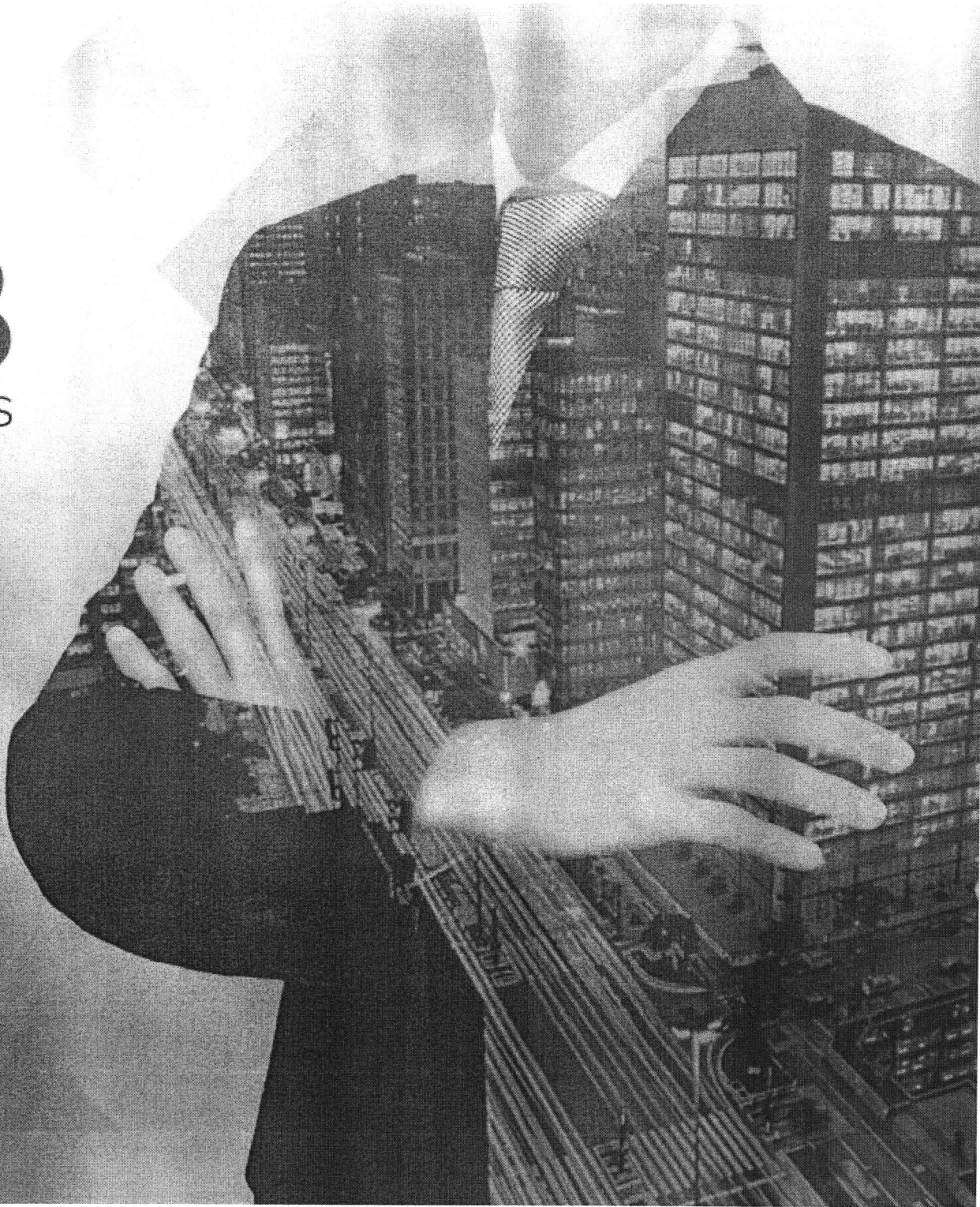


LDB
EMPRESAS

JALES
AGOSTO 2024

[Handwritten signature]



Prezados Senhores,

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

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

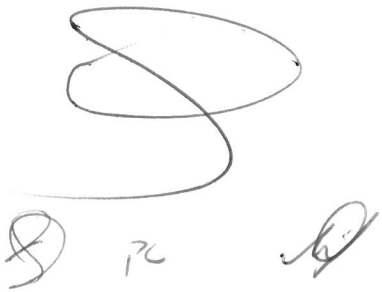
Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

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

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

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

Equipe LDB Empresas.

Handwritten signature and initials in the bottom left corner. The signature is a large, stylized 'S' shape. Below it are the initials 'PC' and another signature.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

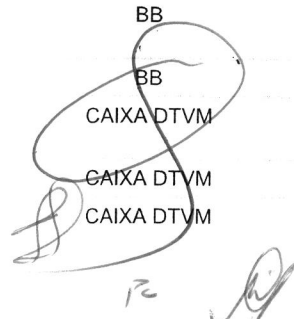
75,08%

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	4,10	0,00	0,51	7,46	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,700000%)	3,13	0,03	0,19	0,19	1.538.961,05	2,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,540000%)	4,25	0,03	0,22	0,22	1.540.558,58	2,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,490000%)	3,44	0,02	0,23	0,23	1.538.033,88	2,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,96	-0,56	1,14	-1,72	2.703.021,53	3,77
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,83	-0,19	0,66	3,06	7.320.575,04	10,20

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,65	0,02	0,95	5,91	1.311.405,83	1,83	6.458.247.673,10	0,02
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,14	0,14	0,61	1,31	2.777.512,01	3,87	3.467.274.754,62	0,08
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,76	0,00	0,58	7,44	0,00	0,00	586.369.898,98	0,00
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	3,32	-0,07	0,68	2,34	1.402.581,92	1,95	821.214.445,73	0,17
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,75	0,00	0,58	7,37	0,00	0,00	392.787.249,14	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,87	0,11	0,59	4,32	835.463,62	1,16	4.335.355.090,03	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,05	-0,27	0,50	1,33	3.978.390,24	5,54	3.888.604.125,92	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	-0,22	0,64	3,37	6.027.791,40	8,40	1.624.970.153,09	0,37



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,48	-0,12	0,42	4,79	16.333.145,02	22,76		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	4,06	-0,27	0,43	1,18	2.988.008,75	4,16	777.957.277,97	0,38
BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,04	0,91	0,96	6.949.355,85	9,68	15.057.333.281,43	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,04	0,88	7,33	5.642.540,14	7,86	18.688.563.354,91	0,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,09	0,04	0,89	1,97	7.316.903,72	10,20	7.241.319.247,76	0,10
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,04	0,91	5,70	2.172.615,40	3,03	3.601.057.030,35	0,06
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,49	0,05	0,77	2,52	1.543.858,72	2,15	912.411.700,86	0,17
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,86	0,01	0,95	5,98	26.613.282,58	37,09		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SANTANDER	SANTANDER	LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 5,74% a.a	2,62	0,87	0,87	4,26	2.085.237,58	2,91		
SANTANDER	SANTANDER	LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a.a	2,82	0,94	0,94	1,84	1.527.674,38	2,13		
Sub-total Artigo 7º IV			2,45	0,90	0,90	3,97	3.612.911,96	5,03		
Renda Fixa			16,33	-0,00	0,76	20,10	53.879.914,60	75,08		



2 de 28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

14,15%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,85	0,50	6,80	2,47	1.216.180,63	1,69	822.113.263,16	0,15
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	13,02	0,04	5,07	-0,26	981.782,80	1,37	768.602.980,72	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,53	-0,08	4,36	-10,14	495.685,81	0,69	631.340.232,56	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,93	0,61	9,54	2,74	5.951.976,50	8,29	722.164.315,16	0,82
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	16,18	0,30	4,06	0,90	1.505.592,02	2,10	585.382.543,19	0,26
Sub-total Artigo 8º I			14,30	0,46	7,66	-0,14	10.151.217,76	14,15		
Renda Variável			14,30	0,46	7,66	-0,14	10.151.217,76	14,15		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,18%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	15,16	0,81	1,39	31,34	4.437.186,55	6,18	1.551.525.015,19	0,29
Sub-total Artigo 9º III			15,16	0,81	1,39	31,34	4.437.186,55	6,18		
Investimentos no Exterior			16,34	0,81	1,39	31,34	4.437.186,55	6,18		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,59%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	2,61	0,04	0,93	7,02	3.291.993,33	4,59	59.883.193,14	5,50
Sub-total Artigo 10º I			2,61	0,04	0,93	7,02	3.291.993,33	4,59		
Investimentos Estruturados			0,99	0,04	0,93	7,02	3.291.993,33	4,59		
Total			2,81	0,12	1,74	5,71	71.760.312,24	100,00		

40

PC



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	47.703,35
Sub-total Disponibilidades Financeiras	47.703,35
Total	71.808.015,59



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Pró-Gestão Nível 1
				Mínimo	Objetivo	Máximo		Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	7.320.575,04	10,20	0,00	12,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	16.333.145,02	22,76	0,00	28,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	26.613.282,58	37,09	0,00	22,00	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	3.612.911,96	5,03	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	53.879.914,60	75,08					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	10.151.217,76	14,15	0,00	15,30	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	10.151.217,76	14,15					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	4.437.186,55	6,18	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.437.186,55	6,18					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.291.993,33	4,59	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	3.291.993,33	4,59					15,00
Total		71.760.312,24	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 76,13	3,06 43,06	2,07 80,20	2,52 48,14		56.955,51	200.419,27
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,42 48,06	4,79 67,43	1,89 73,20	3,40 65,05		175.877,51	1.369.982,21
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,95 109,19	5,98 84,26	2,61 100,82	4,47 85,49		135.368,45	911.099,22
Artigo 7º IV % do CDI	0,90 103,92	3,97 85,30	2,23 86,38			32.280,92	112.911,96
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	7,66 1,12	-0,14 -1,49	9,08 -2,31	1,20 -4,21		722.682,72	-38.040,00
Artigo 9º III % do CDI	1,39 160,76	31,34 441,68	10,76 416,10	17,87 341,79		61.029,00	1.058.917,58
Artigo 10º I % do CDI	0,93 107,65	7,02 98,95	3,14 121,35	5,45 104,21		30.457,28	216.012,58
JALES (Total)						1.214.651,39	3.831.302,82

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 150527 (6,540000%)	0,00	1.537.118,30	0,00	0,00	1.540.558,58	3.440,28	3.440,28
NTN-B 150545	2.672.499,26	0,00	0,00	0,00	2.703.021,53	30.522,27	-50.315,47
NTN-B 150824	3.403.868,56	0,00	-3.421.169,67	0,00	0,00	17.301,11	241.602,61
NTN-B 150826 (6,700000%)	0,00	1.580.896,69	0,00	44.652,69	1.538.961,05	2.717,05	2.717,05
NTN-B 150828 (6,490000%)	0,00	1.579.839,35	0,00	44.780,27	1.538.033,88	2.974,80	2.974,80
	6.076.367,82	4.697.854,34	-3.421.169,67	89.432,96	7.320.575,04	56.955,51	

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1.299.105,65	0,00	0,00	0,00	1.311.405,83	12.300,18	70.808,87

Carteira: JALES

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	2.760.550,16	80.364,11	-80.364,11	0,00	2.777.512,01	16.961,85	36.147,24
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	3.422.047,34	0,00	-3.441.932,16	0,00	0,00	19.884,82	239.703,64
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	1.392.964,75	40.289,60	-40.289,60	0,00	1.402.581,92	9.617,17	32.395,83
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	9.376.166,07	0,00	-9.430.161,73	0,00	0,00	53.995,66	651.343,73
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	830.551,71	0,00	0,00	0,00	835.463,62	4.911,91	34.708,07
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.958.617,73	0,00	0,00	0,00	3.978.390,24	19.772,51	51.062,90
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.989.357,99	0,00	0,00	0,00	6.027.791,40	38.433,41	181.639,14
	29.029.361,40	120.653,71	-12.992.747,60	0,00	16.333.145,02	175.877,51	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B	2.975.202,85	0,00	0,00	0,00	2.988.008,75	12.805,90	34.757,76
BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.308.441,49	5.609.142,69	0,00	0,00	6.949.355,85	31.771,67	32.415,72
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.052.300,39	5.431.087,85	-3.865.000,00	0,00	5.642.540,14	24.151,90	388.405,16
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.851.545,82	5.548.953,52	-1.117.865,71	0,00	7.316.903,72	34.270,09	62.871,88
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	4.736.318,76	70.766,62	-2.655.000,00	0,00	2.172.615,40	20.530,02	203.494,74
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	1.532.019,85	0,00	0,00	0,00	1.543.858,72	11.838,87	35.300,49
	17.455.829,16	16.659.950,68	-7.637.865,71	0,00	26.613.282,58	135.368,45	

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 5,74% a.a	2.067.245,62	0,00	0,00	0,00	2.085.237,58	17.991,96	85.237,58
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a.a	1.513.385,42	0,00	0,00	0,00	1.527.674,38	14.288,96	27.674,38
	3.580.631,04	0,00	0,00	0,00	3.612.911,96	32.280,92	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	1.138.694,29	0,00	0,00	0,00	1.216.180,63	77.486,34	29.291,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	934.451,27	0,00	0,00	0,00	981.782,80	47.331,53	-2.568,48
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	474.998,16	0,00	0,00	0,00	495.685,81	20.687,65	-55.952,11
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	5.433.488,52	0,00	0,00	0,00	5.951.976,50	518.487,98	158.853,72
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	1.446.902,80	0,00	0,00	0,00	1.505.592,02	58.689,22	12.268,00
	9.428.535,04	0,00	0,00	0,00	10.151.217,76	722.682,72	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	4.376.157,55	0,00	0,00	0,00	4.437.186,55	61.029,00	1.058.917,58
	4.376.157,55	0,00	0,00	0,00	4.437.186,55	61.029,00	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	3.261.536,05	0,00	0,00	0,00	3.291.993,33	30.457,28	216.012,58
	3.261.536,05	0,00	0,00	0,00	3.291.993,33	30.457,28	



Carteira: JALES

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

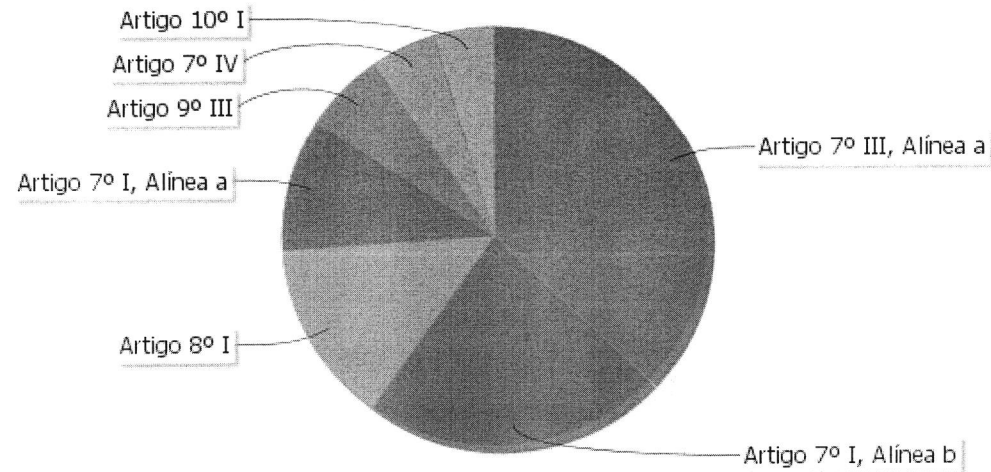
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	54.159.356,49	75,47		54.159.356,49	75,47	
de 31 dias a 365 dias	2.487.374,82	3,47		56.646.731,31	78,94	
acima de 365 dias	15.113.580,93	21,06		71.760.312,24	100,00	

3

[Handwritten signature]
PC

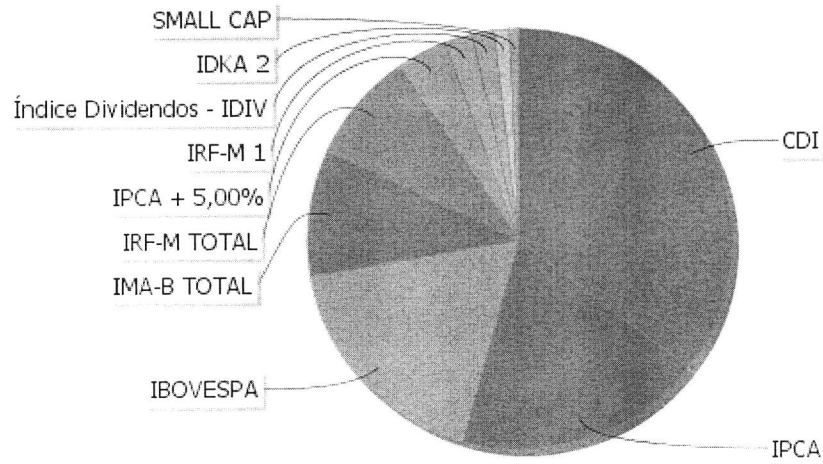
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



- Artigo 7º III, Alínea a: 37.09%
- Artigo 7º I, Alínea b: 22.76%
- Artigo 8º I: 14.15%
- Artigo 7º I, Alínea a: 10.20%
- Artigo 9º III: 6.18%
- Artigo 7º IV: 5.03%
- Artigo 10º I: 4.59%

Alocação Por Estratégia



- CDI: 35.36%
- IPCA: 19.02%
- IBOVESPA: 17.94%
- IMA-B TOTAL: 9.71%
- IRF-M TOTAL: 8.40%
- IPCA + 5,00%: 3.87%
- IRF-M 1: 2.15%
- Índice Dividendos - IDIV: 1.69%
- IDKA 2: 1.16%
- SMALL CAP: 0.69%

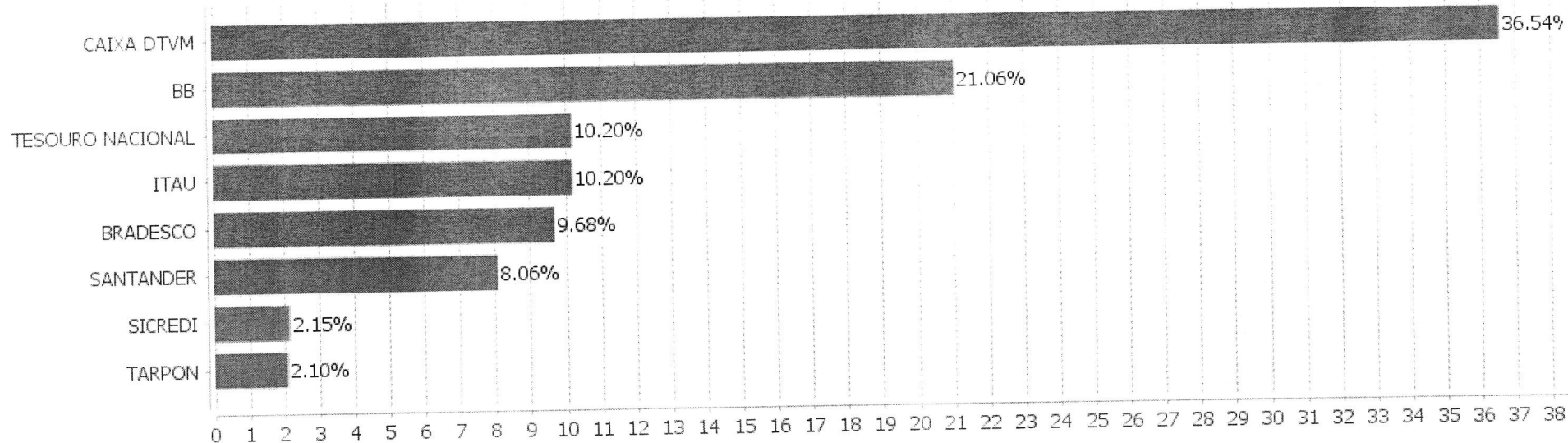
[Handwritten signature]

[Handwritten initials]

Carteira: JALES

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



[Handwritten mark]

[Handwritten signature]
PC

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	0,22	1,17	0,73	-0,95	0,73	0,84	1,11	1,74					5,71
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59	0,82	0,40					6,23
p.p. indexador	-0,62	-0,02	0,19	-1,75	-0,14	0,25	0,28	1,34					-0,52

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

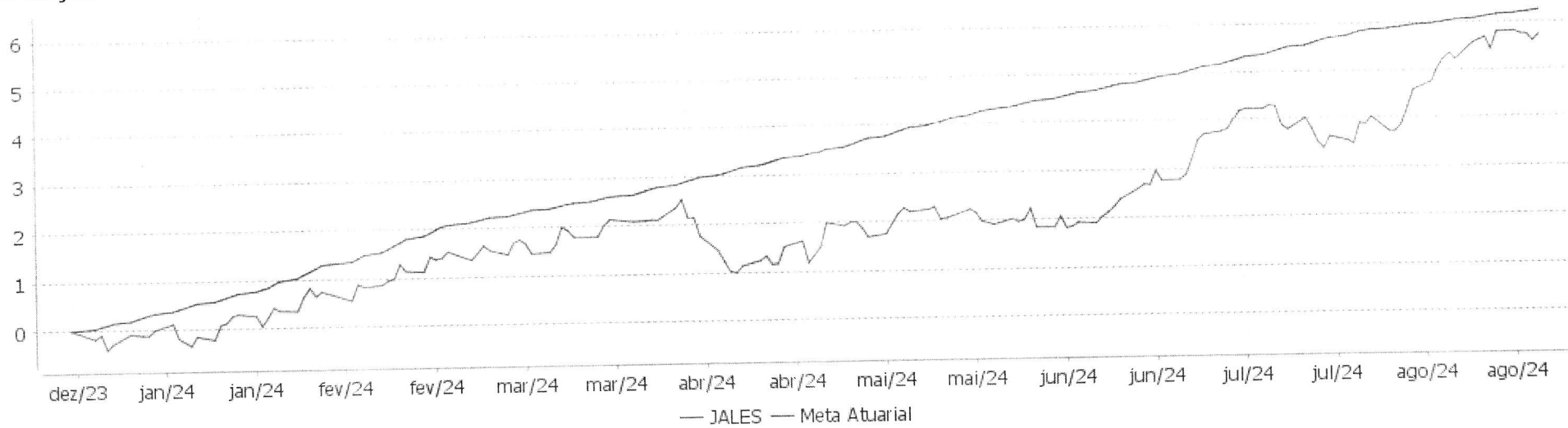
	Quantidade	Perc. (%)	Periodo	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	4	50,00	03 meses	3,73	1,83	1,90	2,87
Meses abaixo - Meta Atuarial	4	50,00	06 meses	4,26	4,10	0,16	2,88
			12 meses				
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,74	2024-08	Desde 29/12/2023	5,71	6,23	-0,52	2,81
Menor rentabilidade da Carteira	-0,95	2024-04					



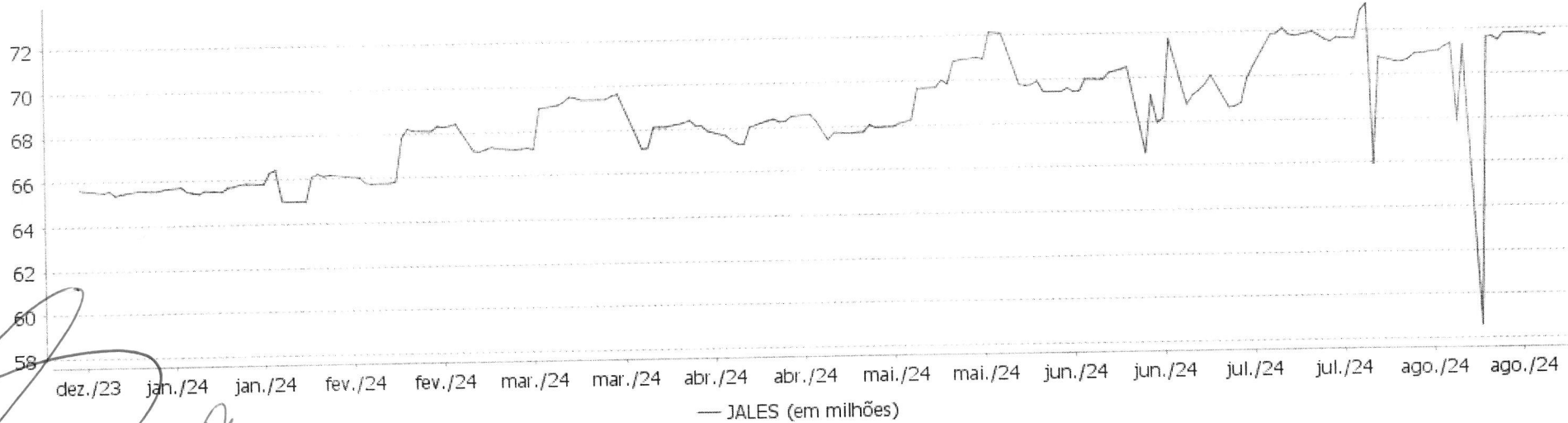
Carteira: JALES

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



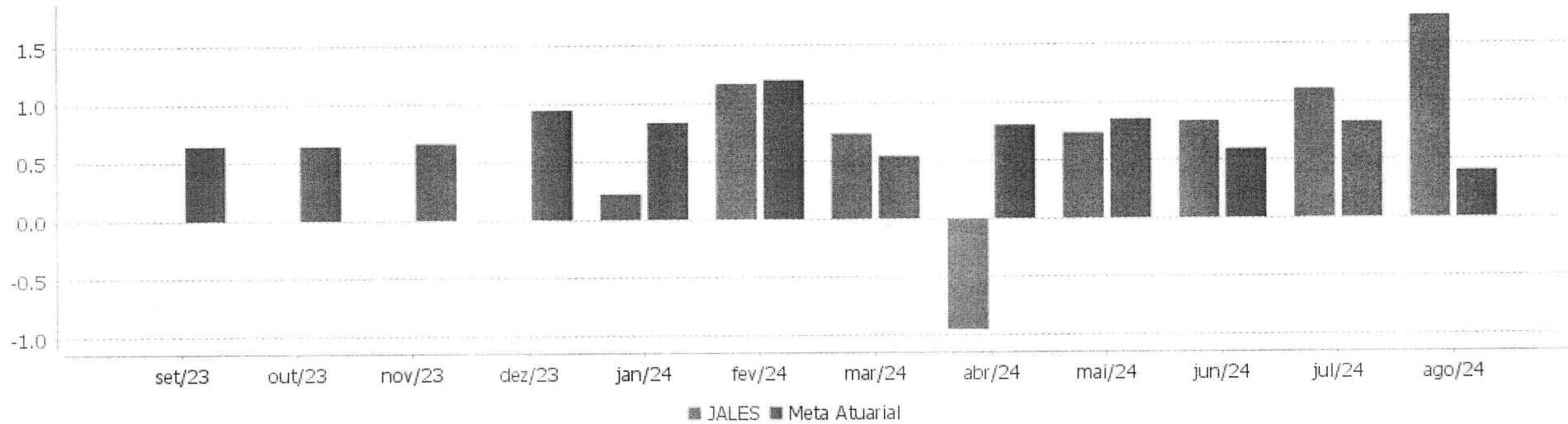
Patrimônio Líquido



Handwritten notes and signatures:
PC
[Signature]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



[Handwritten signature]
[Handwritten initials]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

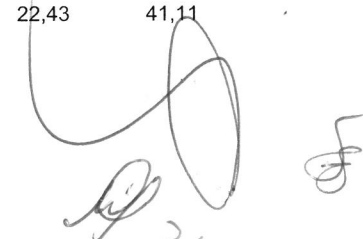
Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Varição da Estratégia							
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 5,74% a.a Var. IPCA p.p.	0,87 0,89	4,26 2,79	2,52 1,95				
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a.a Var. IPCA p.p.	0,94 0,96	1,84 1,46					
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	1,14 1,16	-1,72 -4,58	1,57 1,00	-0,62 -2,20	2,82 -1,42	19,00 9,96	18,71 0,15
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	0,47 0,49	7,42 4,56	2,66 2,09	5,41 3,83	10,90 6,67	23,46 14,42	34,67 16,11
NTN-B 150527 (6,540000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,78	4,56 1,70	2,51 1,94	2,33 0,75	4,75 0,51		
NTN-B 150826 (6,700000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,80	4,66 1,81	2,56 1,99	5,48 3,90	8,05 3,81		
NTN-B 150828 (6,490000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,78	4,51 1,66	2,50 1,93	5,37 3,79	7,83 3,59		
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,50 -0,02	1,33 -0,17	1,56 -0,07	1,26 -0,14	5,08 -0,24	19,27 -0,54	25,72 -0,73
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,61 0,20	1,87 -0,48	1,52 -0,33				
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,59 -0,00	4,32 -0,29	1,52 -0,01	3,11 -0,22	7,68 -0,26	20,09 -0,58	31,00 -1,05
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,95 0,97	5,91 3,05	2,38 1,81	4,21 2,63	9,96 5,72	25,37 16,33	35,11 16,55
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,92 0,52	7,74 1,47	3,09 1,24	5,79 1,66	11,28 1,87	23,62 3,47	
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,64 -0,01	3,37 -0,17	1,65 -0,05	2,24 -0,15	8,00 -0,26	24,03 -0,43	31,51 -0,63
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,66 0,25	7,52 1,25	2,84 0,99	5,55 1,42	11,09 1,68		
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI Var. IPCA p.p.	0,68 0,70	2,34 -0,51	1,46 0,89	1,61 0,03	5,43 1,19		
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,89 102,31	7,43 104,76	2,68 103,82	5,45 104,28	11,85 105,75	27,48 104,56	41,57 106,14
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,77	6,32	2,27	4,53	10,45	25,76	37,57

JP

PC

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	0,00	0,02	-0,09	-0,09	0,06	0,19	0,65
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,91	7,71	2,77	5,61	12,12	27,88	41,82
% do CDI	105,43	108,70	107,16	107,31	108,13	106,10	106,78
BB PREV RF IMA-B	0,43	1,18	1,48	1,15	4,90	19,04	25,29
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,09	-0,32	-0,15	-0,24	-0,42	-0,77	-1,16
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88	7,33	2,70	5,39	11,61	26,97	40,36
% do CDI	101,77	103,24	104,36	103,15	103,59	102,62	103,07
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,91	7,44	2,69	5,42	11,71	27,16	40,97
% do CDI	104,83	104,81	103,90	103,75	104,46	103,34	104,60
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	4,06	2,81	6,43	7,14	23,37	57,00	81,37
Var. IBOVESPA p.p.	-2,49	1,45	-4,96	1,72	5,86	32,83	66,87
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	9,54	2,74	10,19	3,26	17,40	26,11	28,18
Var. IBOVESPA p.p.	3,00	1,39	-1,20	-2,15	-0,11	1,93	13,68
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	4,36	-10,14	5,39	-4,17	-3,07	-5,30	-26,79
Var. SMALL CAP p.p.	-0,15	-0,45	-0,26	-0,36	-0,89	-1,23	-1,38
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	6,80	2,47	10,02	1,71	13,82	26,58	18,99
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,12	-2,54	-0,85	-6,14	-8,11	-8,33	-21,70
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	5,07	-0,26	9,16	3,90	14,36	12,53	6,71
Var. IBOVESPA p.p.	-1,48	-1,62	-2,23	-1,51	-3,15	-11,65	-7,79
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	1,39	31,34	10,76	17,87	36,69	53,29	31,18
Var. IBOVESPA p.p.	-5,15	29,99	-0,63	12,45	19,19	29,11	16,68
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	0,93	7,02	3,14	5,45	8,87	25,01	37,93
% do CDI	107,65	98,95	121,35	104,21	79,16	95,14	96,84
JALES	1,74	5,71	3,73	4,26			
Var. IPCA + 4,94% p.p.	1,34	-0,52	1,90	0,16			
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+3 du		1,00
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		0,20
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+1	D+1		0,10
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	D+1 du	D+0	D+13 du	D+15 du		2,00
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20

Handwritten signatures and initials:
 JF
 PC
 [Signature]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	D+1	D+1	D+90	D+92	O fundo cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro	2,00



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

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

Renda Variável

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

Handwritten mark

Handwritten signature and initials
PC

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

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

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

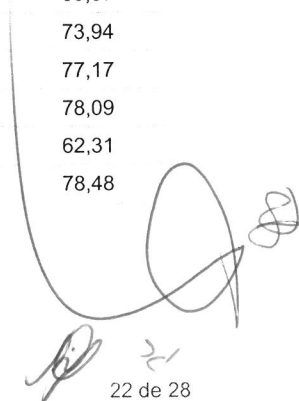
Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,29	33,98	14,52	24,30	39,63	48,51	23,68	47,36	123,03

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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





22 de 28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150527 (6,540000%)	1.540.558,58	6,540000	1.540.558,58	6,540000	-0,00
NTN-B 150826 (6,700000%)	1.538.961,05	6,700000	1.538.961,05	6,697100	0,00
NTN-B 150828 (6,490000%)	1.538.033,88	6,490000	1.538.033,87	6,490600	-0,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
91	01/08/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	1.117.865,71	243,68004887	4.587,4322300000
94	01/08/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	343.582,10	1.284,88253096	267,4035110000
95	01/08/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	359.315,77	1.343,72121240	267,4035110000
96	01/08/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	331.080,02	1.238,12891896	267,4035110000
97	01/08/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.466.022,11	5.482,43403580	267,4035110000
101	01/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.620.000,00	681.119,18795540	5,3147820000
121	02/08/2024	NTN-B 150826 (6,700000%)	1.538.048,32	0,00	350,00000000	4.394,4237714286
122	02/08/2024	NTN-B 150527 (6,540000%)	1.537.118,30	0,00	355,00000000	4.329,9107042254
123	02/08/2024	NTN-B 150828 (6,490000%)	1.536.843,34	0,00	351,00000000	4.378,4710541311
92	02/08/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	117.865,67	0,00	25,68314204	4.589,2231490000
89	09/08/2024	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	178.054,84	0,00	10.048,74760171	17,7191076000
98	09/08/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	155.000,00	578,26121513	268,0449526000
104	09/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	245.000,00	45.988,86129300	5,3273770000
88	15/08/2024	NTN-B 150824	0,00	3.421.169,67	770,00000000	4.443,0774935065
106	15/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,00	80.364,11	78.751,22822384	1,0204807190
109	15/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	0,00	28.001,18	25.540,20024342	1,0963571050
113	15/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	0,00	12.288,42	11.208,41005541	1,0963571050
103	16/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.421.169,67	0,00	640.912,60041746	5,3379660000
105	16/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	80.364,11	0,00	78.979,84145498	1,0175268590
108	16/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	28.001,18	0,00	25.599,56362043	1,0938147390
112	16/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	12.288,42	0,00	11.234,46188999	1,0938147390
107	19/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,00	2.390.680,38	2.096.880,94822100	1,1401125970
110	19/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	4.781.723,00	3.688.885,18957600	1,2962515090
111	19/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,00	1.051.251,78	922.059,61302961	1,1401125970
114	19/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	4.648.438,73	3.586.062,34802848	1,2962515090
120	20/08/2024	NTN-B 150826 (6,700000%)	42.848,37	0,00	10,00000000	4.284,8370000000
124	20/08/2024	NTN-B 150828 (6,490000%)	42.996,01	0,00	10,00000000	4.299,6010000000
90	20/08/2024	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.431.087,85	0,00	305.648,02010538	17,7690922000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
93	20/08/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	5.431.087,85	0,00	1.177,69717801	4.611,6165950000
100	20/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.741.315,53	0,00	325.946,46424300	5,3423360000
102	20/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	268.602,65	0,00	50.278,12739500	5,3423360000
99	23/08/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	70.766,62	0,00	262,95053958	269,1252131000
Total			21.478.458,73	24.051.782,98		

S
PC

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.049.904,13

Value-At-Risk: 1,46%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	2,06	0,70	1,64	0,34	-0,06	0,74	53.879.914,60	75,08
Artigo 8º	14,52	7,19	8,52	0,91	0,47	7,66	10.151.217,76	14,15
Artigo 9º	20,72	9,49	9,40	0,21	0,03	1,39	4.437.186,55	6,18
Artigo 10º	0,56	0,49	8,52	0,00	0,12	0,93	3.291.993,33	4,59
JALES	2,81	1,46		1,46	-0,49	5,71	71.760.312,24	100,00

Renda Fixa

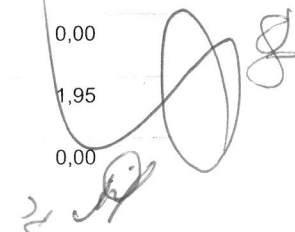
Value-At-Risk: 0,70%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	0,41	NaN	0,00	NaN	-0,97	0,47	0,00	0,00
NTN-B 150826 (6,700000%)	3,31	0,11	0,00	0,13	-0,03	0,78	1.538.961,05	2,14
NTN-B 150527 (6,540000%)	2,25	0,17	-0,00	0,19	-0,05	0,76	1.540.558,58	2,15
NTN-B 150828 (6,490000%)	5,88	0,11	0,00	0,13	-0,02	0,76	1.538.033,88	2,14
NTN-B 150545	8,97	3,37	0,07	3,37	0,03	1,14	2.703.021,53	3,77
Sub-total	3,48	1,25	0,07		-0,06	0,66	7.320.575,04	10,20

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,86	0,44	0,01	0,45	0,09	0,95	1.311.405,83	1,83
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,69	1,22	0,02	1,22	-0,10	0,61	2.777.512,01	3,87
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,37	NaN	0,00	NaN	-0,56	0,66	0,00	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	4,06	1,84	0,02	1,84	-0,05	0,68	1.402.581,92	1,95
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,18	NaN	0,00	NaN	0,31	0,92	0,00	0,00



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,83	1,36	0,01	0,24	-0,10	0,59	835.463,62	1,16
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,12	2,06	0,07	0,01	-0,07	0,50	3.978.390,24	5,54
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,41	1,46	0,09	0,02	-0,07	0,64	6.027.791,40	8,40
Sub-total	2,27	1,41	0,21		-0,20	0,42	16.333.145,02	22,76

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B	5,15	2,06	0,05	0,04	-0,08	0,43	2.988.008,75	4,16
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,08	0,05	-0,00	0,05	0,58	0,91	6.949.355,85	9,68
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05	0,02	0,00	0,03	0,33	0,88	5.642.540,14	7,86
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,03	0,03	0,00	0,02	0,65	0,89	7.316.903,72	10,20
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,02	0,00	0,02	0,51	0,91	2.172.615,40	3,03
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,85	0,37	0,00	0,10	-0,11	0,77	1.543.858,72	2,15
Sub-total	1,41	0,25	0,06		0,06	0,95	26.613.282,58	37,09

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 5,74% a.a	2,93	0,18	-0,00	0,19	0,00	0,87	2.085.237,58	2,91
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a.a	3,18	0,18	0,00	0,19	0,02	0,94	1.527.674,38	2,13
Sub-total	3,04	0,17	0,00		0,01	0,90	3.612.911,96	5,03

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,19%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	12,76	6,44	0,09	3,61	0,47	6,80	1.216.180,63	1,69
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	11,48	5,34	0,06	1,07	0,37	5,07	981.782,80	1,37
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	20,66	10,09	0,06	0,14	0,17	4,36	495.685,81	0,69
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,37	7,84	0,57	4,61	0,56	9,54	5.951.976,50	8,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	19,19	8,22	0,13	5,87	0,17	4,06	1.505.592,02	2,10
Sub-total	14,52	7,19	0,91		0,47	7,66	10.151.217,76	14,15

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,49%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	20,72	9,49	0,21	10,31	0,03	1,39	4.437.186,55	6,18
Sub-total	20,72	9,49	0,21		0,03	1,39	4.437.186,55	6,18

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,49%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	0,56	0,49	0,00	0,49	0,12	0,93	3.291.993,33	4,59
Sub-total	0,56	0,49	0,00		0,12	0,93	3.291.993,33	4,59

(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 (%)

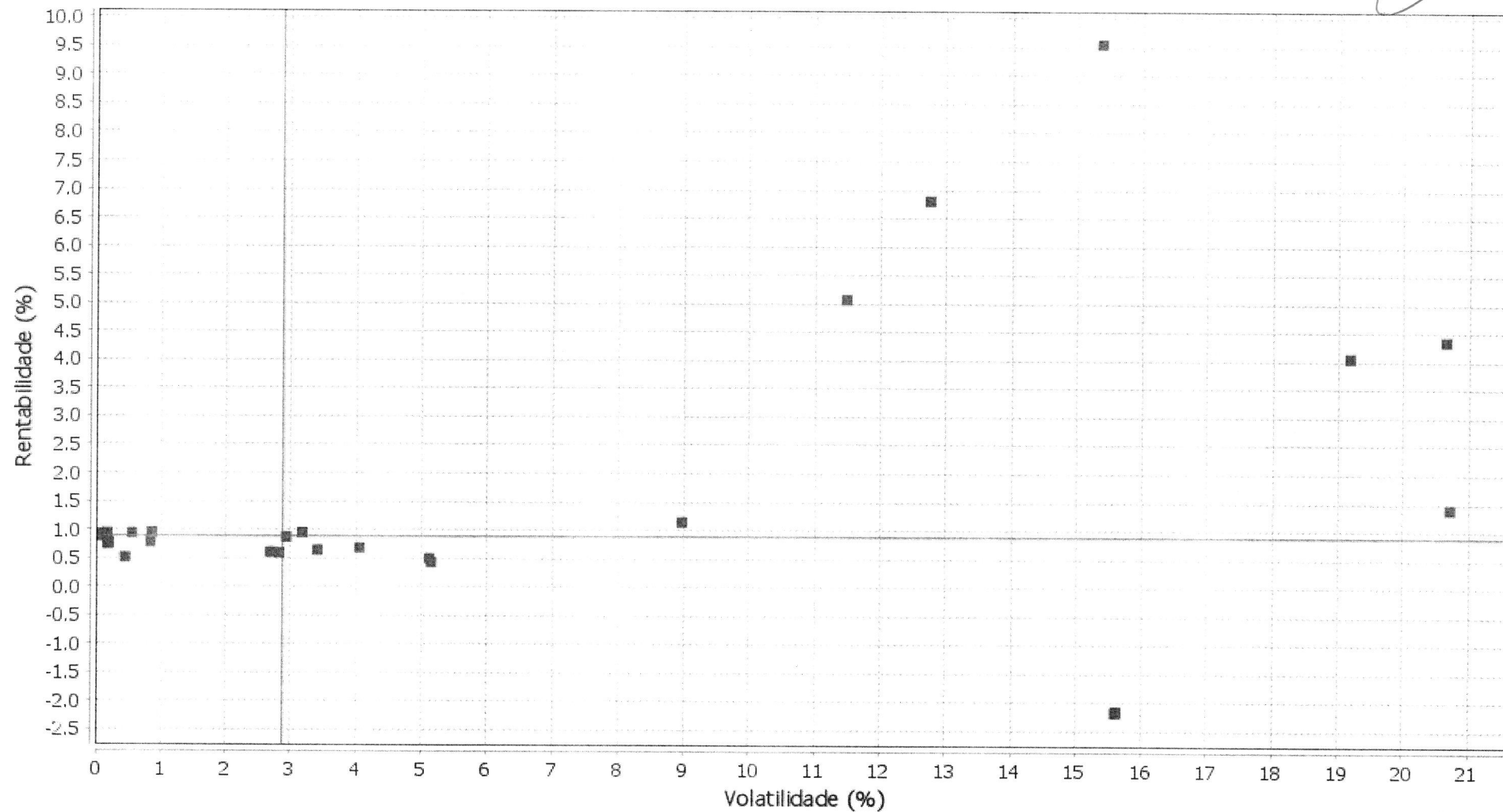
(5) Limite Política de Investimentos (%)



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

JALES - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 1.049.570,41

Value-At-Risk: 1,46%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	2,05	0,70	1,64	0,34	-0,05	0,77	53.901.620,66	75,09
Artigo 8º	14,52	7,19	8,52	0,91	0,47	7,66	10.151.217,76	14,14
Artigo 9º	20,72	9,49	9,40	0,21	0,03	1,39	4.437.186,55	6,18
Artigo 10º	0,56	0,49	8,52	0,00	0,12	0,93	3.291.993,33	4,59
JALES	2,83	1,46		1,46	0,31	1,76	71.782.018,30	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,70%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	0,45	NaN	0,00	NaN	-0,79	0,51	0,00	0,00
NTN-B 150826 (6,420000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,57	0,76	1.503.630,20	2,09
NTN-B 150826 (6,450000%)	15,62	0,17	-0,00	0,18	-0,19	-2,16	42.934,49	0,06
NTN-B 150527 (6,350000%)	0,18	0,16	-0,00	0,18	-0,66	0,75	1.547.394,71	2,16
NTN-B 150828 (6,160000%)	15,61	0,17	-0,00	0,17	-0,19	-2,17	43.078,68	0,06
NTN-B 150828 (6,360000%)	0,20	0,06	0,00	0,08	-0,52	0,77	1.502.221,49	2,09
NTN-B 150545	8,97	3,37	0,07	3,37	0,03	1,14	2.703.021,53	3,77
Sub-total	3,36	1,24	0,07		-0,00	0,86	7.342.281,10	10,23

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,86	0,44	0,01	0,45	0,09	0,95	1.311.405,83	1,83
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,69	1,22	0,02	1,22	-0,10	0,61	2.777.512,01	3,87
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,18	NaN	0,00	NaN	0,36	0,93	0,00	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	4,06	1,84	0,02	1,84	-0,05	0,68	1.402.581,92	1,95
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,18	NaN	0,00	NaN	0,31	0,92	0,00	0,00



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,83	1,36	0,01	0,24	-0,10	0,59	835.463,62	1,16
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,12	2,06	0,07	0,01	-0,07	0,50	3.978.390,24	5,54
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,41	1,46	0,09	0,02	-0,07	0,64	6.027.791,40	8,40
Sub-total	2,27	1,41	0,21		-0,20	0,42	16.333.145,02	22,75

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B	5,15	2,06	0,05	0,04	-0,08	0,43	2.988.008,75	4,16
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,08	0,05	-0,00	0,05	0,58	0,91	6.949.355,85	9,68
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05	0,02	0,00	0,03	0,33	0,88	5.642.540,14	7,86
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,03	0,03	0,00	0,02	0,65	0,89	7.316.903,72	10,19
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,02	0,00	0,02	0,51	0,91	2.172.615,40	3,03
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,85	0,37	0,00	0,10	-0,11	0,77	1.543.858,72	2,15
Sub-total	1,41	0,25	0,06		0,06	0,95	26.613.282,58	37,08

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 5,74% a.a	2,93	0,18	-0,00	0,19	0,00	0,87	2.085.237,58	2,90
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a.a	3,18	0,18	0,00	0,19	0,02	0,94	1.527.674,38	2,13
Sub-total	3,04	0,17	0,00		0,01	0,90	3.612.911,96	5,03

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,19%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	12,76	6,44	0,09	3,61	0,47	6,80	1.216.180,63	1,69
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	11,48	5,34	0,06	1,07	0,37	5,07	981.782,80	1,37
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	20,66	10,09	0,06	0,14	0,17	4,36	495.685,81	0,69
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,37	7,84	0,57	4,61	0,56	9,54	5.951.976,50	8,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	19,19	8,22	0,13	5,87	0,17	4,06	1.505.592,02	2,10
Sub-total	14,52	7,19	0,91		0,47	7,66	10.151.217,76	14,14

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,49%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	20,72	9,49	0,21	10,31	0,03	1,39	4.437.186,55	6,18
Sub-total	20,72	9,49	0,21		0,03	1,39	4.437.186,55	6,18

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,49%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	0,56	0,49	0,00	0,49	0,12	0,93	3.291.993,33	4,59
Sub-total	0,56	0,49	0,00		0,12	0,93	3.291.993,33	4,59

(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 (%)

