

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

71,97%

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 150523 (6,680000%)	2,97	0,07	1,01	2,28	1.544.744,31	2,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,750000%)	2,97	0,07	1,02	2,29	1.556.862,54	2,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,130000%)	0,66	0,10	0,91	2,04	1.625.501,44	2,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,550000%)	0,63	0,06	0,94	2,11	799.351,13	1,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,210000%)	0,63	0,07	0,98	2,21	1.491.471,66	2,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,771000%)	5,81	0,07	0,66	0,66	1.468.370,77	2,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,360000%)	5,81	0,07	0,64	0,64	1.467.286,13	2,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,120000%)	0,63	0,06	0,91	2,04	1.584.075,52	2,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,450000%)	0,63	0,06	0,93	2,09	774.850,44	1,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,170000%)	0,63	0,06	0,91	2,05	1.055.151,20	1,61
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		1,09	0,07	0,93	2,12	13.367.665,14	20,39

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,44	0,04	0,96	2,03	93.814,56	0,14	6.481.837.661,08	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,55	-0,28	1,27	1,26	3.460.564,34	5,28	5.703.776.580,01	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,44	0,04	0,97	2,10	429.790,29	0,66	6.896.825.441,61	0,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	2,64	0,01	1,39	2,78	3.188.609,49	4,86	7.935.684.977,28	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,97	0,00	1,50	2,93	2.483.111,56	3,79	6.865.433.667,15	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,71	-0,08	0,83	1,72	1.845.097,55	2,81	991.192.385,85	0,19
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,70	0,02	1,40	2,70	2.261.451,79	3,45	425.947.102,39	0,53
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,52	0,00	1,20	1,71	0,00	0,00	2.181.457.433,60	0,00
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	2,63	0,01	1,35	2,67	1.051.707,49	1,60	149.306.386,97	0,70
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,78	0,05	0,96	2,01	1.971.167,51	3,01	5.085.339.032,83	0,04
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	5,51	0,00	1,25	1,46	0,00	0,00	332.788.581,85	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,29	-0,05	1,26	2,20	16.785.314,58	25,61		

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				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,08	-0,29	1,21	1,14	2.148.818,10	3,28	283.116.559,96	0,76
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,05	0,85	1,99	4.206.600,82	6,42	13.891.144.708,98	0,03
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,05	0,85	1,89	930.413,77	1,42	3.964.919.513,24	0,02
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,05	0,88	2,02	5.449.983,37	8,31	8.371.920.489,79	0,07
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL OPTIMUS RENDA FIXA LONGO PRAZO FICFI	0,66	0,04	0,99	2,09	1.218.840,43	1,86	1.291.004.024,18	0,09
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,76	0,03	0,87	1,91	3.073.264,12	4,69	2.496.061.867,24	0,12
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,27	0,00	0,94	1,92	17.027.920,61	25,98		
Renda Fixa			1,94	0,00	1,05	2,07	47.180.900,33	71,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

18,01%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	22,48	-0,92	-6,29	-1,93	1.248.670,05	1,90	1.337.859.374,92	0,09
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	21,47	-1,14	-7,85	-5,04	926.222,14	1,41	213.405.356,36	0,43
XP	SANTANDER	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	20,46	-0,31	-5,13	-1,75	353.297,63	0,54	268.162.031,61	0,13
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,67	-0,76	-6,80	-4,55	1.071.578,03	1,63	1.687.120.867,12	0,06
XP	SANTANDER	XP INVESTOR 30 FIC FIA	20,32	-0,41	-5,66	-2,43	446.300,89	0,68	200.578.600,83	0,22
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	21,12	-0,57	-9,39	-7,34	1.224.839,91	1,87	239.209.283,56	0,51
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	23,42	1,06	-3,69	-4,58	459.911,52	0,70	188.530.137,50	0,24
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	31,17	-2,35	-10,56	-12,09	1.210.086,77	1,85	271.507.156,05	0,45
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	29,41	-1,16	-9,93	-6,85	759.899,02	1,16	96.396.199,72	0,79
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	21,78	-1,42	-9,01	-5,34	1.516.993,65	2,31	90.855.017,95	1,67
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	21,82	0,67	-2,53	-0,24	1.432.308,44	2,18	590.438.062,23	0,24
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,82	0,23	-4,00	-0,77	1.153.627,61	1,76	204.471.931,28	0,56
Sub-total Artigo 8º I			21,76	-0,70	-7,04	-4,69	11.803.735,66	18,01		
Renda Variável			21,76	-0,70	-7,04	-4,69	11.803.735,66	18,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,89%

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	SYSTEMATICA BLUE TREND DOLAR ADVISORY FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,62	0,66	3,66	-3,01	356.426,92	0,54	20.602.408,80	1,73
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	21,43	-0,18	-6,01	3,48	415.023,59	0,63	57.652.930,65	0,72
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,33	0,47	-3,94	1,40	383.236,84	0,58	18.412.905,52	2,08
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	32,31	-0,17	-3,03	8,58	375.637,64	0,57	220.200.259,80	0,17
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,56	0,28	-0,86	12,03	388.832,44	0,59	69.754.930,67	0,56
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	39,18	1,41	1,39	12,55	950.311,11	1,45	590.852.345,79	0,16
Sub-total Artigo 9º II			25,16	0,59	-1,48	7,86	2.869.468,54	4,38		

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				
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	25,79	0,33	0,23	2,79	502.244,74	0,77	847.652.363,95	0,06
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	29,30	0,46	2,51	7,75	487.910,26	0,74	1.429.443.520,56	0,03
Sub-total Artigo 9º III			27,09	0,39	1,34	5,17	990.155,00	1,51		
Investimentos no Exterior			24,04	0,54	-0,73	7,11	3.859.623,54	5,89		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,13%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	19,66	-0,03	1,20	1,62	979.771,04	1,49	39.974.658,43	2,45
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	23,71	-0,11	-1,78	4,59	1.730.495,55	2,64	1.139.873.707,23	0,15
Sub-total Artigo 10º I			22,42	-0,08	-0,96	3,84	2.710.266,59	4,13		
Investimentos Estruturados			22,42	-0,08	-0,96	3,84	2.710.266,59	4,13		
Total			6,81	-0,10	-0,69	1,15	65.554.526,12	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	13.367.665,14	20,39	0,00	15,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	16.785.314,58	25,61	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	17.027.920,61	25,98	0,00	30,00	60,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	47.180.900,33	71,97					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	11.803.735,66	18,01	0,00	18,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	11.803.735,66	18,01					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	2.869.468,54	4,38	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	990.155,00	1,51	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	3.859.623,54	5,89					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	2.710.266,59	4,13	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	2.710.266,59	4,13					15,00
Total		65.554.526,12	100,00					