



HORTOLÂNDIA
NOVEMBRO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.11.2024.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA	83,09%
------------	--------

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%)	0,71	0,04	0,79	9,32	22.624.524,35	2,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,813502%)	0,41	0,04	0,84	9,94	53.885.431,92	5,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020001%)	0,43	0,04	0,78	9,18	54.471.912,09	6,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,121999%)	0,48	0,04	0,86	10,23	82.553.216,69	9,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,56	0,37	0,35	-5,29	14.889.186,63	1,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,660001%)	0,52	0,04	0,83	9,79	22.642.974,82	2,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,859998%)	0,53	0,04	0,84	9,98	22.391.733,46	2,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,442001%)	0,56	0,04	0,89	10,54	69.888.807,66	7,75
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,66	0,05	0,82	9,27	343.347.787,62	38,05

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	3,86	0,14	0,01	-0,07	103.811.949,49	11,51	3.900.376.937,62	2,66
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,43	0,02	0,54	8,44	139.302.030,33	15,44	8.272.095.859,24	1,68
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP- RESP LIMITADA	1,88	-0,10	0,20	5,74	82.829.009,90	9,18	3.885.051.809,15	2,13
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,03	0,04	0,79	2,98	73.761.878,21	8,18	38.486.514.757,86	0,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,62	0,03	0,38	5,57	399.704.867,93	44,30		

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 *	0,85	-0,00	-0,14	-0,80	152.180,07	0,02	3.648.701,54	4,17
VERITAS	RJI	FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 *	5,55	-0,05	-0,90	-9,64	233.319,83	0,03	35.572.663,62	0,66
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA B FI RENDA FIXA *	1,80	-0,05	-0,22	-0,91	3.961.744,94	0,44	75.065.994,37	5,28
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,67	-0,05	-0,25	-1,41	4.347.244,84	0,48		

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 *	2,18	-0,40	-0,40	-2,83	621.919,63	0,07	28.675.504,10	2,17
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC *	4,76	-0,42	-0,42	-8,58	1.663.031,20	0,18	65.840.937,25	2,53
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			3,70	-0,42	-0,42	-7,08	2.284.950,83	0,25		
Renda Fixa			0,98	0,04	0,58	7,34	749.684.851,22	83,09		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL 10,97%

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	13,23	0,65	-1,40	-0,02	48.275.229,37	5,35	751.071.846,13	6,43
BRADESCO	BEM	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	17,58	0,67	-5,53	-20,44	18.101.041,59	2,01	344.764.047,20	5,25
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	12,69	0,91	-1,01	7,46	32.589.817,50	3,61	1.259.288.524,99	2,59
Sub-total Artigo 8º I			12,86	0,74	-2,06	-2,36	98.966.088,46	10,97		
Renda Variável			12,86	0,74	-2,06	-2,36	98.966.088,46	10,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,39%

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 IE	18,55	0,08	10,21	59,38	17.008.182,79	1,89	883.211.610,48	1,93
SCHRODER	INTRAG	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	15,52	0,40	4,74	36,65	31.642.299,07	3,51	385.281.941,94	8,21
Sub-total Artigo 9º II			15,68	0,29	6,59	43,82	48.650.481,86	5,39		
Investimentos no Exterior			15,68	0,29	6,59	43,82	48.650.481,86	5,39		

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	-0,37	-5,79	183.317,59	0,02	1.298.255,45	14,12
Sub-total Artigo 10º I			1,77	-0,02	-0,37	-5,79	183.317,59	0,02		

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	-0,04	-0,04	-0,52	1.484.650,74	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	
Sub-total Artigo 10º II			0,16	-0,04	-0,04	-0,52	1.484.650,75	0,16		
Investimentos Estruturados			0,25	-0,04	-0,08	-1,12	1.667.968,34	0,18		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,37%

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	14,18	-1,66	-0,96	-16,69	138.214,68	0,02	0,00	
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII *	14,00	-4,57	-3,61	-7,67	1.897.200,00	0,21	1.672.885.560,75	0,11
QUELUZ	RJI	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII *	2,62	-0,12	-0,12	-3,78	1.270.986,87	0,14	136.828.615,98	0,93
Sub-total Artigo 11º			6,47	-2,78	-2,18	-6,60	3.306.401,55	0,37		
Fundos Imobiliários			6,47	-2,78	-2,18	-6,60	3.306.401,55	0,37		
Total			1,93	0,12	0,57	7,55	902.275.791,43	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	0,00
Sub-total Disponibilidades Financeiras	0,00
Total	902.275.791,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 1
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	343.347.787,62	38,05	15,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	399.704.867,93	44,30	10,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	4.347.244,84	0,48	0,00	0,50	30,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	2.284.950,83	0,25	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	749.684.851,22	83,09					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	98.966.088,46	10,97	0,00	15,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	98.966.088,46	10,97					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	48.650.481,86	5,39	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	48.650.481,86	5,39					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	183.317,59	0,02	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.484.650,75	0,16	0,00	0,50	2,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	1.667.968,34	0,18					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	3.306.401,55	0,37	0,00	0,50	1,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	3.306.401,55	0,37					5,00
Total		902.275.791,43	100,00					

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	0,82 103,79	9,27 94,09	2,27 88,33	4,68 89,64	10,50 96,83	2.829.369,51	0,31	32.744.816,77
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,38 48,45	5,57 56,57	1,14 44,27	3,14 60,12	7,23 66,74	1.533.522,63	0,17	18.244.625,11
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,25 -31,59	-1,41 -14,34	-0,56 -21,76	-1,81 -34,67	-0,96 -8,86	-10.893,34	-0,00	-62.300,85
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,42 -52,54	-7,08 -71,88	-1,26 -48,76	-5,43 -103,81	-7,50 -69,23	-9.537,28	-0,00	-174.187,50
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,06 1,06	-2,36 3,98	-5,73 1,87	4,50 1,58	3,48 4,78	-2.077.446,66	-0,23	-2.396.825,64
Artigo 9º II % do CDI	6,59 833,05	43,82 444,66	9,59 372,33	26,18 500,93	49,66 458,14	3.008.299,61	0,33	14.823.033,51
Artigo 10º I % do CDI	-0,37 -47,24	-5,79 -58,74	-1,15 -44,67	-2,29 -43,86	-6,13 -56,53	-687,76	-0,00	-11.262,90
Artigo 10º II % do CDI	-0,04 -5,53	-0,52 -5,24	-0,14 -5,52	-0,29 -5,47	-0,57 -5,22	-649,99	-0,00	-7.706,81
Artigo 11º % do CDI	-2,18 -275,99	-6,60 -67,02	-6,95 -269,93	-7,93 -151,69	-3,54 -32,65	-73.704,97	-0,01	-232.522,16
HORTOLÂNDIA (Total)						5.198.271,75	0,57	62.927.669,53

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%)	23.067.291,75	0,00	0,00	624.063,31	22.624.524,35	181.295,91	2.004.331,73
NTN-B 150535 (5,813502%)	54.988.267,42	0,00	0,00	1.560.029,46	53.885.431,92	457.193,96	5.069.714,32
NTN-B 150545	15.311.833,37	0,00	0,00	478.740,56	14.889.186,63	56.093,82	-872.390,72
NTN-B 150545 (5,660001%)	23.091.932,09	0,00	0,00	638.492,52	22.642.974,82	189.535,25	2.099.556,28
NTN-B 150545 (5,859998%)	22.847.103,21	0,00	0,00	646.093,62	22.391.733,46	190.723,87	2.114.979,54
NTN-B 150545 (6,442001%)	71.416.961,49	0,00	0,00	2.153.301,87	69.888.807,66	625.148,04	6.952.370,94
NTN-B 150840 (5,020001%)	54.048.541,95	0,00	0,00	0,00	54.471.912,09	423.370,14	4.682.953,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (6,121999%)	81.847.208,17	0,00	0,00	0,00	82.553.216,69	706.008,52	7.855.838,84
	346.619.139,45	0,00	0,00	6.100.721,34	343.347.787,62	2.829.369,51	32.744.816,77

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	103.800.729,81	0,00	0,00	0,00	103.811.949,49	11.219,68	36.733,90
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	155.126.210,67	0,00	-16.658.322,35	0,00	139.302.030,33	834.142,01	12.171.051,97
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP-RESP LIMITADA	82.660.665,44	0,00	0,00	0,00	82.829.009,90	168.344,46	4.495.992,31
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	56.398.527,92	16.843.533,81	0,00	0,00	73.761.878,21	519.816,48	1.540.846,93
	397.986.133,84	16.843.533,81	-16.658.322,35	0,00	399.704.867,93	1.533.522,63	18.244.625,11

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	152.396,62	0,00	0,00	0,00	152.180,07	-216,55	-1.231,18
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	235.443,80	0,00	0,00	0,00	233.319,83	-2.123,97	-24.883,04
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	3.970.297,76	0,00	0,00	0,00	3.961.744,94	-8.552,82	-36.186,63
	4.358.138,18	0,00	0,00	0,00	4.347.244,84	-10.893,34	-62.300,85

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	624.438,68	0,00	0,00	0,00	621.919,63	-2.519,05	-18.106,95
LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC	1.670.049,43	0,00	0,00	0,00	1.663.031,20	-7.018,23	-156.080,55
	2.294.488,11	0,00	0,00	0,00	2.284.950,83	-9.537,28	-174.187,50

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	48.959.138,95	0,00	0,00	0,00	48.275.229,37	-683.909,58	-8.222,72
BRANCO FIA MID SMALL CAPS	19.160.950,33	0,00	0,00	0,00	18.101.041,59	-1.059.908,74	-4.651.148,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	32.923.445,84	0,00	0,00	0,00	32.589.817,50	-333.628,34	2.262.545,68
	101.043.535,12	0,00	0,00	0,00	98.966.088,46	-2.077.446,66	-2.396.825,64

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 IE	15.432.370,35	0,00	0,00	0,00	17.008.182,79	1.575.812,44	6.336.805,74
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	30.209.811,90	0,00	0,00	0,00	31.642.299,07	1.432.487,17	8.486.227,77
	45.642.182,25	0,00	0,00	0,00	48.650.481,86	3.008.299,61	14.823.033,51

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	184.005,35	0,00	0,00	0,00	183.317,59	-687,76	-11.262,90
	184.005,35	0,00	0,00	0,00	183.317,59	-687,76	-11.262,90

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	1.485.300,73	0,00	0,00	0,00	1.484.650,74	-649,99	-7.706,81
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	0,01	0,00	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00
	1.485.300,74	0,00	0,00	0,00	1.484.650,75	-649,99	-7.706,81

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRCR11	141.201,00	0,00	0,00	0,00	1.623,00	138.214,68	-1.363,32	-28.609,71
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	1.988.000,00	0,00	0,00	0,00	20.000,00	1.897.200,00	-70.800,00	-154.000,00
ÂQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	1.272.528,52	0,00	0,00	0,00	0,00	1.270.986,87	-1.541,65	-49.912,45
	3.401.729,52	0,00	0,00	0,00	21.623,00	3.306.401,55	-73.704,97	-232.522,16

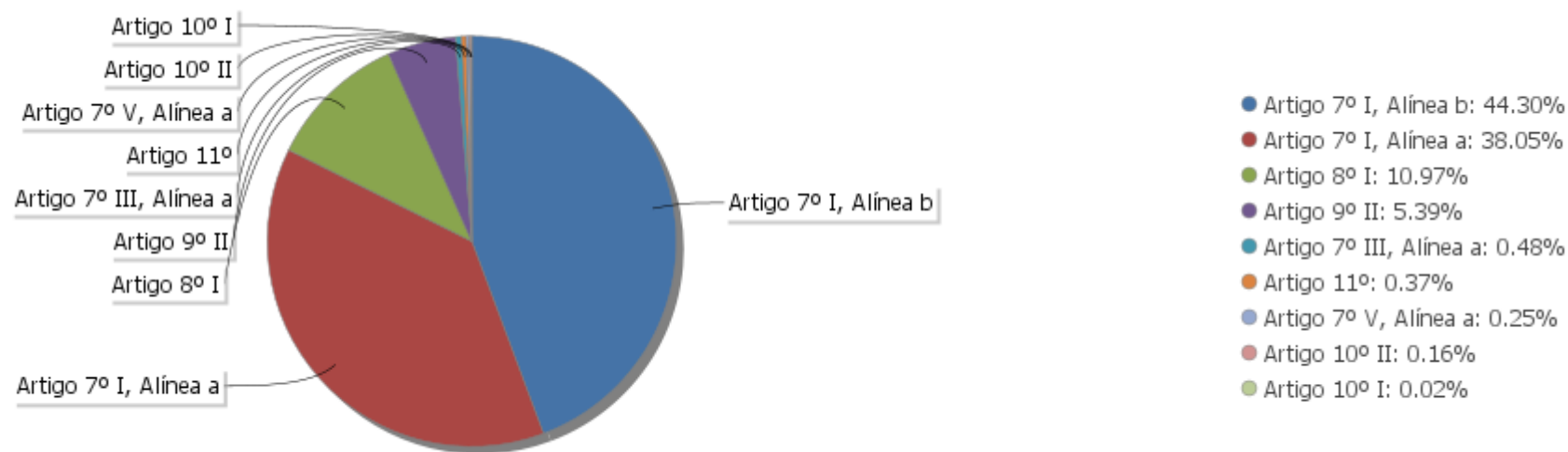
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

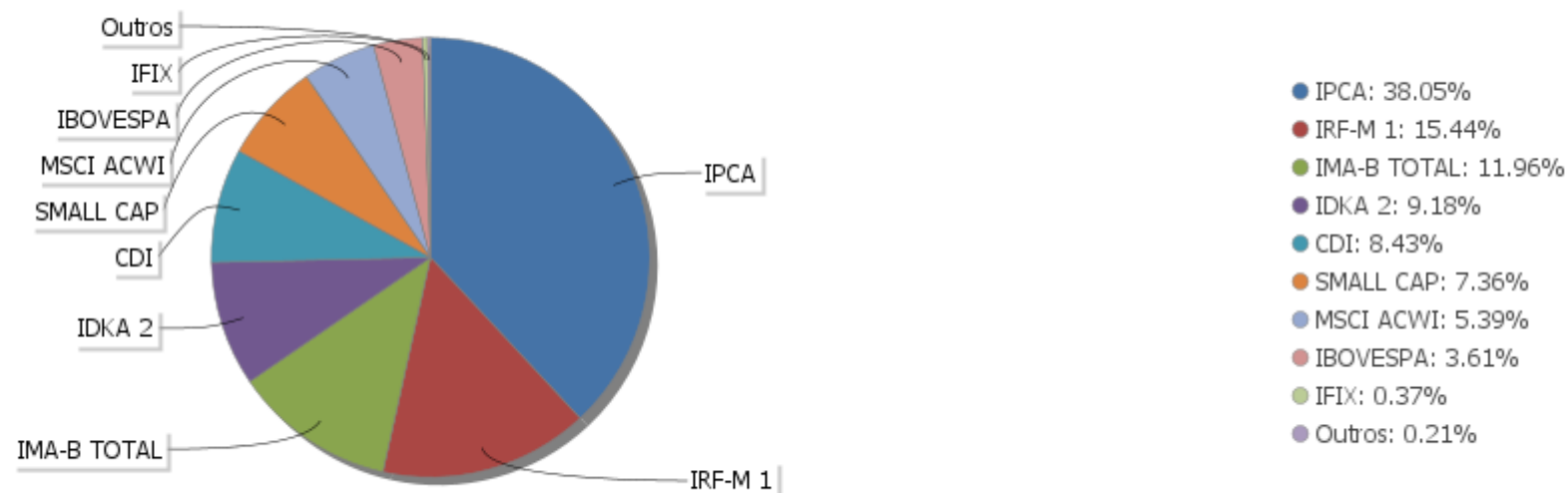
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	515.675.072,66	57,15	515.675.072,66	57,15	
de 31 dias a 365 dias	34.487.017,50	3,82	550.162.090,16	60,97	
acima de 365 dias	352.113.701,27	39,03	902.275.791,43	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

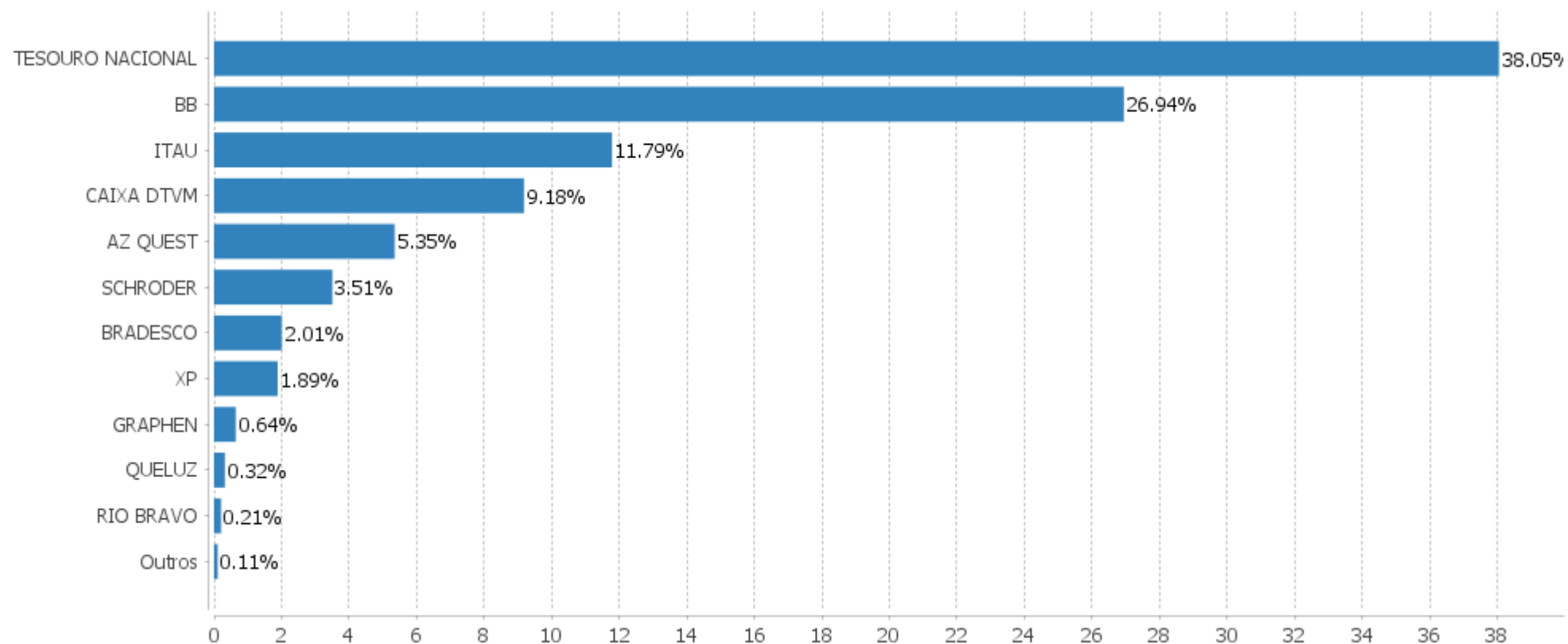


Alocação Por Estratégia



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	0,57		7,55
IPCA + 4,96%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,82	0,40	0,85	1,01	0,76		9,04
p.p. indexador	-0,60	-0,09	0,43	-1,11	-0,31	0,27	0,57	0,95	-0,87	-0,43	-0,18		-1,49
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

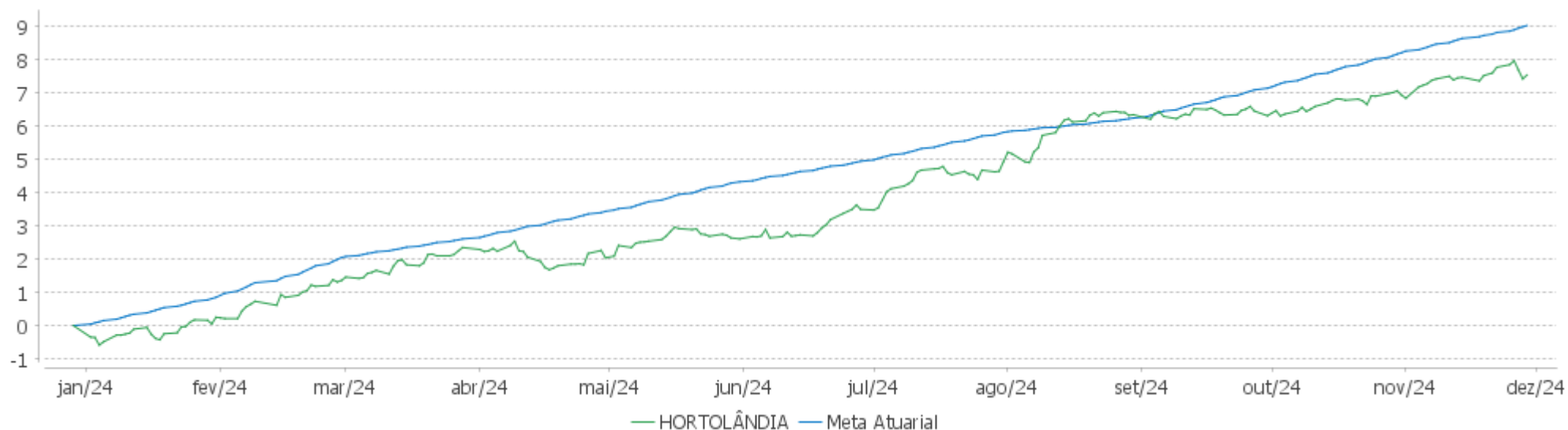
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	33	46,48	03 meses	1,13	2,63	-1,50	1,71
Meses abaixo - Meta Atuarial	38	53,52	06 meses	4,81	4,51	0,30	1,87
			12 meses	9,69	10,08	-0,39	1,93
			24 meses	21,32	20,92	0,39	2,44
			36 meses	27,12	34,32	-7,20	3,03
			48 meses	29,32	56,79	-27,47	3,36
			60 meses	34,11	73,08	-38,97	5,36
			Desde 31/12/2018	52,69	88,32	-35,63	5,13

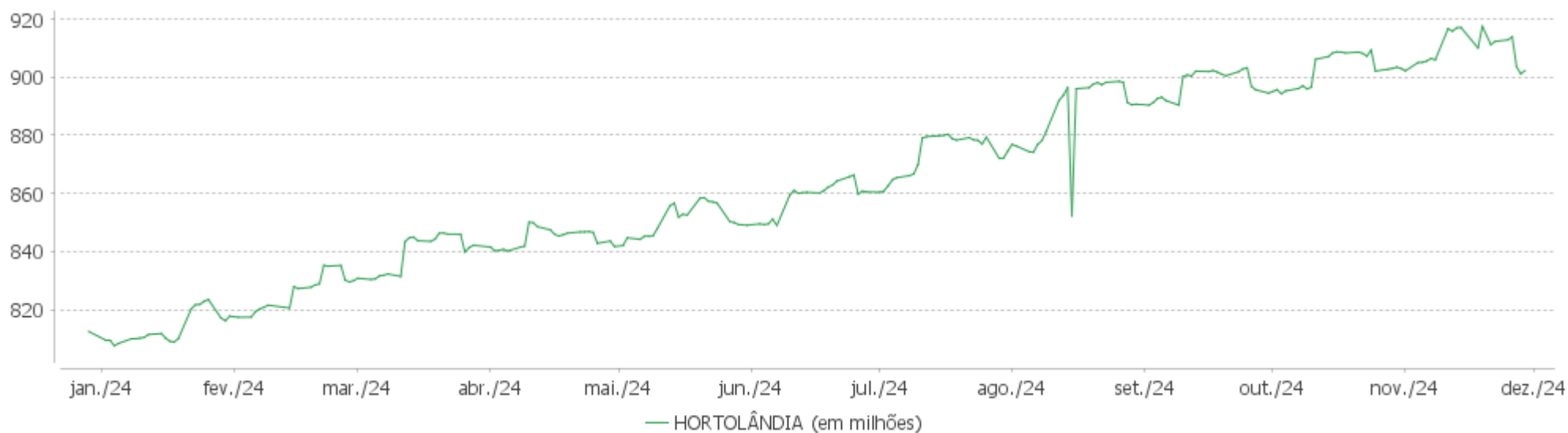
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,88	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-6,76	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

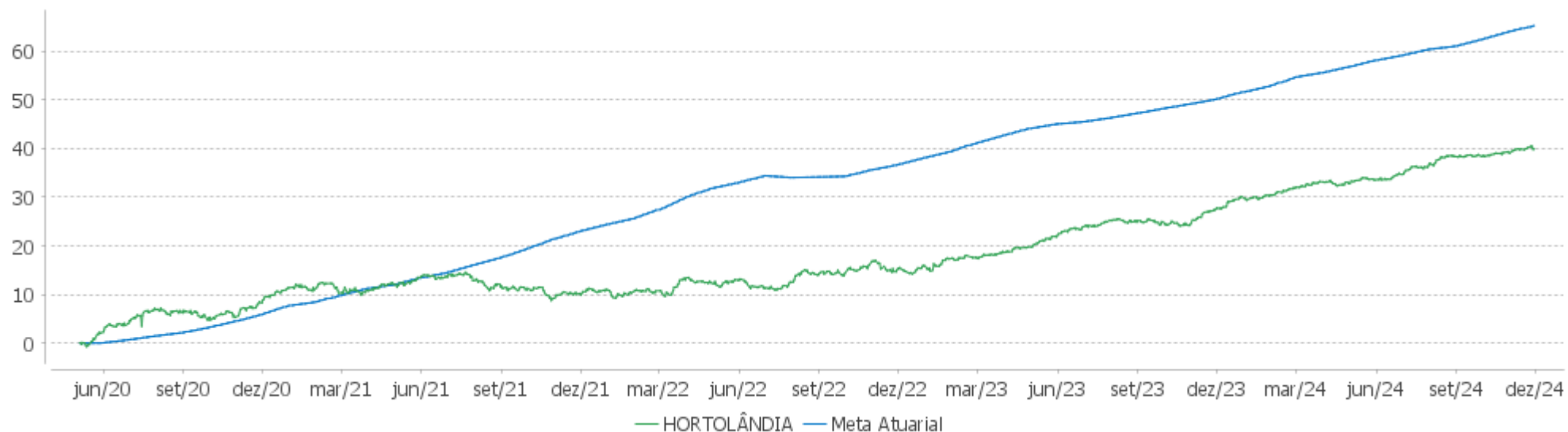


Patrimônio Líquido No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

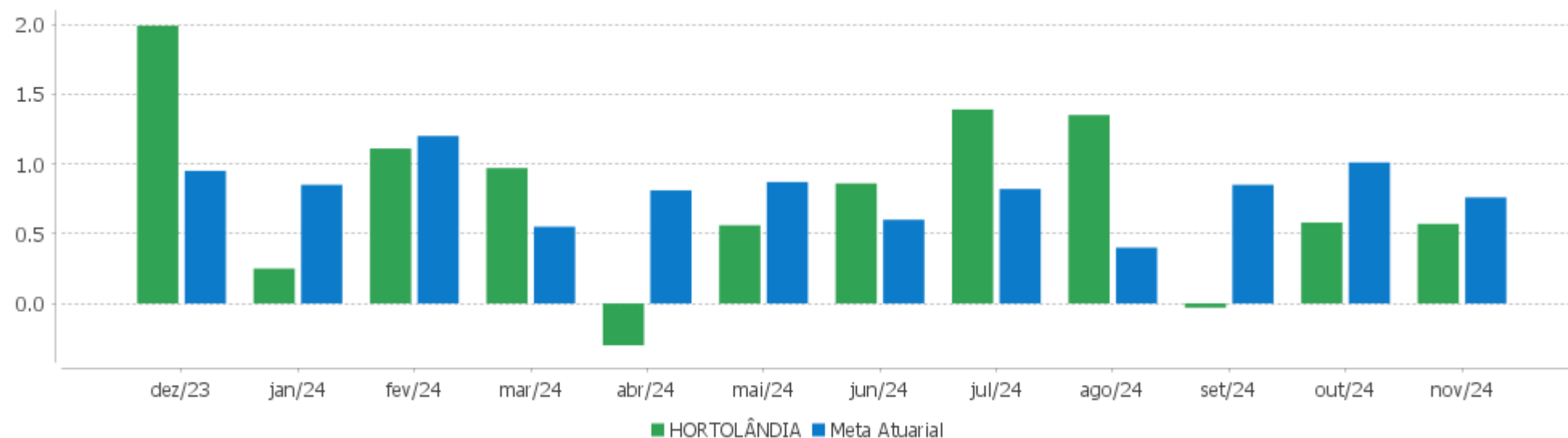


Patrimônio Líquido



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
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,54 -0,02	8,44 -0,26	2,18 -0,08	4,50 -0,17	9,40 -0,29	23,83 -0,72	37,92 -1,18
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP- RESP LIMITADA Var. IDKA 2 p.p.	0,20 -0,01	5,74 -0,35	1,36 -0,06	2,90 -0,07	7,22 -0,41	19,78 -0,65	29,95 -1,20
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,01 -0,01	-0,07 -0,25	-1,34 -0,05	0,17 -0,14	2,67 -0,27	15,44 -0,60	22,99 -0,96
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,79 100,40	9,81 99,50	2,57 99,80	5,22 99,79	10,78 99,50	25,41 99,31	40,41 99,48
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	0,35 -0,04	-5,29 -9,58	-3,63 -5,03	-2,11 -4,09	-1,59 -6,47	12,36 2,58	15,89 -0,37
NTN-B 150545 (6,442001%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,50	10,54 6,25	2,71 1,31	5,26 3,29	11,74 6,87	24,49 14,71	40,73 24,47
NTN-B 150545 (5,660001%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,44	9,79 5,50	2,52 1,12	4,87 2,90	10,90 6,02	22,65 12,86	37,63 21,37
NTN-B 150535 (5,813502%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,45	9,94 5,65	2,56 1,16	4,95 2,97	10,99 6,12	22,93 13,15	38,15 21,89
NTN-B 150840 (6,121999%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,47	10,23 5,94	2,63 1,23	5,10 3,13	11,36 6,49	23,70 13,91	39,41 23,15
NTN-B 150840 (5,020001%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,39	9,18 4,89	2,36 0,97	4,55 2,57	10,17 5,30	21,11 11,33	35,09 18,82
NTN-B 150535 (5,170000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,40	9,32 5,03	2,40 1,00	4,62 2,65	10,30 5,43	21,43 11,64	35,63 19,37
NTN-B 150545 (5,859998%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,45	9,98 5,69	2,57 1,17	4,97 3,00	11,11 6,24	23,12 13,33	38,42 22,16
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,40 -50,99	-2,83 -28,71	-1,28 -49,80	-2,66 -50,86	-3,30 -30,46	-6,59 -25,77	-62,82 -154,65
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,42 -53,11	-8,58 -87,07	-1,25 -48,37	-6,42 -122,84	-8,98 -82,88	-11,50 -44,94	-8,55 -21,06
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,14 -0,16	-0,80 -0,99	-0,93 0,36	-0,95 -1,27	-0,64 -3,58	5,16 -10,88	11,61 -12,34
LME REC IMA B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,22 -0,24	-0,91 -1,09	-0,27 1,02	-1,30 -1,62	-0,40 -3,34	3,98 -12,06	8,94 -15,01
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	-0,90	-9,64	-5,02	-10,17	-9,81	-43,69	-49,47

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.	-1,26	-16,10	-6,52	-13,62	-17,83	-64,18	-81,54
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. SMALL CAP p.p.	-1,40 3,08	-0,02 18,65	-4,15 5,79	6,54 11,39	5,22 18,15	13,19 20,80	7,69 23,70
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. IBOVESPA p.p.	-1,01 2,11	7,46 13,81	-4,27 3,33	10,29 7,37	15,36 16,67	21,92 10,20	27,17 3,86
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-5,53 -1,05	-20,44 -1,78	-12,03 -2,10	-8,77 -3,93	-15,86 -2,93	-19,81 -12,20	-21,51 -5,50
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. MSCI ACWI p.p.	4,74 -3,83	36,65 -11,69	4,56 -6,16	19,86 -6,94	42,22 -10,12	53,30 -3,01	20,90 -6,97
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	10,21 1,64	59,38 11,04	20,34 9,62	39,91 13,11	65,79 13,44	112,92 56,61	17,28 -10,59
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V Var. Não Se Aplica p.p.	-0,37 -0,37	-5,79 -5,79	-1,15 -1,15	-2,29 -2,29	-6,13 -6,13	-12,14 -12,14	-16,74 -16,74
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,00 -0,83	0,00 -10,04	0,00 -2,88	0,00 -5,04	0,00 -11,17	0,00 -23,33	0,00 -38,44
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,04 -0,88	-0,52 -10,55	-0,14 -3,03	-0,29 -5,32	-0,57 -11,73	-1,17 -24,49	-1,85 -40,29
BRCR11 Var. IFIX p.p.	-0,96 1,14	-16,69 -11,43	-12,35 -4,80	-16,59 -9,35	-17,43 -16,19	-7,10 -16,52	-7,53 -29,20
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,12 1,99	-3,78 1,48	-0,49 7,06	-3,26 3,98	-3,88 -2,64	-6,18 -15,60	7,05 -14,62
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII Var. IFIX p.p.	-3,61 -1,50	-7,67 -2,41	-10,40 -2,85	-10,12 -2,88	6,73 7,96	37,25 27,83	47,05 25,38
HORTOLÂNDIA Var. IPCA + 4,96% p.p.	0,57 -0,18	7,55 -1,49	1,13 -1,50	4,81 0,30	9,69 -0,38	21,32 0,39	27,12 -7,29
CDI	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58	40,62
IBOVESPA	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72	23,31
INPC + 6,00%	0,77	10,01	2,91	4,86	11,13	22,31	37,39
IPCA + 6,00%	0,83	10,04	2,88	5,04	11,17	23,33	38,44

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 VARIAÇÃO 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
BRABESCO FIA 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				
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP- RESP LIMITADA	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 SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
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 IE	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	0,57	8,70	2,25	4,67	9,69	24,55	39,10	42,37	47,99
IRF-M 1+	-1,13	1,19	-1,16	0,25	2,94	21,88	31,77	26,13	33,70
IRF-M TOTAL	-0,52	3,57	0,03	1,73	5,11	22,46	33,80	31,22	38,18
IMA-B 5	0,36	6,46	1,51	3,44	8,02	20,49	32,08	39,53	49,87
IMA-B 5+	-0,23	-4,45	-3,28	-1,64	-0,68	12,61	17,33	18,28	19,09
IMA-B TOTAL	0,02	0,19	-1,29	0,32	2,94	16,04	23,95	28,04	32,54
IMA-GERAL TOTAL	0,32	5,72	1,04	3,28	7,44	22,31	34,25	37,09	42,81
IDKA 2	0,22	6,09	1,42	2,97	7,63	20,43	31,15	38,90	50,09
IDKA 20	-0,82	-13,71	-7,94	-6,77	-8,03	6,06	5,14	2,45	-2,26
CDI	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58	40,62	45,93	50,28

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72	23,31	15,40	16,11
IBRX 100	-2,91	-5,57	-7,24	3,28	-0,40	11,51	22,85	15,49	17,47
IBRX 50	-2,62	-4,28	-7,20	3,62	0,80	11,99	26,06	18,92	20,01
SMALL CAP	-4,48	-18,66	-9,94	-4,85	-12,93	-7,61	-16,01	-27,09	-24,11
Índice Consumo - ICON	-5,91	-16,48	-10,36	-2,17	-11,49	-15,37	-33,32	-48,25	-46,33
Índice Dividendos - IDIV	-0,07	2,38	-2,50	8,11	9,45	27,77	48,64	49,15	49,07

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	10,77	58,14	14,30	32,01	61,98	69,06	42,28	89,11	175,24

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,11	-5,26	-7,55	-7,24	-1,23	9,42	21,68	11,71	8,55

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,57	48,34	10,72	26,80	52,35	56,31	27,87	58,39	126,10

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,39	4,29	1,40	1,98	4,87	9,78	16,26	28,75	34,30
INPC	0,33	4,27	1,43	1,80	4,84	8,88	15,38	28,03	34,68
IGPM	1,30	5,55	3,48	5,25	6,33	2,65	8,70	28,14	59,57
SELIC	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58	40,62	45,92	50,28

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,69	8,12	2,40	4,03	9,07	18,72	30,76	50,55	63,27
IPCA + 5,00%	0,76	9,08	2,64	4,53	10,12	21,01	34,56	56,40	71,24
IPCA + 5,50%	0,80	9,56	2,76	4,79	10,64	22,17	36,49	59,39	75,34
IPCA + 5,89%	0,82	9,93	2,86	4,98	11,05	23,07	38,01	61,76	78,59
IPCA + 6,00%	0,83	10,04	2,88	5,04	11,17	23,33	38,44	62,43	79,51
INPC + 4,00%	0,63	8,10	2,43	3,85	9,03	17,74	29,77	49,70	63,73
INPC + 6,00%	0,77	10,01	2,91	4,86	11,13	22,31	37,39	61,52	80,03

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%)	22.624.524,35	5,170000	19.814.762,44	6,957200	-2.809.761,91
NTN-B 150535 (5,813502%)	53.885.431,92	5,813502	49.532.815,55	6,957200	-4.352.616,37
NTN-B 150545 (5,660001%)	22.642.974,82	5,660001	19.857.591,22	6,830100	-2.785.383,60
NTN-B 150545 (5,859998%)	22.391.733,46	5,859998	20.093.991,11	6,830100	-2.297.742,35
NTN-B 150545 (6,442001%)	69.888.807,66	6,442001	66.969.285,64	6,830100	-2.919.522,02
NTN-B 150840 (5,020001%)	54.471.912,09	5,020001	45.704.325,86	6,835600	-8.767.586,23
NTN-B 150840 (6,121999%)	82.553.216,69	6,121999	77.162.826,92	6,835600	-5.390.389,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
336	01/11/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	80.000,00	21.033,42143400	3,8034705980
344	05/11/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	240.000,00	63.015,86409300	3,8085647710
335	05/11/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	80.000,00	21.005,28803100	3,8085647710
343	08/11/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	754.322,35	197.918,74536000	3,8112728970
339	11/11/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	10.069.533,81	0,00	142.600,21525000	70,6137350000
338	13/11/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	626.000,00	0,00	8.857,52677000	70,6743560000
337	19/11/2024	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	6.148.000,00	0,00	86.881,51575000	70,7630380000
342	21/11/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	7.003.000,00	1.832.178,30568200	3,8222262420
334	21/11/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	100.000,00	26.162,76318300	3,8222262420
333	22/11/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	265.000,00	69.310,26036200	3,8233877440
332	25/11/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	140.000,00	36.605,83171800	3,8245272250
340	27/11/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	710.000,00	185.591,60533900	3,8256040660
341	27/11/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	7.046.000,00	1.841.800,63551800	3,8256040660
331	27/11/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	140.000,00	36.595,52781300	3,8256040660
330	28/11/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	100.000,00	26.145,12836600	3,8248043230
Total			16.843.533,81	16.658.322,35		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 8.129.097,30

Value-At-Risk: 0,90%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,37	0,49		0,21	-0,16	0,58	749.684.851,22	83,09
Artigo 8º	17,32	6,23		0,57	-0,16	-2,06	98.966.088,46	10,97
Artigo 9º	17,08	9,24		0,12	0,34	6,59	48.650.481,86	5,39
Artigo 10º	0,14	0,01		-0,00	-6,14	-0,08	1.667.968,34	0,18
Artigo 11º	10,64	0,53		0,00	-0,28	-2,18	3.306.401,55	0,37
HORTOLÂNDIA		0,90		0,90			902.275.791,43	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,49%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,170000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,02	0,79	22.624.524,35	2,51
NTN-B 150535 (5,813502%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,34	0,84	53.885.431,92	5,97
NTN-B 150840 (5,020001%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	-0,05	0,78	54.471.912,09	6,04
NTN-B 150840 (6,121999%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,49	0,86	82.553.216,69	9,15
NTN-B 150545	10,49	3,47	0,03	3,47	-0,04	0,35	14.889.186,63	1,65
NTN-B 150545 (5,660001%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,26	0,83	22.642.974,82	2,51
NTN-B 150545 (5,859998%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,36	0,84	22.391.733,46	2,48
NTN-B 150545 (6,442001%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,65	0,89	69.888.807,66	7,75
Sub-total	0,44	0,17	0,03		0,07	0,82	343.347.787,62	38,05

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,25	2,04	0,12	0,02	-0,12	0,01	103.811.949,49	11,51
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,47	0,23	0,01	0,01	-0,53	0,54	139.302.030,33	15,44
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP- RESP LIMITADA	2,37	1,10	0,05	0,22	-0,25	0,20	82.829.009,90	9,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,02	0,02	-0,00	0,01	0,20	0,79	73.761.878,21	8,18
Sub-total	2,16	0,79	0,18		-0,19	0,38	399.704.867,93	44,30

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRA1 FI RENDA FIXA	0,29	0,12	-0,00	2,06	-3,20	-0,14	152.180,07	0,02
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	3,20	0,34	0,00	1,02	-0,53	-0,90	233.319,83	0,03
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	1,52	0,54	0,00	1,85	-0,66	-0,22	3.961.744,94	0,44
Sub-total	1,39	0,49	0,00		-0,75	-0,25	4.347.244,84	0,48

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC PREMIUM	1,47	0,10	-0,00	0,10	-0,81	-0,40	621.919,63	0,07
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,53	0,28	-0,00	0,28	-0,79	-0,42	1.663.031,20	0,18
Sub-total	1,52	0,22	-0,00		-0,80	-0,42	2.284.950,83	0,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,23%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	14,91	6,21	0,26	6,27	-0,15	-1,40	48.275.229,37	5,35
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	26,40	8,54	0,12	2,88	-0,24	-5,53	18.101.041,59	2,01
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	18,71	6,79	0,19	3,21	-0,10	-1,01	32.589.817,50	3,61
Sub-total	17,32	6,23	0,57		-0,16	-2,06	98.966.088,46	10,97

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,24%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	18,47	9,61	0,05	9,69	0,51	10,21	17.008.182,79	1,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	17,84	9,57	0,07	9,22	0,22	4,74	31.642.299,07	3,51
Sub-total	17,08	9,24	0,12		0,34	6,59	48.650.481,86	5,39

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	0,00	0,01	0,00	0,01	-2.810,04	-0,37	183.317,59	0,02
Sub-total	0,00	0,01	0,00		-2.766,74	-0,37	183.317,59	0,02

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,16	0,01	-0,00	0,08	-5,24	-0,04	1.484.650,74	0,16
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	0,00	0,00	0,00	0,08	0,00	0,00	0,01	0,00
Sub-total	0,16	0,01	-0,00		-5,24	-0,04	1.484.650,75	0,16

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,53%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRCR11	20,38	7,39	0,00	6,61	-0,09	-0,96	138.214,68	0,02
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	17,61	0,67	0,00	2,94	-0,25	-3,61	1.897.200,00	0,21
ÂQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	0,44	0,15	-0,00	2,90	-2,07	-0,12	1.270.986,87	0,14
Sub-total	10,64	0,53	0,00		-0,28	-2,18	3.306.401,55	0,37

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O fundo FIDC PREMIUM não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo BRA1 FI RENDA FIXA 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 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 GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA 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 BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP 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;
- O fundo FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.