



CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO
JULHO 2024



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.07.2024.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

75,36%

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 (6,210000%)	0,22	0,04	0,81	6,68	1.631.884,72	1,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,422000%)	0,22	0,04	0,83	6,81	1.070.140,58	1,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,771000%)	0,22	0,04	0,86	7,01	1.618.245,37	1,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,520000%)	0,22	0,04	0,92	7,45	2.143.742,39	2,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,280000%)	0,23	0,04	0,82	6,72	1.588.772,94	1,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,360000%)	0,26	0,04	0,82	6,77	1.608.671,03	1,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,170000%)	2,94	0,04	0,81	2,76	1.994.482,89	2,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,980000%)	4,13	0,05	0,79	2,96	2.060.279,18	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (6,200000%)	4,16	0,03	0,81	1,60	6.091.883,12	6,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,120000%)	0,31	0,03	0,71	6,04	1.714.350,57	1,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,450000%)	0,32	0,04	0,74	6,24	841.512,04	0,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,130000%)	0,47	0,07	0,72	6,05	1.715.093,29	1,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,550000%)	0,39	0,04	0,75	6,29	845.914,17	0,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,610000%)	2,84	0,02	0,76	4,42	1.012.979,60	1,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,170000%)	0,43	0,03	0,72	6,07	1.145.931,51	1,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,630000%)	2,80	0,02	0,76	5,82	3.086.870,05	3,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,011000%)	0,54	0,04	0,79	6,56	3.108.441,51	3,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,020000%)	2,98	0,00	0,79	6,57	3.163.119,55	3,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,32	0,03	0,80	6,56	36.442.314,51	38,87

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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,92	0,29	2,07	0,82	4.512.398,82	4,81	4.446.980.761,25	0,10
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,84	0,04	0,98	1,63	3.125.736,58	3,33	3.539.594.658,05	0,09
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,82	0,08	0,87	3,22	1.180.579,26	1,26	105.314.174,78	1,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,73	0,09	0,89	4,13	3.616.901,43	3,86	7.242.310.243,82	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,13	0,48	3,20	-2,04	1.899.596,63	2,03	1.166.611.040,66	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,57	0,22	1,33	2,71	2.701.351,78	2,88	1.777.075.206,22	0,15
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,33	0,08	0,96	3,35	3.135.560,45	3,34	4.733.163.653,12	0,07
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,84	0,11	0,83	2,41	2.528.044,01	2,70	313.948.393,03	0,81
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,54	0,17	1,38	2,24	22.700.168,96	24,21		

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				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,04	0,82	5,56	1.131.033,50	1,21	3.802.123.463,62	0,03
BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,05	1,00	6,74	3.403.507,48	3,63	12.128.254.135,40	0,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL OPTIMUS RENDA FIXA LONGO PRAZO FICFI	0,61	-0,01	0,74	6,71	1.435.002,38	1,53	1.288.184.142,93	0,11
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,76	-0,01	0,90	6,06	2.574.617,39	2,75	2.144.231.245,29	0,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,28	0,26	1,99	-0,47	2.959.257,37	3,16	263.784.752,92	1,12
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,78	0,08	1,23	5,32	11.503.418,12	12,27		
		Renda Fixa	1,04	0,09	1,05	4,87	70.645.901,59	75,36		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

13,87%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ALASKA	BTG PACTUAL	ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	18,60	0,84	-1,98	-18,32	945.348,01	1,01	1.112.284.248,04	0,08
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	14,42	0,78	2,42	-1,19	1.016.866,36	1,08	113.193.249,39	0,90
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	14,66	1,38	5,40	-8,16	544.702,82	0,58	154.987.418,70	0,35
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15,04	0,66	2,14	-7,80	1.359.649,95	1,45	1.057.502.803,68	0,13
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	14,96	0,02	3,57	-2,23	1.437.478,24	1,53	635.527.360,43	0,23
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	22,72	0,91	-0,40	-17,43	997.720,42	1,06	152.354.115,95	0,65
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	21,87	0,52	3,44	-11,84	862.359,90	0,92	56.061.140,53	1,54
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	13,74	1,85	5,58	-7,19	1.199.469,10	1,28	134.720.459,85	0,89
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	15,83	1,20	2,10	-0,99	2.531.625,42	2,70	848.848.485,49	0,30
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	18,27	1,69	3,33	-9,50	1.388.470,07	1,48	78.851.164,27	1,76
XP	SANTANDER	XP INVESTOR 30 FIC FIA	14,80	1,20	5,04	-5,68	717.558,44	0,77	351.452.326,85	0,20
Sub-total Artigo 8º I			14,68	1,00	2,61	-7,41	13.001.248,73	13,87		
Renda Variável			14,68	1,00	2,61	-7,41	13.001.248,73	13,87		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,03%

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				
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	14,64	1,88	-0,68	4,44	463.737,08	0,49	35.643.168,51	1,30
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13,59	2,14	0,09	19,18	433.872,72	0,46	9.395.870,32	4,62
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,46	3,31	-3,14	10,52	505.645,56	0,54	67.469.058,21	0,75
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17,97	1,33	-2,20	24,29	2.094.787,45	2,23	756.611.993,89	0,28
XP	BNP PARIBAS	SYSTEMATICA BLUE TREND DOLAR ADVISORY FIC DE FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,17	-0,03	-0,02	17,15	357.433,42	0,38	13.785.642,84	2,59
Sub-total Artigo 9º II			12,17	1,61	-1,69	18,41	3.855.476,23	4,11		

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				
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	12,93	2,27	0,62	28,86	739.172,12	0,79	761.918.431,79	0,10
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	15,84	4,29	1,45	36,20	1.057.783,77	1,13	1.804.671.905,53	0,06
Sub-total Artigo 9º III			14,18	3,45	1,11	33,08	1.796.955,89	1,92		
Investimentos no Exterior			11,82	2,19	-0,82	22,71	5.652.432,12	6,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,74%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	11,50	1,48	1,38	18,36	2.606.041,13	2,78	1.339.882.729,51	0,19
SAFRA	SAFRA	SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	9,56	-0,39	-0,97	11,24	1.364.266,13	1,46	55.662.058,45	2,45
Sub-total Artigo 10º I			8,36	0,83	0,56	15,81	3.970.307,26	4,24		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PÁTRIA	XP	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	14,28	6,62	-1,12	8,53	475.223,32	0,51	158.407.771,10	0,30
Sub-total Artigo 10º II			14,28	6,62	-1,12	8,53	475.223,32	0,51		

Investimentos Estruturados			7,88	1,42	0,38	15,39	4.445.530,58	4,74		
----------------------------	--	--	------	------	------	-------	--------------	------	--	--

Total			3,11	0,40	1,14	4,26	93.745.113,02	100,00		
-------	--	--	------	------	------	------	---------------	--------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível I
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	36.442.314,51	38,87	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	22.700.168,96	24,21	0,00	22,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	11.503.418,12	12,27	0,00	23,00	60,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	70.645.901,59	75,36					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	13.001.248,73	13,87	0,00	17,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	13.001.248,73	13,87					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	3.855.476,23	4,11	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.796.955,89	1,92	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.652.432,12	6,03					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.970.307,26	4,24	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	475.223,32	0,51	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	4.445.530,58	4,74					15,00
Total		93.745.113,02	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	0,80 87,67	6,56 106,20	2,57 100,68	5,46 105,77	10,75 93,38	287.530,83	1.813.828,52
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,38 152,38	2,24 36,20	2,12 83,04	2,04 39,54	6,71 58,30	308.944,11	472.332,81
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,23 135,46	5,32 86,21	2,59 101,56	4,54 87,97	10,16 88,28	134.725,55	906.960,68
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,61 -0,42	-7,41 -2,54	0,29 -1,08	-2,35 -2,27	0,24 -4,44	330.144,33	-1.061.556,21
Artigo 9º II % do CDI	-1,69 -186,66	18,41 298,04	7,12 279,09	17,46 338,49	22,34 194,12	-66.404,72	599.333,89
Artigo 9º III % do CDI	1,11 122,39	33,08 535,66	18,72 734,21	27,02 523,78	45,00 390,94	19.730,24	446.680,72
Artigo 10º I % do CDI	0,56 61,75	15,81 256,05	8,66 339,66	13,70 265,59	22,83 198,40	22.116,44	542.098,42
Artigo 10º II % do CDI	-1,12 -122,94	8,53 138,13	6,97 273,27	8,53 165,34		-5.359,61	34.377,22
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO (Total)						1.031.427,17	3.754.056,05

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 150525 (6,280000%)	1.575.912,91	0,00	0,00	0,00	1.588.772,94	12.860,03	102.059,79
NTN-B 150527 (6,170000%)	1.978.528,82	0,00	0,00	0,00	1.994.482,89	15.954,07	53.950,31
NTN-B 150529 (6,200000%)	6.042.991,53	0,00	0,00	0,00	6.091.883,12	48.891,59	95.681,86
NTN-B 150535 (5,130000%)	1.702.911,35	0,00	0,00	0,00	1.715.093,29	12.181,94	99.546,78
NTN-B 150535 (5,550000%)	839.597,20	0,00	0,00	0,00	845.914,17	6.316,97	51.035,92
NTN-B 150535 (5,610000%)	1.005.360,43	0,00	0,00	0,00	1.012.979,60	7.619,17	43.519,60
NTN-B 150545 (5,630000%)	3.063.603,11	0,00	0,00	0,00	3.086.870,05	23.266,94	172.916,19
NTN-B 150545 (6,011000%)	3.084.000,48	0,00	0,00	0,00	3.108.441,51	24.441,03	195.224,65
NTN-B 150824 (6,210000%)	1.618.776,68	0,00	0,00	0,00	1.631.884,72	13.108,04	102.874,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150824 (6,422000%)	1.061.351,90	0,00	0,00	0,00	1.070.140,58	8.788,68	68.635,92
NTN-B 150824 (6,771000%)	1.604.476,02	0,00	0,00	0,00	1.618.245,37	13.769,35	106.698,15
NTN-B 150824 (7,520000%)	2.124.141,49	0,00	0,00	0,00	2.143.742,39	19.600,90	149.561,74
NTN-B 150826 (6,360000%)	1.595.544,12	0,00	0,00	0,00	1.608.671,03	13.126,91	102.663,92
NTN-B 150828 (5,980000%)	2.044.142,60	0,00	0,00	0,00	2.060.279,18	16.136,58	59.148,39
NTN-B 150830 (5,120000%)	1.702.182,89	0,00	0,00	0,00	1.714.350,57	12.167,68	98.286,10
NTN-B 150830 (5,450000%)	835.300,00	0,00	0,00	0,00	841.512,04	6.212,04	49.708,16
NTN-B 150840 (5,170000%)	1.137.747,84	0,00	0,00	0,00	1.145.931,51	8.183,67	65.982,87
NTN-B 150850 (6,020000%)	3.138.214,31	0,00	0,00	0,00	3.163.119,55	24.905,24	196.333,66
	36.154.783,68	0,00	0,00	0,00	36.442.314,51	287.530,83	

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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.420.698,76	0,00	0,00	0,00	4.512.398,82	91.700,06	36.854,81
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	3.095.267,52	0,00	0,00	0,00	3.125.736,58	30.469,06	50.101,65
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.170.425,68	0,00	0,00	0,00	1.180.579,26	10.153,58	36.779,10
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.584.894,21	0,00	0,00	0,00	3.616.901,43	32.007,22	143.515,94
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.840.734,58	0,00	0,00	0,00	1.899.596,63	58.862,05	-39.640,43
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.665.970,67	0,00	0,00	0,00	2.701.351,78	35.381,11	71.340,02
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3.037.843,92	68.170,60	0,00	0,00	3.135.560,45	29.545,93	95.926,97
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2.507.218,91	0,00	0,00	0,00	2.528.044,01	20.825,10	59.389,00
	22.323.054,25	68.170,60	0,00	0,00	22.700.168,96	308.944,11	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	192.037,96	2.243.750,35	-1.314.467,17	0,00	1.131.033,50	9.712,36	87.455,51
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	3.369.960,44	0,00	0,00	0,00	3.403.507,48	33.547,04	333.317,58
ITAU INSTITUCIONAL OPTIMUS RENDA FIXA LONGO PRAZO FICFI	1.424.418,63	0,00	0,00	0,00	1.435.002,38	10.583,75	90.272,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	2.551.545,32	0,00	0,00	0,00	2.574.617,39	23.072,07	176.329,24
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2.901.447,04	0,00	0,00	0,00	2.959.257,37	57.810,33	-14.093,79
	10.439.409,39	2.243.750,35	-1.314.467,17	0,00	11.503.418,12	134.725,55	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	964.407,62	0,00	0,00	0,00	945.348,01	-19.059,61	-162.345,08
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	992.820,56	0,00	0,00	0,00	1.016.866,36	24.045,80	-32.056,33
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	516.805,44	0,00	0,00	0,00	544.702,82	27.897,38	-65.873,70
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.331.108,51	0,00	0,00	0,00	1.359.649,95	28.541,44	-114.951,71
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	1.387.931,79	0,00	0,00	0,00	1.437.478,24	49.546,45	-24.261,61
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	1.001.709,46	0,00	0,00	0,00	997.720,42	-3.989,04	-210.560,69
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	833.709,81	0,00	0,00	0,00	862.359,90	28.650,09	-115.782,80
SCHRODER BEST IDEAS FIA	1.136.085,67	0,00	0,00	0,00	1.199.469,10	63.383,43	-121.420,87
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	2.479.604,99	0,00	0,00	0,00	2.531.625,42	52.020,43	-25.373,18
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	1.343.786,81	0,00	0,00	0,00	1.388.470,07	44.683,26	-145.728,12
XP INVESTOR 30 FIC FIA	683.133,74	0,00	0,00	0,00	717.558,44	34.424,70	-43.202,12
	12.671.104,40	0,00	0,00	0,00	13.001.248,73	330.144,33	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	466.898,90	0,00	0,00	0,00	463.737,08	-3.161,82	19.697,39
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	433.468,20	0,00	0,00	0,00	433.872,72	404,52	69.829,39
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	522.011,12	0,00	0,00	0,00	505.645,56	-16.365,56	48.147,04
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.142.005,61	0,00	0,00	0,00	2.094.787,45	-47.218,16	409.334,52
SYSTEMATICA BLUE TREND DOLAR ADVISORY FIC DE FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	357.497,12	0,00	0,00	0,00	357.433,42	-63,70	52.325,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	3.921.880,95	0,00	0,00	0,00	3.855.476,23	-66.404,72	

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	734.598,85	0,00	0,00	0,00	739.172,12	4.573,27	165.550,70
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	1.042.626,80	0,00	0,00	0,00	1.057.783,77	15.156,97	281.130,02
	1.777.225,65	0,00	0,00	0,00	1.796.955,89	19.730,24	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	2.570.579,92	0,00	0,00	0,00	2.606.041,13	35.461,21	404.262,06
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1.377.610,90	0,00	0,00	0,00	1.364.266,13	-13.344,77	137.836,36
	3.948.190,82	0,00	0,00	0,00	3.970.307,26	22.116,44	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	480.582,93	0,00	0,00	0,00	475.223,32	-5.359,61	34.377,22
	480.582,93	0,00	0,00	0,00	475.223,32	-5.359,61	

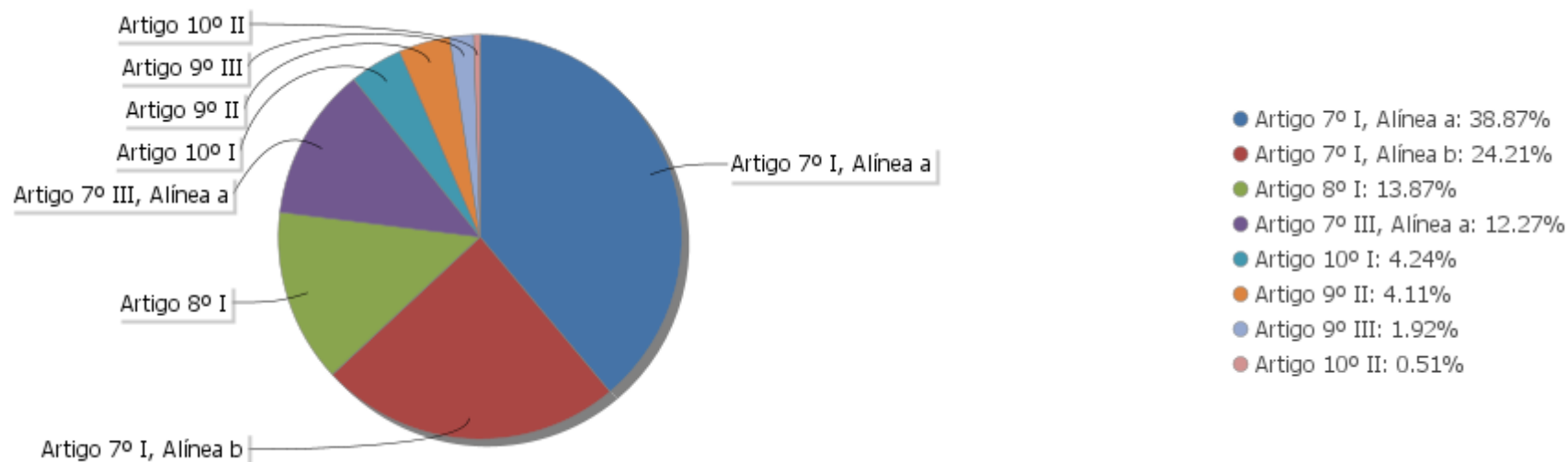
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

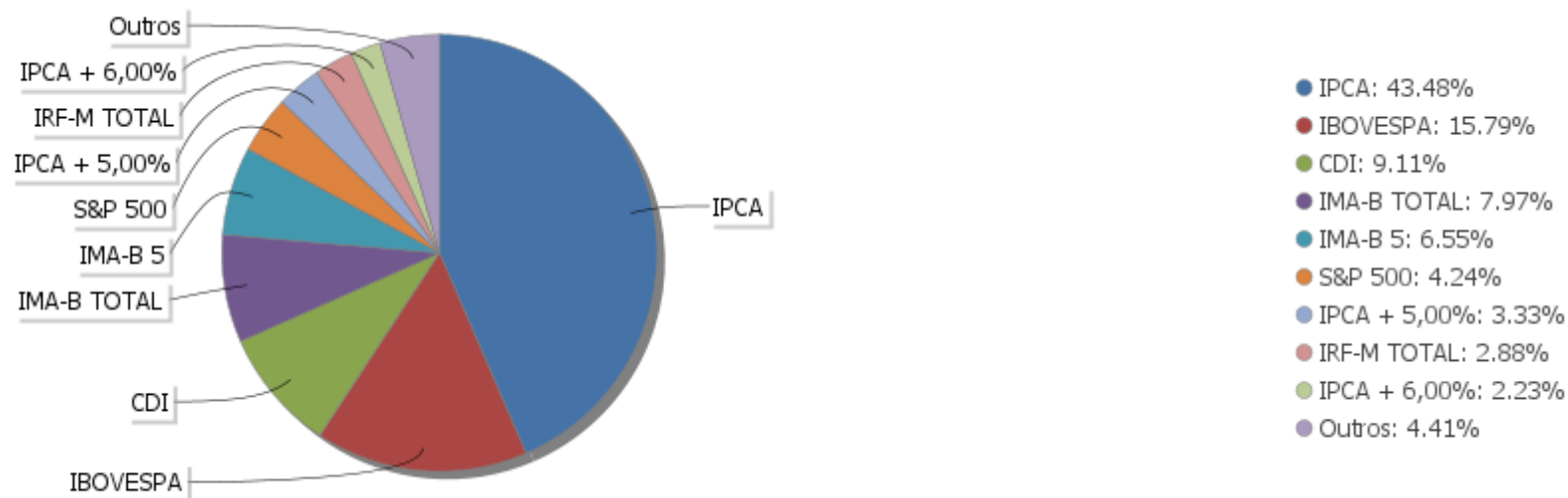
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	53.002.489,17	56,54		53.002.489,17	56,54	
de 31 dias a 365 dias	11.877.872,02	12,67		64.880.361,19	69,21	
acima de 365 dias	28.864.751,83	30,79		93.745.113,02	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

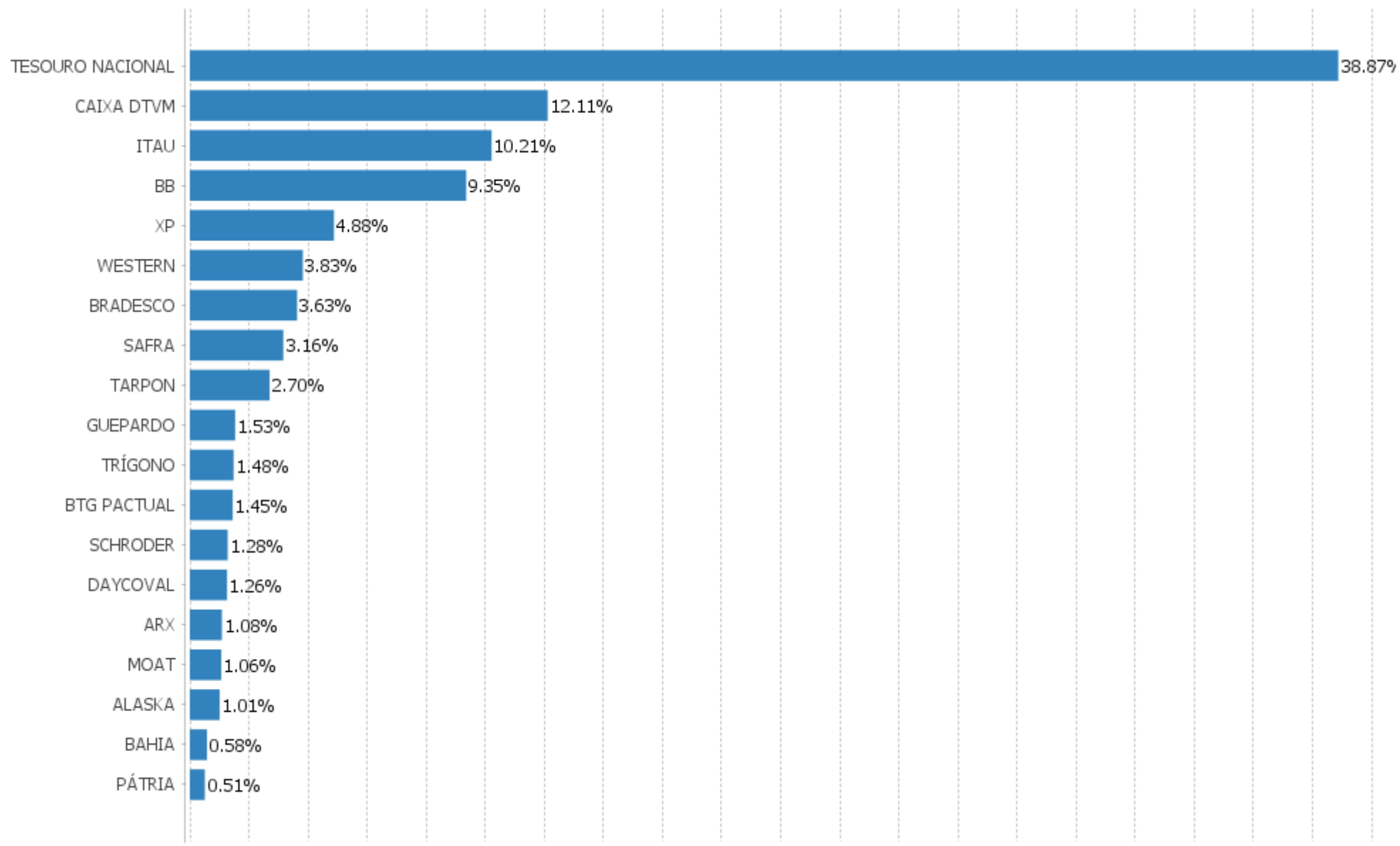


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

0 2 4 6 8 10 12 14 16 18 20 22 24 26 28 30 32 34 36 38 40

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	-0,19	1,36	1,11	-0,92	0,56	1,16	1,14						4,26
INPC + 5,01%	1,00	1,18	0,58	0,80	0,87	0,64	0,71						5,92
p.p. indexador	-1,19	0,18	0,53	-1,71	-0,31	0,52	0,43						-1,66
2023	1,86	-0,69	0,70	1,01	2,71	2,72	1,53	-0,44	0,20	-0,81	3,51	2,44	15,65
INPC + 5,02%	0,89	1,12	1,09	0,88	0,79	0,31	0,32	0,65	0,50	0,53	0,49	0,94	8,85
p.p. indexador	0,96	-1,81	-0,39	0,13	1,92	2,42	1,21	-1,09	-0,30	-1,34	3,02	1,50	6,80
2022	0,10	-0,44	2,58	-2,71	0,76	-3,40	2,48	1,89	-0,38	2,70	-1,23	-0,52	1,62
INPC + 4,88%	1,07	1,36	2,13	1,40	0,87	1,02	-0,20	0,12	0,08	0,85	0,76	1,11	11,08
p.p. indexador	-0,97	-1,80	0,45	-4,12	-0,11	-4,42	2,68	1,77	-0,46	1,85	-1,99	-1,63	-9,46
2021	-0,40	-0,71	0,31	1,16	1,16	0,42	-1,15	-1,07	-1,90	-2,32	0,49	1,34	-2,71
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04	1,49	1,35	1,65	1,58	1,26	1,22	16,11
p.p. indexador	-1,09	-1,91	-1,04	0,36	-0,24	-0,63	-2,63	-2,41	-3,54	-3,91	-0,78	0,13	-18,82
2020	0,35	-0,86	-6,80	3,31	2,77	3,07	3,42	-0,76	-1,52	-0,35	3,94	3,56	10,00
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	-0,36	-1,52	-7,37	3,17	2,70	2,33	2,54	-1,48	-2,64	-1,69	2,59	1,70	-0,62

Performance Sobre a Meta Atuarial

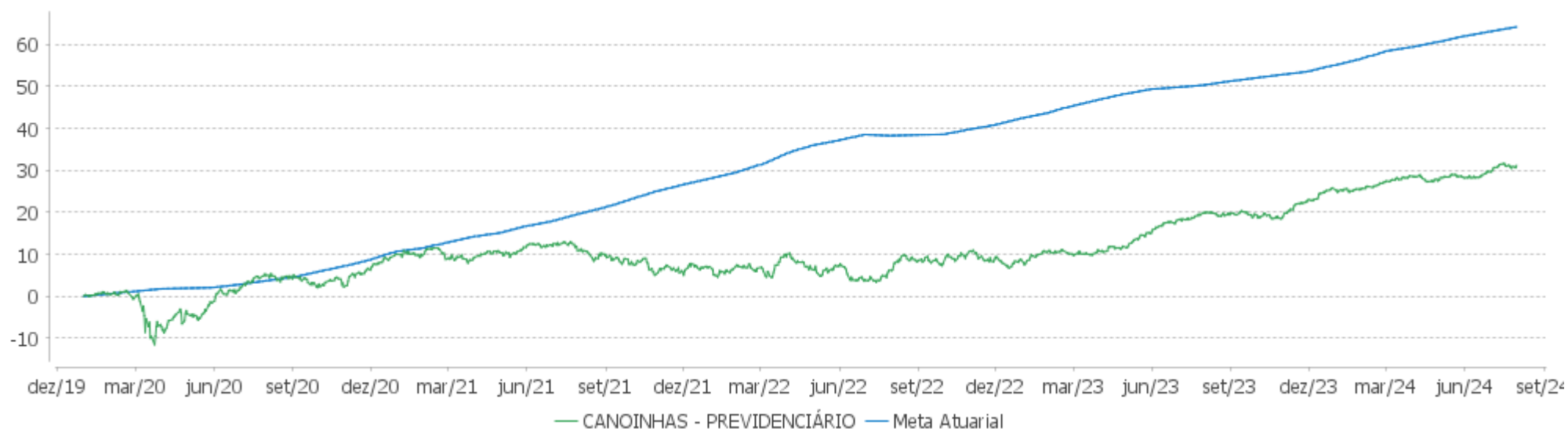
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	23	41,82	03 meses	2,88	2,23	0,64	2,52
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	58,18	06 meses	4,46	4,87	-0,41	2,52
			12 meses	9,40	9,26	0,14	3,11
			24 meses	23,51	18,70	4,81	4,29
			36 meses	18,30	37,37	-19,06	5,42
			48 meses	24,97	58,43	-33,46	5,52
			Desde 31/12/2019	31,14	64,50	-33,37	7,29

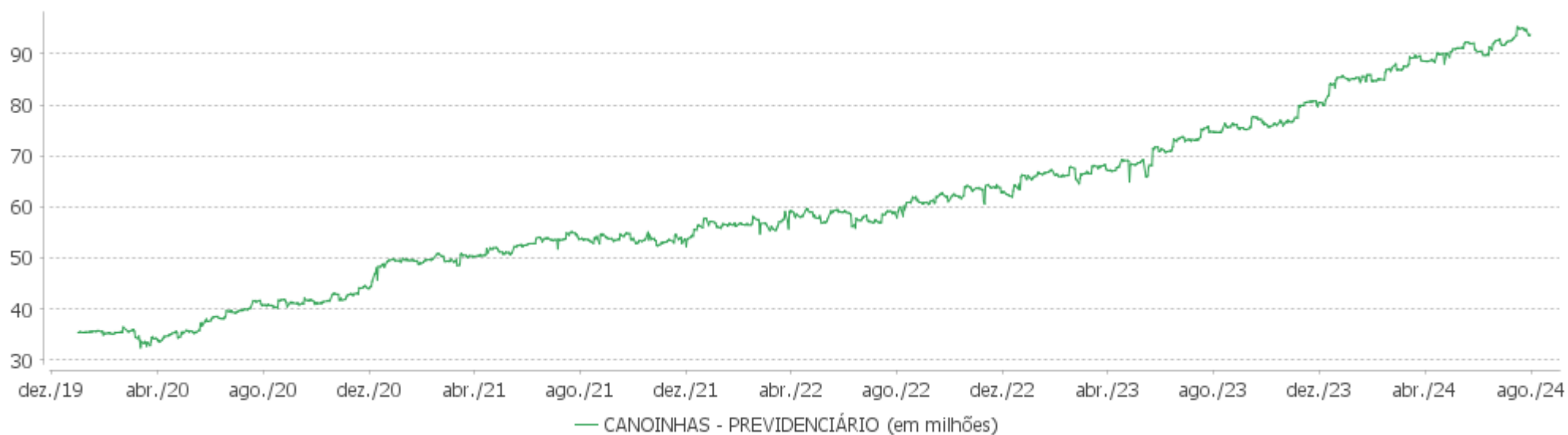
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,94	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-6,80	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

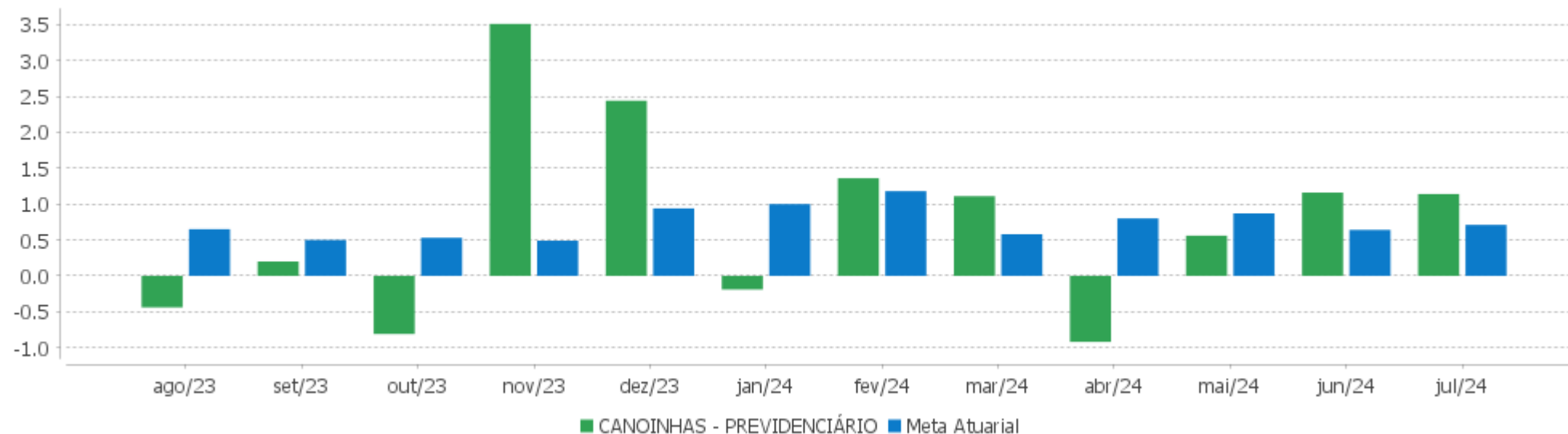


Patrimônio Líquido



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
NTN-B 150525 (6,280000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,44	6,72 3,85	2,63 1,58	5,59 3,14	10,93 6,43	15,08 6,41	
NTN-B 150535 (5,550000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	6,29 3,42	2,45 1,40	5,23 2,78	10,28 5,79	20,48 11,81	37,26 17,65
NTN-B 150824 (6,771000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,48	7,01 4,14	2,75 1,69	5,83 3,38	11,41 6,91	16,07 7,40	
NTN-B 150830 (5,450000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,36	6,24 3,36	2,42 1,37	5,18 2,73	10,13 5,64	20,21 11,54	36,80 17,19
NTN-B 150527 (6,170000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,43	6,65 3,78	2,60 1,55	5,53 3,09	7,59 3,09		
NTN-B 150830 (5,120000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,33	6,04 3,17	2,34 1,29	5,01 2,57	9,79 5,29	19,45 10,78	35,61 15,99
NTN-B 150824 (6,422000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,45	6,81 3,93	2,66 1,61	5,66 3,21	11,05 6,55	15,35 6,68	
NTN-B 150535 (5,610000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	6,31 3,44	2,46 1,41	5,23 2,79	7,12 2,63		
NTN-B 150545 (6,011000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,41	6,56 3,69	2,56 1,51	5,45 3,01	10,84 6,35	18,13 9,46	
NTN-B 150840 (5,170000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,34	6,07 3,20	2,35 1,30	5,04 2,59	9,91 5,41	19,65 10,98	36,01 16,40
NTN-B 150850 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,41	6,57 3,70	2,57 1,51	5,46 3,01	7,66 3,16	11,45 2,78	
NTN-B 150826 (6,360000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,44	6,77 3,90	2,65 1,59	5,62 3,18	11,03 6,54	15,24 6,57	
NTN-B 150529 (6,200000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,43	3,58 0,71	-0,37 -1,42	2,49 0,04	4,50 -0,00		
NTN-B 150824 (7,520000%) Var. IPCA p.p.	0,92 0,54	7,45 4,57	2,93 1,88	6,20 3,75	12,19 7,69	17,62 8,95	
NTN-B 150545 (5,630000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	6,33 3,45	2,47 1,41	5,26 2,82	7,19 2,69		
NTN-B 150824 (6,210000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,43	6,68 3,81	2,61 1,56	5,55 3,11	10,83 6,33	21,83 13,16	35,46 15,85
NTN-B 150828 (5,980000%)	0,79	3,51	2,55	2,43	4,35		

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.	0,41	0,63	1,50	-0,02	-0,14		
NTN-B 150535 (5,130000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,34	6,05 3,17	2,34 1,29	5,02 2,57	9,83 5,34	19,51 10,84	35,82 16,21
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,83 -0,08	2,41 -1,86	1,74 -0,63	1,85 -1,72	6,00 -2,16	16,97 -3,40	25,14 -7,32
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,89 -0,02	4,13 -0,13	2,31 -0,06	3,45 -0,12	7,93 -0,23	20,02 -0,35	31,84 -0,63
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA Var. IPCA p.p.	0,87 0,49	3,22 0,34	2,06 1,00	2,57 0,12	6,78 2,29	18,61 9,94	29,30 9,69
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,96 0,58	3,35 0,47	1,85 0,79	2,67 0,23	7,47 2,97	23,28 14,61	29,89 10,28
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,07 -0,02	0,82 -0,15	2,39 -0,06	1,31 -0,12	4,13 -0,25	19,89 -0,62	23,44 -0,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,33 -0,01	2,71 -0,16	1,64 -0,06	2,03 -0,16	8,10 -0,28	25,75 -0,43	29,84 -0,65
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,98 0,16	6,82 0,97	3,07 0,76	5,64 0,68	11,37 1,66		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	3,20 -0,04	-2,04 -0,08	2,45 -0,07	-0,60 -0,09	1,00 -0,03	20,02 -0,58	15,55 -1,17
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,00 109,74	6,74 109,10	2,74 107,26	5,59 108,36	12,51 108,72	28,26 106,00	41,22 106,93
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,10	-0,47 -1,45	2,20 -0,25	0,08 -1,34	2,23 -2,15	17,23 -3,28	20,33 -4,10
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,82 90,28	5,56 90,11	2,29 89,90	4,64 90,01	10,41 90,42	24,18 90,70	34,41 89,25
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,90 99,68	6,06 98,07	2,69 105,68	5,11 98,98	10,50 91,20	25,11 94,21	39,24 101,78
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS RENDA FIXA LONGO PRAZO FICFI % do CDI	0,74 81,91	6,71 108,70	3,04 119,07	5,77 111,92	11,46 99,55	26,61 99,82	43,44 112,68
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,44 0,41	-11,84 -6,97	2,24 0,87	-5,42 -5,35	-11,91 -16,59	-5,36 -29,09	-51,15 -55,96
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,98 -5,00	-18,41 -13,54	-5,55 -6,92	-13,87 -13,79	-9,58 -14,27	15,68 -8,06	9,71 4,91
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,14 -0,88	-7,80 -2,93	0,25 -1,12	-4,58 -4,50	-2,85 -7,53	8,10 -15,64	-30,35 -35,15
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	2,10	-0,99	-0,99	5,50	16,35	66,92	65,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,92	3,88	-2,36	5,58	11,66	43,19	60,71
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,33 0,30	-9,50 -4,63	1,87 0,50	-1,84 -1,76	-7,36 -12,04	9,02 -14,72	-5,01 -9,81
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,40 -3,42	-17,43 -12,56	-4,18 -5,55	-11,30 -11,22	-15,31 -19,99	-9,99 -33,73	-25,98 -30,78
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,57 0,55	-2,23 2,63	2,62 1,25	-0,76 -0,68	7,93 3,25	47,85 24,12	42,74 37,94
SCHRODER BEST IDEAS FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,58 2,56	-7,19 -2,32	2,24 0,87	-2,37 -2,29	0,07 -4,61	17,80 -5,93	5,90 1,10
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,42 -0,60	-1,19 3,68	2,53 1,15	3,57 3,65	8,81 4,12	20,78 -2,95	2,70 -2,11
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,40 2,38	-8,16 -3,29	1,69 0,32	-3,75 -3,67	-0,53 -5,21	13,69 -10,05	-17,67 -22,47
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,04 2,02	-5,68 -0,81	2,48 1,11	-3,66 -3,58	4,90 0,22	19,63 -4,11	8,42 3,62
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	0,62 -2,40	28,86 33,73	17,65 16,27	25,43 25,51	38,64 33,96	39,96 16,23	20,15 15,34
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	1,45 -1,57	36,20 41,07	19,49 18,12	28,16 28,24	49,59 44,91	62,64 38,90	28,19 23,38
SYSTEMATICA BLUE TREND DOLAR ADVISORY FIC DE FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-0,02 -3,42	17,15 -13,83	-0,01 -17,82	16,37 -10,97	20,62 -16,88	4,67 -34,66	20,80 -3,49
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-0,68 -4,08	4,44 -26,54	4,51 -13,30	11,39 -15,94	0,91 -36,58	13,14 -26,19	-9,34 -33,62
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,20 -3,12	24,29 17,86	8,47 5,91	19,46 14,01	36,07 25,32	58,79 36,75	-2,61 -44,97
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	0,09 -3,31	19,18 -11,79	12,80 -5,01	25,05 -2,29	15,56 -21,94	10,76 -28,57	-16,81 -41,09
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-3,14 -6,53	10,52 -20,45	4,84 -12,97	10,33 -17,00	11,74 -25,75	35,77 -3,56	11,01 -13,28
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	1,38 -1,63	18,36 -17,04	10,73 -9,32	16,42 -13,85	26,57 -17,13	52,91 7,00	54,59 15,69
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-0,97 -3,98	11,24 -24,17	4,91 -15,15	8,86 -21,41	16,27 -27,43		
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C Var. IPCA + 7,00% p.p.	-1,12 -2,12	8,53 1,52	6,97 4,16	10,12 4,18			
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO	1,14	4,26	2,88	4,46	9,40	23,51	18,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. INPC + 5,01% p.p.	0,43	-1,66	0,64	-0,41	0,15	4,76	-19,00
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro e Julho	2,00
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du	-	
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	-	1,90
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	D+0	D+0	D+2 du	D+3 du		0,50
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU INSTITUCIONAL OPTIMUS RENDA FIXA LONGO PRAZO FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A VINTE POR CENTO DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A CEM POR CENTO DA VARIAÇÃO DO CDI, DE UM DIA, APURADO E DIVULGADO PELA B3 S.A. BRASIL, BOLSA, BALCÃO.	
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	0,50
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	D+0	D+0		D+15	O GESTOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% (VINTE POR CENTO) DA	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% (CEM POR CENTO) DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&F BOVESPA.	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C						0,08
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
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
SYSTEMATICA BLUE TREND DOLAR ADVISORY FIC DE FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+3	D+3	D+3	D+5		
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	D+1 du	D+1 du	D+30	D+32	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro	
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1	D+1	D+30	D+32	-	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
XP INVESTOR 30 FIC FIA	D+0	D+0	D+30	D+32	Para informações adicionais, vide o Regulamento	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	0,94	5,49	2,37	4,62	10,81	26,14	36,37	39,08	46,74
IRF-M 1+	1,55	1,77	1,44	1,17	7,38	27,10	28,37	24,09	39,00
IRF-M TOTAL	1,34	2,87	1,71	2,19	8,37	26,19	30,49	28,67	41,29
IMA-B 5	0,91	4,27	2,37	3,56	8,16	20,37	32,46	39,16	51,45
IMA-B 5+	3,24	-1,97	2,52	-0,51	1,03	20,60	16,72	17,12	26,27
IMA-B TOTAL	2,09	0,97	2,45	1,43	4,38	20,51	24,43	27,57	37,98
IMA-GERAL TOTAL	1,36	3,81	2,36	3,33	8,64	24,49	31,89	34,10	43,92
IDKA 2	0,75	3,98	2,01	3,15	8,12	19,52	31,61	39,35	51,45
IDKA 20	6,19	-6,65	2,88	-3,43	-3,72	23,96	4,78	3,52	8,64
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,01	35,40	20,06	30,27	43,70	45,91	38,90	83,71	178,66

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150525 (6,280000%)	1.588.772,94	6,280000	1.588.191,31	6,333700	-581,63
NTN-B 150527 (6,170000%)	1.994.482,89	6,170000	1.978.148,49	6,511500	-16.334,40
NTN-B 150529 (6,200000%)	6.091.883,12	6,200000	6.052.559,79	6,367500	-39.323,33
NTN-B 150535 (5,130000%)	1.715.093,29	5,130000	1.580.223,26	6,202900	-134.870,03
NTN-B 150535 (5,550000%)	845.914,17	5,550000	805.181,88	6,202900	-40.732,29
NTN-B 150535 (5,610000%)	1.012.979,60	5,610000	968.801,73	6,202900	-44.177,87
NTN-B 150545 (5,630000%)	3.086.870,05	5,630000	2.867.634,14	6,278700	-219.235,91
NTN-B 150545 (6,011000%)	3.108.441,51	6,011000	3.016.106,32	6,278700	-92.335,19
NTN-B 150824 (6,210000%)	1.631.884,72	6,210000	1.631.204,54	7,231400	-680,18
NTN-B 150824 (6,422000%)	1.070.140,58	6,422000	1.069.787,26	7,231400	-353,32
NTN-B 150824 (6,771000%)	1.618.245,37	6,771000	1.617.942,72	7,231400	-302,65
NTN-B 150824 (7,520000%)	2.143.742,39	7,520000	2.143.995,13	7,231400	252,74
NTN-B 150826 (6,360000%)	1.608.671,03	6,360000	1.601.519,44	6,609700	-7.151,59
NTN-B 150828 (5,980000%)	2.060.279,18	5,980000	2.025.987,76	6,479500	-34.291,42
NTN-B 150830 (5,120000%)	1.714.350,57	5,120000	1.624.158,68	6,260000	-90.191,89
NTN-B 150830 (5,450000%)	841.512,04	5,450000	809.890,45	6,260000	-31.621,59
NTN-B 150840 (5,170000%)	1.145.931,51	5,170000	1.040.958,83	6,149800	-104.972,68
NTN-B 150850 (6,020000%)	3.163.119,55	6,020000	3.064.502,98	6,280200	-98.616,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
483	03/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12.425,60	0,00	4.359,84302800	2,8500108650
475	08/07/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	47.736,05	0,00	24.396,91348900	1,9566430000
482	08/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1,00	0,35050200	2,8530514930
481	12/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	70.063,24	0,00	24.522,38447400	2,8571136740
498	15/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	478.867,40	0,00	167.546,20809600	2,8581213830
480	16/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.563.360,55	0,00	546.797,57834600	2,8591212030
479	18/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	110.241,41	0,00	38.530,40300000	2,8611538270
478	22/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	8.792,15	0,00	3.070,74474900	2,8631979270
474	26/07/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	20.434,55	0,00	10.414,45712300	1,9621330000
477	29/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.100.193,48	383.576,88399400	2,8682476080
476	31/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	214.272,69	74.652,45125700	2,8702699830
Total			2.311.920,95	1.314.467,17		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.257.049,49

Value-At-Risk: 1,34%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,13	0,50		0,28	0,13	1,05	70.645.901,59	75,36
Artigo 8º	13,70	6,95		0,90	0,12	2,61	13.001.248,73	13,87
Artigo 9º	14,29	5,15		0,05	-0,12	-0,80	5.652.432,12	6,03
Artigo 10º	12,63	3,80		0,12	-0,04	0,38	4.445.530,58	4,74
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO		1,34		1,34			93.745.113,02	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 (6,210000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,43	0,81	1.631.884,72	1,74
NTN-B 150824 (6,422000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,35	0,83	1.070.140,58	1,14
NTN-B 150824 (6,771000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,22	0,86	1.618.245,37	1,73
NTN-B 150824 (7,520000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	0,07	0,92	2.143.742,39	2,29
NTN-B 150525 (6,280000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,40	0,82	1.588.772,94	1,69
NTN-B 150826 (6,360000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,37	0,82	1.608.671,03	1,72
NTN-B 150527 (6,170000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,45	0,81	1.994.482,89	2,13
NTN-B 150828 (5,980000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,50	0,79	2.060.279,18	2,20
NTN-B 150529 (6,200000%)	0,23	0,24	-0,00	0,25	-0,43	0,81	6.091.883,12	6,50
NTN-B 150830 (5,120000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,85	0,71	1.714.350,57	1,83
NTN-B 150830 (5,450000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,72	0,74	841.512,04	0,90
NTN-B 150535 (5,130000%)	0,29	0,17	0,00	0,18	-0,66	0,72	1.715.093,29	1,83
NTN-B 150535 (5,550000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,69	0,75	845.914,17	0,90
NTN-B 150535 (5,610000%)	0,24	0,11	0,00	0,12	-0,61	0,76	1.012.979,60	1,08
NTN-B 150840 (5,170000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,83	0,72	1.145.931,51	1,22
NTN-B 150545 (5,630000%)	0,24	0,11	0,00	0,12	-0,63	0,76	3.086.870,05	3,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (6,011000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,51	0,79	3.108.441,51	3,32
NTN-B 150850 (6,020000%)	0,29	0,17	0,00	0,18	-0,39	0,79	3.163.119,55	3,37
Sub-total	0,23	0,10	0,00		-0,49	0,80	36.442.314,51	38,87

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,44	2,23	0,07	0,01	0,26	2,07	4.512.398,82	4,81
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,54	0,31	0,00	0,32	0,14	0,98	3.125.736,58	3,33
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,75	0,96	0,01	0,96	-0,02	0,87	1.180.579,26	1,26
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	1,01	0,03	0,01	-0,01	0,89	3.616.901,43	3,86
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,12	3,13	0,04	0,04	0,32	3,20	1.899.596,63	2,03
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,96	1,42	0,03	0,02	0,14	1,33	2.701.351,78	2,88
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,35	0,73	0,02	0,73	0,04	0,96	3.135.560,45	3,34
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,91	1,68	0,03	0,75	-0,03	0,83	2.528.044,01	2,70
Sub-total	2,60	1,30	0,23		0,18	1,38	22.700.168,96	24,21

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	0,01	-0,00	0,01	-17,80	0,82	1.131.033,50	1,21
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	-0,00	0,04	0,78	1,00	3.403.507,48	3,63
ITAU INSTITUCIONAL OPTIMUS RENDA FIXA LONGO PRAZO FICFI	0,88	0,37	-0,00	0,37	-0,19	0,74	1.435.002,38	1,53
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,39	0,26	-0,00	0,26	-0,01	0,90	2.574.617,39	2,75
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,43	2,31	0,05	0,37	0,24	1,99	2.959.257,37	3,16
Sub-total	1,09	0,55	0,04		0,30	1,23	11.503.418,12	12,27

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,95%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	19,59	9,36	0,07	5,17	-0,15	-1,98	945.348,01	1,01
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	11,62	6,24	0,06	2,89	0,13	2,42	1.016.866,36	1,08
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	11,86	6,52	0,03	2,21	0,38	5,40	544.702,82	0,58
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	11,59	7,18	0,09	3,87	0,11	2,14	1.359.649,95	1,45
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	11,79	7,02	0,09	3,72	0,23	3,57	1.437.478,24	1,53
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	23,86	10,84	0,10	6,98	-0,05	-0,40	997.720,42	1,06
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	19,59	11,02	0,09	7,07	0,13	3,44	862.359,90	0,92
SCHRODER BEST IDEAS FIA	10,84	5,90	0,06	2,20	0,43	5,58	1.199.469,10	1,28
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	14,31	7,71	0,15	5,57	0,08	2,10	2.531.625,42	2,70
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	18,20	7,96	0,09	5,70	0,13	3,33	1.388.470,07	1,48
XP INVESTOR 30 FIC FIA	15,79	7,94	0,05	4,01	0,26	5,04	717.558,44	0,77
Sub-total	13,70	6,95	0,90		0,12	2,61	13.001.248,73	13,87

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,15%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	15,86	6,97	0,02	8,14	-0,10	-0,68	463.737,08	0,49
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15,00	6,21	0,00	5,48	-0,05	0,09	433.872,72	0,46
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,67	8,82	0,02	7,64	-0,16	-3,14	505.645,56	0,54
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	14,47	6,80	0,01	6,81	-0,21	-2,20	2.094.787,45	2,23
SYSTEMATICA BLUE TREND DOLAR ADVISORY FIC DE FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	14,32	7,71	-0,01	7,50	-0,06	-0,02	357.433,42	0,38
Sub-total	12,42	5,15	0,05		-0,21	-1,69	3.855.476,23	4,11

Artigo 9º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	15,64	5,89	0,00	8,69	-0,02	0,62	739.172,12	0,79
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	20,78	7,38	0,00	9,97	0,03	1,45	1.057.783,77	1,13
Sub-total	18,30	6,59	0,00		0,01	1,11	1.796.955,89	1,92

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,80%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	13,59	5,68	0,09	5,37	0,03	1,38	2.606.041,13	2,78
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	12,92	5,44	0,03	9,37	-0,15	-0,97	1.364.266,13	1,46
Sub-total	10,13	4,26	0,12		-0,03	0,56	3.970.307,26	4,24

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	3,71	0,48	-0,00	0,49	-0,54	-1,12	475.223,32	0,51
Sub-total	33,48	0,48	-0,00		-0,06	-1,12	475.223,32	0,51

(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 (%)