

A decorative graphic on the left side of the page, featuring several concentric circles composed of small squares. The squares are arranged in a grid-like pattern, with the innermost circle being orange and the outer circles being light gray.

Relatório de Posição Consolidada Fevereiro 2022

Período: De 01/FEV/2022 até 28/FEV/2022

Cliente Número: 6078111 / Número da Conta de Corretagem: JTU040105

Composição

% de Composição de Ativos

- 62.82% Conta Corrente
- 10.33% Renda Fixa
- 11.88% Renda Variável/Ações
- 14.97% Fundos Hedge



% de Exposição em Moeda

- 100.00% USD

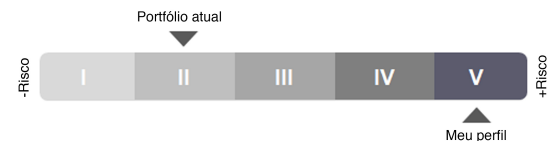


Descrição dos Ativos	Valor de Mercado período anterior	Valor de Mercado período atual
Conta Corrente	5,094,943.28	5,096,341.85
Renda Fixa	850,799.65	838,447.67
Renda Variável/Ações	998,732.87	963,998.04
Fundos Hedge	1,214,686.89	1,214,686.89
Juros Acumulados	7,929.17	11,312.50
Total	8,167,091.86	8,124,786.95

Resumo das Transações

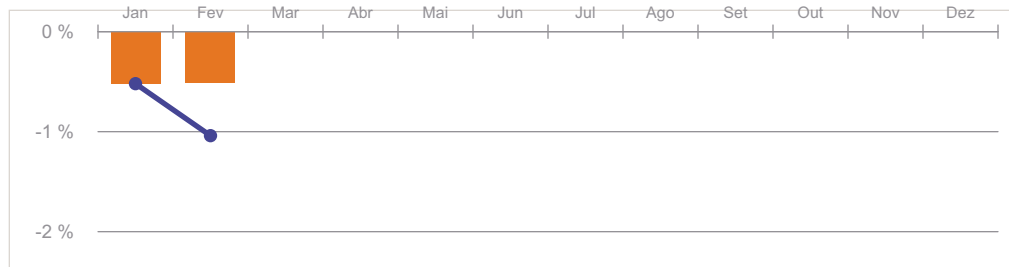
Movimentos - Conta Corrente	01/FEV/2022 até 28/FEV/2022
Saldo Inicial	5,094,943.28
Entrada e Saída de Dinheiro (Incoming and Outgoing Cash)	0.00
Compra e Venda de Valores Mobiliários (Buying and Selling Securities)	0.00
Cupons e Dividendos (Coupons and Dividends)	2,718.04
Liberação do Empréstimo (Loan Disbursement)	0.00
Impostos, Juros e Taxas (Taxes, Interests, Fees)	- 1,319.47
Distribuição de Private Equity	0.00
Outros (Others)	0.00
Saldo Final	5,096,341.85

Meu Perfil de Investidor



Referenciais Financeiros & Performance

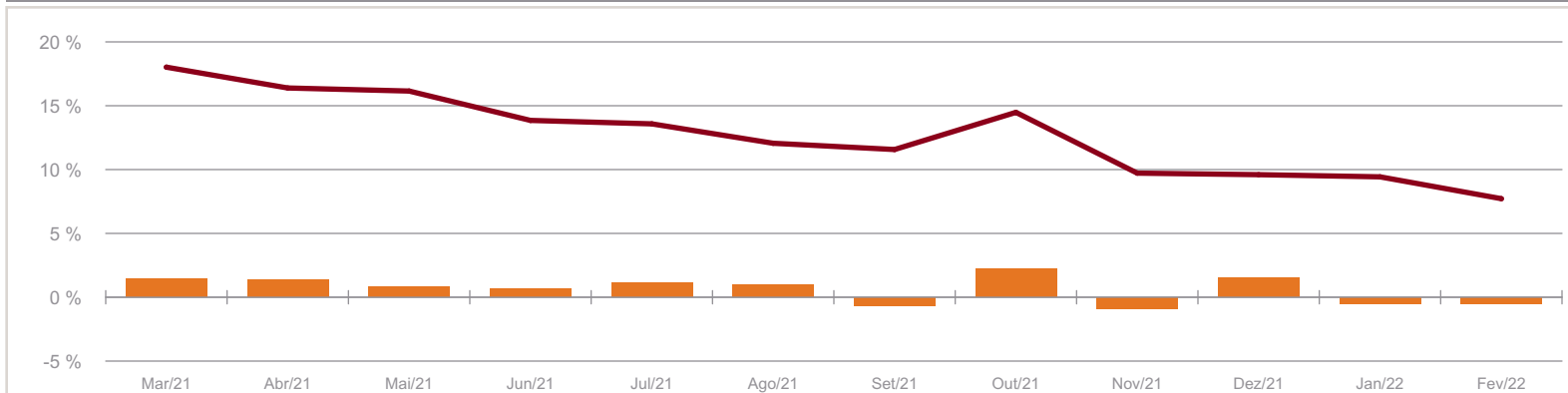
Referenciais	Acumulado 12 meses	Período	Acumulado do Ano
S & P 500	14.77%	- 3.14%	- 8.23%
MSCI ALL CNTRY W IDX EXUS	- 0.47%	- 2.05%	- 5.66%
Barclays US Agg IDX UNHDG	- 3.40%	- 1.88%	- 4.00%
HFRX Global HDG-FUND IDX	- 0.18%	- 0.61%	- 2.06%
1 Month LIBOR	- 100.00%	- 100.00%	- 100.00%



Rentabilidade do Portfólio no ano
Período
- 0.51%
Acumulado do Ano
- 1.04%

Período: De 01/FEV/2022 até 28/FEV/2022
 Cliente Número: 6078111 / Número da Conta de Corretagem: JTU040105

Historico da Rentabilidade Mensal (acumulado últimos 12 meses)



Histórico da Rentabilidade

Período

- 0.51%

Últimos 12 meses

7.72%

Rentabilidade Historica do Portfólio e dos Referenciais Financeiros (acumulado no ano)



Retorno Anual

- 1.04%

Retorno Anual Historico

Ano

%

2021

9.60%

Rentabilidade Historica do Portfólio e dos Referenciais Financeiros

	Mar/21	Abr/21	Mai/21	Jun/21	Jul/21	Ago/21	Set/21	Out/21	Nov/21	Dez/21	Jan/22	Fev/22
Portfólio	1.43%	1.35%	0.85%	0.65%	1.12%	0.99%	- 0.70%	2.20%	- 0.90%	1.55%	- 0.52%	- 0.51%
MSCI ALL CNTRY W IDX EXUS	1.26%	2.94%	3.13%	0.14%	- 2.42%	1.90%	- 3.20%	2.39%	- 4.50%	4.13%	- 3.68%	- 2.05%
Barclays US Agg IDX UNHDG	- 1.25%	0.79%	0.33%	0.56%	1.26%	- 0.19%	- 0.87%	- 0.03%	0.30%	- 0.26%	- 2.15%	- 1.88%
HFRX Global HDG-FUND IDX	- 0.39%	1.76%	0.13%	0.50%	- 0.37%	0.60%	- 0.38%	0.94%	- 1.33%	0.47%	- 1.47%	- 0.61%
S & P 500	4.24%	5.24%	0.55%	2.22%	2.27%	2.90%	- 4.76%	6.91%	- 0.83%	4.36%	- 5.26%	- 3.14%
1 Month LIBOR	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%

Conta Corrente

Tipo de Conta	Número da Conta	Moeda	Taxa Câmbio	Principal	Principal (USD)
Depósitos a Vista (Demand Deposit)	6078111-001-000-840	USD	1.0000	5,096,341.85	5,096,341.85

* Posições mantidas na Conta de Corretagem sujeita à cobertura do SIPC

Período: De 01/FEV/2022 até 28/FEV/2022
 Cliente Número: 6078111 / Número da Conta de Corretagem: JTU040105

Renda Fixa	Moeda Taxa Câmbio	Quantidade	Valor de Custo Preço de Custo Início da Posição	Valor de Mercado Preço de Mercado Data Último Preço	Ganhos e Perdas não Realizados	Receita Juros Acumulados	Rendimento Anual Estimado	Mudança no Valor de Mercado	% do Portfólio
Renda Fixa - Grau de Investimento									
LORD ABBETT SHRT DUR-USD CL A	USD	18,645.5580	212,530.00	208,457.34	- 4,072.66	0.00	0.00	- 1.91%	2.57%
ISIN : IE00BFNWX26	1.0000		11.39843	11.180		0.00			
			17/MAR/21	28/FEV/22					
Renda Fixa - Mercados Emergentes									
*CREDIT SUISSE GROUP AG PERP TIER 1	USD	300,000	329,940.00	305,490.00	- 24,450.00	0.00	22,500.00	- 7.41%	3.76%
CONTINGENT WRITE REG S DOWN CAP NT 7.500% 07/17/88	1.0000		109.98000	101.830		2,562.50			
ISIN : USH3698DBW32			05/MAR/20	28/FEV/22					
*KONINKLIJKE KPN NV CAP SECS REG S	USD	300,000	328,896.00	307,500.00	- 21,396.00	0.00	21,000.00	- 6.50%	3.78%
7.000% 03/28/73 B/E	1.0000		109.63200	102.500		8,750.00			
ISIN : USN4297BBC74			05/MAR/20	28/FEV/22					
*BUENOS AIRES PROVINCE REGD NOTES RE	USD	100,000	16,133.23	17,000.33	867.10	0.00	10,875.00	5.37%	0.21%
G S 10.875% 01/26/21 REG	1.0000		48.40000	51.001		0.00			
ISIN : XS0584493349			05/MAR/20	28/FEV/22					
Totais Renda Fixa			887,499.23	838,447.67	- 49,051.56	11,312.50	54,375.00		10.32%

Renda Variável/Ações	Moeda Taxa Câmbio	Quantidade	Valor de Custo Preço de Custo Início da Posição	Valor de Mercado Preço de Mercado Data Último Preço	Ganhos e Perdas não Realizados	Receita Juros Acumulados	Rendimento Anual Estimado	Mudança no Valor de Mercado	% do Portfólio
Renda Variável/Ações Estados Unidos									
*AT&T INC COM	USD	5,227	194,339.86	123,827.63	- 70,512.23	0.00	10,872.16	- 36.28%	1.52%
ISIN : US00206R1023	1.0000		37.18000	23.690		0.00			
			05/MAR/20	28/FEV/22					
*CISCO SYSTEMS INC	USD	4,415	174,701.55	246,224.55	71,523.00	0.00	6,710.80	40.94%	3.03%
ISIN : US17275R1023	1.0000		39.57000	55.770		0.00			
			05/MAR/20	28/FEV/22					
*JP MORGAN CHASE & CO COM	USD	1,462	166,624.14	207,311.60	40,687.46	0.00	5,848.00	24.41%	2.55%
ISIN : US46625H1005	1.0000		113.97000	141.800		0.00			
			05/MAR/20	28/FEV/22					
*MICROSOFT CORP COM	USD	1,294	215,153.38	386,634.26	171,480.88	0.00	3,209.12	79.70%	4.76%
ISIN : US5949181045	1.0000		166.27000	298.790		0.00			
			05/MAR/20	28/FEV/22					
Totais Renda Variável/Ações			750,818.93	963,998.04	213,179.11	0.00	26,640.08		11.86%

Período: De 01/FEV/2022 até 28/FEV/2022

Cliente Número: 6078111 / Número da Conta de Corretagem: JTU040105

Fundos Hedge	Moeda Taxa Câmbio	Quantidade	Valor de Custo Preço de Custo Início da Posição	Valor de Mercado Preço de Mercado Data Último Preço	Ganhos e Perdas não Realizados	Receita Juros Acumulados	Rendimento Anual Estimado	Mudança no Valor de Mercado	% do Portfólio
Hedge Funds - Rela.									
OBSIDIAN OFF FD CL VIII- MASTER SE	USD	798.9790	795,517.97	1,214,686.89	419,168.92	0.00	0.00	52.69%	14.95%
ISIN : M0021274-000	1.0000		995.66818	1520.298		0.00			
			04/JAN/20	31/DEZ/21					
Totais Fundos Hedge			795,517.97	1,214,686.89	419,168.92	0.00	0.00		14.95%
GRAND TOTAL			2,433,836.13	3,017,132.60	583,296.47	11,312.50	81,015.08		37.08%

* Posições mantidas na Conta de Corretagem sujeita à cobertura do SIPC

Período: De 01/FEV/2022 até 28/FEV/2022
 Cliente Número: 6078111 / Número da Conta de Corretagem: JTU040105

Tipo de Conta: Demand Deposit Account

Número da Conta: 6078111/001.000.840

Moeda: USD

Data Inicial	Data Valor	Tipo de Transação	Descrição	Débito	Crédito	Saldo
SALDO INICIAL						5,094,943.28
01/FEB/22	01/FEB/22	BROKERAGE TRANSACTION	CASH DIVD RECD 5227 SHRS AT&T INC COM RD 01/10 PD 02/01/22		2,718.04	5,097,661.32
01/FEB/22	01/FEB/22	BROKERAGE TRANSACTION	NON-RESIDENT ALIEN TAX NRA TAX WITHHELD ON 5227 SHRS AT&T INC COM RD 01/10 P D 02/01/22	815.41		5,096,845.91
14/FEB/22	14/FEB/22	ADMINISTRATIVE FEE JAN 2022	909-5892770	252.18		5,096,593.73
23/FEB/22	23/FEB/22	ADMINISTRATIVE FEE FEB 2022	909-5898666	251.88		5,096,341.85
SALDO FINAL						5,096,341.85

NOTAS GERAIS

NAO É SEGURADO PELO FDIC - SEM GARANTIA BANCÁRIA - PODE PERDER VALOR

Este relatório não é o registro oficial de suas contas com o Banco Itaú International (BII) nem com o Itaú International Securities (IIS). Este relatório foi elaborado para fornecer a você uma visão consolidada dos seus ativos, tanto com o BII quanto com o IIS, e tem finalidade exclusivamente informativa. Os seus extratos do BII e do IIS constituem o registro oficial das suas contas. Portanto, se houver qualquer discrepância entre este relatório e seus extratos do BII e do IIS, você deverá basear-se nos extratos.

Determinação de Preços: O preço dos valores mobiliários pode variar em comparação com o valor de liquidação real. Os preços apresentados devem ser utilizados somente como orientação geral em relação ao valor do portfólio. Os preços são enviados por vários serviços de determinação de preços. Entretanto, muitas vezes esses serviços não conseguem prestar informações em tempo hábil. Nos casos em que não existem fontes de determinação de preços prontamente disponíveis - particularmente no que diz respeito a determinados títulos de dívidas -, os preços estimados podem ser gerados por um sistema-matriz que leva em consideração diversos fatores. A determinação de preços das opções listadas leva em conta o último preço de fechamento e também os atuais preços de oferta de compra e venda.

Comunicado sobre Opções: As informações referentes às comissões e outros encargos incorridos relativamente a transações de exercício de opções já foram incluídas em confirmações previamente te fornecidas a você. Você terá um resumo dessas informações prontamente à sua disposição mediante solicitação por escrito dirigida à firma que o(a) apresentou. Para que a firma que o(a) apresentou possa manter informações financeiras e histórico atualizados no que diz respeito às suas contas de opções, favor orientá-la imediatamente, por escrito, sobre qualquer alteração material nos seus objetivos de investimento ou situação financeira. Os contratos de opção próximos a expirar, com um valor intrínseco positivo, serão exercitados automaticamente de acordo com o procedimento de exercício por exceção da Options Clearing Corporation. Outras informações sobre esse procedimento estão disponíveis mediante solicitação, por escrito, à firma que o(a) apresentou.

Dentre os produtos negociáveis na bolsa de valores pode estar qualquer combinação de fundos negociados na bolsa, notas negociadas na bolsa e outros produtos negociados na bolsa de valores. A moeda de referência deste relatório é o Dólar Americano.

Página de Resumo

Cupons e Dividendos Inclui:

- juros acumulados durante o período em obrigações, depósitos a prazo e empréstimos,
- juros acumulados pagos ou recebidos durante o período (compra ou venda de obrigações),
- coupons e dividendos recebidos durante o período.

Taxas & Impostos Inclui todos os impostos e taxas pagos durante o período.

Página de Desempenho

Período: Retorno de 01/FEV/22 (abertura do dia) até 28/FEV/22 (fechamento do dia)
Acumulado no ano: Retorno de 01/JAN/22 (abertura do dia) até 28/FEV/22 (fechamento do dia)

Apesar de valorização de mercado e de Resultados incluírem apenas os ativos, os índices de rentabilidade em (%) levam em consideração os os juros dos empréstimos que foram contraídos. As taxas também estão integradas na rentabilidade do portfólio.

Glossário Financeiro

S&P 500

O índice Standard & Poor 500 (S&P 500) é um índice de 500 ações e é visto como o principal indicador de desempenho das ações dos EUA. O índice é um reflexo do desempenho do universo de grandes capitais. O S&P 500 é amplamente reconhecido como o indicador mais preciso do desempenho das ações de grandes capitais dos EUA. Embora o S&P 500 se concentra no setor de mercado de grandes capitais, ele é considerado representativo no mercado porque inclui uma parcela significativa do valor total de mercado.

MSCI ALL CNTRY W IDX EXUS

Um índice de capitalização ponderado do mercado mantido pela Morgan Stanley Capital International (MSCI) e criado para proporcionar uma ampla medida de desempenho das ações em todo o mundo, com exceção das empresas baseadas nos EUA. O índice MSCI All Country World Index Ex-U.S. inclui mercados desenvolvidos e emergentes.

Barclays US Agg IDX UNHDG

O índice Barclays Capital U.S Aggregate Bond é um indicador de títulos agregados ponderado de acordo com capitalização de mercado. Isso significa que os valores representados no índice são ponderados de acordo com a categoria do mercado de títulos. Títulos do Tesouro, títulos estrangeiros, títulos hipotecários, títulos de agências governamentais e títulos corporativos são algumas das categorias incluídas no índice. Os títulos representados são a médio prazo com vencimento médio de aproximadamente 4,57 anos.

HFRX Global HDG-FUND IDX

O HFRX Global Hedge Fund Index foi projetado para representar a composição total do universo de fundos de hedge. Trata-se de todas as estratégias de fundos de hedge qualificadas; incluindo, entre outras, a arbitragem conversível, ativos problemáticos, equity hedge, mercado neutro de ações, ações orientadas por eventos, macro, arbitragem de fusões e arbitragem de valor relativo. As estratégias são ponderadas por ativos com base na distribuição de ações no setor de fundos de hedge.

Taxa Libor (1 mês)

LIBOR é uma taxa de referência que alguns dos principais bancos do mundo cobram entre si para empréstimos de curto prazo. Representa a taxa interbancária de Londres e serve como um primeiro passo para calcular as taxas de juros sobre vários empréstimos em todo o mundo. A LIBOR é administrada pela ICE Benchmark Administration (IBA) e é baseada em cinco moedas: dólar americano (USD), euro (EUR), libra esterlina (GBP), iene japonês (JPY) e franco suíço (CHF) e reúne sete vencimentos diferentes: overnight, uma semana, e 1, 2, 3, 6 e 12 meses.

Perfil de Investimento: Descrição

Perfil 1: O cliente tem uma baixa tolerância a risco e procura um alto grau de preservação do capital. O cliente espera um alto nível de liquidez baseado em investimentos de baixo risco que possibilitem pronta conversão em efetivo sem que haja perdas significativas de valor. O cliente antecipa que seus investimentos crescerão a uma baixa taxa de retorno que permanecerá muito próxima à taxa de juros nominal de curto prazo dos Estados Unidos.

Perfil 2: O cliente tem tolerância entre baixa a moderada ao risco, e procura algum nível de preservação de capital com um alto grau de liquidez, onde os seus investimentos possam ser convertidos em efetivo em um curto prazo sem incorrer penalidades significativas. O cliente espera uma taxa de retorno moderada, algo que provavelmente ocorrerá em um prazo mais prolongado de tempo. O cliente aceita que o valor do seu portfólio tenha um grau de flutuação maior que investimentos conservadores, mas deseja alguma proteção contra quedas inesperadas no mercado.

Perfil 3: O cliente tem média tolerância a risco e procura que seus investimentos cresçam a uma taxa acima da média de mercado através do emprego de estratégias de médio ou longo prazo. Para atingir o crescimento pretendido, aceita que o valor dos seus investimentos flutue com frequência que possa resultar em quedas abruptas. Cliente entende e aceita que seus investimentos tenham um nível de liquidez médio ou baixo, que consequentemente não poderão ser prontamente liquidadas.

Perfil 4: O cliente tem tolerância entre média e alta ao risco, e procura crescimento de capital acima da média de mercado, principalmente através de estratégias de longo prazo. Cliente raramente espera converter os investimentos em caixa, requerendo um baixo nível de liquidez. O cliente aceita que o valor de sua carteira sofra oscilações significativas.

Perfil 5: O cliente tem alta tolerância a risco e procura máximo retorno através de estratégias que assumem riscos consideravelmente maiores. O cliente não necessita de caixa proveniente desses investimentos por um longo prazo e espera obter seu retorno com estratégias de investimento de longo prazo. Cliente aceita que o valor dos seus investimentos oscile com alta frequência e de forma substancial, mesmo que resultem em perda total do capital em função de 100% de alocação em ativos de alto risco.