



LDB
EMPRESAS

HORTOLÂNDIA
AGOSTO 2023



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 31.08.2023.

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

83,17%

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	2,05	-0,01	0,92	7,79	37.780.680,38	4,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	8,61	-1,06	-1,56	15,28	16.427.504,41	2,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,170000%)	0,41	0,03	0,69	7,10	21.829.148,19	2,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,813502%)	0,46	0,03	0,74	7,53	51.807.077,31	6,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,660001%)	0,41	0,03	0,73	7,43	21.748.197,00	2,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,859998%)	0,41	0,03	0,75	7,56	21.497.357,97	2,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,442001%)	3,08	0,04	0,80	6,32	67.021.815,49	8,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020001%)	0,41	0,03	0,67	6,99	51.124.328,94	6,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,121999%)	0,41	0,04	0,77	7,74	76.934.265,05	10,01
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,79	-0,02	0,66	7,86	366.170.374,74	47,65

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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,03	1,12	8,82	105.705.863,20	13,75	6.785.029.538,03	1,56
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,89	-0,64	-0,40	11,65	84.477.004,21	10,99	5.260.991.740,78	1,61
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	-0,17	0,77	8,41	75.887.967,05	9,87	5.504.316.744,32	1,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,30	-0,24	0,55	9,78	266.070.834,46	34,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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				
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA B FI RENDA FIXA	1,14	-0,05	0,39	3,64	3.956.519,03	0,51	74.966.974,97	5,28
QUELUZ	RJI	BRA1 FI RENDA FIXA	0,59	0,00	0,62	4,62	152.550,75	0,02	3.657.589,15	4,17
VERITAS	RJI	FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	39,90	-0,03	-2,08	-36,96	280.417,79	0,04	42.753.364,96	0,66
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			3,65	-0,05	0,24	-0,51	4.389.487,57	0,57		

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				
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,05	-0,38	-0,38	-1,74	1.849.897,36	0,24	73.239.138,77	2,53
PETRA	FINAXIS	FIDC PREMIUM	13,59	-0,45	-0,45	-8,83	681.549,32	0,09	31.424.912,92	2,17
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			4,03	-0,40	-0,40	-3,75	2.531.446,68	0,33		
Renda Fixa			1,53	-0,11	0,60	8,47	639.162.143,45	83,17		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

11,98%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	24,61	-2,57	-10,28	-3,77	21.152.490,13	2,75	681.339.924,33	3,10
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,94	-1,94	-6,24	6,99	44.806.633,86	5,83	811.429.533,50	5,52
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,06	-0,77	-4,95	-3,99	26.125.574,06	3,40	1.414.031.639,81	1,85
Sub-total Artigo 8º I			19,44	-1,76	-6,84	1,11	92.084.698,05	11,98		
Renda Variável			19,44	-1,76	-6,84	1,11	92.084.698,05	11,98		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,14%

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	30,05	2,56	1,35	27,77	9.878.751,19	1,29	665.927.943,70	1,48
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	22,56	1,94	1,30	6,09	21.941.065,65	2,85	297.474.925,12	7,38
Sub-total Artigo 9º II			23,63	2,13	1,32	11,99	31.819.816,84	4,14		
Investimentos no Exterior			23,63	2,13	1,32	11,99	31.819.816,84	4,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,22%

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	2,29	-0,02	-0,37	-2,87	197.405,12	0,03	1.398.023,25	14,12
Sub-total Artigo 10º I			2,29	-0,02	-0,37	-2,87	197.405,12	0,03		

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	-0,01	-0,01	-0,39	1.495.494,79	0,19	27.614.114,87	5,42
GENIAL	RJI	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
Sub-total Artigo 10º II				-0,01	-0,01	0,93	1.495.494,79	0,19		
Investimentos Estruturados				-0,01	-0,05	0,47	1.692.899,91	0,22		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,49%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	13,11	2,55	2,55	31,10	2.236.000,00	0,29	1.252.971.176,76	0,18
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BRCR11	24,73	-9,33	-9,33	9,56	198.006,00	0,03	2.661.291.864,16	0,01
QUELUZ	RJI	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	0,88	-0,15	-0,15	-1,84	1.327.949,99	0,17	142.961.004,61	0,93
Sub-total Artigo 11º			8,17	0,89	0,89	16,40	3.761.955,99	0,49		
Fundos Imobiliários			8,17	0,89	0,89	16,40	3.761.955,99	0,49		
Total			3,36	-0,22	-0,32	7,69	768.521.514,24	100,00		

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
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	366.170.374,74	47,65	20,00	30,00	65,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	266.070.834,46	34,62	15,00	41,80	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	4.389.487,57	0,57	0,00	1,00	15,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	2.531.446,68	0,33	0,00	0,50	1,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	639.162.143,45	83,17					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	92.084.698,05	11,98	3,00	10,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	92.084.698,05	11,98					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	31.819.816,84	4,14	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	31.819.816,84	4,14					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	197.405,12	0,03	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.495.494,79	0,19	0,00	0,20	2,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	1.692.899,91	0,22					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	3.761.955,99	0,49	0,00	0,50	1,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	3.761.955,99	0,49					5,00
Total		768.521.514,24	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	0,66 57,68	7,86 88,63	1,89 57,04	5,69 85,25	10,62 78,33	2.409.025,49	26.536.219,11
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,55 48,07	9,78 110,35	3,00 90,52	7,47 111,91	12,87 94,93	1.399.156,96	22.930.459,33
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,24 20,64	-0,51 -5,73	0,86 26,01	-0,65 -9,70	0,40 2,98	10.298,52	-22.844,36
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,40 -34,83	-3,75 -42,33	-1,16 -34,97	-3,83 -57,31	-0,52 -3,80	-10.085,90	-98.726,61
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-6,84 -1,76	1,11 -4,36	3,37 -3,47	5,37 -4,93	-2,77 -8,44	-6.764.225,93	1.010.785,67
Artigo 9º II % do CDI	1,32 115,57	11,99 135,21	2,01 60,51	6,71 100,54	11,80 87,06	413.524,60	3.406.230,95
Artigo 10º I % do CDI	-0,37 -32,74	-2,87 -32,36	-1,09 -32,77	-2,19 -32,80	-6,35 -46,82	-739,13	-5.831,79
Artigo 10º II % do CDI	-0,01 -0,78	0,93 10,50	-0,12 -3,65	-0,29 -4,30	0,72 5,32	-133,69	14.060,65
Artigo 11º % do CDI	0,89 78,37	16,40 185,00	9,28 279,44	16,28 243,85	13,48 99,46	33.481,68	540.764,40
HORTOLÂNDIA (Total)						-2.509.697,40	54.311.117,35

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%)	21.680.444,57	0,00	0,00	0,00	21.829.148,19	148.703,62	1.474.686,34
NTN-B 150535 (5,813502%)	51.425.573,13	0,00	0,00	0,00	51.807.077,31	381.504,18	3.702.830,35
NTN-B 150545	16.687.035,13	0,00	0,00	0,00	16.427.504,41	-259.530,72	2.219.316,56
NTN-B 150545 (5,660001%)	21.590.879,68	0,00	0,00	0,00	21.748.197,00	157.317,32	1.533.750,90
NTN-B 150545 (5,859998%)	21.338.167,45	0,00	0,00	0,00	21.497.357,97	159.190,52	1.542.390,62
NTN-B 150545 (6,442001%)	66.492.276,73	0,00	0,00	0,00	67.021.815,49	529.538,76	4.060.343,76
NTN-B 150824	38.548.213,51	0,00	0,00	1.119.539,29	37.780.680,38	352.006,16	2.834.722,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,020001%)	52.134.735,95	0,00	0,00	1.356.022,13	51.124.328,94	345.615,12	3.446.697,67
NTN-B 150840 (6,121999%)	78.628.963,02	0,00	0,00	2.289.378,50	76.934.265,05	594.680,53	5.721.480,41
					366.170.374,74	2.409.025,49	

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	84.817.354,09	0,00	0,00	0,00	84.477.004,21	-340.349,88	8.811.987,74
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	97.780.535,95	13.119.000,00	-6.350.000,00	0,00	105.705.863,20	1.156.327,25	7.472.445,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	75.304.787,46	0,00	0,00	0,00	75.887.967,05	583.179,59	5.885.429,03
					266.070.834,46	1.399.156,96	

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	151.609,13	0,00	0,00	0,00	152.550,75	941,62	9.107,09
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	286.381,04	0,00	0,00	0,00	280.417,79	-5.963,25	-170.908,56
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	3.941.198,88	0,00	0,00	0,00	3.956.519,03	15.320,15	138.957,11
					4.389.487,57	10.298,52	

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	684.613,15	0,00	0,00	0,00	681.549,32	-3.063,83	-66.028,90
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.856.919,43	0,00	0,00	0,00	1.849.897,36	-7.022,07	-32.697,71
					2.531.446,68	-10.085,90	

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	47.788.217,85	0,00	0,00	0,00	44.806.633,86	-2.981.583,99	2.926.931,28
BRANDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	23.575.374,17	0,00	0,00	0,00	21.152.490,13	-2.422.884,04	-829.660,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	27.485.331,96	0,00	0,00	0,00	26.125.574,06	-1.359.757,90	-1.086.485,25
					92.084.698,05	-6.764.225,93	

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	9.747.564,67	0,00	0,00	0,00	9.878.751,19	131.186,52	2.146.845,81
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	21.658.727,57	0,00	0,00	0,00	21.941.065,65	282.338,08	1.259.385,14
					31.819.816,84	413.524,60	

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	198.144,25	0,00	0,00	0,00	197.405,12	-739,13	-5.831,80
					197.405,12	-739,13	

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	1.495.628,48	0,00	0,00	0,00	1.495.494,79	-133,69	-5.855,63
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
					1.495.494,79	-133,69	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRCR11	219.981,42	0,00	0,00	0,00	1.460,70	198.006,00	-20.514,72	17.658,24
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	2.200.000,00	0,00	0,00	0,00	20.000,00	2.236.000,00	56.000,00	548.000,00
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	1.329.953,59	0,00	0,00	0,00	0,00	1.327.949,99	-2.003,60	-24.893,84
						3.761.955,99	33.481,68	

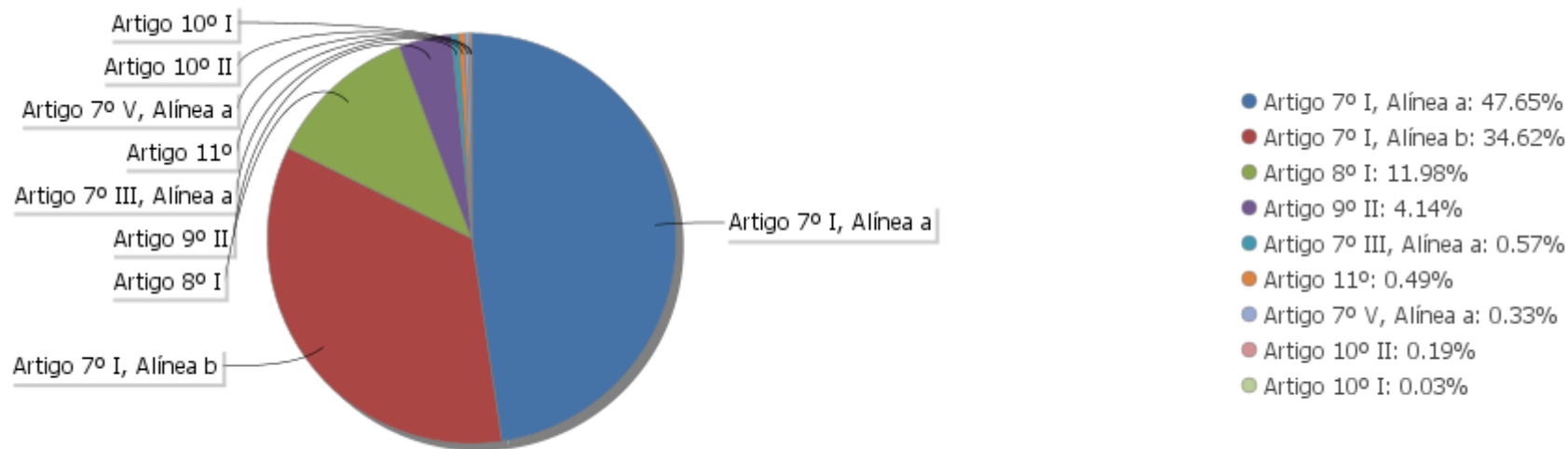
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

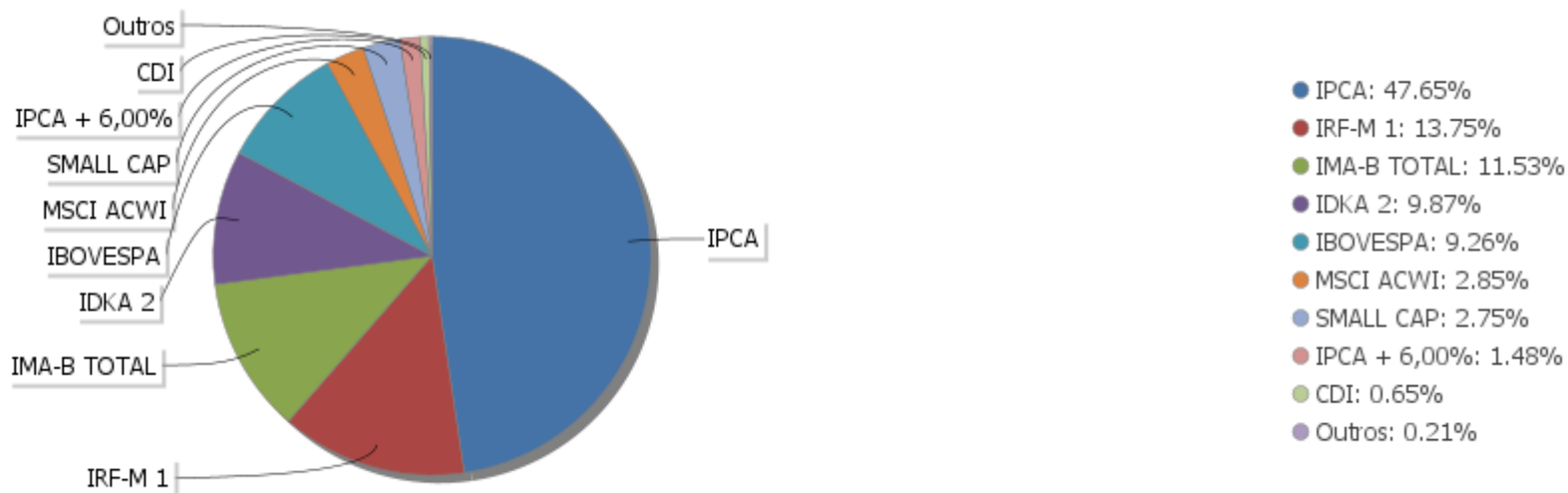
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	368.272.127,88	47,92	368.272.127,88	47,92	
de 31 dias a 365 dias	63.906.254,44	8,32	432.178.382,32	56,24	
acima de 365 dias	336.343.131,92	43,76	768.521.514,24	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

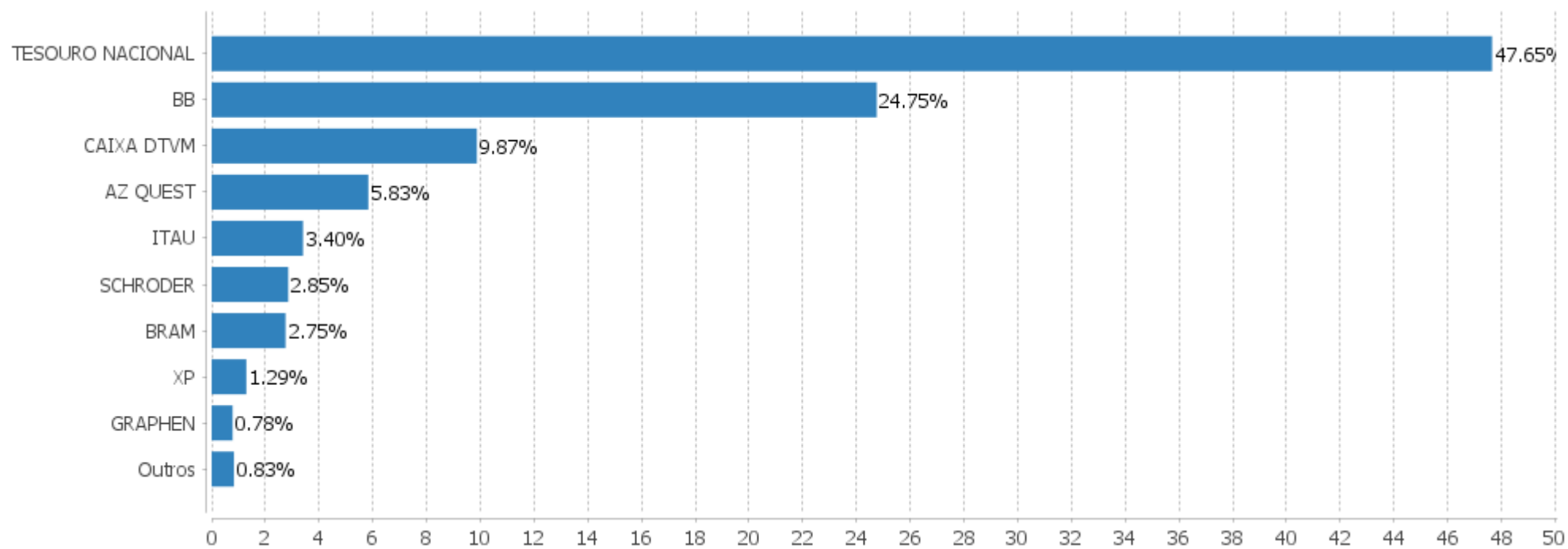


Alocação Por Estratégia



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
2023	1,31	0,04	0,95	0,97	1,73	1,67	1,11	-0,32					7,69
IPCA + 4,97%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,32	0,53	0,67					6,62
p.p. indexador	0,35	-1,15	-0,21	0,02	1,07	1,34	0,59	-1,00					1,06
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

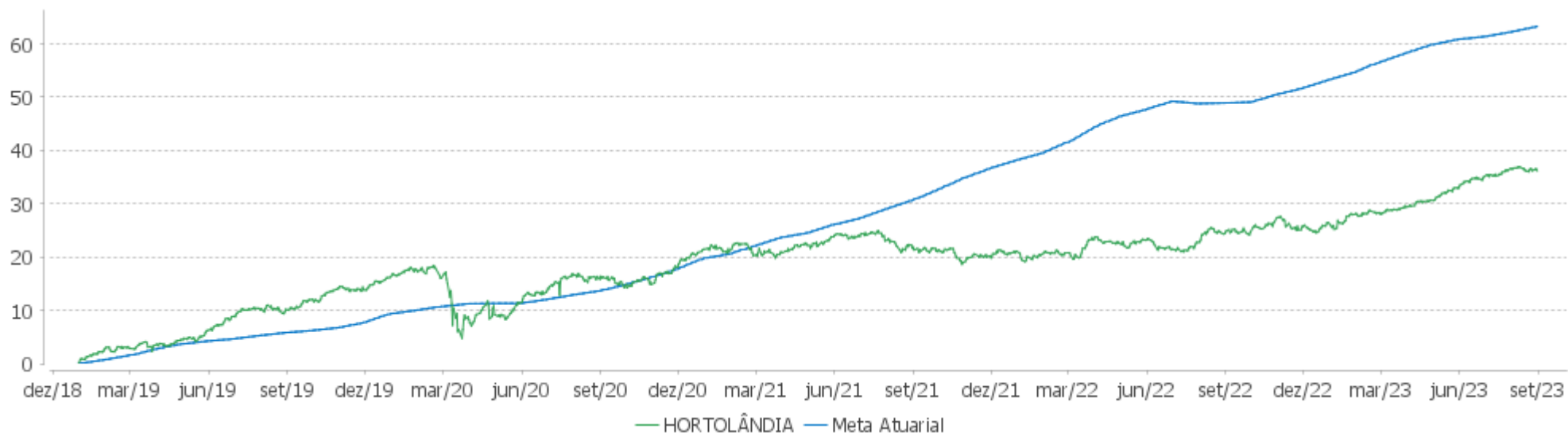
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	27	48,21
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	51,79
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,88	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-6,76	2020-03

Relatório

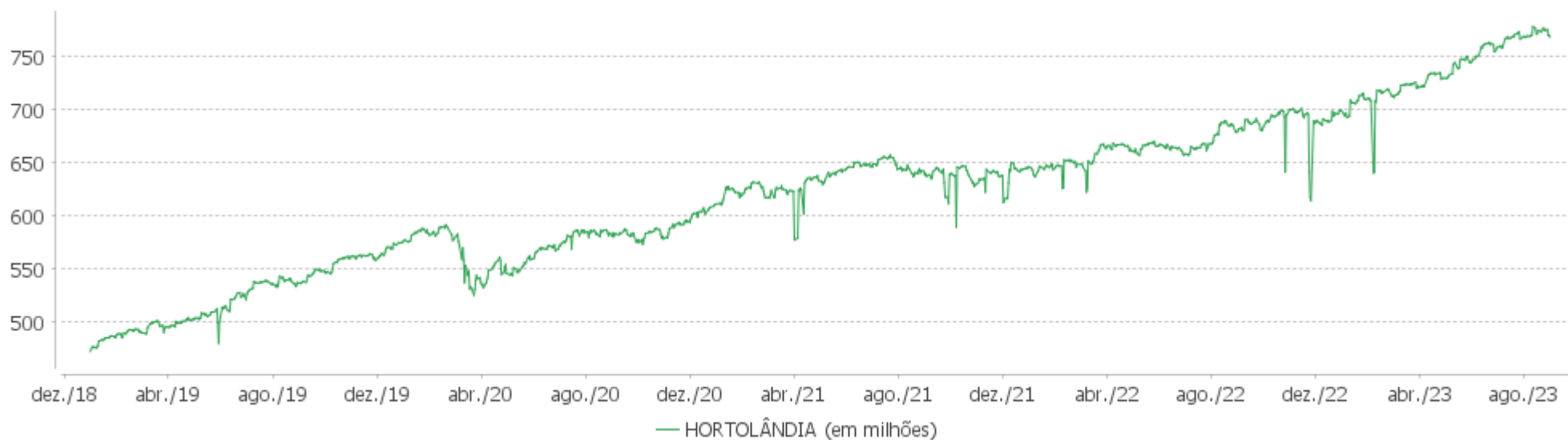
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,46	1,53	0,93	2,32
06 meses	6,25	4,37	1,88	2,09
12 meses	9,47	9,74	-0,27	3,36
24 meses	11,93	25,32	-13,39	3,58
36 meses	17,57	45,07	-27,50	3,90
48 meses	23,62	57,39	-33,77	5,92
Desde 31/12/2018	36,19	67,77	-31,58	5,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

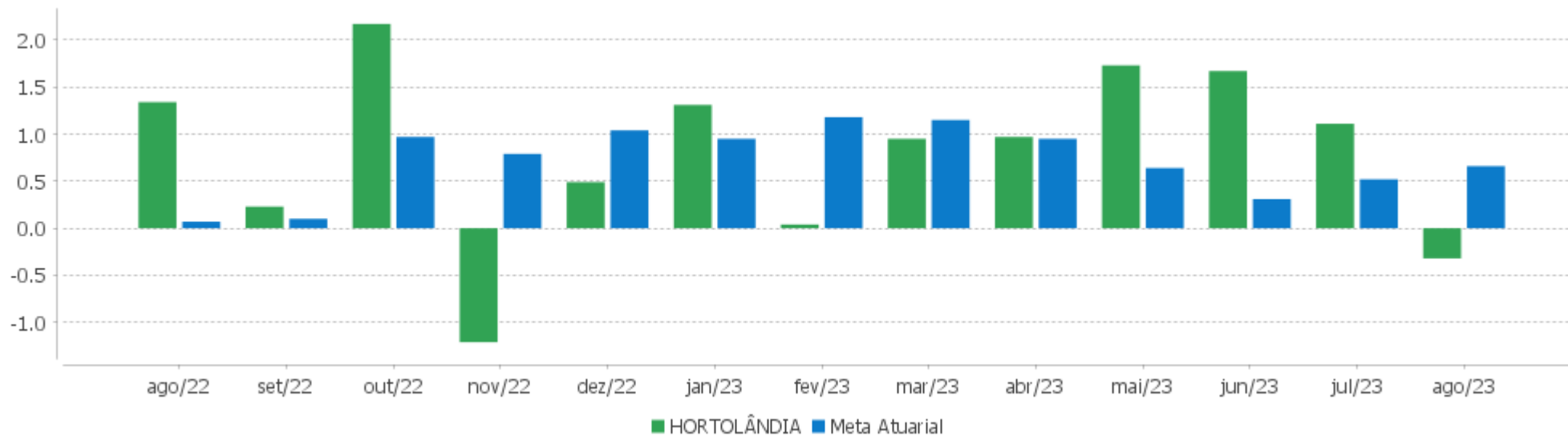


Patrimônio Líquido



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 150824 Var. IPCA p.p.	0,92 0,69	7,79 4,56	2,98 2,71	4,87 3,04	11,32 6,71	21,43 7,69	25,45 0,70
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	-1,56 -1,79	15,28 12,05	3,27 3,00	16,46 14,63	15,73 11,13	15,45 1,72	18,49 -6,25
NTN-B 150545 (6,442001%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,57	7,96 4,73	1,84 1,57	5,59 3,76	7,68 3,07		
NTN-B 150545 (5,660001%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,50	7,43 4,20	1,65 1,38	5,19 3,36	10,21 5,60	23,99 10,26	35,35 10,60
NTN-B 150535 (5,813502%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,53 4,30	1,69 1,42	5,27 3,44	10,37 5,76	20,76 7,02	
NTN-B 150840 (6,121999%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,54	7,74 4,51	1,76 1,49	5,43 3,59	10,69 6,08	21,26 7,52	
NTN-B 150840 (5,020001%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,44	6,99 3,76	1,49 1,22	4,87 3,04	9,54 4,94	25,96 12,23	37,16 12,42
NTN-B 150535 (5,170000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,46	7,10 3,87	1,53 1,26	4,94 3,11	9,70 5,09	26,32 12,59	37,51 12,77
NTN-B 150545 (5,859998%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,56 4,33	1,70 1,43	5,29 3,46	10,42 5,81	24,38 10,64	35,83 11,09
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 -0,03	8,82 -0,23	3,37 -0,07	6,66 -0,16	13,40 -0,34	23,37 -0,66	25,63 -1,17
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,77 0,01	8,41 -0,26	2,76 0,01	5,32 -0,10	11,53 -0,27	21,66 -0,68	27,54 -1,01
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,40 -0,02	11,65 -0,20	2,71 -0,12	10,26 -0,17	13,45 -0,31	19,42 -0,65	23,03 -0,96
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,45 -39,28	-8,83 -99,61	-1,41 -42,58	-8,73 -130,74	0,98 7,27	-59,62 -237,19	-61,75 -216,55
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,38 -33,19	-1,74 -19,59	-1,07 -32,16	-1,89 -28,23	-1,06 -7,80	2,90 11,53	-0,46 -1,61
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,62 1,00	4,62 -7,22	1,58 -1,25	3,29 -7,14	7,46 -6,30	12,40 -7,67	9,58 -14,41
LME REC IMA B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,39 0,77	3,64 -8,20	1,17 -1,66	3,10 -7,33	6,06 -7,70	7,21 -12,86	5,73 -18,26
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	-2,08	-36,96	-3,68	-34,60	-43,40	-41,86	-64,72

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 5 p.p.	-2,69	-45,70	-6,34	-40,36	-55,37	-64,89	-93,62
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,24 -1,15	6,99 1,51	6,37 -0,46	10,14 -0,16	0,90 -4,78	-14,13 -11,58	-2,96 -19,43
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-4,95 0,14	-3,99 -9,47	2,67 -4,16	0,58 -9,72	-2,10 -7,78	-13,16 -10,60	5,30 -11,18
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-10,28 -2,85	-3,77 -11,90	-1,68 -4,95	2,02 -15,38	-10,42 -8,48	-25,35 -1,59	-13,16 -2,35
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,30 0,58	6,09 -0,83	0,49 -2,04	3,91 0,82	9,30 2,95	-10,65 0,77	13,48 7,94
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,35 0,58	27,77 20,45	5,56 3,77	13,52 8,63	17,77 6,91	-28,49 -56,26	-20,65 -69,16
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,37 -32,74	-2,87 -32,36	-1,09 -32,77	-2,19 -32,80	-6,35 -46,82	-11,46 -45,59	-15,90 -55,75
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,00 -0,76	0,00 -7,32	0,00 -1,79	0,00 -4,89	0,00 -10,86	0,00 -27,77	0,00 -48,51
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,01 -0,77	-0,39 -7,71	-0,12 -1,91	-0,29 -5,18	-0,59 -11,45	-1,46 -29,23	-2,93 -51,44
BRCR11 Var. IBOVESPA p.p.	-9,33 -4,24	9,56 4,09	6,30 -0,54	20,65 10,35	-5,01 -10,69	-6,48 -3,92	-10,74 -27,21
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,15 -0,64	-1,84 -13,90	-0,46 -7,07	-0,96 -15,36	-2,40 -10,35	12,34 -4,50	-34,17 -49,65
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII % do CDI	2,55 223,43	31,10 350,75	16,17 487,28	28,80 431,32	27,69 204,32	26,95 107,21	32,08 112,50
HORTOLÂNDIA Var. IPCA + 4,84% p.p.	-0,32 -1,00	7,69 1,06	2,46 0,93	6,25 1,88	9,47 -0,32	11,93 -13,37	17,57 -26,66
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51

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	-	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 MULTISTRATEGIA	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 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	1,90
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	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du	SEMESTRAL, C / VENCIMENTO NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DE DEZEMBRO E JUNHO.	0,80
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	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	1,15	9,05	3,44	6,81	13,74	24,03	26,80	33,22	43,08
IRF-M 1+	0,59	12,99	4,10	11,31	16,04	21,61	17,57	30,08	56,68
IRF-M TOTAL	0,76	11,43	3,81	9,56	14,96	22,06	20,53	31,03	52,86
IMA-B 5	0,61	8,75	2,66	5,76	11,97	23,03	28,90	40,81	61,13
IMA-B 5+	-1,27	14,28	2,80	14,40	15,00	16,66	18,76	24,36	71,86
IMA-B TOTAL	-0,38	11,84	2,83	10,43	13,76	20,07	23,99	32,22	68,62
IMA-GERAL TOTAL	0,63	10,39	3,38	8,50	13,72	22,67	24,97	33,10	54,16
IDKA 2	0,77	8,66	2,75	5,42	11,80	22,33	28,55	41,03	58,78
IDKA 20	-3,05	19,50	3,45	24,26	18,37	10,39	11,16	10,89	77,63
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48	14,44	50,95
IBRX 100	-5,01	4,62	6,85	9,37	4,16	-4,36	15,60	14,31	54,15
IBRX 50	-4,76	3,66	7,43	8,45	4,56	-3,16	18,26	15,68	49,30
SMALL CAP	-7,43	8,13	3,26	17,40	-1,94	-23,76	-10,81	-5,44	42,85
Índice Consumo - ICON	-10,42	-0,75	0,30	6,83	-15,38	-41,83	-41,59	-38,22	-6,46
Índice Dividendos - IDIV	-2,83	9,22	8,71	11,58	10,64	15,38	37,76	32,74	99,45

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	1,97	10,75	4,16	7,31	8,32	-4,62	15,85	83,19	84,91

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	12,06	6,62	14,40	7,95	16,84	15,48	20,93	50,17

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,73	6,92	2,53	3,09	6,36	-11,42	5,54	59,73	56,19

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	3,23	0,27	1,83	4,61	13,74	24,75	27,79	32,17
INPC	0,20	2,80	0,01	1,55	4,06	13,24	25,04	28,72	32,95
IGPM	-0,14	-5,28	-2,77	-5,42	-7,20	0,77	32,13	49,34	56,73
SELIC	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	5,97	1,29	3,88	8,78	23,00	40,28	49,45	60,68
IPCA + 5,00%	0,68	6,64	1,54	4,39	9,82	25,37	44,35	55,27	68,52
IPCA + 5,50%	0,72	6,98	1,66	4,64	10,34	26,57	46,42	58,24	72,56
IPCA + 5,89%	0,75	7,25	1,76	4,84	10,74	27,50	48,05	60,59	75,76
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51	61,26	76,67
INPC + 4,00%	0,56	5,52	1,03	3,59	8,20	22,46	40,61	50,54	61,62
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86	62,43	77,71

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%)	21.829.148,19	5,170000	21.418.236,39	5,404200	-410.911,80
NTN-B 150535 (5,813502%)	51.807.077,31	5,813502	53.541.169,39	5,404200	1.734.092,08
NTN-B 150545 (5,660001%)	21.748.197,00	5,660001	21.909.233,58	5,597500	161.036,58
NTN-B 150545 (5,859998%)	21.497.357,97	5,859998	22.170.057,78	5,597500	672.699,81
NTN-B 150545 (6,442001%)	67.021.815,49	6,442001	73.888.403,95	5,597500	6.866.588,46
NTN-B 150840 (5,020001%)	51.124.328,94	5,020001	48.636.273,80	5,492000	-2.488.055,14
NTN-B 150840 (6,121999%)	76.934.265,05	6,121999	82.112.848,31	5,492000	5.178.583,26

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
181	02/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	100.000,00	29.715,31355600	3,3652682080
185	02/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	60.000,00	17.829,18813300	3,3652682080
184	07/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	140.000,00	41.515,09443900	3,3722674100
180	11/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	7.739.000,00	0,00	2.289.767,44248700	3,3798192150
179	11/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	105.000,00	31.066,75041500	3,3798192150
186	11/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	600.000,00	0,00	177.524,28808533	3,3798192150
178	17/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.780.000,00	0,00	1.412.086,80402900	3,3850610220
177	29/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	5.800.000,00	1.707.020,27675700	3,3977335120
183	29/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	125.000,00	36.789,23010300	3,3977335120
182	31/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	20.000,00	5.880,80629300	3,4008941980
Total			13.119.000,00	6.350.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 8.096.457,36

Value-At-Risk: 1,05%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HORTOLÂNDIA		1,05	1,05			768.521.514,24	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,43%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824		0,48	0,00	0,51			37.780.680,38	4,92
NTN-B 150545		3,42	0,05	3,41			16.427.504,41	2,14
NTN-B 150535 (5,170000%)		0,10	0,00	0,11			21.829.148,19	2,84
NTN-B 150535 (5,813502%)		0,10	0,00	0,11			51.807.077,31	6,74
NTN-B 150545 (5,660001%)		0,10	0,00	0,11			21.748.197,00	2,83
NTN-B 150545 (5,859998%)		0,10	0,00	0,11			21.497.357,97	2,80
NTN-B 150545 (6,442001%)		0,10	0,00	0,11			67.021.815,49	8,72
NTN-B 150840 (5,020001%)		0,10	0,00	0,11			51.124.328,94	6,65
NTN-B 150840 (6,121999%)		0,10	0,00	0,11			76.934.265,05	10,01
Sub-total	0,37	0,20	0,05		-1,30	0,66	366.170.374,74	47,65

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,13	0,01	0,01			105.705.863,20	13,75
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,86	0,14	0,06			84.477.004,21	10,99
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,72	0,03	0,16			75.887.967,05	9,87
Sub-total	1,65	0,78	0,18		-0,36	0,55	266.070.834,46	34,62

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LME REC IMA B FI RENDA FIXA		0,28	0,00	1,78			3.956.519,03	0,51
BRA1 FI RENDA FIXA		0,14	-0,00	1,88			152.550,75	0,02
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5		1,03	-0,00	1,26			280.417,79	0,04
Sub-total	1,18	0,25	0,00		-0,77	0,24	4.389.487,57	0,57

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,08	-0,00	0,08			1.849.897,36	0,24
FIDC PREMIUM		0,40	0,00	0,40			681.549,32	0,09
Sub-total	1,32	0,14	0,00		-1,17	-0,40	2.531.446,68	0,33

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,62%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		9,20	0,22	2,76			21.152.490,13	2,75
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,40	0,44	5,32			44.806.633,86	5,83
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,99	0,20	2,76			26.125.574,06	3,40
Sub-total	14,29	7,62	0,85		-0,56	-6,84	92.084.698,05	11,98

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,04%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,25	-0,00	9,25			9.878.751,19	1,29
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		7,90	-0,03	7,78			21.941.065,65	2,85
Sub-total	16,99	8,04	-0,03		0,01	1,32	31.819.816,84	4,14

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 2,10%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII		3,50	-0,00	3,50			2.236.000,00	0,29
BRCR11		0,83	0,00	7,57			198.006,00	0,03
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII		0,04	-0,00	1,84			1.327.949,99	0,17
Sub-total	2,94	2,10	-0,00		-0,08	0,89	3.761.955,99	0,49

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,01%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V		0,01	-0,00	0,01			197.405,12	0,03
Sub-total	0,00	0,01	-0,00		-3.930,99	-0,37	197.405,12	0,03

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP		0,01	-0,00	0,11			1.495.494,79	0,19
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	0,03	0,01	-0,00		-38,80	-0,01	1.495.494,79	0,19