



LDB
EMPRESAS

COLOMBO
SETEMBRO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.09.2024.

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 77,55%

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 150826	2,17	-0,10	0,50	4,61	10.710.933,06	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832	4,71	-0,18	-0,89	0,18	25.043.264,03	4,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	5,42	-0,48	-1,18	-1,08	15.063.100,19	2,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,520000%)	4,29	0,05	0,72	2,18	60.899.399,23	11,98
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,29	-0,51	-2,09	-2,66	13.503.250,59	2,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,430000%)	3,04	0,05	0,72	2,16	88.621.403,75	17,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,66	-0,30	-1,42	-3,12	8.831.469,01	1,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	7,33	-0,34	-1,75	-4,73	3.605.258,52	0,71
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,49	-0,07	0,10	-0,10	226.278.078,38	44,53

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	-0,08	0,38	5,14	42.230.287,08	8,31	6.913.810.528,18	0,61
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,04	0,83	7,77	65.923.195,19	12,97	11.229.374.861,63	0,59
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,34	-0,01	0,52	4,59	6.682.566,28	1,32	4.436.237.468,68	0,15
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,57	0,12	1,23	9,68	33.571.562,18	6,61	900.438.967,77	3,73
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,80	0,02	0,78	6,28	148.407.610,73	29,21		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,04	0,04	0,75	7,17	1.297.427,52	0,26	1.178.841.947,20	0,11
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,65	0,06	1,06	8,02	12.676.614,17	2,49	2.178.673.563,05	0,58
RJI	RJI	TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 *	16,23	0,02	-1,42	-5,96	1.109.759,92	0,22	39.080.301,83	2,84
GENIAL	RJI	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 *	54,82	-0,06	-2,10	-55,54	242.941,16	0,05	12.342.464,90	1,97
INFINITY	PLANNER	VANQUISH CORAL FI RF LP *	0,62	-0,01	-0,45	1,87	557.875,05	0,11	11.187.423,83	4,99
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,02	0,05	0,75	1,15	15.884.617,82	3,13		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	PLANNER	AR CAPITAL FIDC IMOBILIARIOS I *	153,03	145,24	145,24	108,43	1.209.715,47	0,24	7.744.477,97	15,62
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC *	4,77	-0,42	-0,42	-7,82	2.315.458,48	0,46	66.389.735,50	3,49
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			54,45	25,07	25,07	32,44	3.525.173,95	0,69		
Renda Fixa			1,69	0,15	0,56	3,97	394.095.480,88	77,55		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

10,75%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	11,81	-0,50	-1,33	0,26	7.476.799,51	1,47	342.004.983,48	2,19
PLURAL	BEM	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	12,23	-0,51	-4,87	-6,13	3.707.522,40	0,73	457.095.113,70	0,81
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	13,15	-0,51	-2,45	-4,11	19.804.718,12	3,90	1.370.744.573,46	1,44
FINACAP	BEM	FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES	14,00	-0,33	-0,08	0,57	23.642.980,34	4,65	490.448.090,25	4,82
Sub-total Artigo 8º I			12,72	-0,43	-1,45	-3,78	54.632.020,37	10,75		
Renda Variável			12,51	-0,43	-1,45	-1,71	54.632.020,37	10,75		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR **4,02%**

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				
ITAU	ITAU	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC FIA IE	13,41	-0,02	-1,42	32,50	11.385.450,65	2,24	450.030.856,73	2,53
Sub-total Artigo 9º II			13,41	-0,02	-1,42	32,50	11.385.450,65	2,24		

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	15,47	0,57	0,17	31,57	9.025.358,34	1,78	1.573.122.577,07	0,57
Sub-total Artigo 9º III			15,47	0,57	0,17	31,57	9.025.358,34	1,78		

Investimentos no Exterior			12,94	0,24	-0,72	31,90	20.410.808,99	4,02		
----------------------------------	--	--	--------------	-------------	--------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,05%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	12,45	0,39	2,35	24,15	24.360.880,22	4,79	1.402.848.275,13	1,74
Sub-total Artigo 10º I			12,45	0,39	2,35	24,15	24.360.880,22	4,79		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
KINEA	LIONS TRUST	FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	7,13	0,71	0,71	4,58	2.003.819,50	0,39	161.208.970,21	1,24
A5	PLANNER	W7 FIP MULTISTRATÉGIA *	61,61	-0,12	-0,12	-55,19	4.396.327,02	0,87	54.944.868,36	8,00
Sub-total Artigo 10º II			54,95	0,14	0,14	-45,12	6.400.146,52	1,26		
Investimentos Estruturados			18,46	0,34	1,88	-1,28	30.761.026,74	6,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,62%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	RJI	BR HOTÉIS FII *	2,50	-0,36	-0,36	-0,70	6.072.833,37	1,20	123.612.342,78	4,91
PLANNER	PLANNER	CARE11 *	45,70	-1,24	-3,05	16,06	1.025.805,99	0,20	250.509.603,82	0,41
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11 *	30,04	-19,86	-19,86	-8,10	1.157.531,07	0,23	71.188.600,69	1,63
Sub-total Artigo 11º			7,49	-3,75	-3,97	-0,26	8.256.170,43	1,62		
Fundos Imobiliários			7,51	-3,75	-3,97	-0,26	8.256.170,43	1,62		
Total			3,04	0,03	0,29	3,14	508.155.507,41	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	226.278.078,38	44,53	0,00	14,80	50,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	148.407.610,73	29,21	0,00	31,65	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	15.884.617,82	3,13	0,00	14,82	40,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	3.525.173,95	0,69	0,00	1,34	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	394.095.480,88	77,55					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	54.632.020,37	10,75	0,00	21,09	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	54.632.020,37	10,75					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	11.385.450,65	2,24	0,00	3,58	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	9.025.358,34	1,78	0,00	3,58	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	20.410.808,99	4,02					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	24.360.880,22	4,79	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	6.400.146,52	1,26	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	30.761.026,74	6,05					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	8.256.170,43	1,62	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	8.256.170,43	1,62					5,00
Total		508.155.507,41	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	0,10 12,37	-0,10 -1,21	2,87 108,87	0,55 10,53		233.325,00	2.732.972,19
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,78 93,21	6,28 78,59	2,37 90,22	4,01 76,64		1.159.126,80	10.612.826,12
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,75 90,12	1,15 14,36	1,94 73,78	1,37 26,21		120.179,58	-321.907,88
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	25,07 3.005,16	32,44 405,99	13,01 494,20	33,44 639,62		706.621,79	1.270.631,62
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-1,45 1,62	-3,78 -2,02	6,62 0,23	-0,44 -3,34		-806.518,21	-3.907.880,60
Artigo 9º II % do CDI	-1,42 -170,12	32,50 406,70	2,94 111,84	18,41 352,20		-163.909,14	2.792.444,29
Artigo 9º III % do CDI	0,17 20,52	31,57 395,10	1,07 40,65	15,48 296,10		15.426,34	2.165.612,14
Artigo 10º I % do CDI	2,35 281,36	24,15 302,23	6,34 240,82	11,73 224,31		558.684,96	4.738.608,99
Artigo 10º II % do CDI	0,14 16,96	-45,12 -564,68	-13,95 -530,07	-13,85 -264,81		9.044,50	-5.319.724,98
Artigo 11º % do CDI	-3,97 -475,33	-0,26 -3,31	-4,61 -175,20	-5,60 -107,04		-340.908,04	-18.723,19
COLOMBO (Total)						1.491.073,58	14.744.858,70

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	15.243.647,65	0,00	0,00	0,00	15.063.100,19	-180.547,46	-173.347,96
NTN-B 150535 (6,520000%)	60.462.542,00	0,00	0,00	0,00	60.899.399,23	436.857,23	1.297.412,43
NTN-B 150545	8.958.585,68	0,00	0,00	0,00	8.831.469,01	-127.116,67	-293.876,47
NTN-B 150826	10.657.305,28	0,00	0,00	0,00	10.710.933,06	53.627,78	486.969,76
NTN-B 150832	25.269.292,14	0,00	0,00	0,00	25.043.264,03	-226.028,11	62.392,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840	13.792.168,93	0,00	0,00	0,00	13.503.250,59	-288.918,34	-366.395,18
NTN-B 150840 (6,430000%)	87.991.916,26	0,00	0,00	0,00	88.621.403,75	629.487,49	1.900.647,72
NTN-B 150850	3.669.295,44	0,00	0,00	0,00	3.605.258,52	-64.036,92	-180.830,84
	226.044.753,38	0,00	0,00	0,00	226.278.078,38	233.325,00	

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	34.338.230,15	7.757.899,31	0,00	0,00	42.230.287,08	134.157,62	1.457.133,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	65.759.122,32	5.141.077,73	-5.558.560,08	0,00	65.923.195,19	581.555,22	4.751.444,91
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6.655.607,03	0,00	-7.941,61	0,00	6.682.566,28	34.900,86	371.783,88
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	33.163.049,08	0,00	0,00	0,00	33.571.562,18	408.513,10	1.624.723,40
	139.916.008,58	12.898.977,04	-5.566.501,69	0,00	148.407.610,73	1.159.126,80	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	1.233.759,44	401.976,02	-348.837,42	0,00	1.297.427,52	10.529,48	70.348,57
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	12.543.286,64	0,00	0,00	0,00	12.676.614,17	133.327,53	941.400,33
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.125.690,18	0,00	0,00	0,00	1.109.759,92	-15.930,26	-72.472,65
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	248.144,12	0,00	0,00	0,00	242.941,16	-5.202,96	-557.072,61
VANQUISH CORAL FI RF LP	560.419,26	0,00	0,00	0,00	557.875,05	-2.544,21	10.226,97
	15.711.299,64	401.976,02	-348.837,42	0,00	15.884.617,82	120.179,58	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AR CAPITAL FIDC IMOBILIARIOS I	493.268,69	0,00	0,00	0,00	1.209.715,47	716.446,78	1.467.007,70
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2.325.283,47	0,00	0,00	0,00	2.315.458,48	-9.824,99	-196.376,08
	2.818.552,16	0,00	0,00	0,00	3.525.173,95	706.621,79	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	7.577.778,95	0,00	0,00	0,00	7.476.799,51	-100.979,44	19.717,28
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	3.897.477,58	0,00	0,00	0,00	3.707.522,40	-189.955,18	-242.095,03
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	20.301.338,51	0,00	0,00	0,00	19.804.718,12	-496.620,39	-847.877,29
FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES	23.661.943,54	0,00	0,00	0,00	23.642.980,34	-18.963,20	133.382,87
	55.438.538,58	0,00	0,00	0,00	54.632.020,37	-806.518,21	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC FIA IE	11.549.359,79	0,00	0,00	0,00	11.385.450,65	-163.909,14	2.792.444,29
	11.549.359,79	0,00	0,00	0,00	11.385.450,65	-163.909,14	

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	9.009.932,00	0,00	0,00	0,00	9.025.358,34	15.426,34	2.165.612,14
	9.009.932,00	0,00	0,00	0,00	9.025.358,34	15.426,34	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	23.802.195,26	0,00	0,00	0,00	24.360.880,22	558.684,96	4.738.608,99
	23.802.195,26	0,00	0,00	0,00	24.360.880,22	558.684,96	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	1.989.612,34	0,00	0,00	0,00	2.003.819,50	14.207,16	94.733,04
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	4.401.489,68	0,00	0,00	0,00	4.396.327,02	-5.162,66	-5.414.458,02
	6.391.102,02	0,00	0,00	0,00	6.400.146,52	9.044,50	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BR HOTÉIS FII	6.094.702,86	0,00	0,00	0,00	0,00	6.072.833,37	-21.869,49	-43.052,32
CARE11	1.058.064,04	0,00	0,00	0,00	0,00	1.025.805,99	-32.258,05	141.935,42
FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11	1.444.311,57	0,00	0,00	0,00	0,00	1.157.531,07	-286.780,50	-101.966,40
	8.597.078,47	0,00	0,00	0,00	0,00	8.256.170,43	-340.908,04	

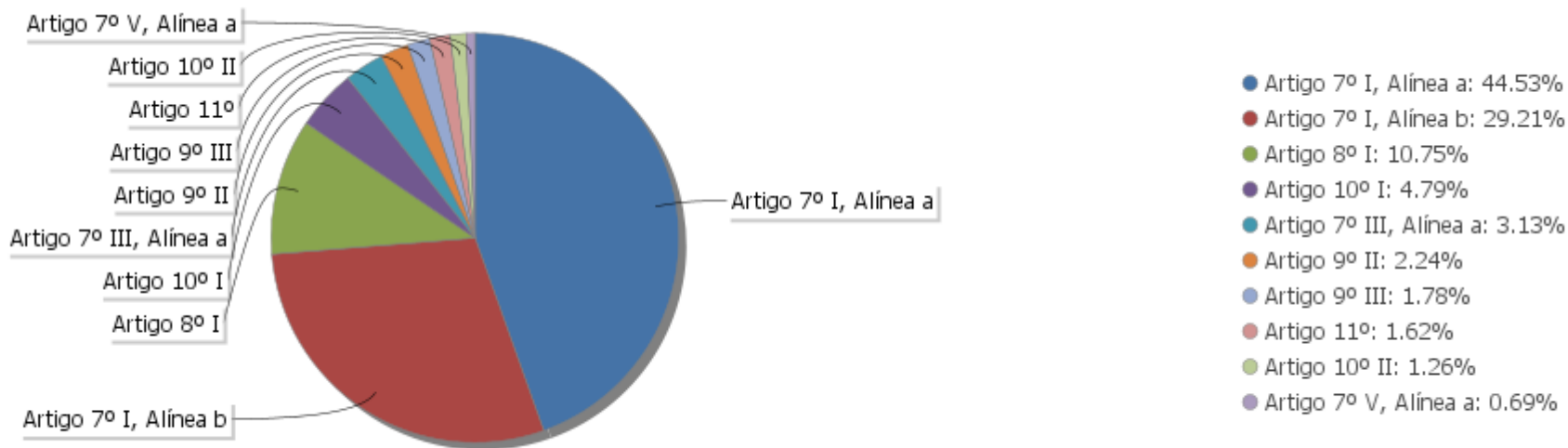
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

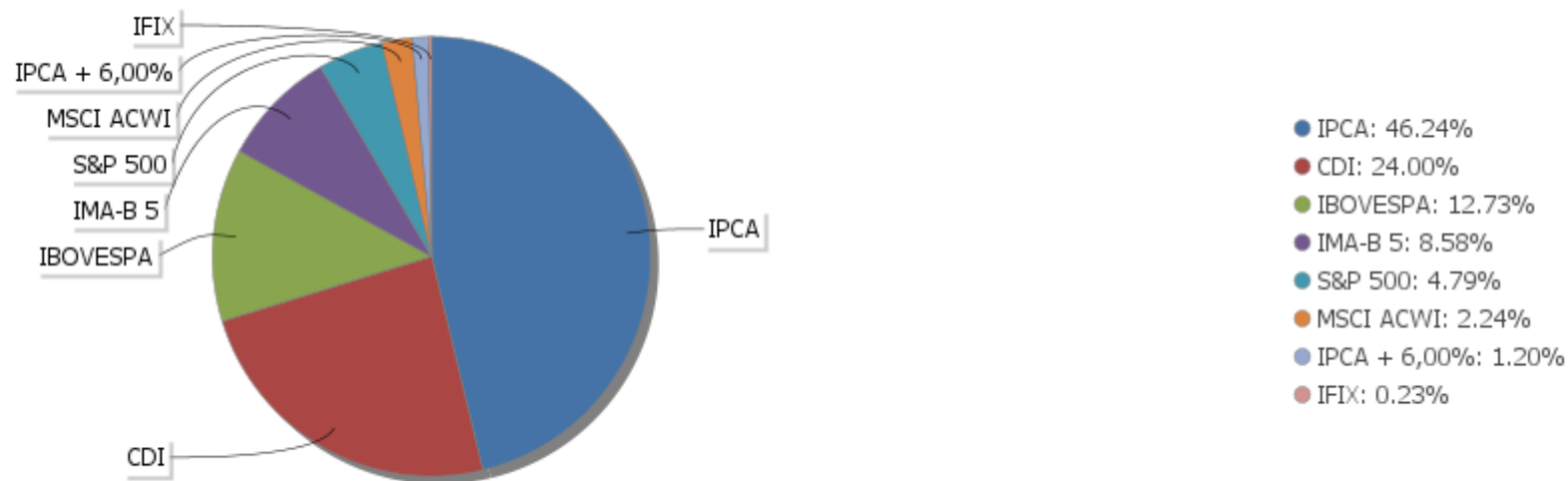
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	280.524.727,95	55,20		280.524.727,95	55,20	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00		280.524.727,95	55,20	
acima de 365 dias	227.630.779,46	44,80		508.155.507,41	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

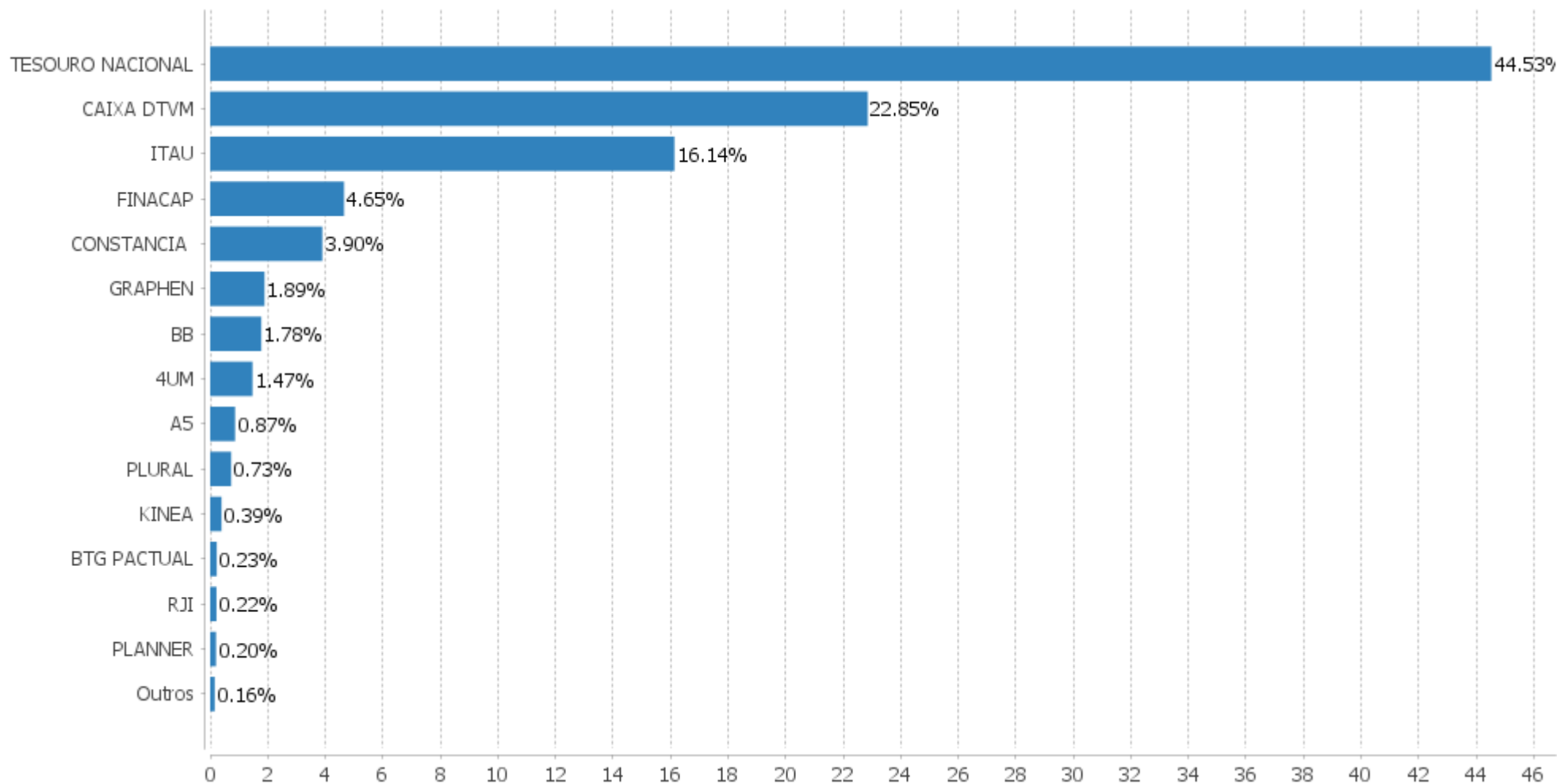


Alocação Por Estratégia



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	-0,71	0,09	0,75	-1,59	1,12	0,72	1,15	1,32	0,29				3,14
IPCA + 5,10%	0,86	1,21	0,56	0,82	0,88	0,61	0,84	0,42	0,86				7,25
p.p. indexador	-1,57	-1,12	0,20	-2,40	0,24	0,11	0,31	0,90	-0,57				-4,11

Performance Sobre a Meta Atuarial

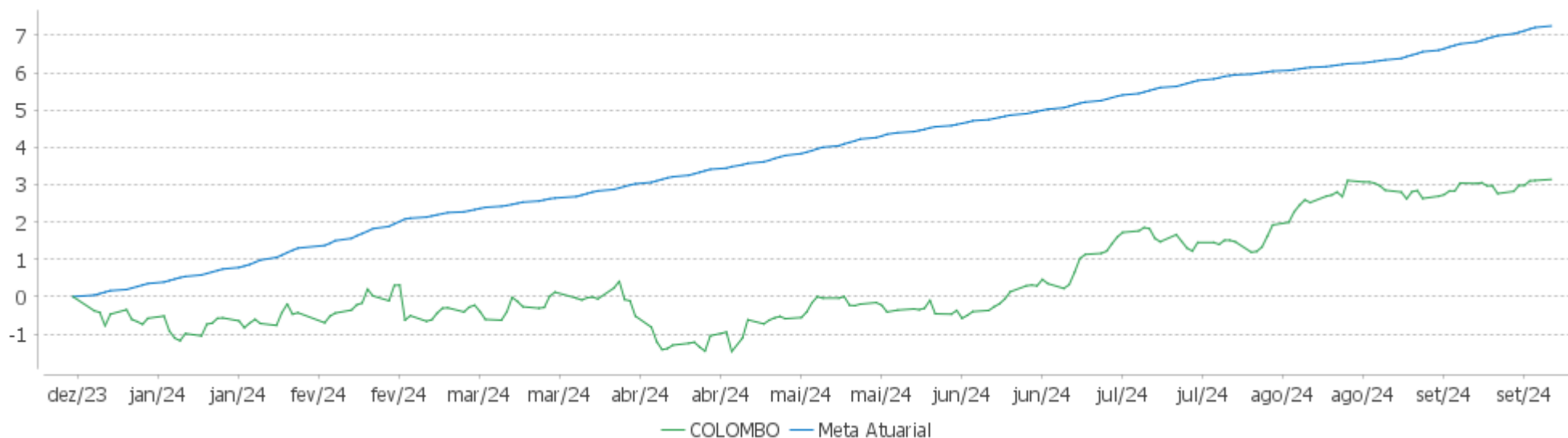
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	5	55,56	03 meses	2,78	2,12	0,66	2,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	4	44,44	06 meses	3,02	4,49	-1,47	2,74
			12 meses				
			24 meses				
Desde 29/12/2023				3,14	7,25	-4,11	3,04

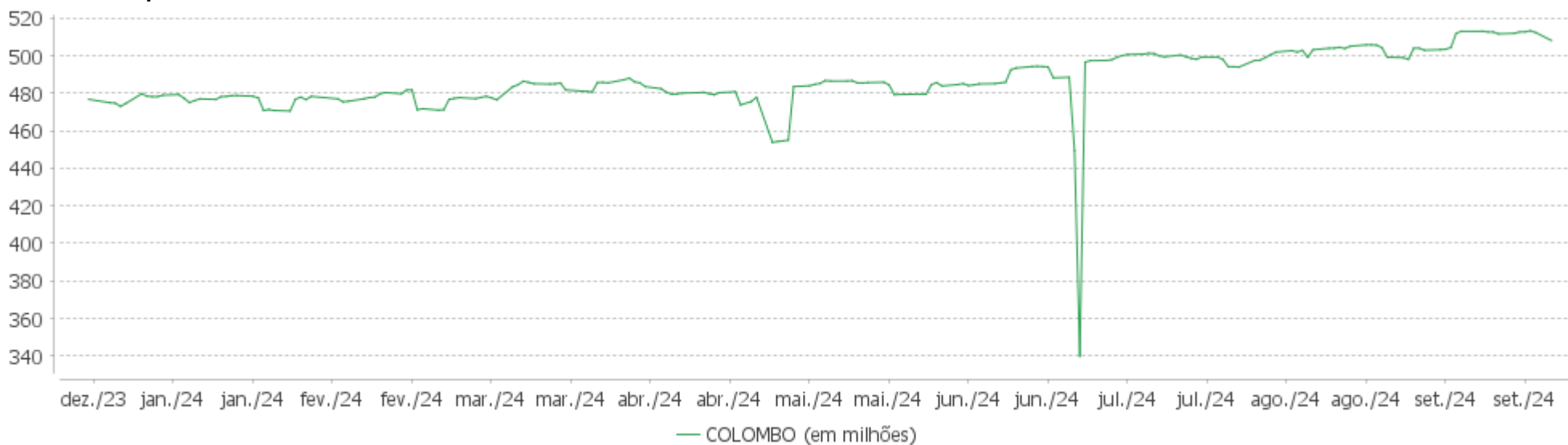
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,32	2024-08
Menor rentabilidade da Carteira	-1,59	2024-04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

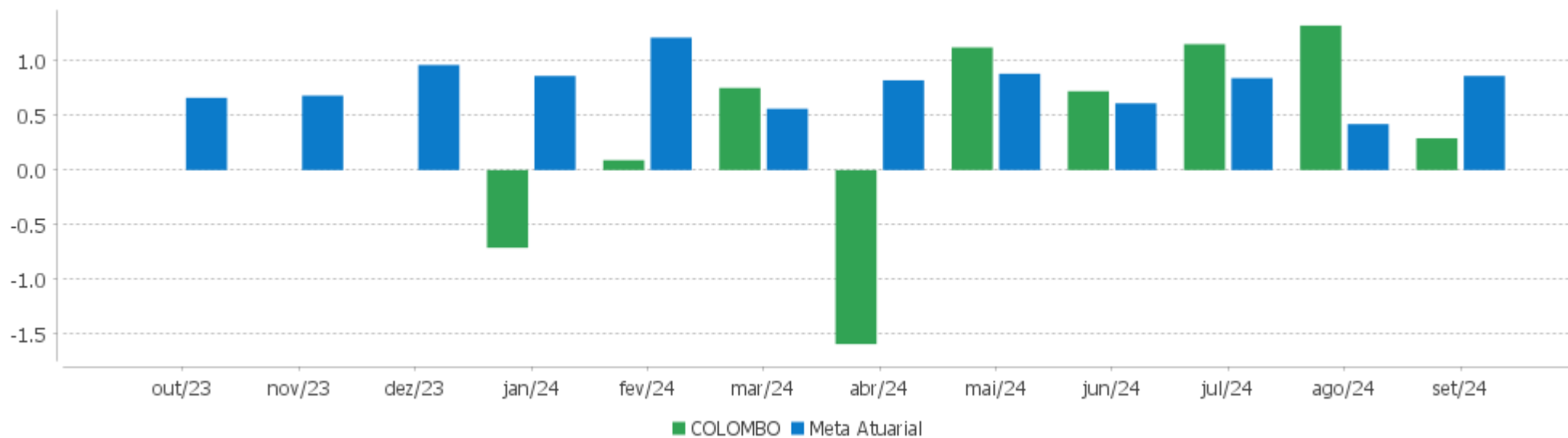


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,38 -0,02	5,14 -0,17	1,87 -0,05	3,07 -0,11	8,21 -0,23	20,61 -0,45	31,64 -0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,52 0,08	4,59 1,29	2,18 1,38	2,74 0,88	7,65 3,22	21,44 11,61	32,91 15,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,83 99,84	7,77 97,19	2,64 100,14	5,08 97,24	10,77 97,44	25,55 98,32	39,49 99,44
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	1,23 147,66	9,68 121,15	2,75 104,47	6,86 131,16	13,66 123,52	25,11 96,64	37,46 94,32
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	-1,42 -1,86	-3,12 -6,42	3,01 2,21	-1,34 -3,21	3,39 -1,04	14,02 4,18	18,51 0,79
NTN-B 150840 (6,430000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,28	5,15 1,84	2,32 1,51	4,99 3,13	7,67 3,24		
NTN-B 150850 Var. IPCA p.p.	-1,75 -2,19	-4,73 -8,04	2,74 1,94	-2,48 -4,34	2,57 -1,85	12,50 2,66	16,21 -1,50
NTN-B 150832 Var. IPCA p.p.	-0,89 -1,33	0,18 -3,13	2,19 1,39	0,37 -1,49	4,38 -0,04	16,64 6,80	
NTN-B 150535 Var. IPCA p.p.	-1,18 -1,62	-1,08 -4,38	2,43 1,63	-0,12 -1,99	4,05 -0,38	15,80 5,96	22,88 5,17
NTN-B 150826 Var. IPCA p.p.	0,50 0,06	4,61 1,30	1,83 1,03	2,64 0,78	7,93 3,50	20,29 10,45	31,17 13,46
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-2,09 -2,53	-2,66 -5,97	2,34 1,54	-0,88 -2,74	3,75 -0,68	14,15 4,31	20,63 2,91
NTN-B 150535 (6,520000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,28	5,22 1,92	2,34 1,54	1,91 0,05	4,55 0,13		
AR CAPITAL FIDC IMOBILIARIOS I % do CDI	145,24 17.410,36	108,43 1.357,05	40,36 1.533,71	108,72 2.079,38	106,98 967,71	98,14 377,67	137,59 346,46
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,42 -50,65	-7,82 -97,84	-5,20 -197,54	-6,46 -123,57	-8,94 -80,86	-10,54 -40,58	-7,17 -18,06
VANQUISH CORAL FI RF LP % do CDI	-0,45 -54,42	1,87 23,37	-0,55 -20,92	0,38 7,32	-0,29 -2,61	-87,82 -337,98	-85,40 -215,05
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-2,10 -2,50	-55,54 -60,84	-5,14 -7,06	-10,79 -13,97	-63,83 -72,26	-64,34 -85,40	-63,91 -96,16
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1,06	8,02	2,77	5,84	11,35	24,95	39,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	127,41	100,40	105,43	111,70	102,65	96,01	98,42
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-1,42 -1,82	-5,96 -11,26	-3,84 -5,76	-3,08 -6,26	-15,05 -23,49	-7,42 -28,48	-5,73 -37,99
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,75 89,83	7,17 89,73	2,36 89,66	4,69 89,61	9,94 89,96	22,88 88,05	34,20 86,12
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-2,45 0,63	-4,11 -2,34	6,25 -0,13	-2,52 -5,41	7,33 -5,76	8,42 -11,37	11,84 -6,93
FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-0,08 3,00	0,57 2,33	7,77 1,39	1,82 -1,07	15,61 2,53	24,25 4,45	31,64 12,87
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-4,87 -1,79	-6,13 -4,36	2,84 -3,55	-2,02 -4,92	6,45 -6,63	16,68 -3,11	37,15 18,38
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,33 1,75	0,26 2,03	5,92 -0,46	3,82 0,92	14,24 1,16	23,30 3,50	27,09 8,32
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,17 3,25	31,57 33,34	1,07 -5,31	15,48 12,58	41,58 28,49	63,92 44,12	30,48 11,70
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-1,42 0,17	32,50 0,65	2,94 -1,15	18,41 -0,18	42,34 1,25	60,47 5,36	28,71 8,46
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	2,35 4,08	24,15 -11,80	6,34 2,91	11,73 -7,86	40,26 -5,95	81,32 19,38	64,46 30,47
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,12 -14,06	-55,19 -690,70	-19,72 -749,54	-20,05 -383,42	-55,38 -500,94	-56,22 -216,34	-59,78 -150,54
FIP MULTIESTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	4,58 1,27	2,18 1,38	3,58 1,71	5,99 1,57		
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	-3,05 0,03	17,44 19,20	-7,56 -13,94	-24,82 -27,72	-9,10 -22,19	-59,68 -79,47	-49,72 -68,50
BR HOTÉIS FII Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,36 -1,29	-0,70 -8,64	-0,47 -2,82	-0,66 -5,61	1,81 -8,86	4,69 -18,64	1,92 -38,18
FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11 Var. IFIX p.p.	-19,86 -17,28	-8,10 -7,93	-19,86 -18,62	-8,10 -5,10			
COLOMBO Var. IPCA + 5,10% p.p.	0,29 -0,57	3,14 -4,11	2,78 0,66	3,02 -1,47			
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	2,00
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,00
BR HOTÉIS FII	Não se aplica	Não se aplica				
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES			D+5 du	D+7 du	-	2,00
CARE11	Não se aplica	Não se aplica				
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	D+1 du	D+0	D+14 du	D+15 du		2,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11						
FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES			D+1 du	D+3 du	-	2,00
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II						
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CDI, DE UM DIA, APURADO PELA CETIP	0,50
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O GESTOR RECEBERÁ TAXA	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,15
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1 du	D+0	D+1470	D+1471		0,35
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1 du	D+0	D+1470	D+1471		0,70
VANQUISH CORAL FI RF LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,75
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	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	0,82	7,18	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,50	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	3,90	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	5,30	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	-2,62	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	4,99	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	5,01	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	-9,14	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	-1,23	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	-0,22	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	-13,67	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	-11,22	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-1,73	35,95	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-0,16	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	31,85	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	3,31	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	3,29	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	2,64	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	6,41	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	7,18	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	7,56	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	7,86	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	6,39	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (6,520000%)	60.899.399,23	6,520000	60.996.152,03	6,498200	96.752,80
NTN-B 150840 (6,430000%)	88.621.403,75	6,430000	88.706.873,03	6,420000	85.469,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
270	02/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	282,40	110,67199800	2,5516840000
272	03/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	2.261,20	885,84840800	2,5525810000
267	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.031.126,58	0,00	701.855,84288394	5,7435250000
277	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	929.126,94	0,00	161.769,46039235	5,7435250000
269	05/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	87.325,60	34.186,61323100	2,5543800000
282	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	56.815,82	9.884,30928200	5,7480820000
283	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.468,64	603,44301500	5,7480820000
261	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	10.277,28	1.787,94942000	5,7480820000
264	06/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.489,20	582,79304200	2,5552810000
265	11/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	401.976,02	0,00	157.145,63500006	2,5579840000
260	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.757.899,31	0,00	1.784.909,68120151	4,3463820000
275	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	10.013,24	1.739,33509400	5,7569360000
268	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	88.647,18	15.398,32644800	5,7569360000
280	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.247,43	216,68297100	5,7569360000
262	12/09/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	7.941,61	3.997,57070600	1,9866090000
273	12/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	4.576,89	1.788,62599600	2,5588860000
278	13/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.667,56	0,00	289,54213100	5,7593000000
276	13/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.530,00	612,92184000	5,7593000000
263	19/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	4.997,34	1.949,49523500	2,5634020000
279	25/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.530,00	611,00695300	5,7773470000
274	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	998.832,61	172.750,48771500	5,7819380000
271	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	70.674,62	0,00	12.218,43339700	5,7842620000
266	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.382.197,88	757.607,08626269	5,7842620000
284	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	108.482,03	0,00	18.754,68815209	5,7842620000
281	30/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	247.904,79	96.464,83750300	2,5698980000
Total			13.300.953,06	5.915.339,11		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.499.217,11

Value-At-Risk: 1,08%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,76	0,57		0,24	-0,13	0,61	394.095.480,88	77,55
Artigo 8º	10,70	6,06		0,55	-0,21	-1,45	54.632.020,37	10,75
Artigo 9º	16,30	7,44		0,07	-0,10	-0,72	20.410.808,99	4,02
Artigo 10º	10,90	5,86		0,23	0,10	1,89	30.761.026,74	6,05
Artigo 11º	13,40	2,34		-0,00	-0,36	-3,97	8.256.170,43	1,62
COLOMBO		1,08		1,08			508.155.507,41	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,57%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826	1,69	1,19	0,01	1,19	-0,20	0,50	10.710.933,06	2,11
NTN-B 150832	5,01	2,54	0,07	2,54	-0,35	-0,89	25.043.264,03	4,93
NTN-B 150535	5,16	2,82	0,04	2,82	-0,39	-1,18	15.063.100,19	2,96
NTN-B 150535 (6,520000%)	0,25	0,20	-0,00	0,22	-0,45	0,72	60.899.399,23	11,98
NTN-B 150840	6,01	3,32	0,05	3,32	-0,49	-2,09	13.503.250,59	2,66
NTN-B 150840 (6,430000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,48	0,72	88.621.403,75	17,44
NTN-B 150545	5,46	3,35	0,03	3,35	-0,41	-1,42	8.831.469,01	1,74
NTN-B 150850	6,01	3,78	0,01	3,78	-0,43	-1,75	3.605.258,52	0,71
Sub-total	1,61	0,89	0,21		-0,46	0,10	226.278.078,38	44,53

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,03	1,01	0,04	0,01	-0,22	0,38	42.230.287,08	8,31
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,04	0,04	0,00	0,04	-0,03	0,83	65.923.195,19	12,97
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,18	0,66	0,00	0,66	-0,26	0,52	6.682.566,28	1,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	2,40	0,83	-0,02	0,82	0,17	1,23	33.571.562,18	6,61
Sub-total	0,29	0,25	0,03		-0,20	0,78	148.407.610,73	29,21

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,01	0,00	-0,00	0,00	-12,17	0,75	1.297.427,52	0,26
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1,06	0,34	-0,00	0,34	0,22	1,06	12.676.614,17	2,49
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	6,06	0,24	-0,00	1,04	-0,37	-1,42	1.109.759,92	0,22
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	4,24	0,36	0,00	1,09	-0,69	-2,10	242.941,16	0,05
VANQUISH CORAL FI RF LP	0,64	0,23	-0,00	0,23	-2,03	-0,45	557.875,05	0,11
Sub-total	0,96	0,27	-0,00		-0,09	0,75	15.884.617,82	3,13

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AR CAPITAL FIDC IMOBILIARIOS I	310,76	3,38	-0,00	3,38	0,46	145,24	1.209.715,47	0,24
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,47	0,28	-0,00	0,28	-0,86	-0,42	2.315.458,48	0,46
Sub-total	77,49	1,28	-0,00		0,31	25,07	3.525.173,95	0,69

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,06%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	11,01	5,41	0,06	3,60	-0,20	-1,33	7.476.799,51	1,47
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	10,88	5,67	0,03	2,70	-0,52	-4,87	3.707.522,40	0,73
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	9,94	5,80	0,19	3,20	-0,33	-2,45	19.804.718,12	3,90
FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES	11,82	6,96	0,27	3,29	-0,08	-0,08	23.642.980,34	4,65
Sub-total	10,70	6,06	0,55		-0,21	-1,45	54.632.020,37	10,75

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,86%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	13,64	7,42	0,23	6,12	0,11	2,35	24.360.880,22	4,79
Sub-total	13,64	7,42	0,23		0,11	2,35	24.360.880,22	4,79

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2,46	0,13	0,00	0,14	-0,05	0,71	2.003.819,50	0,39
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	0,41	1,02	-0,00	1,02	-2,34	-0,12	4.396.327,02	0,87
Sub-total	0,49	0,70	-0,00		-1,41	0,14	6.400.146,52	1,26

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,44%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC FIA IE	15,93	7,18	-0,01	5,87	-0,14	-1,42	11.385.450,65	2,24
Sub-total	15,93	7,18	-0,01		-0,14	-1,42	11.385.450,65	2,24

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	16,76	10,19	0,07	11,48	-0,04	0,17	9.025.358,34	1,78
Sub-total	16,76	10,19	0,07		-0,04	0,17	9.025.358,34	1,78

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 2,34%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BR HOTÉIS FII	1,25	0,02	0,00	0,07	-0,96	-0,36	6.072.833,37	1,20
CARE11	19,69	18,79	-0,00	20,94	-0,20	-3,05	1.025.805,99	0,20
FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11	76,68	0,39	0,00	2,46	-0,27	-19,86	1.157.531,07	0,23
Sub-total	13,40	2,34	-0,00		-0,36	-3,97	8.256.170,43	1,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (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 (%)