



**LDB**  
EMPRESAS

**HORTOLÂNDIA**  
OUTUBRO 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 31.10.2024.

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

83,19%

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 150535 (5,170000%)	0,70	0,04	0,97	8,46	23.067.291,75	2,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,813502%)	0,41	0,05	1,03	9,02	54.988.267,42	6,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020001%)	0,43	0,04	0,96	8,33	54.048.541,95	5,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,121999%)	0,48	0,05	1,05	9,29	81.847.208,17	9,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,28	0,19	-2,58	-5,62	15.311.833,37	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,660001%)	0,52	0,05	1,01	8,89	23.091.932,09	2,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,859998%)	0,53	0,05	1,03	9,06	22.847.103,21	2,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,442001%)	0,56	0,05	1,08	9,57	71.416.961,49	7,91
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,65</b>	<b>0,05</b>	<b>0,87</b>	<b>8,38</b>	<b>346.619.139,45</b>	<b>38,38</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	3,67	0,10	-0,67	-0,08	103.800.729,81	11,49	4.070.369.176,30	2,55
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,41	0,04	0,82	7,85	155.126.210,67	17,18	8.415.592.732,29	1,84
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,83	0,01	0,76	5,52	82.660.665,44	9,15	4.039.305.995,01	2,05
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,04	0,04	0,93	2,17	56.398.527,92	6,25	38.514.070.105,23	0,15
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,58</b>	<b>0,05</b>	<b>0,43</b>	<b>5,17</b>	<b>397.986.133,84</b>	<b>44,07</b>		

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				
QUELUZ	RJI	BRA1 FI RENDA FIXA *	0,86	0,02	-0,74	-0,66	152.396,62	0,02	3.653.893,72	4,17
VERITAS	RJI	FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 *	7,69	0,01	-3,33	-8,81	235.443,80	0,03	35.896.490,39	0,66
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA B FI RENDA FIXA *	1,76	-0,00	-0,06	-0,69	3.970.297,76	0,44	75.228.050,02	5,28
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>1,67</b>	<b>-0,00</b>	<b>-0,27</b>	<b>-1,17</b>	<b>4.358.138,18</b>	<b>0,48</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 *	5,34	-0,49	-0,49	-2,44	624.438,68	0,07	28.932.663,18	2,16
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC *	4,75	-0,41	-0,41	-8,19	1.670.049,43	0,18	66.118.795,31	2,53
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>3,97</b>	<b>-0,43</b>	<b>-0,43</b>	<b>-6,70</b>	<b>2.294.488,11</b>	<b>0,25</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,95</b>	<b>0,05</b>	<b>0,62</b>	<b>6,73</b>	<b>751.257.899,58</b>	<b>83,19</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

11,19%

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	13,75	-0,24	0,03	1,40	48.959.138,95	5,42	759.200.892,40	6,45
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	17,69	-0,44	-1,21	-15,78	19.160.950,33	2,12	413.703.189,66	4,63
ITAU	ITAU	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,78	-1,26	-2,34	8,56	32.923.445,84	3,65	1.276.716.564,14	2,58
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>13,28</b>	<b>-0,61</b>	<b>-0,99</b>	<b>-0,32</b>	<b>101.043.535,12</b>	<b>11,19</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>13,28</b>	<b>-0,61</b>	<b>-0,99</b>	<b>-0,32</b>	<b>101.043.535,12</b>	<b>11,19</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**INVESTIMENTOS NO EXTERIOR**

**5,05%**

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	18,68	-2,36	6,62	44,61	15.432.370,35	1,71	825.916.041,18	1,87
SCHRODER	INTRAG	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	15,28	-1,43	2,17	30,46	30.209.811,90	3,35	368.225.833,40	8,20
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>15,56</b>	<b>-1,74</b>	<b>3,63</b>	<b>34,93</b>	<b>45.642.182,25</b>	<b>5,05</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>15,56</b>	<b>-1,74</b>	<b>3,63</b>	<b>34,93</b>	<b>45.642.182,25</b>	<b>5,05</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS**

**0,18%**

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 *	1,77	-0,02	-0,40	-5,43	184.005,35	0,02	1.303.126,10	14,12
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>1,77</b>	<b>-0,02</b>	<b>-0,40</b>	<b>-5,43</b>	<b>184.005,35</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 *	0,16	-0,05	-0,05	-0,47	1.485.300,73	0,16	27.435.021,81	5,41
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>0,16</b>	<b>-0,05</b>	<b>-0,05</b>	<b>-0,47</b>	<b>1.485.300,74</b>	<b>0,16</b>		

<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>0,25</b>	<b>-0,05</b>	<b>-0,09</b>	<b>-1,05</b>	<b>1.669.306,09</b>	<b>0,18</b>		
-----------------------------------	--	--	-------------	--------------	--------------	--------------	---------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,38%

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	16,84	-1,07	-7,87	-15,88	141.201,00	0,02	0,00	
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII *	13,50	-2,44	-1,49	-4,21	1.988.000,00	0,22	1.344.249.003,88	0,15
QUELUZ	RJI	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII *	2,61	-0,25	-0,25	-3,66	1.272.528,52	0,14	136.994.582,70	0,93
<b>Sub-total Artigo 11º</b>			<b>5,96</b>	<b>-1,58</b>	<b>-1,31</b>	<b>-4,52</b>	<b>3.401.729,52</b>	<b>0,38</b>		
Fundos Imobiliários			5,96	-1,58	-1,31	-4,52	3.401.729,52	0,38		
<b>Total</b>			<b>2,04</b>	<b>-0,13</b>	<b>0,58</b>	<b>6,94</b>	<b>903.014.652,56</b>	<b>100,00</b>		



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	1.141.260,00
<b>Sub-total Disponibilidades Financeiras</b>	<b>1.141.260,00</b>
<b>Total</b>	<b>904.155.912,56</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	346.619.139,45	38,38	15,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	397.986.133,84	44,07	10,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	4.358.138,18	0,48	0,00	0,50	30,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	2.294.488,11	0,25	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>751.257.899,58</b>	<b>83,19</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	101.043.535,12	11,19	0,00	15,00	30,00	0,00	35,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>101.043.535,12</b>	<b>11,19</b>					35,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	45.642.182,25	5,05	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>45.642.182,25</b>	<b>5,05</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	184.005,35	0,02	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.485.300,74	0,16	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>1.669.306,09</b>	<b>0,18</b>					15,00
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	3.401.729,52	0,38	0,00	0,50	1,00	0,00	5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>3.401.729,52</b>	<b>0,38</b>					5,00
<b>Total</b>		<b>903.014.652,56</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\$)	Atribuição Desemp. (%)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,87 93,22	8,38 93,21	2,16 81,61	4,78 90,69	10,50 95,64	2.972.574,21	0,33	29.915.447,26
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,43 46,21	5,17 57,51	1,47 55,45	3,74 71,00	8,61 78,42	1.700.977,69	0,19	16.711.102,48
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,27 -29,14	-1,17 -12,96	-1,42 -53,39	-1,35 -25,64	-0,26 -2,34	-11.817,99	-0,00	-51.407,51
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,43 -46,31	-6,70 -74,46	-4,20 -158,27	-5,39 -102,17	-8,54 -77,83	-9.901,80	-0,00	-164.650,22
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,99 0,61	-0,32 3,02	1,42 -0,19	3,82 0,81	18,12 3,48	-1.007.789,32	-0,11	-319.378,98
Artigo 9º II % do CDI	3,63 391,42	34,93 388,40	6,80 256,48	20,93 397,17	54,34 495,00	1.599.705,02	0,18	11.814.733,90
Artigo 10º I % do CDI	-0,40 -42,83	-5,43 -60,44	-1,16 -43,91	-2,30 -43,58	-6,11 -55,68	-734,22	-0,00	-10.575,14
Artigo 10º II % do CDI	-0,05 -5,49	-0,47 -5,26	-0,15 -5,52	-0,29 -5,53	-0,57 -5,23	-756,91	-0,00	-7.056,82
Artigo 11º % do CDI	-1,31 -141,35	-4,52 -50,27	-4,31 -162,32	-6,01 -114,08	-2,13 -19,43	-45.140,10	-0,01	-158.817,19
<b>HORTOLÂNDIA (Total)</b>						<b>5.197.116,58</b>	<b>0,58</b>	<b>57.729.397,78</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%)	22.845.365,64	0,00	0,00	0,00	23.067.291,75	221.926,11	1.823.035,82
NTN-B 150535 (5,813502%)	54.428.952,58	0,00	0,00	0,00	54.988.267,42	559.314,84	4.612.520,36
NTN-B 150545	15.717.307,87	0,00	0,00	0,00	15.311.833,37	-405.474,50	-928.484,54
NTN-B 150545 (5,660001%)	22.860.073,48	0,00	0,00	0,00	23.091.932,09	231.858,61	1.910.021,03
NTN-B 150545 (5,859998%)	22.613.809,69	0,00	0,00	0,00	22.847.103,21	233.293,52	1.924.255,67
NTN-B 150545 (6,442001%)	70.652.347,10	0,00	0,00	0,00	71.416.961,49	764.614,39	6.327.222,90
NTN-B 150840 (5,020001%)	53.535.562,82	0,00	0,00	0,00	54.048.541,95	512.979,13	4.259.583,08

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (6,121999%)	80.993.146,06	0,00	0,00	0,00	81.847.208,17	854.062,11	7.149.830,32
	343.646.565,24	0,00	0,00	0,00	346.619.139,45	2.972.574,21	

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	104.501.933,44	0,00	0,00	0,00	103.800.729,81	-701.203,63	25.514,22
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	161.332.180,30	0,00	-7.512.000,00	0,00	155.126.210,67	1.306.030,37	11.336.909,96
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	82.038.080,05	0,00	0,00	0,00	82.660.665,44	622.585,39	4.327.647,85
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	45.099.870,56	10.825.091,80	0,00	0,00	56.398.527,92	473.565,56	1.021.030,45
	392.972.064,35	10.825.091,80	-7.512.000,00	0,00	397.986.133,84	1.700.977,69	

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	153.525,75	0,00	0,00	0,00	152.396,62	-1.129,13	-1.014,63
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	243.565,78	0,00	0,00	0,00	235.443,80	-8.121,98	-22.759,07
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	3.972.864,64	0,00	0,00	0,00	3.970.297,76	-2.566,88	-27.633,81
	4.369.956,17	0,00	0,00	0,00	4.358.138,18	-11.817,99	

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	627.496,94	0,00	0,00	0,00	624.438,68	-3.058,26	-15.587,90
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.676.892,97	0,00	0,00	0,00	1.670.049,43	-6.843,54	-149.062,32
	2.304.389,91	0,00	0,00	0,00	2.294.488,11	-9.901,80	

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	48.942.542,04	0,00	0,00	0,00	48.959.138,95	16.596,91	675.686,86
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19.395.157,51	0,00	0,00	0,00	19.160.950,33	-234.207,18	-3.591.239,86

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	33.713.624,89	0,00	0,00	0,00	32.923.445,84	-790.179,05	2.596.174,02
	102.051.324,44	0,00	0,00	0,00	101.043.535,12	-1.007.789,32	

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	14.474.323,00	0,00	0,00	0,00	15.432.370,35	958.047,35	4.760.993,30
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	29.568.154,23	0,00	0,00	0,00	30.209.811,90	641.657,67	7.053.740,60
	44.042.477,23	0,00	0,00	0,00	45.642.182,25	1.599.705,02	

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	184.739,57	0,00	0,00	0,00	184.005,35	-734,22	-10.575,14
	184.739,57	0,00	0,00	0,00	184.005,35	-734,22	

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	1.486.057,64	0,00	0,00	0,00	1.485.300,73	-756,91	-7.056,82
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	0,01	0,00	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00
	1.486.057,65	0,00	0,00	0,00	1.485.300,74	-756,91	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRCR11	154.964,04	0,00	0,00	0,00	1.623,00	141.201,00	-12.140,04	-27.246,39
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	2.037.800,00	0,00	0,00	0,00	20.000,00	1.988.000,00	-29.800,00	-83.200,00
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	1.275.728,58	0,00	0,00	0,00	0,00	1.272.528,52	-3.200,06	-48.370,80
	3.468.492,62	0,00	0,00	0,00	21.623,00	3.401.729,52	-45.140,10	

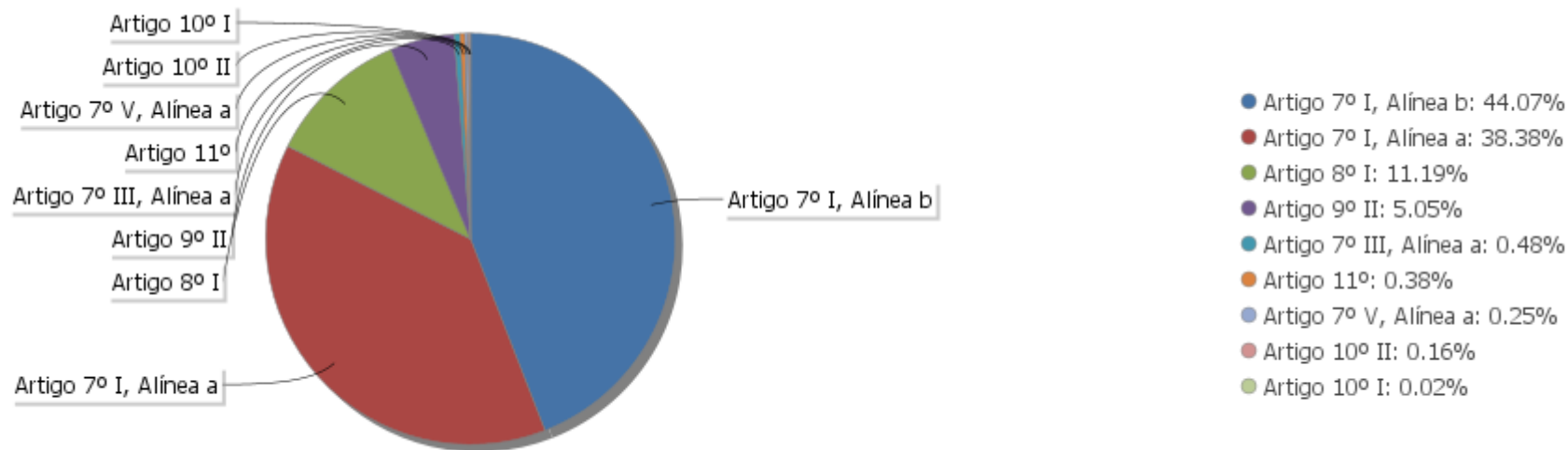
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

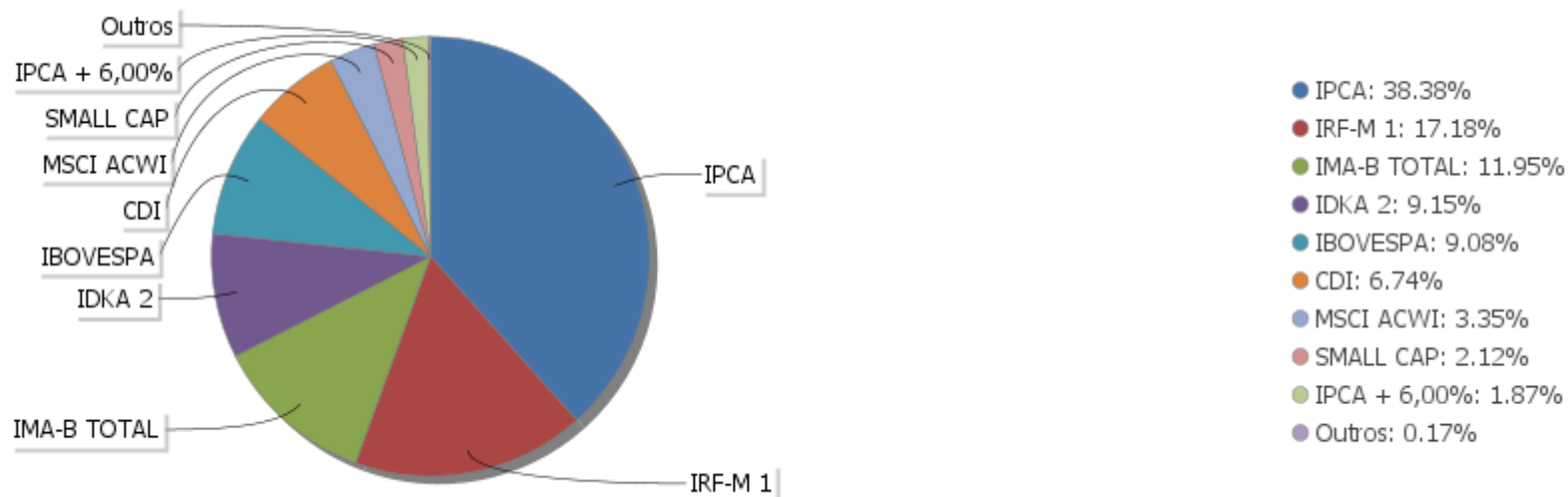
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	515.853.400,57	57,13		515.853.400,57	57,13	
de 31 dias a 365 dias	36.183.974,36	4,01		552.037.374,93	61,13	
acima de 365 dias	350.977.277,63	38,87		903.014.652,56	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

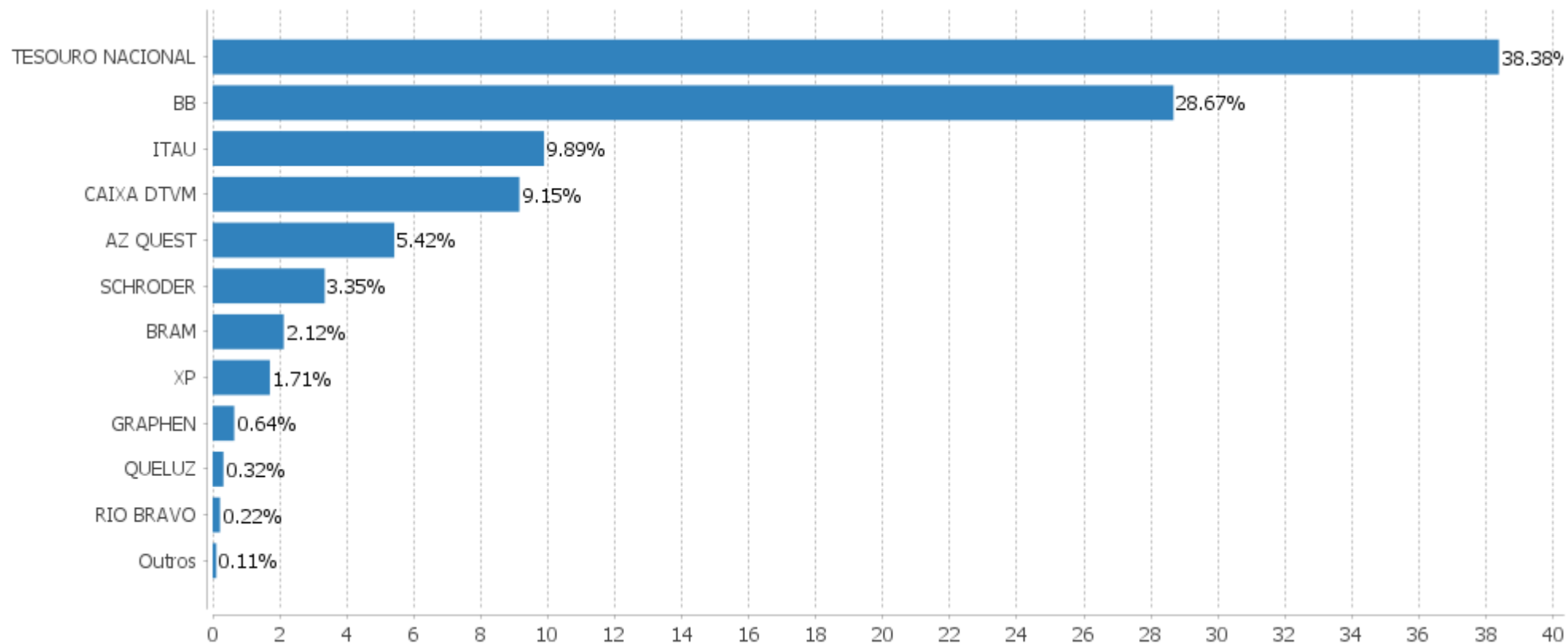


Alocação Por Estratégia



## 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	-0,03	0,58			6,94
IPCA + 4,96%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,82	0,40	0,85	1,01			8,22
p.p. indexador	-0,60	-0,09	0,43	-1,11	-0,31	0,27	0,57	0,95	-0,87	-0,43			-1,28
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**

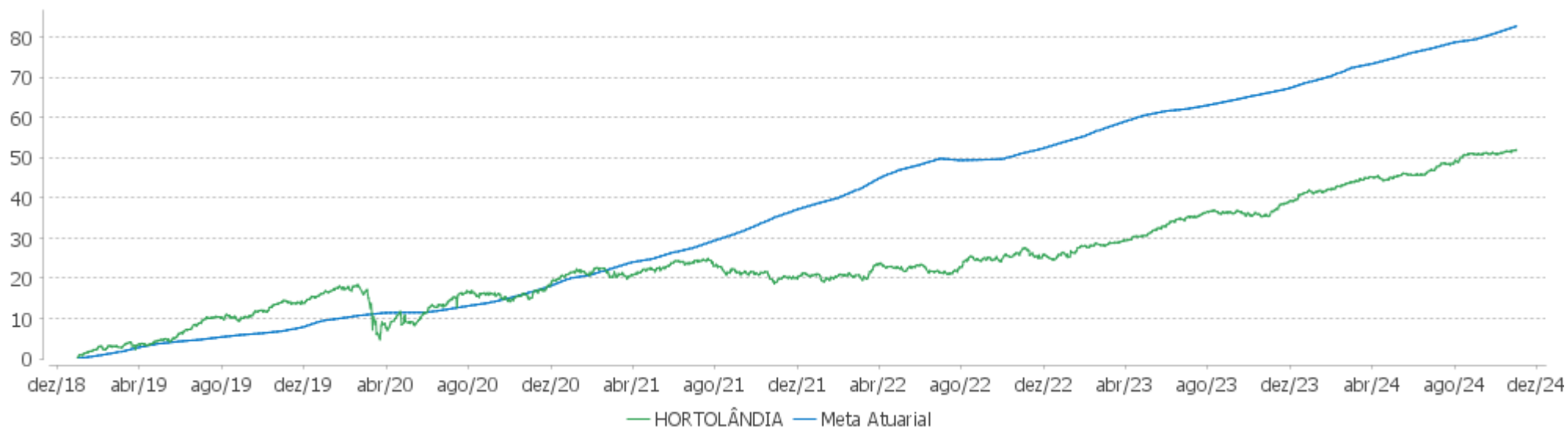
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	33	47,14
Meses abaixo - Meta Atuarial	37	52,86
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,88	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-6,76	2020-03

**Relatório**

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,91	2,27	-0,36	1,78
06 meses	4,80	4,63	0,17	1,77
12 meses	11,98	9,98	2,00	2,04
24 meses	19,16	20,96	-1,80	2,66
36 meses	27,62	35,14	-7,53	3,06
48 meses	32,19	57,71	-25,51	3,41
60 meses	33,01	73,46	-40,45	5,37
Desde 31/12/2018	51,82	86,91	-35,09	5,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

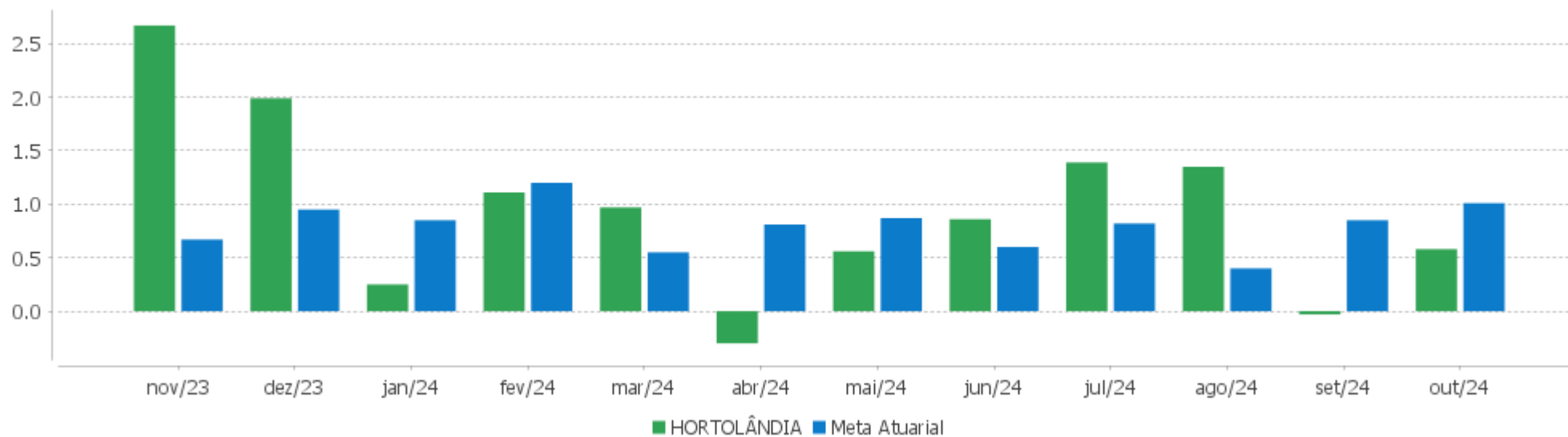


Patrimônio Líquido



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.	-2,58 -3,14	-5,62 -9,50	-2,87 -3,85	-0,96 -3,01	1,48 -3,28	10,62 0,82	20,74 3,83
NTN-B 150545 (6,442001%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,52	9,57 5,68	2,58 1,59	5,31 3,27	11,58 6,82	21,03 11,23	29,48 12,57
NTN-B 150545 (5,660001%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,45	8,89 5,00	2,38 1,40	4,91 2,87	10,73 5,98	22,94 13,14	34,99 18,08
NTN-B 150535 (5,813502%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	9,02 5,14	2,42 1,43	4,99 2,94	10,83 6,07	23,23 13,42	31,58 14,67
NTN-B 150840 (6,121999%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,49	9,29 5,41	2,49 1,51	5,15 3,10	11,20 6,44	24,00 14,19	32,57 15,65
NTN-B 150840 (5,020001%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,40	8,33 4,45	2,21 1,23	4,58 2,54	10,01 5,25	21,40 11,60	36,24 19,33
NTN-B 150535 (5,170000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,41	8,46 4,58	2,25 1,27	4,66 2,61	10,14 5,38	21,72 11,91	36,79 19,88
NTN-B 150545 (5,859998%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	9,06 5,18	2,43 1,45	5,01 2,97	10,95 6,19	23,42 13,61	35,67 18,76
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,82 -0,03	7,85 -0,23	2,38 -0,08	4,70 -0,18	9,86 -0,30	24,28 -0,73	38,24 -1,17
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,76 -0,05	5,52 -0,34	1,76 -0,05	3,75 -0,10	8,86 -0,52	18,70 -0,55	32,82 -1,33
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,67 -0,02	-0,08 -0,24	-0,90 -0,09	1,47 -0,16	5,34 -0,28	14,51 -0,59	27,21 -1,01
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,93 99,81	8,94 99,42	2,65 99,76	5,24 99,50	10,90 99,28	25,67 99,23	40,13 99,49
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,49 -52,52	-2,44 -27,08	-1,28 -48,43	-2,54 -48,25	-7,57 -68,96	-6,66 -25,74	-62,87 -155,88
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,41 -43,98	-8,19 -91,12	-5,24 -197,70	-6,41 -121,53	-8,90 -81,09	-10,85 -41,93	-7,56 -18,75
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,74 -0,09	-0,66 -0,82	-0,80 0,00	-0,80 -2,43	-0,59 -6,21	5,93 -9,17	12,96 -15,26
LME REC IMA B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,06 0,59	-0,69 -0,85	-1,20 -0,39	-0,80 -2,43	0,42 -5,20	4,89 -10,20	8,39 -19,83
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	-3,33	-8,81	-5,34	-10,07	-10,25	-50,10	-48,97

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.	-4,07	-14,90	-7,08	-14,23	-19,83	-69,76	-83,87
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,03 1,63	1,40 4,73	1,58 -0,04	4,20 1,19	17,86 3,22	3,51 -8,27	4,86 -20,46
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,34 -0,75	8,56 11,89	4,11 2,49	8,12 5,12	31,93 17,29	12,68 0,89	26,62 1,29
BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-1,21 0,16	-15,78 -0,93	-3,25 -1,79	-3,66 0,10	0,59 -1,92	-24,15 -10,01	-19,54 -5,46
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. MSCI ACWI p.p.	2,17 -1,46	30,46 -6,17	2,51 -1,81	18,40 -4,49	47,73 -1,62	58,30 2,30	12,74 -1,62
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	6,62 5,52	44,61 35,49	16,36 13,82	26,22 21,06	69,17 58,10	106,67 83,29	3,40 -35,84
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,40 -42,83	-5,43 -60,44	-1,16 -43,91	-2,30 -43,58	-6,11 -55,68	-12,11 -46,80	-16,78 -41,60
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,00 -1,10	0,00 -9,13	0,00 -2,54	0,00 -5,16	0,00 -11,07	0,00 -23,38	0,00 -39,24
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,05 -1,15	-0,47 -9,60	-0,15 -2,68	-0,29 -5,45	-0,57 -11,64	-1,18 -24,56	-1,94 -41,18
BRCR11 Var. IBOVESPA p.p.	-7,87 -6,27	-15,88 -12,55	-10,25 -11,86	-12,57 -15,58	-6,66 -21,31	-17,21 -28,99	-10,63 -35,96
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,25 2,81	-3,66 -0,44	-2,91 1,84	-3,26 1,97	-3,91 -5,47	-6,22 -13,35	6,68 -13,10
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII % do CDI	-1,49 -160,18	-4,21 -46,84	-4,74 -178,65	-7,21 -136,78	8,36 76,18	38,07 147,18	49,40 122,48
HORTOLÂNDIA Var. IPCA + 4,96% p.p.	0,58 -0,43	6,94 -1,28	1,91 -0,36	4,80 0,17	11,98 2,00	19,16 -1,81	27,62 -7,57
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24

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 VARIACÃO 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 AÇÕES DUNAMIS FIC FI	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 VARIACÃO 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	0,84	8,08	2,45	4,88	10,15	25,01	39,40	41,88	47,64
IRF-M 1+	-0,14	2,35	0,56	2,01	7,39	21,52	36,19	28,16	34,10
IRF-M TOTAL	0,21	4,12	1,21	2,94	8,27	22,29	36,91	32,39	38,26
IMA-B 5	0,74	6,08	1,74	4,16	9,57	19,66	34,90	40,87	48,92
IMA-B 5+	-1,66	-4,23	-2,31	0,15	2,92	11,54	22,86	21,61	14,50
IMA-B TOTAL	-0,65	0,16	-0,80	1,63	5,62	15,10	28,22	30,57	29,26
IMA-GERAL TOTAL	0,38	5,39	1,52	3,92	9,08	21,85	36,23	37,66	41,34
IDKA 2	0,81	5,86	1,81	3,85	9,37	19,24	34,15	40,34	49,79
IDKA 20	-4,24	-13,00	-6,80	-4,11	-2,93	4,69	12,47	6,78	-7,39
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33	38,06	20,98
IBRX 100	-1,53	-2,74	1,84	2,99	15,29	11,28	24,40	37,33	22,16
IBRX 50	-1,49	-1,71	1,51	3,10	15,95	12,48	27,12	41,91	24,29
SMALL CAP	-1,37	-14,85	-1,46	-3,76	2,51	-14,14	-14,08	-10,98	-16,47
Índice Consumo - ICON	-0,02	-11,24	1,22	1,62	9,43	-22,91	-34,44	-40,10	-41,26
Índice Dividendos - IDIV	-1,72	2,45	4,09	7,11	21,24	28,86	50,07	70,74	52,68



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Investimentos Estruturados**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	5,00	42,76	5,43	26,58	55,42	61,95	26,85	74,67	171,04

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-3,06	-3,22	-4,75	-5,23	1,56	7,13	19,78	15,83	14,79

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,63	36,63	4,32	22,90	49,35	56,01	14,35	51,21	124,74

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	3,88	0,98	2,05	4,76	9,81	16,91	29,39	34,46
INPC	0,61	3,92	0,95	1,93	4,60	8,93	15,97	28,82	34,96
IGPM	1,52	4,20	2,45	4,83	5,59	0,76	7,33	30,65	58,00
SELIC	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,92	7,39	2,02	4,13	8,97	18,77	31,51	51,32	63,49
IPCA + 5,00%	1,01	8,26	2,28	4,65	10,02	21,06	35,34	57,21	71,47
IPCA + 5,50%	1,05	8,69	2,41	4,90	10,54	22,22	37,28	60,22	75,58
IPCA + 5,89%	1,09	9,03	2,51	5,10	10,95	23,12	38,81	62,60	78,84
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24	63,27	79,77
INPC + 4,00%	0,97	7,43	1,99	4,02	8,80	17,82	30,45	50,65	64,10
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12	62,56	80,45

## 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%)	23.067.291,75	5,170000	20.503.363,43	6,785700	-2.563.928,32
NTN-B 150535 (5,813502%)	54.988.267,42	5,813502	51.254.175,87	6,785700	-3.734.091,55
NTN-B 150545 (5,660001%)	23.091.932,09	5,660001	20.421.271,85	6,780000	-2.670.660,24
NTN-B 150545 (5,859998%)	22.847.103,21	5,859998	20.664.382,23	6,780000	-2.182.720,98
NTN-B 150545 (6,442001%)	71.416.961,49	6,442001	68.870.286,06	6,780000	-2.546.675,43
NTN-B 150840 (5,020001%)	54.048.541,95	5,020001	45.844.179,52	6,706700	-8.204.362,43
NTN-B 150840 (6,121999%)	81.847.208,17	6,121999	77.398.942,50	6,706700	-4.448.265,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
329	01/10/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	90.000,00	23.836,70249300	3,7756900320
326	04/10/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	500.000,00	0,00	7.154,81038000	69,8830540000
325	11/10/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	8.897.691,80	0,00	127.058,56391000	70,0282730000
324	15/10/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	638.400,00	0,00	9.109,37912000	70,0816150000
323	24/10/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	120.000,00	0,00	1.707,66452000	70,2714140000
328	24/10/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	265.000,00	69.763,50641500	3,7985476020
321	25/10/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	7.000.000,00	1.842.489,76410400	3,7992069950
327	25/10/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	157.000,00	41.324,41328100	3,7992069950
322	31/10/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	669.000,00	0,00	9.501,16188000	70,4124410000
<b>Total</b>			<b>10.825.091,80</b>	<b>7.512.000,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.847.865,46

Value-At-Risk: 0,87%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,92	0,52		0,26	-0,33	0,62	751.257.899,58	83,19
Artigo 8º	9,19	5,61		0,56	-0,21	-0,99	101.043.535,12	11,19
Artigo 9º	13,43	7,67		0,05	0,20	3,63	45.642.182,25	5,05
Artigo 10º	0,15	0,01		0,00	-6,78	-0,09	1.669.306,09	0,18
Artigo 11º	5,71	0,41		0,00	-0,39	-1,31	3.401.729,52	0,38
HORTOLÂNDIA		0,87		0,87			903.014.652,56	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,52%

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 150535 (5,170000%)	0,07	0,07	0,00	0,09	0,59	0,97	23.067.291,75	2,55
NTN-B 150535 (5,813502%)	0,07	0,07	0,00	0,09	1,35	1,03	54.988.267,42	6,09
NTN-B 150840 (5,020001%)	0,07	0,07	0,00	0,09	0,41	0,96	54.048.541,95	5,99
NTN-B 150840 (6,121999%)	0,07	0,07	0,00	0,09	1,71	1,05	81.847.208,17	9,06
NTN-B 150545	6,36	3,79	0,04	3,80	-0,55	-2,58	15.311.833,37	1,70
NTN-B 150545 (5,660001%)	0,07	0,07	0,00	0,09	1,17	1,01	23.091.932,09	2,56
NTN-B 150545 (5,859998%)	0,07	0,07	0,00	0,09	1,40	1,03	22.847.103,21	2,53
NTN-B 150545 (6,442001%)	0,07	0,07	0,00	0,09	2,08	1,08	71.416.961,49	7,91
<b>Sub-total</b>	0,30	0,18	0,04		-0,21	0,87	346.619.139,45	38,38

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	3,97	2,09	0,14	0,03	-0,40	-0,67	103.800.729,81	11,49
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,30	0,24	0,02	0,01	-0,37	0,82	155.126.210,67	17,18
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,97	1,23	0,06	0,24	-0,09	0,76	82.660.665,44	9,15

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
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,04	0,02	-0,00	0,02	-0,05	0,93	56.398.527,92	6,25
<b>Sub-total</b>	1,46	0,84	0,22		-0,34	0,43	397.986.133,84	44,07

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	2,70	0,10	-0,00	2,12	-0,62	-0,74	152.396,62	0,02
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	8,38	0,30	0,00	1,04	-0,51	-3,33	235.443,80	0,03
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	0,99	0,55	0,00	1,92	-1,01	-0,06	3.970.297,76	0,44
<b>Sub-total</b>	0,84	0,50	0,00		-1,43	-0,27	4.358.138,18	0,48

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	1,62	0,10	0,00	0,11	-0,88	-0,49	624.438,68	0,07
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,35	0,28	0,00	0,28	-0,99	-0,41	1.670.049,43	0,18
<b>Sub-total</b>	1,43	0,22	0,00		-0,95	-0,43	2.294.488,11	0,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,61%

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	8,55	5,85	0,26	4,29	-0,10	0,03	48.959.138,95	5,42
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	12,73	8,01	0,13	3,44	-0,17	-1,21	19.160.950,33	2,12
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,60	5,82	0,17	3,16	-0,26	-2,34	32.923.445,84	3,65
<b>Sub-total</b>	9,19	5,61	0,56		-0,21	-0,99	101.043.535,12	11,19

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,67%

Artigo 9º II

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	14,81	8,87	0,02	8,87	0,38	6,62	15.432.370,35	1,71

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
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	14,33	7,50	0,03	7,72	0,09	2,17	30.209.811,90	3,35
<b>Sub-total</b>	13,43	7,67	0,05		0,20	3,63	45.642.182,25	5,05

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,41%

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	15,77	5,90	0,00	8,23	-0,56	-7,87	141.201,00	0,02
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	8,94	0,53	0,00	0,53	-0,27	-1,49	1.988.000,00	0,22
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	0,83	0,15	0,00	2,95	-1,42	-0,25	1.272.528,52	0,14
<b>Sub-total</b>	5,71	0,41	0,00		-0,39	-1,31	3.401.729,52	0,38

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	-2.918,44	-0,40	184.005,35	0,02
<b>Sub-total</b>	0,00	0,00	0,00		-2.928,73	-0,40	184.005,35	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	0,17	0,01	0,00	0,07	-5,80	-0,05	1.485.300,73	0,16
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,00	0,00	0,00	0,07	0,00	0,00	0,01	0,00
<b>Sub-total</b>	0,17	0,01	0,00		-5,80	-0,05	1.485.300,74	0,16

(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

**Observações**

-Referente ao mês de outubro de 2024, vale observar que:

- O fundo LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo LME REC IMA B FI RENDA FIXA não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.