



**LDB**  
EMPRESAS

**HORTOLÂNDIA**  
AGOSTO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.08.2024.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

82,64%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	8,00	0,00	0,51	7,35	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,170000%)	0,71	0,02	0,65	6,76	22.705.601,82	2,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,813502%)	0,41	0,02	0,70	7,20	54.068.449,93	6,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020001%)	0,43	0,02	0,64	6,66	53.214.349,74	5,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,121999%)	0,48	0,02	0,73	7,41	80.437.199,01	9,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,96	-0,56	1,14	-1,72	15.943.536,57	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,660001%)	0,52	0,02	0,69	7,09	22.711.419,43	2,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,859998%)	0,53	0,02	0,71	7,23	22.463.219,85	2,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,442001%)	0,56	0,03	0,76	7,62	70.149.770,11	7,88
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,67</b>	<b>-0,00</b>	<b>0,71</b>	<b>6,84</b>	<b>341.693.546,46</b>	<b>38,36</b>

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	4,05	-0,27	0,46	1,29	105.223.471,10	11,81	4.414.843.191,53	2,38
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,40	0,04	0,74	6,13	156.024.077,39	17,52	8.469.459.153,05	1,84
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,87	0,11	0,59	4,32	81.714.031,67	9,17	4.335.355.090,03	1,88
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,05	0,04	0,40	0,40	44.729.563,19	5,02	41.323.119.298,86	0,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,75</b>	<b>-0,03</b>	<b>0,71</b>	<b>4,38</b>	<b>387.691.143,35</b>	<b>43,53</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				
QUELUZ	RJI	BRA1 FI RENDA FIXA	0,29	0,00	-0,01	0,13	153.609,89	0,02	3.682.983,23	4,17
VERITAS	RJI	FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	7,31	-0,04	-1,24	-4,86	245.647,74	0,03	37.452.215,64	0,66
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA B FI RENDA FIXA	1,82	-1,50	-1,14	-0,64	3.972.484,70	0,45	75.269.488,39	5,28
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>1,72</b>	<b>-1,36</b>	<b>-1,11</b>	<b>-0,86</b>	<b>4.371.742,33</b>	<b>0,49</b>		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PETRA	FINAXIS	FIDC PREMIUM	5,45	-0,41	-0,41	-1,57	629.998,65	0,07	29.166.363,05	2,16
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	4,78	-4,45	-4,45	-7,43	1.684.008,38	0,19	66.671.443,11	2,53
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>4,02</b>	<b>-3,38</b>	<b>-3,38</b>	<b>-5,90</b>	<b>2.314.007,03</b>	<b>0,26</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,01</b>	<b>-0,04</b>	<b>0,66</b>	<b>5,61</b>	<b>736.070.439,17</b>	<b>82,64</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

11,79%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	15,54	0,37	4,49	4,31	50.363.938,82	5,65	786.927.594,64	6,40
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,19	-0,87	3,90	-9,56	20.577.222,74	2,31	558.947.959,76	3,68
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	12,80	0,66	7,64	12,25	34.042.321,77	3,82	1.212.463.107,40	2,81
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>14,66</b>	<b>0,22</b>	<b>5,38</b>	<b>3,57</b>	<b>104.983.483,33</b>	<b>11,79</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>14,66</b>	<b>0,22</b>	<b>5,38</b>	<b>3,57</b>	<b>104.983.483,33</b>	<b>11,79</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**INVESTIMENTOS NO EXTERIOR**

**4,98%**

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	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,31	0,47	6,56	32,44	14.132.915,96	1,59	788.344.730,75	1,79
SCHRODER	INTRAG	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	15,10	0,63	2,68	30,68	30.261.106,91	3,40	366.369.527,30	8,26
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>15,65</b>	<b>0,58</b>	<b>3,88</b>	<b>31,24</b>	<b>44.394.022,87</b>	<b>4,98</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>15,65</b>	<b>0,58</b>	<b>3,88</b>	<b>31,24</b>	<b>44.394.022,87</b>	<b>4,98</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS**

**0,19%**

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	RJI	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	1,78	-0,02	-0,39	-4,69	185.450,93	0,02	1.313.363,76	14,12
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>1,78</b>	<b>-0,02</b>	<b>-0,39</b>	<b>-4,69</b>	<b>185.450,93</b>	<b>0,02</b>		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,17	-0,05	-0,05	-0,37	1.486.764,33	0,17	27.435.021,81	5,42
GENIAL	RJI	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00	
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>0,17</b>	<b>-0,05</b>	<b>-0,05</b>	<b>-0,37</b>	<b>1.486.764,34</b>	<b>0,17</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>0,25</b>	<b>-0,04</b>	<b>-0,09</b>	<b>-0,87</b>	<b>1.672.215,27</b>	<b>0,19</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,40%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BRCR11	18,85	-0,38	1,41	-4,95	162.949,20	0,02	0,00	
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	12,34	1,53	2,49	3,05	2.159.800,00	0,24	1.347.800.908,67	0,16
QUELUZ	RJI	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	2,62	-2,55	-2,55	-3,30	1.277.254,99	0,14	137.503.413,55	0,93
<b>Sub-total Artigo 11º</b>			<b>5,09</b>	<b>-0,04</b>	<b>0,60</b>	<b>0,37</b>	<b>3.600.004,19</b>	<b>0,40</b>		
<b>Fundos Imobiliários</b>			<b>5,09</b>	<b>-0,04</b>	<b>0,60</b>	<b>0,37</b>	<b>3.600.004,19</b>	<b>0,40</b>		
<b>Total</b>			<b>2,29</b>	<b>0,02</b>	<b>1,35</b>	<b>6,35</b>	<b>890.720.164,83</b>	<b>100,00</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	341.693.546,46	38,36	15,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	387.691.143,35	43,53	10,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	4.371.742,33	0,49	0,00	0,50	30,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	2.314.007,03	0,26	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>736.070.439,17</b>	<b>82,64</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	104.983.483,33	11,79	0,00	15,00	30,00	0,00	35,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>104.983.483,33</b>	<b>11,79</b>					35,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	44.394.022,87	4,98	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>44.394.022,87</b>	<b>4,98</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	185.450,93	0,02	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.486.764,34	0,17	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>1.672.215,27</b>	<b>0,19</b>					15,00
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	3.600.004,19	0,40	0,00	0,50	1,00	0,00	5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>3.600.004,19</b>	<b>0,40</b>					5,00
<b>Total</b>		<b>890.720.164,83</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 a % do CDI	0,71 82,21	6,84 96,41	2,36 91,18	4,85 92,77	10,30 91,84	2.684.545,23	24.989.854,27
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,71 82,04	4,38 61,78	1,98 76,58	3,32 63,48	8,09 72,14	2.305.300,27	13.742.604,58
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-1,11 -127,78	-0,86 -12,08	-1,26 -48,70	-1,16 -22,28	-0,10 -0,88	-49.003,48	-37.803,36
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-3,38 -390,05	-5,90 -83,16	-4,22 -163,37	-4,93 -94,38	-8,59 -76,63	-81.040,43	-145.131,30
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,38 -1,17	3,57 2,22	10,86 -0,53	5,35 -0,06	14,01 -3,50	5.355.094,39	3.620.569,23
Artigo 9º II % do CDI	3,88 447,62	31,24 440,15	15,14 585,79	21,51 411,44	39,52 352,52	1.659.445,67	10.566.574,52
Artigo 10º I % do CDI	-0,39 -44,78	-4,69 -66,11	-1,16 -44,70	-2,27 -43,41	-6,06 -54,02	-723,16	-9.129,56
Artigo 10º II % do CDI	-0,05 -5,55	-0,37 -5,28	-0,14 -5,57	-0,28 -5,45	-0,58 -5,21	-715,74	-5.593,22
Artigo 11º % do CDI	0,60 68,82	0,37 5,24	-1,05 -40,62	-1,04 -19,97	2,16 19,31	21.505,76	16.211,48
<b>HORTOLÂNDIA (Total)</b>						<b>11.894.408,51</b>	<b>52.738.156,64</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,170000%)	22.559.108,54	0,00	0,00	0,00	22.705.601,82	146.493,28	1.461.345,89
NTN-B 150535 (5,813502%)	53.691.024,68	0,00	0,00	0,00	54.068.449,93	377.425,25	3.692.702,87
NTN-B 150545	15.763.503,62	0,00	0,00	0,00	15.943.536,57	180.032,95	-296.781,34
NTN-B 150545 (5,660001%)	22.555.719,48	0,00	0,00	0,00	22.711.419,43	155.699,95	1.529.508,37
NTN-B 150545 (5,859998%)	22.305.551,90	0,00	0,00	0,00	22.463.219,85	157.667,95	1.540.372,31
NTN-B 150545 (6,442001%)	69.624.050,21	0,00	0,00	0,00	70.149.770,11	525.719,90	5.060.031,52
NTN-B 150824	40.536.980,05	0,00	-40.743.020,70	0,00	0,00	206.040,65	2.837.462,62

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,020001%)	54.288.740,52	0,00	0,00	1.417.021,30	53.214.349,74	342.630,52	3.425.390,87
NTN-B 150840 (6,121999%)	82.236.727,90	0,00	0,00	2.392.363,67	80.437.199,01	592.834,78	5.739.821,16
	383.561.406,90	0,00	-40.743.020,70	3.809.384,97	341.693.546,46	2.684.545,23	

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	104.738.960,17	0,00	0,00	0,00	105.223.471,10	484.510,93	1.448.255,51
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	150.570.446,61	11.687.141,01	-7.396.724,41	0,00	156.024.077,39	1.163.214,18	8.736.177,47
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	81.233.614,03	0,00	0,00	0,00	81.714.031,67	480.417,64	3.381.014,08
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	44.552.405,67	0,00	0,00	44.729.563,19	177.157,52	177.157,52
	336.543.020,81	56.239.546,68	-7.396.724,41	0,00	387.691.143,35	2.305.300,27	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRA1 FI RENDA FIXA	153.624,53	0,00	0,00	0,00	153.609,89	-14,64	198,64
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	248.724,36	0,00	0,00	0,00	245.647,74	-3.076,62	-12.555,13
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	4.018.396,92	0,00	0,00	0,00	3.972.484,70	-45.912,22	-25.446,87
	4.420.745,81	0,00	0,00	0,00	4.371.742,33	-49.003,48	

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC PREMIUM	632.565,47	0,00	0,00	0,00	629.998,65	-2.566,82	-10.027,93
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.762.481,99	0,00	0,00	0,00	1.684.008,38	-78.473,61	-135.103,37
	2.395.047,46	0,00	0,00	0,00	2.314.007,03	-81.040,43	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	48.198.276,72	0,00	0,00	0,00	50.363.938,82	2.165.662,10	2.080.486,73

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19.804.904,25	0,00	0,00	0,00	20.577.222,74	772.318,49	-2.174.967,45
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	31.625.207,97	0,00	0,00	0,00	34.042.321,77	2.417.113,80	3.715.049,95
	99.628.388,94	0,00	0,00	0,00	104.983.483,33	5.355.094,39	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13.263.061,99	0,00	0,00	0,00	14.132.915,96	869.853,97	3.461.538,91
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	29.471.515,21	0,00	0,00	0,00	30.261.106,91	789.591,70	7.105.035,61
	42.734.577,20	0,00	0,00	0,00	44.394.022,87	1.659.445,67	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	186.174,09	0,00	0,00	0,00	185.450,93	-723,16	-9.129,56
	186.174,09	0,00	0,00	0,00	185.450,93	-723,16	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	1.487.480,07	0,00	0,00	0,00	1.486.764,33	-715,74	-5.593,22
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,01	0,00	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00
	1.487.480,08	0,00	0,00	0,00	1.486.764,34	-715,74	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRCR11	162.267,54	0,00	0,00	0,00	1.623,00	162.949,20	2.304,66	-8.744,19
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	2.127.200,00	0,00	0,00	0,00	20.000,00	2.159.800,00	52.600,00	68.600,00
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	1.310.653,89	0,00	0,00	0,00	0,00	1.277.254,99	-33.398,90	-43.644,33
	3.600.121,43	0,00	0,00	0,00	21.623,00	3.600.004,19	21.505,76	

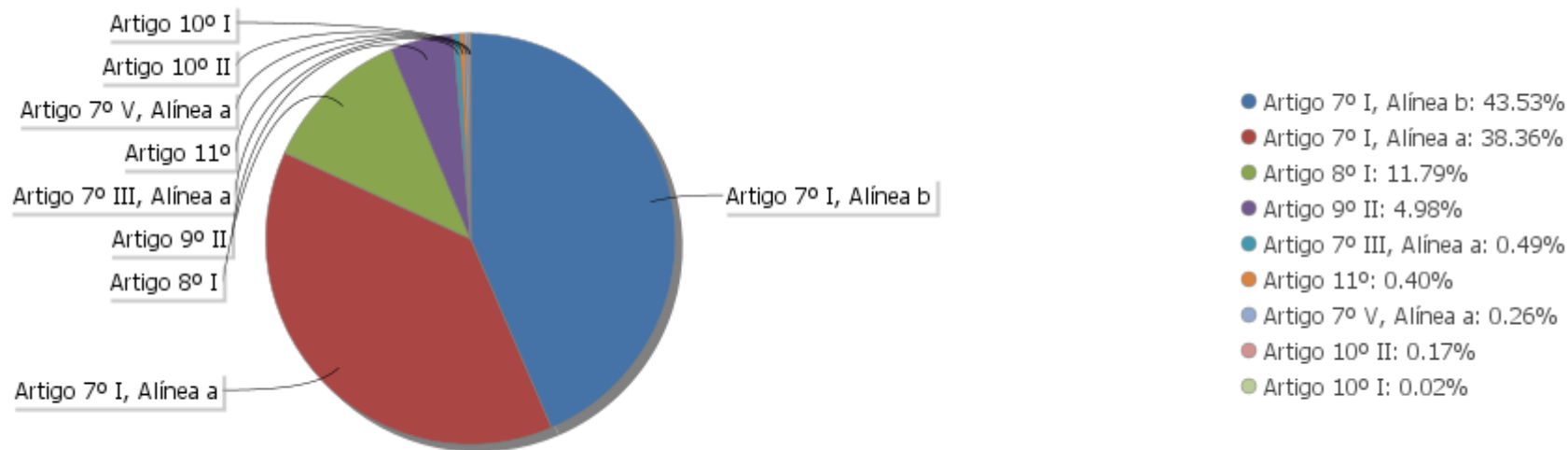
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

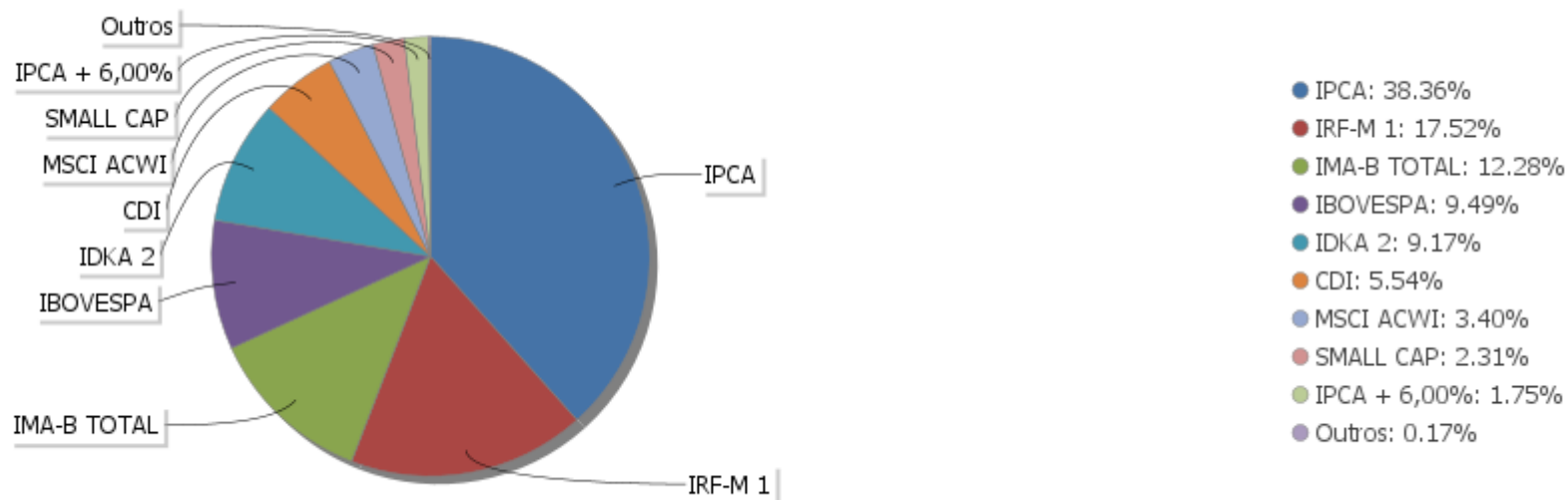
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	507.175.499,28	56,94		507.175.499,28	56,94	
de 31 dias a 365 dias	37.479.376,76	4,21		544.654.876,04	61,15	
acima de 365 dias	346.065.288,79	38,85		890.720.164,83	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

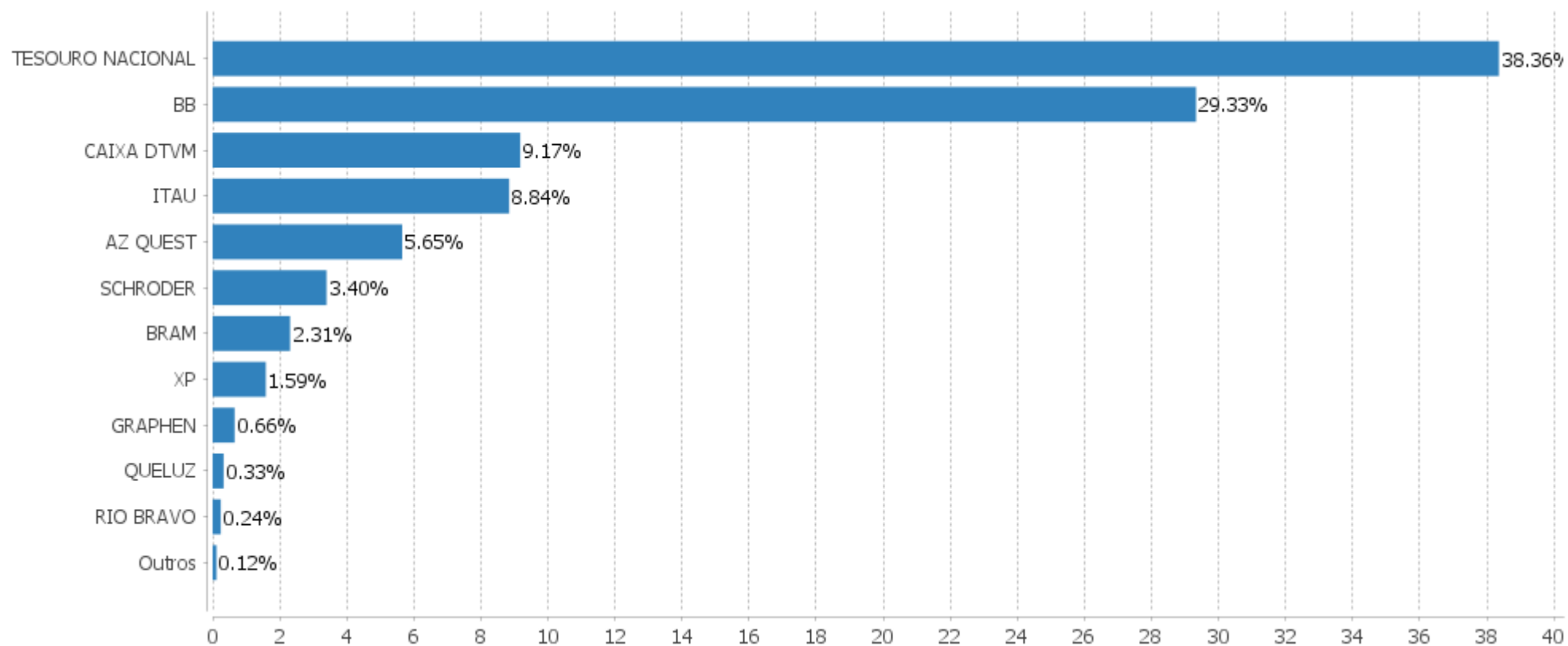


Alocação Por Estratégia



## 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	0,25	1,11	0,97	-0,30	0,56	0,86	1,39	1,35					6,35
IPCA + 4,96%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,82	0,40					6,25
p.p. indexador	-0,60	-0,09	0,43	-1,11	-0,31	0,27	0,57	0,95					0,10
2023	1,31	0,04	0,95	0,97	1,73	1,67	1,11	-0,32	0,09	-0,54	2,67	1,99	12,25
IPCA + 4,97%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,32	0,53	0,67	0,65	0,65	0,67	0,95	9,76
p.p. indexador	0,35	-1,15	-0,21	0,02	1,07	1,34	0,59	-1,00	-0,55	-1,19	2,01	1,04	2,49
2022	-0,33	0,06	2,07	-0,52	0,46	-1,47	1,16	1,34	0,23	2,17	-1,21	0,49	4,46
IPCA + 4,84%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,29	0,07	0,10	0,97	0,79	1,04	10,88
p.p. indexador	-1,26	-1,31	0,03	-1,94	-0,43	-2,54	1,45	1,27	0,13	1,20	-2,00	-0,55	-6,43
2021	-0,37	-0,60	0,51	1,09	1,28	0,17	-0,77	-1,12	-0,53	-1,71	0,97	0,80	-0,33
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
p.p. indexador	-1,04	-1,84	-0,90	0,36	0,01	-0,80	-2,19	-2,46	-2,14	-3,38	-0,40	-0,42	-16,32
2020	0,74	-0,95	-6,76	0,85	2,01	1,95	2,67	-0,62	-1,01	0,15	2,81	2,88	4,40
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	0,03	-1,61	-7,33	0,71	1,94	1,21	1,79	-1,34	-2,13	-1,19	1,46	1,02	-6,22
2019	2,83	0,10	0,40	1,16	1,59	2,44	1,21	0,05	1,70	1,87	-0,25	2,19	16,35
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	2,00	-0,79	-0,79	0,10	0,95	1,99	0,49	-0,57	1,25	1,24	-1,23	0,55	5,76

**Performance Sobre a Meta Atuarial**

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	33	48,53
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	51,47
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,88	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-6,76	2020-03

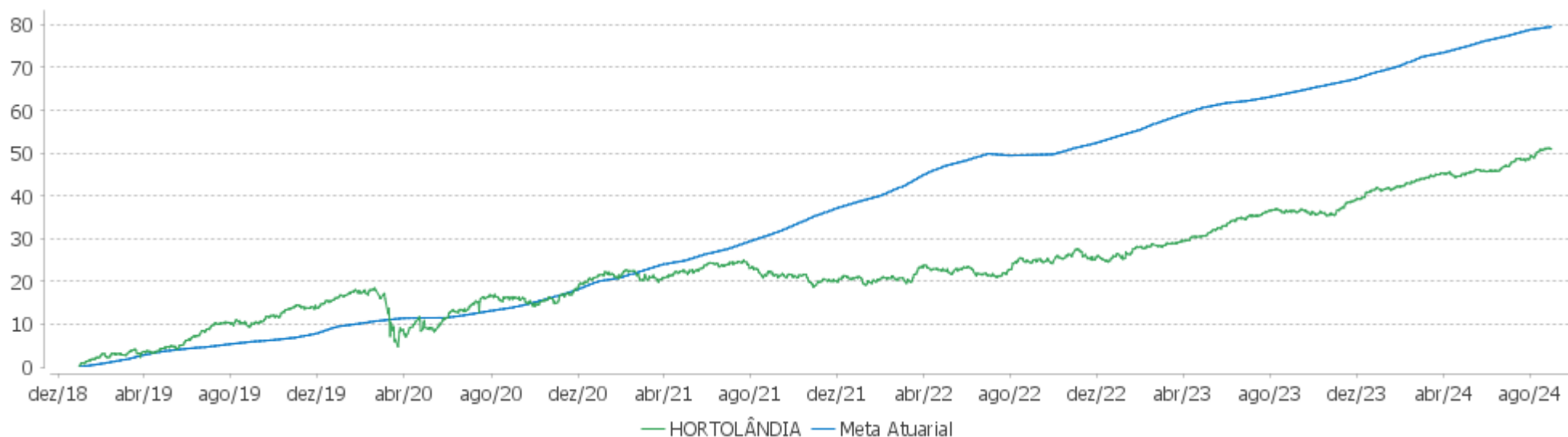
**Relatório**

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,64	1,83	1,81	1,98
06 meses	4,92	4,11	0,81	1,91
12 meses	10,86	9,37	1,49	2,29
24 meses	21,36	20,02	1,33	2,88
36 meses	24,08	37,06	-12,98	3,21
48 meses	30,34	58,66	-28,32	3,57
60 meses	37,05	72,14	-35,09	5,40
Desde 31/12/2018	50,98	83,49	-32,51	5,23

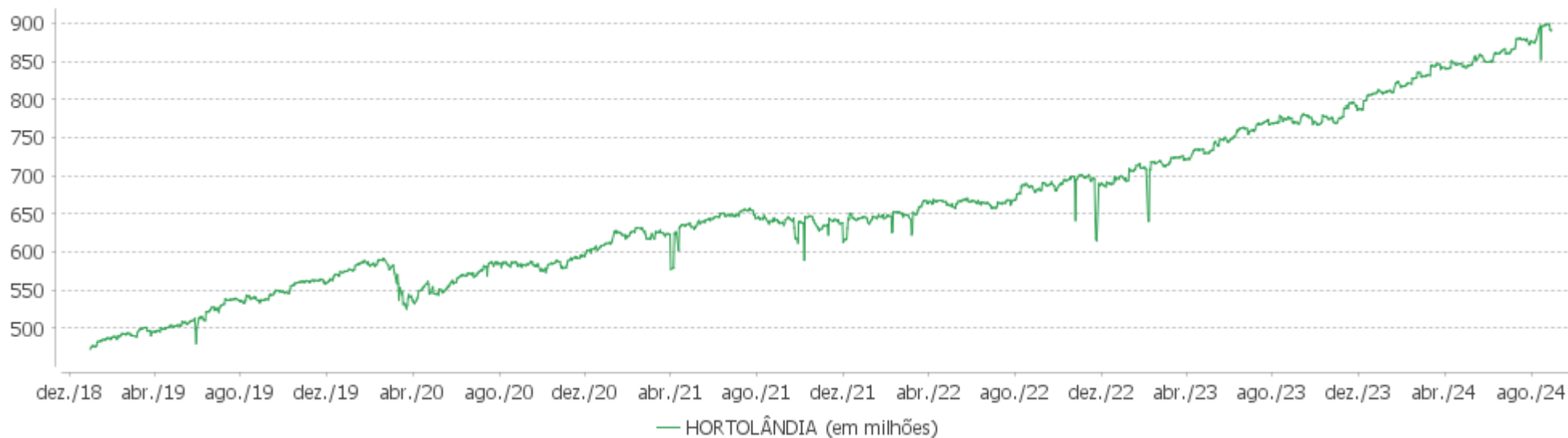


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

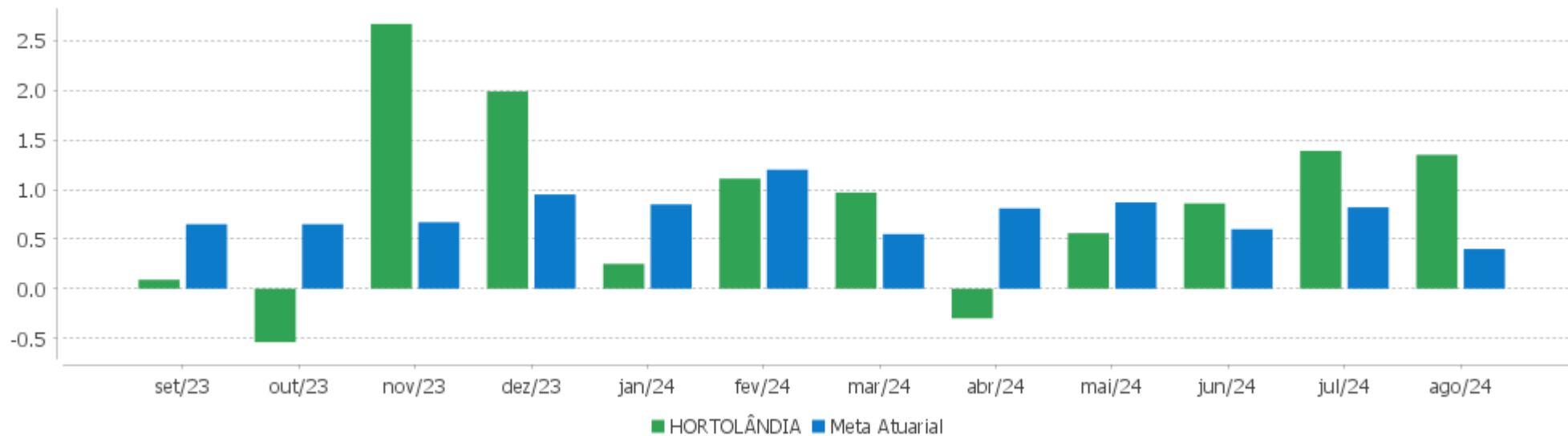


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	1,14 1,16	-1,72 -4,58	1,57 1,00	-0,62 -2,20	2,82 -1,42	19,00 9,96	18,71 0,15
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	7,59 7,61	15,03 12,17	9,94 9,37	12,87 11,29	18,76 14,52	32,21 23,17	44,21 25,65
NTN-B 150545 (6,442001%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,78	7,62 4,77	2,49 1,92	5,35 3,77	11,26 7,02	19,80 10,76	
NTN-B 150545 (5,660001%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,71	7,09 4,24	2,29 1,72	4,95 3,38	10,43 6,19	21,70 12,66	36,92 18,37
NTN-B 150535 (5,813502%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,72	7,20 4,34	2,33 1,76	5,03 3,45	10,52 6,28	21,98 12,94	33,46 14,91
NTN-B 150840 (6,121999%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,75	7,41 4,55	2,41 1,84	5,19 3,61	10,88 6,65	22,74 13,69	34,46 15,90
NTN-B 150840 (5,020001%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,66	6,66 3,80	2,13 1,56	4,63 3,05	9,71 5,48	20,18 11,14	38,20 19,64
NTN-B 150535 (5,170000%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,67	6,76 3,91	2,17 1,60	4,71 3,13	9,84 5,60	20,49 11,45	38,75 20,20
NTN-B 150545 (5,859998%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,73	7,23 4,38	2,34 1,77	5,06 3,48	10,64 6,40	22,17 13,12	37,61 19,05
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,74 -0,02	6,13 -0,17	2,27 -0,09	4,45 -0,18	10,09 -0,30	24,84 -0,73	35,82 -1,10
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,59 -0,00	4,32 -0,29	1,52 -0,01	3,11 -0,22	7,68 -0,26	20,09 -0,58	31,00 -1,05
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,46 -0,05	1,29 -0,20	1,54 -0,09	1,24 -0,15	5,04 -0,28	19,17 -0,65	25,43 -1,02
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,87 100,21	7,05 99,40	2,58 99,78	5,20 99,41	11,12 99,17	26,11 99,33	39,01 99,61
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,41 -46,78	-1,57 -22,08	-1,39 -53,92	-0,64 -12,30	-7,56 -67,47	-6,65 -25,32	-62,67 -160,03
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-4,45 -513,25	-7,43 -104,65	-5,24 -202,72	-6,45 -123,30	-8,97 -80,00	-9,93 -37,78	-6,33 -16,16
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01 -0,53	0,13 -1,37	-0,02 -1,65	-0,02 -1,42	0,69 -4,62	8,21 -11,60	13,18 -13,27
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	-1,14	-0,64	-1,04	-1,01	0,40	6,49	7,65

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.	-1,66	-2,13	-2,66	-2,41	-4,91	-13,32	-18,81
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-1,24 -1,83	-4,86 -9,74	-5,43 -7,34	-4,22 -7,78	-7,96 -16,10	-47,91 -68,99	-46,49 -79,53
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,49 -2,05	4,31 2,95	11,15 -0,24	5,88 0,47	12,40 -5,10	13,42 -10,76	-3,48 -17,98
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	7,64 1,10	12,25 10,89	15,21 3,82	11,73 6,32	30,30 12,80	27,56 3,38	13,16 -1,34
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	3,90 -0,61	-9,56 0,13	3,71 -1,94	-4,83 -1,01	-2,72 -0,54	-12,85 -8,78	-27,38 -1,96
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. MSCI ACWI p.p.	2,68 0,39	30,68 -3,29	14,63 0,10	23,52 -0,78	37,92 -1,71	50,75 2,25	23,23 -0,45
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	6,56 6,07	32,44 25,49	16,26 14,16	17,41 12,78	43,06 32,62	68,48 46,05	2,30 -38,81
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,39 -44,78	-4,69 -66,11	-1,16 -44,70	-2,27 -43,41	-6,06 -54,02	-12,02 -45,72	-16,82 -42,95
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,00 -0,49	0,00 -6,95	0,00 -2,09	0,00 -4,63	0,00 -10,44	0,00 -22,43	0,00 -41,11
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,05 -0,54	-0,37 -7,33	-0,14 -2,24	-0,28 -4,92	-0,58 -11,02	-1,17 -23,60	-2,04 -43,15
BRCR11 Var. IBOVESPA p.p.	1,41 -5,13	-4,95 -6,31	-4,84 -16,23	-6,86 -12,27	-5,61 -23,11	-10,34 -34,52	-11,72 -26,22
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p.	-2,55 -3,40	-3,30 -5,78	-2,78 -3,11	-3,09 -4,09	-3,82 -9,44	-6,13 -20,15	8,05 -15,36
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII % do CDI	2,49 286,70	3,05 43,04	0,32 12,22	0,69 13,12	16,47 146,97	48,73 185,41	47,86 122,21
HORTOLÂNDIA Var. IPCA + 4,96% p.p.	1,35 0,95	6,35 0,10	3,64 1,81	4,92 0,81	10,86 1,49	21,36 1,30	24,08 -12,92
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO ÍNDICE SMALL CAP - SMLL, APURADO PELA B3.	2,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRA1 FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1440	D+1445		1,30
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	Não se aplica	Não se aplica				
BRCR11	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	Não se aplica	Não se aplica				
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	D+0	D+0	D+30 ou D+1800 (isento de taxa de resgate)	D+31 ou D+1801 (isento de taxa de resgate)		0,00
FIDC PREMIUM	Não se aplica	Não se aplica				
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1008 du	D+1009 du	PERÍODO SEMESTRAL, C /VENCIMENTO NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DE DEZEMBRO E JUNHO.	0,00
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	Não se aplica	Não se aplica				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,77	6,30	2,36	4,62	10,39	25,57	36,92	39,98	47,06
IRF-M 1+	0,60	2,39	1,43	1,43	7,39	24,61	30,60	26,26	39,69
IRF-M TOTAL	0,66	3,54	1,70	2,39	8,26	24,46	32,14	30,49	41,85
IMA-B 5	0,59	4,88	1,91	3,56	8,14	21,08	33,04	39,39	52,27
IMA-B 5+	0,77	-1,21	1,69	-0,25	3,11	18,58	20,29	22,46	28,23
IMA-B TOTAL	0,52	1,49	1,63	1,40	5,32	19,81	26,45	30,58	39,25
IMA-GERAL TOTAL	0,79	4,63	2,21	3,49	8,81	23,74	33,48	35,98	44,83
IDKA 2	0,60	4,60	1,53	3,33	7,94	20,67	32,05	38,75	52,22
IDKA 20	0,42	-6,26	1,27	-3,24	-0,28	18,04	10,08	10,85	10,58
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

Renda Variável

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

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Investimentos Estruturados**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	2,18	38,35	15,49	25,80	44,00	55,98	37,34	66,82	163,79

**Investimentos Imobiliários**

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

**Investimentos no Exterior**

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

**Indicadores Econômicos**

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

**Meta Atuarial**

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



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (5,170000%)	22.705.601,82	5,170000	20.953.527,00	6,239600	-1.752.074,82
NTN-B 150535 (5,813502%)	54.068.449,93	5,813502	52.379.491,87	6,239600	-1.688.958,06
NTN-B 150545 (5,660001%)	22.711.419,43	5,660001	21.263.769,45	6,243000	-1.447.649,98
NTN-B 150545 (5,859998%)	22.463.219,85	5,859998	21.516.909,56	6,243000	-946.310,29
NTN-B 150545 (6,442001%)	70.149.770,11	6,442001	71.711.590,51	6,243000	1.561.820,40
NTN-B 150840 (5,020001%)	53.214.349,74	5,020001	47.603.983,95	6,130500	-5.610.365,79
NTN-B 150840 (6,121999%)	80.437.199,01	6,121999	80.370.028,54	6,130500	-67.170,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
303	01/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	50.000,00	13.445,19836600	3,7187997260
308	02/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	114.000,00	30.614,63595500	3,7237091490
306	08/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	383.692,00	0,00	102.981,26309300	3,7258428230
302	09/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	60.000,00	16.101,10000100	3,7264534720
305	12/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	9.352.944,00	0,00	2.509.017,10817900	3,7277322540
301	12/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	712.026,12	0,00	191.007,84913800	3,7277322540
304	14/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.238.478,89	0,00	331.902,35519500	3,7314555640
310	15/08/2024	NTN-B 150824	0,00	40.743.020,70	9.169,99999642	4.443,0775044600
309	16/08/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	44.552.405,67	0,00	646.442,32693000	68,9193820000
299	20/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	150.000,00	40.153,87176700	3,7356298010
307	28/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	6.875.960,98	1.837.555,45830800	3,7419066450
300	28/08/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	146.763,43	39.221,56374400	3,7419066450
<b>Total</b>			<b>56.239.546,68</b>	<b>48.139.745,11</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 8.973.726,77

Value-At-Risk: 1,01%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,52	0,54		0,28	-0,12	0,69	736.070.439,17	82,64
Artigo 8º	13,88	6,17		0,64	0,32	5,38	104.983.483,33	11,79
Artigo 9º	29,12	9,03		0,09	0,10	3,88	44.394.022,87	4,98
Artigo 10º	0,14	0,01		0,00	-6,58	-0,09	1.672.215,27	0,19
Artigo 11º	2,15	2,50		-0,00	-0,13	0,60	3.600.004,19	0,40
HORTOLÂNDIA		1,01		1,01			890.720.164,83	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,54%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	23,24	NaN	0,00	NaN	0,29	7,59	0,00	0,00
NTN-B 150535 (5,170000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-1,20	0,65	22.705.601,82	2,55
NTN-B 150535 (5,813502%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,91	0,70	54.068.449,93	6,07
NTN-B 150840 (5,020001%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-1,27	0,64	53.214.349,74	5,97
NTN-B 150840 (6,121999%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,77	0,73	80.437.199,01	9,03
NTN-B 150545	8,97	3,37	0,03	3,37	0,03	1,14	15.943.536,57	1,79
NTN-B 150545 (5,660001%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,98	0,69	22.711.419,43	2,55
NTN-B 150545 (5,859998%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,89	0,71	22.463.219,85	2,52
NTN-B 150545 (6,442001%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,62	0,76	70.149.770,11	7,88
<b>Sub-total</b>	0,52	0,17	0,03		-0,30	0,71	341.693.546,46	38,36

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
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,10	2,03	0,14	0,04	-0,08	0,46	105.223.471,10	11,81
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,64	0,29	0,03	0,01	-0,20	0,74	156.024.077,39	17,52

**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
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,83	1,36	0,07	0,24	-0,10	0,59	81.714.031,67	9,17
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,01	0,01	0,00	0,01	0,15	0,87	44.729.563,19	5,02
<b>Sub-total</b>	<b>2,31</b>	<b>0,90</b>	<b>0,24</b>		<b>-0,07</b>	<b>0,71</b>	<b>387.691.143,35</b>	<b>43,53</b>

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
BRA1 FI RENDA FIXA	0,13	0,14	0,00	2,03	-6,98	-0,01	153.609,89	0,02
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	1,41	0,18	0,00	1,07	-1,50	-1,24	245.647,74	0,03
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	5,24	0,53	0,00	1,88	-0,38	-1,14	3.972.484,70	0,45
<b>Sub-total</b>	<b>4,76</b>	<b>0,48</b>	<b>0,00</b>		<b>-0,41</b>	<b>-1,11</b>	<b>4.371.742,33</b>	<b>0,49</b>

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC PREMIUM	1,38	0,01	-0,00	0,01	-0,93	-0,41	629.998,65	0,07
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	15,41	0,29	0,00	0,29	-0,35	-4,45	1.684.008,38	0,19
<b>Sub-total</b>	<b>11,65</b>	<b>0,21</b>	<b>0,00</b>		<b>-0,36</b>	<b>-3,38</b>	<b>2.314.007,03</b>	<b>0,26</b>

**Renda Variável**

**Value-At-Risk: 6,17%**

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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	14,60	6,38	0,31	3,32	0,25	4,49	50.363.938,82	5,65
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	17,89	8,64	0,16	3,41	0,17	3,90	20.577.222,74	2,31
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	13,14	5,74	0,18	3,27	0,52	7,64	34.042.321,77	3,82
<b>Sub-total</b>	<b>13,88</b>	<b>6,17</b>	<b>0,64</b>		<b>0,32</b>	<b>5,38</b>	<b>104.983.483,33</b>	<b>11,79</b>

**Investimentos no Exterior**

**Value-At-Risk: 9,03%**

Artigo 9º II

**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
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,42	9,23	0,03	9,24	0,18	6,56	14.132.915,96	1,59
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	28,78	9,45	0,06	9,14	0,06	2,68	30.261.106,91	3,40
<b>Sub-total</b>	29,12	9,03	0,09		0,10	3,88	44.394.022,87	4,98

**Fundos Imobiliários**

Value-At-Risk: 2,50%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRCR11	13,93	7,27	0,00	9,12	0,04	1,41	162.949,20	0,02
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	5,91	4,04	-0,00	4,04	0,27	2,49	2.159.800,00	0,24
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	8,74	0,14	0,00	2,39	-0,39	-2,55	1.277.254,99	0,14
<b>Sub-total</b>	2,15	2,50	-0,00		-0,13	0,60	3.600.004,19	0,40

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 0,01%

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
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	0,00	0,00	0,00	0,00	-2.800,05	-0,39	185.450,93	0,02
<b>Sub-total</b>	0,00	0,00	0,00		-2.866,41	-0,39	185.450,93	0,02

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,16	0,01	0,00	0,06	-5,62	-0,05	1.486.764,33	0,17
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	0,00	0,00	0,00	0,06	0,00	0,00	0,01	0,00
<b>Sub-total</b>	0,16	0,01	0,00		-5,62	-0,05	1.486.764,34	0,17

(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 (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS