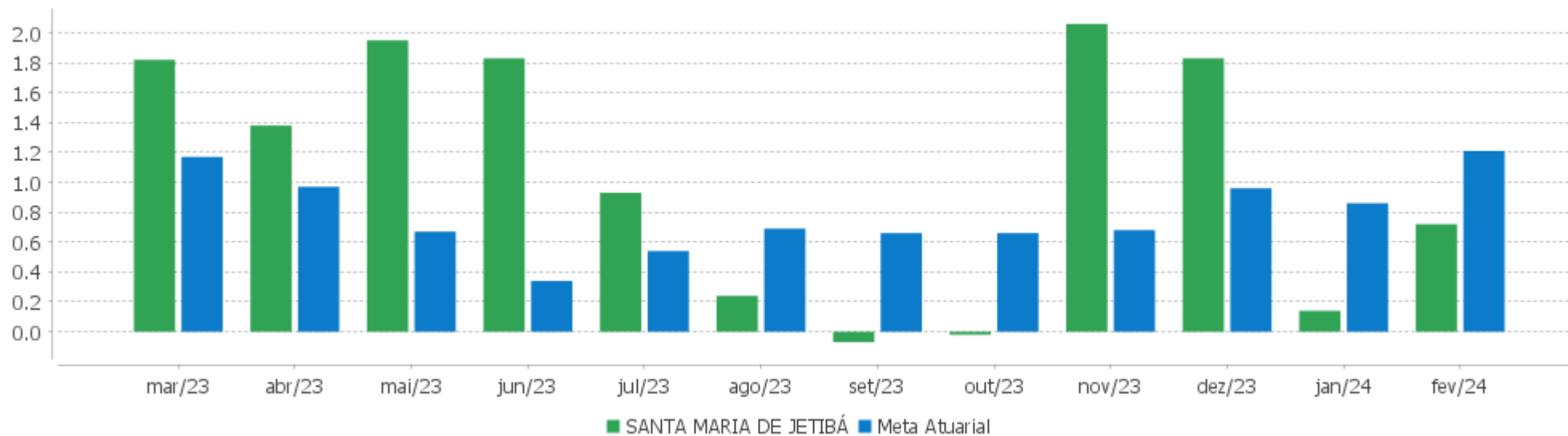


Patrimônio Líquido



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.	0,92 0,09	1,99 0,73	2,77 0,95	5,08 2,46			
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 5,85 % a.a Var. IPCA p.p.	0,87 0,04	1,88 0,63					
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA % do CDI	0,58 72,93	1,30 72,92	1,97 73,09	4,19 73,64	9,43 74,02	20,07 73,26	24,13 69,76
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,54 -0,01	0,07 -0,03	2,80 -0,05	3,78 -0,09	14,54 -0,16	23,41 -0,40	24,22 -0,73
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,54 -0,01	-0,11 -0,21	2,76 -0,09	3,77 -0,10	14,48 -0,22	23,10 -0,70	19,52 -5,43
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,75 -0,02	1,64 0,04	2,54 0,01	5,46 -0,06	12,64 -0,06	27,05 -0,09	32,05 -0,50
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,02	1,24 -0,04	2,70 -0,05	4,31 -0,11	10,24 -0,20	22,71 -0,50	30,07 -0,93
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,44 -0,02	1,10 -0,03	2,57 -0,05	5,62 -0,12	15,44 -0,41	26,85 -0,73	27,01 -1,18
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,77 -0,06	1,63 0,38	2,59 0,77	5,52 2,90	14,98 10,49	26,64 16,29	30,22 8,24
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,79 98,07	1,74 98,20	2,66 98,83	5,58 98,15	12,63 99,15	27,10 98,92	34,47 99,65
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	0,80 99,72	1,76 98,97	2,66 98,80	5,60 98,44	12,55 98,48	27,01 98,57	34,20 98,86
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI Var. IPCA p.p.	0,60 -0,23	0,25 -1,01	2,57 0,75	3,18 0,56	14,01 9,52		
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,79 99,12	1,77 99,62	2,68 99,70	5,59 98,39	12,66 99,34	24,75 90,35	32,58 94,18
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,57 0,02	-0,09 -0,19	2,85 -0,00	3,80 -0,06	15,50 0,80	23,26 -0,54	22,42 -2,52
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,84 105,19	1,88 105,56	2,84 105,54	5,92 104,09	12,61 98,94	25,52 93,14	33,97 98,20
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,75 93,03	1,39 78,22	2,70 100,39	5,30 93,20	11,93 93,61	23,47 85,66	28,39 82,08
BRANDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,90	1,99	2,95	6,17	13,60	28,88	36,98

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	111,72	112,16	109,68	108,45	106,72	105,41	106,89
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,59 0,04	0,10 -0,00	2,87 0,02	3,82 -0,05	14,79 0,09	23,43 -0,38	24,24 -0,70
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,73 90,72	1,61 90,86	2,45 91,05	5,17 90,89	11,62 91,22	24,88 90,81	30,51 88,21
FI BANESTES INVEST MONEY RF % do CDI	0,72 90,08	1,60 90,27	2,43 90,33	5,15 90,63	11,59 90,92	24,78 90,45	30,45 88,01
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,73 90,41	1,61 90,57	2,44 90,60	5,18 91,04	11,42 89,61	23,83 86,97	29,29 84,68
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	2,20 1,21	-4,04 -0,19	5,40 4,07	15,15 3,68	49,36 26,40	60,34 46,31	94,59 77,34
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES - FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,34 1,35	-2,03 1,82	4,92 3,59	9,87 -1,60	30,59 7,63	24,41 10,37	34,62 17,37
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,90 1,91	1,37 5,22	4,08 2,75	15,78 4,30	50,26 27,31	48,40 34,37	79,70 62,44
SCHRODER BEST IDEAS FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,06 -0,93	-4,88 -1,03	1,01 -0,32	8,30 -3,18	20,45 -2,51	12,81 -1,22	14,06 -3,19
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,29 1,30	-2,41 1,44	2,49 1,16	14,06 2,59	23,42 0,46	3,79 -10,24	12,22 -5,03
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,63 0,64	-1,49 2,36	3,67 2,35	6,16 -5,31	16,93 -6,03	2,55 -11,49	-5,25 -22,51
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	1,35 0,36	-3,56 0,29	0,77 -0,56	6,54 -4,93	12,44 -10,52	16,25 2,21	
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,89 -0,11	-0,09 3,76	3,77 2,44	6,88 -4,59	17,88 -5,07	35,26 21,23	33,68 16,43
SANTA MARIA DE JETIBÁ Var. IPCA + 5,17% p.p.	0,72 -0,49	0,86 -1,22	2,71 -0,36	4,73 -0,42	13,55 3,69	23,47 1,50	25,16 -16,68
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21

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 BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES - FIA	D+1	D+1	D+14 du	D+16 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		
BRANDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 10% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA.	1,50
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 indice 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	0,76	1,61	2,53	5,52	12,71	27,14	32,56	36,64	45,55
IRF-M 1+	0,34	0,94	2,69	5,87	17,85	28,53	26,35	29,91	48,38
IRF-M TOTAL	0,46	1,13	2,63	5,74	15,85	27,58	28,20	32,06	47,72
IMA-B 5	0,59	1,28	2,76	4,42	10,44	23,21	31,00	39,16	56,09
IMA-B 5+	0,51	-0,96	2,94	3,37	18,26	24,00	18,75	19,88	46,30
IMA-B TOTAL	0,55	0,10	2,85	3,87	14,70	23,81	24,95	28,90	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,64	1,11	2,75	5,15	14,09	26,08	29,72	34,01	49,13
IDKA 2	0,42	1,23	2,70	4,46	10,12	22,51	30,72	39,80	55,45
IDKA 20	0,22	-3,13	3,25	3,06	28,07	25,16	9,21	7,12	36,25
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59	37,78	45,48

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25	23,85	34,98
IBRX 100	0,96	-3,59	1,70	11,76	22,23	12,17	15,38	23,37	37,13
IBRX 50	0,91	-3,27	1,87	12,03	21,50	12,09	17,44	26,99	35,38
SMALL CAP	0,47	-6,11	0,51	1,70	19,40	-4,74	-17,42	-15,61	14,52
Índice Consumo - ICON	0,09	-8,26	-2,77	-1,10	5,65	-26,51	-42,10	-41,50	-21,16
Índice Dividendos - IDIV	0,91	-2,64	4,09	13,07	26,16	32,52	44,70	39,59	69,79

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Investimentos Estruturados**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	5,80	9,98	12,65	14,47	22,83	12,70	20,50	91,09	143,96

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,79	1,47	5,77	4,58	19,64	22,58	16,40	13,37	38,01

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,79	7,79	10,70	12,33	15,81	5,67	4,39	64,46	101,55

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,83	1,25	1,82	2,62	4,50	10,34	21,98	28,32	33,45
INPC	0,81	1,38	1,94	2,28	3,86	9,54	21,37	28,92	33,97
IGPM	-0,52	-0,45	0,29	1,76	-3,76	-1,97	13,83	46,78	56,79
SELIC	0,80	1,78	2,69	5,68	12,74	27,39	34,59	37,78	45,47

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,13	1,90	2,79	4,58	8,64	19,29	37,17	49,99	62,22
IPCA + 5,00%	1,20	2,06	3,03	5,07	9,68	21,58	41,15	55,82	70,13
IPCA + 5,50%	1,24	2,14	3,15	5,31	10,20	22,74	43,17	58,79	74,20
IPCA + 5,89%	1,27	2,20	3,24	5,50	10,60	23,64	44,76	61,14	77,43
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21	61,81	78,34
INPC + 4,00%	1,11	2,03	2,91	4,24	7,98	18,43	36,48	50,70	62,84
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49	62,57	79,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
761	01/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.875,41	290,81583083	9,8873915900
777	01/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	610,50	0,00	61,74530405	9,8873915900
795	01/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	190,73	78,81486379	2,4199750000
762	02/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	22,20	2,24462321	9,8903013700
778	02/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	708,60	0,00	71,64594621	9,8903013700
763	05/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2,49	0,25168295	9,8933995000
779	05/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	610,50	0,00	61,70780832	9,8933995000
796	05/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.353,17	971,65675948	2,4218120000
772	06/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	2.775,10	0,00	280,41238370	9,8964958800
780	06/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.191,00	0,00	120,34562682	9,8964958800
797	06/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.522,00	1.453,72954687	2,4227340000
773	07/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	3.698,03	0,00	373,55675189	9,8995132100
781	07/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	648,60	0,00	65,51837310	9,8995132100
774	08/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	819.328,26	0,00	82.738,84524265	9,9025827300
782	08/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.711,50	0,00	172,83369871	9,9025827300
785	08/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	99.053,22	0,00	36.029,95777194	2,7491905660
792	08/02/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.000.000,00	223.953,63263990	4,4652100000
783	09/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	4.243,50	0,00	428,39521953	9,9055727200
787	09/02/2024	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	1.000.000,00	37.577,83033085	26,6114352850
791	09/02/2024	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.000.000,00	0,00	59.560,81274231	16,7895627000
798	09/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.011,00	416,82247692	2,4254930000
784	14/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	6.129,30	0,00	618,58194051	9,9086306900
764	15/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	53.163,02	5.363,68936957	9,9116515400
789	15/02/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	0,00	320.069,35	275.583,42654731	1,1614245240
799	15/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.000,10	2.471,89196694	2,4273310000
800	16/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	600,00	247,09142506	2,4282510000
775	19/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	2.800,00	0,00	282,32133893	9,9177767100
790	19/02/2024	AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES - FIA	1.000.000,00	0,00	708.915,47700016	1,4106054000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
801	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.522,00	1.449,87615127	2,4291730000
793	21/02/2024	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,00	120.118,00	25.179,10434934	4,7705430000
807	21/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	120.118,00	0,00	49.410,53549539	2,4310200000
759	22/02/2024	FI BANESTES INVEST MONEY RF	533.281,44	0,00	20.477,00646904	26,0429394700
760	26/02/2024	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	70.000,00	2.635,59704685	26,5594469700
765	26/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.874,22	289,36714505	9,9327793400
766	26/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	13.189,52	1.327,87808412	9,9327793400
767	26/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.785,27	280,41194762	9,9327793400
768	26/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.710,46	373,55707532	9,9327793400
769	26/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	102.307,30	10.299,96705836	9,9327793400
802	26/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	26.490,72	10.884,57243159	2,4337860000
803	26/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	55,00	22,59853578	2,4337860000
776	27/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	4.057,05	0,00	408,32542104	9,9358251800
804	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	9.579,78	3.934,66822140	2,4347110000
770	28/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	566.459,27	56.994,19234911	9,9388945900
771	29/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	4.079,25	410,30749891	9,9419338200
788	29/02/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	319.000,00	0,00	274.257,99240084	1,1631383910
794	29/02/2024	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,00	120.118,00	25.185,96766824	4,7692430000
805	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	34.635,71	14.215,02144214	2,4365570000
806	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	120.118,00	0,00	49.298,25159026	2,4365570000
<b>Total</b>			<b>4.040.082,60</b>	<b>3.469.733,97</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 1.110.453,85 Value-At-Risk: 1,02%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,87	0,89	5,00	0,83	-0,15	0,67	103.300.833,54	94,98
Artigo 8º	13,14	7,54	20,00	0,13	0,11	2,19	2.581.716,43	2,37
Artigo 10º	5,98	2,98	20,00	0,06	0,05	1,07	2.872.372,11	2,64
SANTA MARIA DE JETIBÁ		1,02		1,02			108.754.922,08	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,89%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA		0,01	0,00	0,01			179.017,92	0,16
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,15	0,01	0,19			9.560.999,15	8,79
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI		2,04	0,22	2,04			12.001.475,59	11,04
BB PREV RF IRF M		1,16	0,02	0,03			1.610.194,20	1,48
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,03	0,00	0,03			5.492.839,54	5,05
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		1,86	0,06	0,09			3.469.450,24	3,19
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,81	0,17	0,01			10.268.348,62	9,44
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,95	0,06	0,01			7.438.923,24	6,84
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,10	0,00	0,03			1.435.493,97	1,32
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	0,00	0,01			566.145,62	0,52
<b>Sub-total</b>	1,02	1,13	0,53		-0,17	0,63	52.022.888,09	47,83

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI BANESTES INVEST MONEY RF		0,01	0,00	0,00			5.252.526,32	4,83
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		1,90	0,18	0,10			10.816.961,10	9,95
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		1,91	0,07	0,13			4.323.336,89	3,98

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			3.851.982,84	3,54
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	0,00	0,00			2.276.006,56	2,09
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,03	0,00	0,03			1.879.755,94	1,73
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,03	0,00	0,03			6.175.063,93	5,68
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,38	0,04	0,38			12.566.006,75	11,55
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,06	0,00	0,06			1.005.571,91	0,92
<b>Sub-total</b>	0,65	0,70	0,30		-0,15	0,70	48.147.212,24	44,27

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		0,09	-0,00	0,12			1.081.244,32	0,99
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 5,85 % a.a		0,47	0,00	0,48			2.049.488,89	1,88
<b>Sub-total</b>	1,86	0,28	0,00		0,04	0,89	3.130.733,21	2,88

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 2,98%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		4,53	0,03	3,77			1.140.285,74	1,05
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO		2,49	0,03	5,35			1.732.086,37	1,59
<b>Sub-total</b>	5,98	2,98	0,06		0,05	1,07	2.872.372,11	2,64

**Renda Variável**

Value-At-Risk: 7,54%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES		8,17	0,01	5,71			169.459,67	0,16
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES - FIA		7,70	0,05	3,77			1.021.785,26	0,94
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,19	0,01	4,05			167.273,81	0,15
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		8,29	0,05	3,19			916.716,22	0,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		7,56	0,01	4,16			175.878,97	0,16
SCHRODER BEST IDEAS FIA		6,41	0,01	2,08			130.602,50	0,12
<b>Sub-total</b>	13,14	7,54	0,13		0,11	2,19	2.581.716,43	2,37

(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 (%)