



LDB
EMPRESAS

CARAGUATATUBA
MAIO 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 31.05.2024.

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

88,07%

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 150525 (5,940000%)	0,26	0,04	0,89	4,80	20.813.657,94	2,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,27	0,05	0,89	4,82	10.626.761,41	1,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,080000%)	2,94	0,04	0,90	1,81	19.775.584,59	2,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,30	0,04	0,90	4,87	5.258.837,76	0,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,41	0,04	0,86	4,65	17.354.947,74	2,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,42	0,04	0,88	4,76	20.308.378,10	2,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,54	0,04	0,87	4,71	33.211.152,55	4,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,54	0,04	0,88	4,73	11.042.865,91	1,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,54	0,04	0,88	4,74	11.024.719,88	1,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,63	0,04	0,88	4,75	11.008.340,71	1,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,60	0,01	0,88	4,77	10.644.242,53	1,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,25	0,04	0,89	4,79	5.722.925,49	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	0,25	0,04	0,89	4,79	10.818.700,56	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	0,25	0,04	0,90	4,86	5.411.807,01	0,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	0,25	0,04	0,93	5,01	21.175.248,23	2,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	0,25	0,04	0,93	5,02	22.051.907,98	2,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,680000%)	0,25	0,04	0,95	5,11	5.444.445,24	0,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,990300%)	0,25	0,05	0,97	5,23	31.534.678,75	4,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	0,28	0,04	0,92	4,97	15.823.071,68	2,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	0,30	0,03	0,92	4,97	15.822.431,43	2,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,35	0,04	0,87	4,71	11.299.511,89	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,070000%)	4,15	0,05	0,90	1,26	40.490.935,60	5,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,47	0,04	0,87	4,69	962.629,53	0,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,48	0,04	0,88	4,74	11.334.098,66	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,59	0,04	0,87	4,71	11.397.015,66	1,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,59	0,04	0,88	4,74	11.016.311,58	1,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,59	0,04	0,88	4,75	11.320.621,04	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,60	0,04	0,89	4,79	4.064.023,86	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,57	0,02	0,89	4,80	10.885.067,10	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,970000%)	2,97	0,02	0,89	4,82	20.853.419,41	2,77
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,38	0,04	0,90	4,85	438.498.339,82	58,31

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,80	0,08	0,72	3,44	10.436.626,00	1,39	6.634.026.168,29	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2,69	0,19	0,55	1,64	2.589.378,59	0,34	286.859.264,66	0,90
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,07	0,04	0,82	4,34	11.396.477,38	1,52	7.328.166.843,37	0,16
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,36	0,20	0,64	1,69	10.585.593,31	1,41	4.105.804.160,54	0,26
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,33	0,00	0,65	3,78	496.455,10	0,07	559.403.201,62	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,85	0,24	1,30	-0,23	213.142,62	0,03	4.414.746.482,17	0,00
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,06	0,04	0,82	0,90	13.312.140,81	1,77	34.291.651.726,37	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,33	0,26	0,58	0,84	5.666.712,83	0,75	1.144.130.732,83	0,50
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,46	0,11	0,70	2,19	10.886.773,37	1,45	5.032.963.943,31	0,22
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,92	0,13	0,84	1,86	56.575,33	0,01	284.777.684,21	0,02
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,30	0,11	0,72	2,68	65.639.875,34	8,73		

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	4,28	0,26	1,30	-1,35	193.574,53	0,03	397.568.884,35	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,04	0,84	4,51	58.364.789,89	7,76	15.967.251.260,95	0,37
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,04	0,86	4,63	30.835.388,88	4,10	5.878.240.284,89	0,52
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,04	0,83	4,42	17.811.196,20	2,37	17.741.520.962,30	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,12	0,04	0,83	4,40	17.899.890,00	2,38	5.381.527.271,10	0,33
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,04	0,84		10.699.050,31	1,42	2.945.417.915,81	0,36
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,13	0,04	0,85	0,89	20.879.075,36	2,78	2.184.212.203,72	0,96
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,20	0,04	0,84	4,30	156.682.965,17	20,84		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	111,08	0,48	0,48	3,03	1.485.180,54	0,20	58.098.795,51	2,56
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	111,08	0,48	0,48	3,03	1.485.180,54	0,20		
		Renda Fixa	0,38	0,05	0,87	4,35	662.306.360,87	88,07		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

6,60%

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	13,08	-0,62	-1,60	-7,78	1.613.033,26	0,21	557.841.462,51	0,29
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,52	-0,76	-0,24	-12,79	5.020.480,27	0,67	577.455.862,90	0,87
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	14,44	-0,67	-3,81	-10,05	7.687.978,14	1,02	711.095.279,01	1,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,35	-0,71	-1,49	-5,08	15.833.690,52	2,11	997.864.463,39	1,59
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	13,24	-1,00	-2,96	-2,57	6.608.575,58	0,88	1.147.061.476,64	0,58
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	14,94	-0,91	-4,06	-13,22	5.179.132,84	0,69	367.214.275,19	1,41
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	17,54	-1,17	-4,96	-16,13	7.655.059,44	1,02	115.044.455,26	6,65
Sub-total Artigo 8º I			14,09	-0,84	-2,75	-9,18	49.597.950,05	6,60		
Renda Variável			14,09	-0,84	-2,75	-9,18	49.597.950,05	6,60		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,13%

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				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,53	-0,46	6,78	23,76	23.514.565,90	3,13	2.462.872.316,84	0,95
Sub-total Artigo 9º III			13,53	-0,46	6,78	23,76	23.514.565,90	3,13		
Investimentos no Exterior			13,53	-0,46	6,78	23,76	23.514.565,90	3,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,21%

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	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,35	0,16	5,07	12,32	16.591.761,23	2,21	1.884.343.751,95	0,88
Sub-total Artigo 10º I			11,35	0,16	5,07	8,59	16.591.761,23	2,21		
Investimentos Estruturados			4,06	0,16	5,07	8,59	16.591.761,23	2,21		
Total			1,36	-0,02	0,89	3,85	752.010.638,05	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 3	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	438.498.339,82	58,31	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	65.639.875,34	8,73	0,00	16,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	156.682.965,17	20,84	0,00	19,80	75,00	0,00	75,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.485.180,54	0,20	0,00	0,20	15,00	0,00	15,00
	Total Renda Fixa	662.306.360,87	88,07					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	49.597.950,05	6,60	0,00	6,00	45,00	0,00	45,00
	Total Renda Variável	49.597.950,05	6,60					45,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.514.565,90	3,13	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.514.565,90	3,13					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	16.591.761,23	2,21	0,00	8,00	15,00	0,00	15,00
	Total Investimentos Estruturados	16.591.761,23	2,21					20,00
Total		752.010.638,05	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	0,90 107,94	4,85 110,25	2,69 104,61	5,85 109,69	10,04 83,63	3.930.787,03	18.627.826,64
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,72 86,93	2,68 61,01	1,39 53,98	3,95 74,14	9,91 82,58	472.090,94	2.755.598,38
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,84 101,32	4,30 97,71	2,55 99,15	5,37 100,60	12,04 100,26	1.291.723,27	5.631.488,03
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,48 57,24	3,03 68,93	1,57 61,04	5,35 100,39	280,95 2.340,13	7.050,22	45.591,68
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,75 0,29	-9,18 -0,17	-6,57 -1,21	-3,71 0,40	6,91 -5,80	-1.402.483,42	-5.013.361,76
Artigo 9º III % do CDI	6,78 813,37	23,76 540,19	11,38 441,67	26,96 505,48	35,62 296,69	1.492.678,28	3.830.444,52
Artigo 10º I % do CDI	5,07 608,07	8,59 195,24	4,54 176,07	10,44 195,65	16,97 141,36	800.204,09	1.787.573,45
CARAGUATATUBA (Total)						6.592.050,41	27.665.160,94

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 150525 (5,940000%)	21.239.313,62	0,00	0,00	612.054,82	20.813.657,94	186.399,14	979.578,80
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.843.893,94	0,00	0,00	312.592,35	10.626.761,41	95.459,82	501.566,58
NTN-B 150525 (6,080000%)	20.178.497,34	0,00	0,00	582.260,07	19.775.584,59	179.347,32	359.494,55
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.366.145,02	0,00	0,00	155.033,69	5.258.837,76	47.726,43	250.545,91
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.697.185,57	0,00	0,00	492.370,83	17.354.947,74	150.133,00	790.857,24
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.716.385,58	0,00	0,00	587.941,27	20.308.378,10	179.933,79	946.210,46
NTN-B 150545 (5,710000%)	33.861.349,01	0,00	0,00	941.438,28	33.211.152,55	291.241,82	1.532.465,69
NTN-B 150545 (5,760000%)	11.260.448,39	0,00	0,00	314.864,83	11.042.865,91	97.282,35	511.725,02
NTN-B 150545 (5,781000%)	11.242.533,06	0,00	0,00	315.117,33	11.024.719,88	97.304,15	511.810,64
NTN-B 150555 (5,815000%)	11.225.239,08	0,00	0,00	314.359,84	11.008.340,71	97.461,47	512.467,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.855.202,83	0,00	0,00	305.522,41	10.644.242,53	94.562,11	497.085,40
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.672.610,58	0,00	0,00	0,00	5.722.925,49	50.314,91	263.692,85
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.723.402,24	0,00	0,00	0,00	10.818.700,56	95.298,32	499.341,39
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.363.411,45	0,00	0,00	0,00	5.411.807,01	48.395,56	253.292,62
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.979.999,66	0,00	0,00	0,00	21.175.248,23	195.248,57	1.019.246,28
NTN-B 150824 (6,480000%)	21.848.027,94	0,00	0,00	0,00	22.051.907,98	203.880,04	1.064.132,19
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.393.242,77	0,00	0,00	0,00	5.444.445,24	51.202,47	266.880,12
NTN-B 150824 (6,990300%)	31.230.545,72	0,00	0,00	0,00	31.534.678,75	304.133,03	1.582.076,75
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.678.273,50	0,00	0,00	0,00	15.823.071,68	144.798,18	756.421,20
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.677.637,41	0,00	0,00	0,00	15.822.431,43	144.794,02	756.425,36
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.201.795,24	0,00	0,00	0,00	11.299.511,89	97.716,65	512.764,11
NTN-B 150832 (6,070000%)	40.129.403,47	0,00	0,00	0,00	40.490.935,60	361.532,13	503.704,87
NTN-B 150840 (5,650000%)	954.347,93	0,00	0,00	0,00	962.629,53	8.281,60	43.465,29
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.235.527,35	0,00	0,00	0,00	11.334.098,66	98.571,31	516.922,80
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.298.397,94	0,00	0,00	0,00	11.397.015,66	98.617,72	517.298,42
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.920.414,74	0,00	0,00	0,00	11.016.311,58	95.896,84	502.818,01
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.221.774,28	0,00	0,00	0,00	11.320.621,04	98.846,76	518.224,42
NTN-B 150850 (5,916000%)	4.028.218,08	0,00	0,00	0,00	4.064.023,86	35.805,78	187.598,03
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.789.115,11	0,00	0,00	0,00	10.885.067,10	95.951,99	502.706,57
NTN-B 150850 (5,970000%)	20.668.769,66	0,00	0,00	0,00	20.853.419,41	184.649,75	967.007,96
	439.501.108,51	0,00	0,00	4.933.555,72	438.498.339,82	3.930.787,03	

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	10.361.871,47	0,00	0,00	0,00	10.436.626,00	74.754,53	347.180,95
BB PREV RF IRF M	10.518.565,81	0,00	0,00	0,00	10.585.593,31	67.027,50	312.963,14
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	13.203.369,71	0,00	0,00	0,00	13.312.140,81	108.771,10	119.136,48
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	210.407,30	0,00	0,00	0,00	213.142,62	2.735,32	-3.516,02
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5.633.929,83	0,00	0,00	0,00	5.666.712,83	32.783,00	77.141,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	10.810.792,73	0,00	0,00	0,00	10.886.773,37	75.980,64	334.848,77
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.575.278,02	0,00	0,00	0,00	2.589.378,59	14.100,57	41.658,72
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	492.833,70	400,00	0,00	0,00	496.455,10	3.221,40	18.031,05
SANTANDER RF ATIVO FIC	56.105,01	0,00	0,00	0,00	56.575,33	470,32	8.224,52
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	11.304.230,82	0,00	0,00	0,00	11.396.477,38	92.246,56	803.987,62
	65.167.384,40	400,00	0,00	0,00	65.639.875,34	472.090,94	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB INSTITUCIONAL FI RF	20.702.905,89	0,00	0,00	0,00	20.879.075,36	176.169,47	184.979,93
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	16.161.030,50	1.509.857,96	0,00	0,00	17.811.196,20	140.307,74	1.799.609,47
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	17.752.919,68	0,00	0,00	0,00	17.899.890,00	146.970,32	755.113,02
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	52.041.461,15	10.635.773,63	-4.786.200,58	0,00	58.364.789,89	473.755,69	1.663.266,65
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	30.569.874,06	2.303,19	0,00	0,00	30.835.388,88	263.211,63	1.165.160,34
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	191.089,70	0,00	0,00	0,00	193.574,53	2.484,83	-35.691,69
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	10.610.226,72	0,00	0,00	0,00	10.699.050,31	88.823,59	99.050,31
	148.029.507,70	12.147.934,78	-4.786.200,58	0,00	156.682.965,17	1.291.723,27	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC ITALIA SENIOR	1.478.130,32	0,00	0,00	0,00	1.485.180,54	7.050,22	45.591,68
	1.478.130,32	0,00	0,00	0,00	1.485.180,54	7.050,22	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.639.217,81	0,00	0,00	0,00	1.613.033,26	-26.184,55	-135.989,16
BRADERCO F I A SELECTION	5.398.146,40	0,00	0,00	0,00	5.179.132,84	-219.013,56	-788.900,94
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.032.391,78	0,00	0,00	0,00	5.020.480,27	-11.911,51	-736.429,75
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.992.318,50	0,00	0,00	0,00	7.687.978,14	-304.340,36	-859.320,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	16.073.527,84	0,00	0,00	0,00	15.833.690,52	-239.837,32	-846.695,24
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6.809.965,99	0,00	0,00	0,00	6.608.575,58	-201.390,41	-174.031,33
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	8.054.865,15	0,00	0,00	0,00	7.655.059,44	-399.805,71	-1.471.994,81
	51.000.433,47	0,00	0,00	0,00	49.597.950,05	-1.402.483,42	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22.021.887,62	0,00	0,00	0,00	23.514.565,90	1.492.678,28	3.830.444,52
	22.021.887,62	0,00	0,00	0,00	23.514.565,90	1.492.678,28	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15.791.557,14	0,00	0,00	0,00	16.591.761,23	800.204,09	1.330.607,92
	15.791.557,14	0,00	0,00	0,00	16.591.761,23	800.204,09	

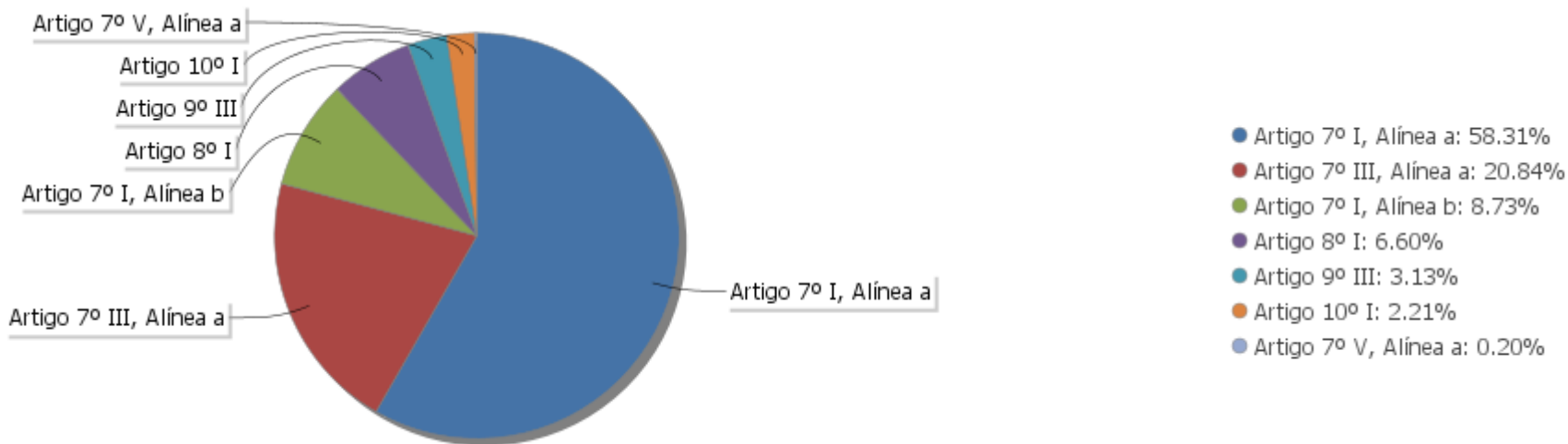
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

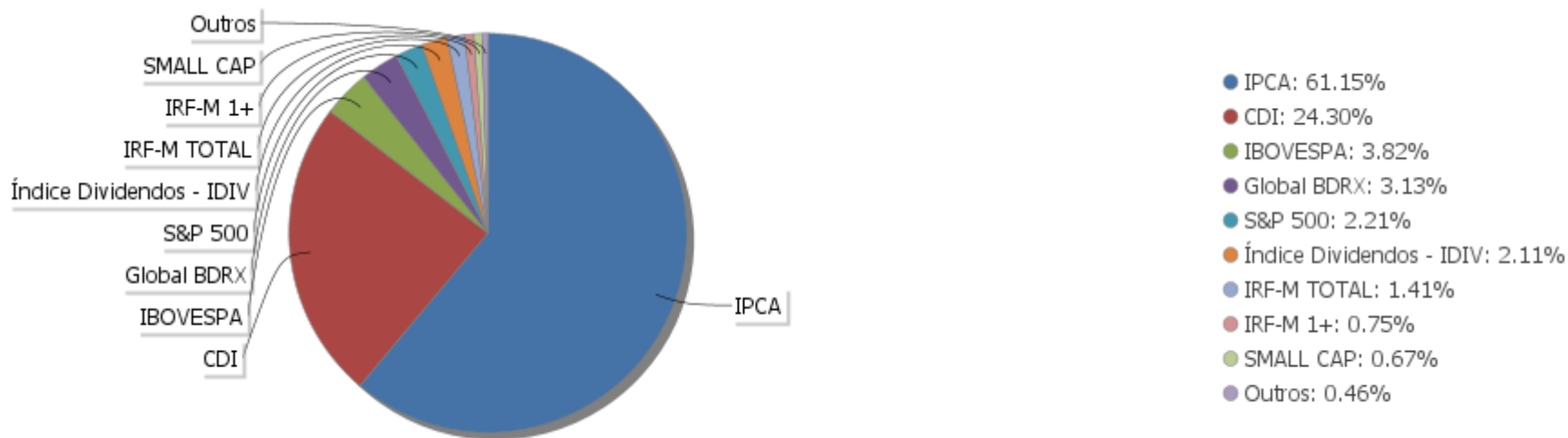
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	275.726.994,55	36,67		275.726.994,55	36,67	
de 31 dias a 365 dias	191.161.020,88	25,42		466.888.015,43	62,09	
acima de 365 dias	285.122.622,62	37,91		752.010.638,05	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

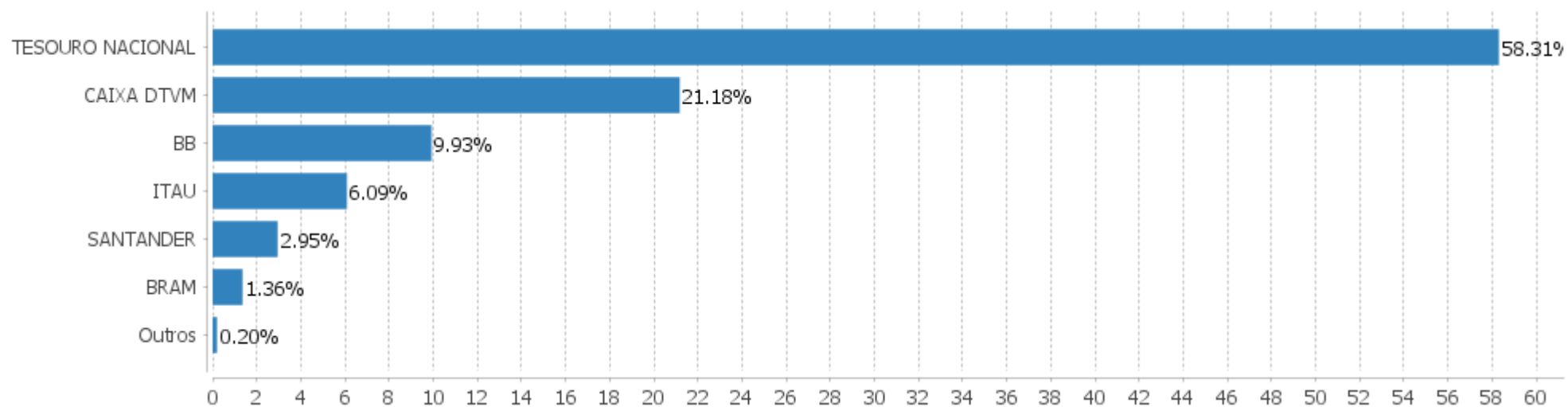


Alocação Por Estratégia



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	0,63	1,12	0,91	0,24	0,89								3,85
IPCA + 5,02%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87								4,36
p.p. indexador	-0,22	-0,08	0,36	-0,57	0,02								-0,51
2023	1,75	-0,11	0,96	0,97	1,66	1,53	0,99	0,35	0,50	0,40	1,81	1,45	12,95
IPCA + 5,03%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68	0,65	0,65	0,67	0,95	9,82
p.p. indexador	0,79	-1,30	-0,20	0,00	1,00	1,20	0,46	-0,33	-0,15	-0,25	1,14	0,50	3,13
2022	-0,53	-0,27	2,35	-1,70	1,01	-1,73	2,27	0,51	-0,83	2,08	0,78	-0,10	3,79
IPCA + 4,99%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12	0,98	0,80	1,05	11,04
p.p. indexador	-1,48	-1,65	0,30	-3,13	0,11	-2,81	2,54	0,42	-0,95	1,10	-0,02	-1,15	-7,25
2021	-0,94	-1,45	0,38	1,02	1,49	0,37	-0,80	-0,98	-1,64	-1,55	1,37	1,32	-1,47
IPCA + 5,46%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,05
p.p. indexador	-1,61	-2,69	-1,04	0,29	0,21	-0,60	-2,23	-2,32	-3,25	-3,23	-0,00	0,10	-17,51
2020	0,26	-1,20	-8,82	2,26	2,04	2,60	3,94	-1,32	-1,68	-0,06	3,29	4,43	5,12
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,45	-1,86	-9,40	2,11	1,97	1,86	3,06	-2,04	-2,80	-1,40	1,94	2,58	-5,52
2019	1,51	0,37	0,41	0,94	1,99	2,58	1,16	0,11	1,85	2,11	-0,78	2,17	15,34
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	0,68	-0,53	-0,78	-0,12	1,35	2,13	0,44	-0,51	1,40	1,47	-1,75	0,52	4,75

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	30	46,15
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	53,85

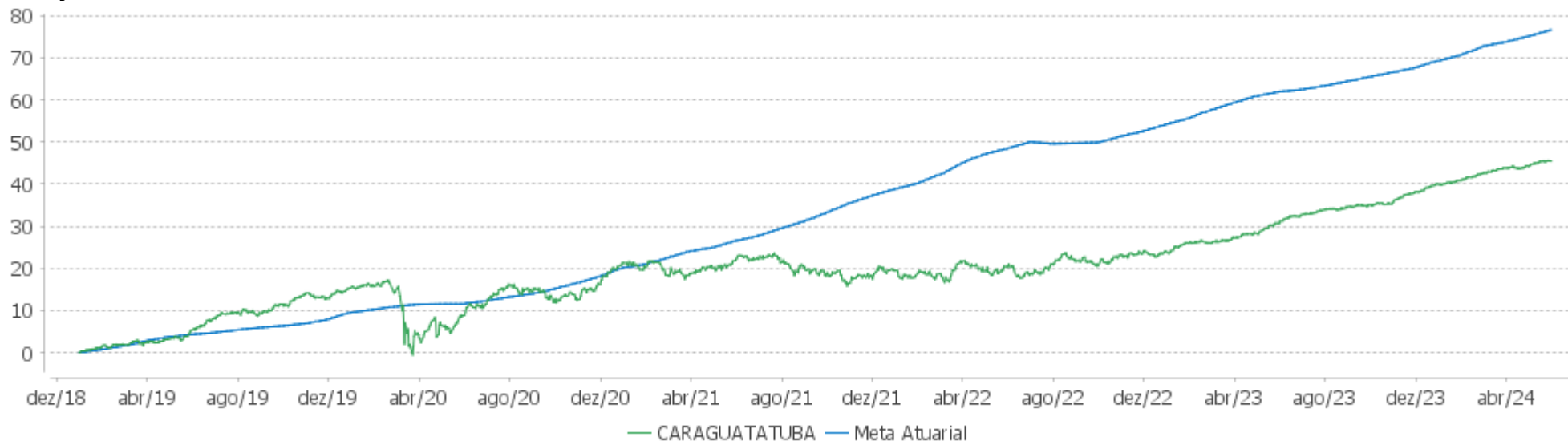
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03

Relatório

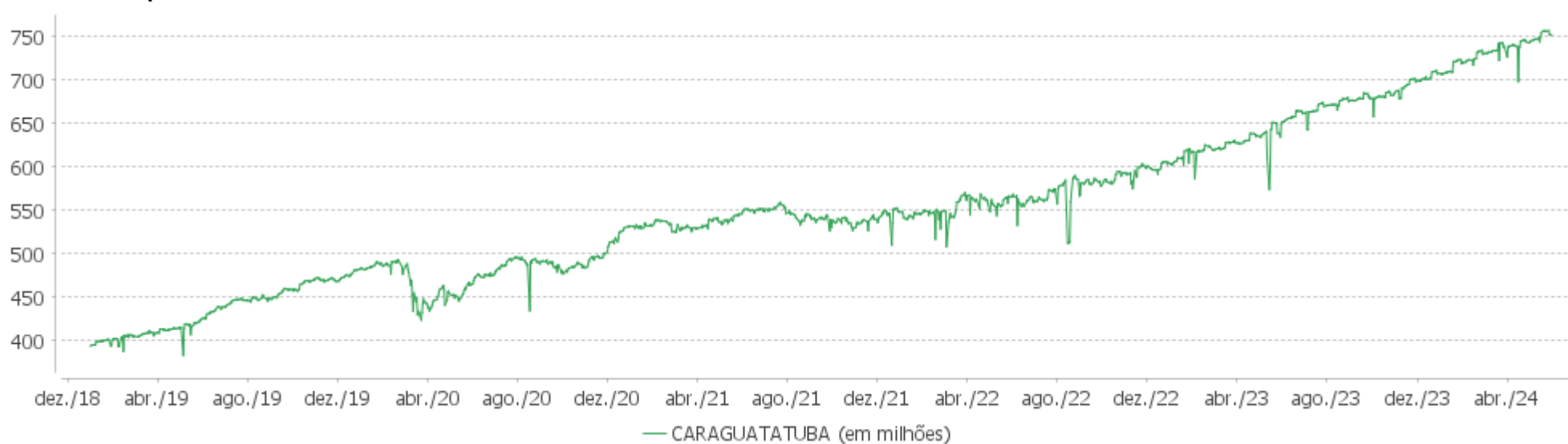
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,05	2,25	-0,20	1,12
06 meses	5,35	5,35	-0,00	1,14
12 meses	11,36	9,11	2,25	1,36
24 meses	20,76	19,06	1,71	2,83
36 meses	19,39	40,03	-20,64	4,15
48 meses	33,80	59,92	-26,12	4,73
60 meses	38,10	72,59	-34,49	6,96
Desde 31/12/2018	45,45	80,71	-35,26	6,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

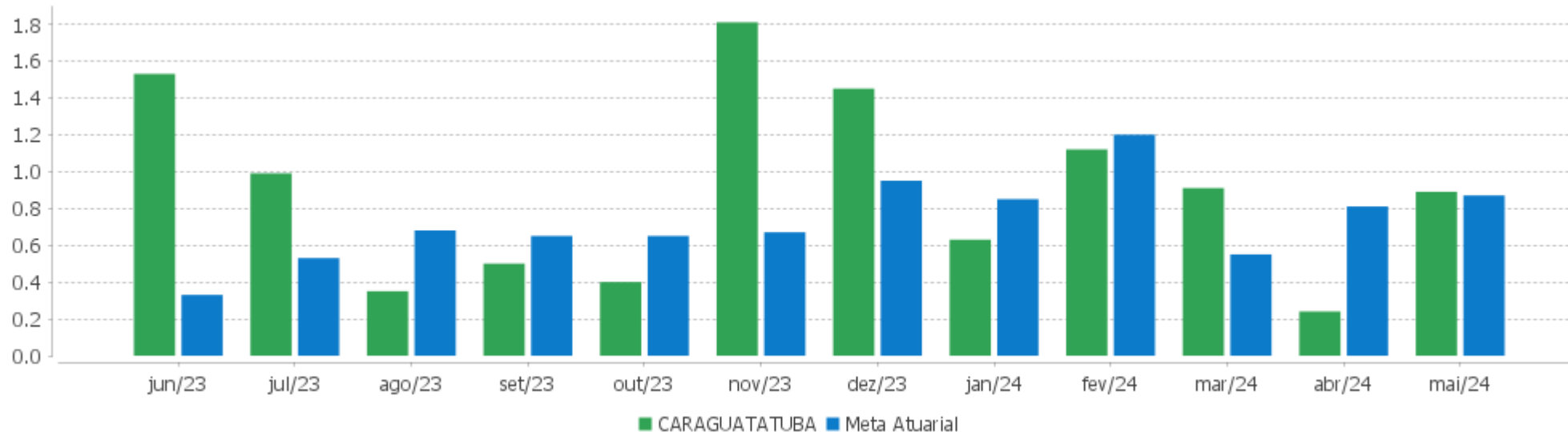


Patrimônio Líquido



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
NTN-B 150850 (5,970000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,82 2,55	2,68 1,67	5,93 3,09	6,92 3,00	11,27 3,26	
NTN-B 150525 (5,940000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,80 2,54	2,67 1,67	5,70 2,86	9,83 5,90	14,23 6,22	
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,40	4,65 2,38	2,58 1,57	5,63 2,79	9,56 5,63	20,34 12,33	38,43 17,75
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,69 2,42	2,60 1,59	5,71 2,87	9,69 5,76	20,59 12,57	38,83 18,14
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,71 2,44	2,61 1,61	5,66 2,82	9,67 5,74	20,63 12,62	34,97 14,29
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,74 2,47	2,63 1,62	5,77 2,93	9,81 5,89	20,86 12,85	35,36 14,67
NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,92 0,46	4,97 2,70	2,77 1,77	5,93 3,09	10,28 6,35	18,49 10,47	
NTN-B 150824 (6,680000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,49	5,11 2,84	2,85 1,84	6,04 3,20	10,57 6,64	19,17 11,16	
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,80 2,53	2,66 1,66	5,91 3,06	10,03 6,11	21,28 13,26	35,87 15,19
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,76 2,49	2,64 1,64	5,76 2,92	9,83 5,90	20,94 12,93	39,38 18,69
NTN-B 150525 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	4,86 2,59	2,70 1,70	5,75 2,90	6,79 2,86		
NTN-B 150832 (6,070000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	1,85 -0,42	2,71 1,71	2,71 -0,13	3,71 -0,21		
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,74 2,47	2,63 1,63	5,81 2,97	9,86 5,93	20,93 12,91	39,35 18,66
NTN-B 150824 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	4,86 2,60	2,70 1,70	5,75 2,91	9,96 6,03	17,90 9,89	
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,79 2,52	2,66 1,65	5,66 2,81	9,76 5,83	20,94 12,92	35,42 14,73
NTN-B 150824 (6,440000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,47	5,01 2,74	2,79 1,79	5,93 3,08	10,32 6,40	18,65 10,64	
NTN-B 150555 (5,850000%)	0,88	4,77	2,65	5,89	9,98	21,14	39,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,42	2,50	1,64	3,05	6,05	13,12	18,93
NTN-B 150824 (5,910000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,79 2,52	2,66 1,66	5,67 2,82	9,78 5,85	17,51 9,50	
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,79 2,53	2,66 1,66	5,90 3,06	10,03 6,10	21,27 13,25	35,90 15,21
NTN-B 150850 (5,713000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,71 2,44	2,61 1,61	5,80 2,96	9,81 5,89	20,80 12,78	35,32 14,63
NTN-B 150527 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	4,87 2,60	2,70 1,70	5,82 2,98	10,03 6,10	21,46 13,45	
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,75 2,48	2,64 1,63	5,85 3,01	9,92 5,99	21,03 13,02	35,61 14,92
NTN-B 150824 (6,990300%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,51	5,23 2,96	2,92 1,92	6,19 3,35	10,89 6,96	16,36 8,34	
NTN-B 150828 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,92 0,46	4,97 2,70	2,77 1,77	5,95 3,11	10,30 6,38	18,49 10,47	
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,73 2,46	2,62 1,62	5,80 2,96	9,84 5,91	20,88 12,86	39,28 18,59
NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,82 2,55	2,68 1,67	5,72 2,88	9,87 5,94	21,17 13,16	35,78 15,09
NTN-B 150824 (6,480000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,47	5,02 2,75	2,80 1,79	5,94 3,10	10,36 6,43	18,74 10,73	33,59 12,90
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,75 2,48	2,64 1,63	5,87 3,03	9,94 6,01	21,05 13,04	39,54 18,85
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,74 2,47	2,63 1,63	5,83 2,99	9,88 5,96	20,95 12,94	35,51 14,82
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,71 2,44	2,61 1,61	5,77 2,93	9,78 5,86	20,76 12,75	39,10 18,41
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,58 -0,02	0,84 -0,10	-0,06 -0,06	2,56 -0,13	9,95 -0,27	26,74 -0,93	25,20 -1,33
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,65 -0,12	3,78 -0,07	2,17 -0,04	4,73 -0,07	11,37 -0,19	26,23 -0,42	34,15 -0,64
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,03	-0,23 -0,10	-0,30 -0,07	2,49 -0,13	6,35 -0,21	17,30 -0,42	22,38 -0,75
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,84 100,59	1,86 42,32	0,93 36,14	3,42 64,18	9,10 75,77	21,84 80,60	29,62 79,77
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,70	2,19	0,96	3,42	9,47	23,13	27,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,24	-0,08	-0,04	0,58	5,54	15,12	6,74
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,72	3,44	1,78	4,42	11,34	25,22	31,28
Var. IPCA p.p.	0,26	1,17	0,78	1,58	7,41	17,21	10,59
BB PREV RF IRF M	0,64	1,69	0,58	3,17	10,09	25,93	27,61
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,12	-0,09	-0,15	-0,41	-0,86	-1,20
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,82	4,38	2,56	5,31	11,94	27,01	37,15
% do CDI	98,86	99,47	99,32	99,54	99,48	99,67	100,06
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,55	1,64	0,49	3,11	10,28		
Var. IDKA 2 p.p.	-0,52	-1,39	-1,28	-1,42	1,05		
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,82	4,34	2,54	5,27	11,85	26,81	36,83
% do CDI	97,92	98,66	98,47	98,77	98,69	98,92	99,17
FIDC ITALIA SENIOR	0,48	3,03	1,57	5,35	280,95	234,06	358,65
% do CDI	57,24	68,83	61,04	100,39	2.340,13	863,64	965,84
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,86	4,63	2,70	5,62	12,92	28,34	39,75
% do CDI	103,32	105,20	104,63	105,37	107,62	104,56	107,06
BB INSTITUCIONAL FI RF	0,85	4,61	2,66	5,66	12,57	27,23	37,87
% do CDI	102,11	104,89	103,39	106,08	104,72	100,46	101,97
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1,30	-1,35	-1,06	1,45	4,73	14,16	19,53
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-1,22	-0,83	-1,17	-1,83	-3,55	-3,60
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,83	4,42	2,59	5,36	12,04	27,13	37,60
% do CDI	100,06	100,41	100,65	100,46	100,32	100,11	101,25
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,83	4,40	2,52	5,38	12,44	27,60	38,37
% do CDI	99,34	100,14	97,98	100,87	103,59	101,85	103,34
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,84	4,51	2,62	5,47	12,52	27,70	38,39
% do CDI	100,93	102,49	101,85	102,62	104,30	102,22	103,39
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,84	4,63	2,67	5,61	12,76	27,98	38,93
% do CDI	100,46	105,23	103,49	105,26	106,30	103,26	104,83
BRADESCO F I A SELECTION	-4,06	-13,22	-11,05	-7,79	-0,11	-2,17	-16,77
Var. IBOVESPA p.p.	-1,02	-4,21	-5,68	-3,68	-12,82	-11,82	-13,50
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	-3,81	-10,05	-7,13	-4,78	9,47	3,71	-9,17
Var. IBOVESPA p.p.	-0,77	-1,05	-1,77	-0,67	-3,23	-5,95	-5,91
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-2,96	-2,57	-3,01	4,60	16,13	11,16	-7,10
Var. IBOVESPA p.p.	0,08	6,44	2,35	8,71	3,42	1,51	-3,83
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-1,49	-5,08	-3,80	0,53	15,29	14,39	7,96
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,50	0,22	-1,07	-0,71	-4,27	-4,15	-13,44
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-4,96	-16,13	-10,48	-11,64	-6,79	-20,05	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,93	-7,12	-5,11	-7,53	-19,50	-29,70	
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-1,60	-7,78	-4,66	-1,92	12,56	7,73	-4,03
Var. IBOVESPA p.p.	1,44	1,23	0,70	2,19	-0,14	-1,92	-0,77
BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-0,24	-12,79	-8,23	-7,77	-7,78	-19,46	-33,65
Var. SMALL CAP p.p.	3,15	1,73	0,73	0,73	-3,39	-8,05	1,56
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6,78	23,76	11,38	26,96	35,62	54,35	31,48
Var. Global BDRX p.p.	-0,54	-1,31	-0,92	-1,66	-2,28	-3,94	-6,18
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,07	12,32	4,50	18,15	33,23	47,36	54,71
Var. S&P 500 p.p.	-1,15	-7,47	-4,42	-4,56	3,36	5,79	28,95
CARAGUATATUBA	0,89	3,85	2,05	5,35	11,36	20,76	19,39
Var. IPCA + 4,99% p.p.	0,02	-0,51	-0,20	-0,00	2,26	1,70	-20,32
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IRF M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	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 INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		1,72
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIDC ITALIA SENIOR	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0	PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	0,18
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
SANTANDER RF ATIVO FIC	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

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	0,78	3,85	2,21	4,80	11,56	26,65	34,79	37,63	46,34
IRF-M 1+	0,60	0,94	-0,00	2,69	10,22	27,67	26,53	26,17	43,40
IRF-M TOTAL	0,66	1,81	0,67	3,32	10,51	26,78	28,81	29,73	44,40
IMA-B 5	1,05	2,92	1,62	4,42	8,94	19,23	30,62	40,27	53,54
IMA-B 5+	1,59	-2,85	-1,91	0,98	4,24	16,02	15,73	28,10	33,44
IMA-B TOTAL	1,33	-0,13	-0,23	2,62	6,56	17,72	23,13	34,41	43,39
IMA-GERAL TOTAL	0,95	2,37	1,25	4,04	10,06	23,87	30,39	35,87	46,18
IDKA 2	1,07	3,03	1,78	4,53	9,23	18,78	29,76	40,74	53,45
IDKA 20	2,01	-7,44	-4,45	-1,34	1,87	15,01	3,51	19,85	17,13
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13	40,12	46,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26	39,70	25,83
IBRX 100	-3,18	-8,57	-5,17	-3,56	13,24	8,19	-5,26	39,86	27,37
IBRX 50	-3,11	-7,63	-4,50	-2,72	14,94	9,84	-3,24	44,50	28,06
SMALL CAP	-3,38	-14,52	-8,96	-8,50	-4,39	-11,41	-35,21	2,20	0,47
Índice Consumo - ICON	-2,26	-14,63	-6,94	-9,52	-7,70	-22,28	-50,93	-37,26	-32,43
Índice Dividendos - IDIV	-0,99	-5,29	-2,73	1,24	19,55	18,54	21,40	67,35	58,14

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	6,22	19,79	8,92	22,70	29,87	41,57	25,76	67,46	155,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,02	2,14	0,66	6,48	12,24	19,92	20,09	27,27	32,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	5,22	16,99	8,53	20,14	25,00	33,38	10,61	48,94	112,32

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,46	2,27	1,00	2,84	3,93	8,02	20,69	30,41	32,86
INPC	0,46	2,42	1,02	2,99	3,34	7,20	19,96	30,63	33,31
IGPM	0,89	0,28	0,73	1,02	-0,34	-4,79	5,42	44,47	53,87
SELIC	0,83	4,40	2,58	5,33	12,00	27,10	37,13	40,12	46,96

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,79	3,94	2,00	4,85	8,05	16,78	35,69	52,47	61,52
IPCA + 5,00%	0,87	4,35	2,24	5,34	9,08	19,02	39,63	58,39	69,40
IPCA + 5,50%	0,91	4,55	2,36	5,59	9,60	20,15	41,63	61,42	73,46
IPCA + 5,89%	0,94	4,71	2,46	5,78	10,00	21,03	43,20	63,81	76,67
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64	64,49	77,59
INPC + 4,00%	0,79	4,09	2,02	4,99	7,44	15,90	34,87	52,72	62,06
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77	64,76	78,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150525 (5,940000%)	20.813.657,94	5,940000	20.789.717,29	6,070000	-23.940,65
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.626.761,41	5,980000	10.617.850,66	6,070000	-8.910,75
NTN-B 150525 (6,080000%)	19.775.584,59	6,080000	19.777.676,59	6,070000	2.092,00
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.258.837,76	6,090000	5.244.066,19	6,200000	-14.771,57
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.354.947,74	5,560000	16.542.991,09	6,180600	-811.956,65
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.308.378,10	5,821000	19.754.028,07	6,180600	-554.350,03
NTN-B 150545 (5,710000%)	33.211.152,55	5,710000	31.499.161,81	6,168300	-1.711.990,74
NTN-B 150545 (5,760000%)	11.042.865,91	5,760000	10.534.921,49	6,168300	-507.944,42
NTN-B 150545 (5,781000%)	11.024.719,88	5,781000	10.543.369,70	6,168300	-481.350,18
NTN-B 150555 (5,815000%)	11.008.340,71	5,815000	10.501.115,05	6,160200	-507.225,66
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.644.242,53	5,850000	10.205.902,98	6,160200	-438.339,55
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.722.925,49	5,892000	5.688.813,33	8,887900	-34.112,16
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.818.700,56	5,910000	10.754.669,16	8,887900	-64.031,40
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.411.807,01	6,090000	5.381.660,67	8,887900	-30.146,34
NTN-B 150824 (6,440000%)	21.175.248,23	6,440000	21.072.402,85	8,887900	-102.845,38
NTN-B 150824 (6,480000%)	22.051.907,98	6,480000	21.946.273,79	8,887900	-105.634,19
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.444.445,24	6,680000	5.420.595,52	8,887900	-23.849,72
NTN-B 150824 (6,990300%)	31.534.678,75	6,990300	31.416.093,10	8,887900	-118.585,65
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.823.071,68	6,350000	15.872.107,29	6,194200	49.035,61
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.822.431,43	6,350000	15.898.026,22	6,216500	75.594,79
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.299.511,89	5,708000	11.067.022,35	6,133600	-232.489,54
NTN-B 150832 (6,070000%)	40.490.935,60	6,070000	40.229.137,32	6,174300	-261.798,28
NTN-B 150840 (5,650000%)	962.629,53	5,650000	917.158,53	6,140000	-45.471,00
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.334.098,66	5,770000	10.928.395,96	6,140000	-405.702,70
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.397.015,66	5,713000	10.745.455,47	6,178200	-651.560,19
NTN-B 150850 (5,780000%)	11.016.311,58	5,780000	10.476.177,95	6,178200	-540.133,63
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.320.621,04	5,815000	10.813.843,42	6,178200	-506.777,62
NTN-B 150850 (5,916000%)	4.064.023,86	5,916000	3.932.306,70	6,178200	-131.717,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.885.067,10	5,920000	10.540.291,65	6,178200	-344.775,45
NTN-B 150850 (5,970000%)	20.853.419,41	5,970000	20.319.767,43	6,178200	-533.651,98

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
96	02/05/2024	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	400,00	0,00	8,84382860	45,2292800000
97	06/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	69.138,66	0,00	13.342,94543200	5,1816640000
98	08/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	244.684,12	0,00	76.981,14573700	3,1784941320
99	10/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	64.000,00	12.332,51148706	5,1895350000
100	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.933.560,72	0,00	949.121,43044900	5,1980290000
101	16/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.630,06343400	3,1858661240
102	17/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	837.446,62	0,00	161.039,71559800	5,2002490000
103	17/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.357.019,15	0,00	837.848,17803900	5,2002490000
104	20/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	398.725,36	0,00	76.644,49557500	5,2022700000
105	20/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	14.653,76623700	3,1883578080
106	20/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	376.773,45277428	3,1883578080
107	22/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	2.753,16287370	3,1907956060
108	24/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	205.000,00	39.342,20597100	5,2106890000
109	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	231.048,64	44.306,02227900	5,2148360000
110	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.286.151,94	821.915,00213500	5,2148360000
111	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	38.202,09	0,00	7.325,65511100	5,2148360000
112	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.681,03	0,00	322,35529500	5,2148360000
113	29/05/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.303,19	0,00	0,51138018	4.503,8702830000
Total			12.148.334,78	4.786.200,58		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 3.812.691,06 Value-At-Risk: 0,51%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,22	0,09		0,03	0,16	0,87	662.306.360,87	88,07
Artigo 8º	11,18	5,98		0,34	-0,32	-2,75	49.597.950,05	6,60
Artigo 9º	9,51	5,64		0,06	0,63	6,78	23.514.565,90	3,13
Artigo 10º	8,53	5,13		0,08	0,50	5,07	16.591.761,23	2,21
CARAGUATATUBA		0,51		0,51			752.010.638,05	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,09%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,940000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,42	0,89	20.813.657,94	2,77
NTN-B 150525 (5,980000%)	0,14	0,11	0,00	0,13	0,43	0,89	10.626.761,41	1,41
NTN-B 150525 (6,080000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,50	0,90	19.775.584,59	2,63
NTN-B 150527 (6,090000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,51	0,90	5.258.837,76	0,70
NTN-B 150535 (5,560000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,20	0,86	17.354.947,74	2,31
NTN-B 150535 (5,821000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,35	0,88	20.308.378,10	2,70
NTN-B 150545 (5,710000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,29	0,87	33.211.152,55	4,42
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,32	0,88	11.042.865,91	1,47
NTN-B 150545 (5,781000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,33	0,88	11.024.719,88	1,47
NTN-B 150555 (5,815000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,35	0,88	11.008.340,71	1,46
NTN-B 150555 (5,850000%)	0,19	0,15	-0,00	0,18	0,26	0,88	10.644.242,53	1,42
NTN-B 150824 (5,892000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,39	0,89	5.722.925,49	0,76
NTN-B 150824 (5,910000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,40	0,89	10.818.700,56	1,44
NTN-B 150824 (6,090000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,50	0,90	5.411.807,01	0,72
NTN-B 150824 (6,440000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,71	0,93	21.175.248,23	2,82
NTN-B 150824 (6,480000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,73	0,93	22.051.907,98	2,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (6,680000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,85	0,95	5.444.445,24	0,72
NTN-B 150824 (6,990300%)	0,14	0,08	0,00	0,12	1,03	0,97	31.534.678,75	4,19
NTN-B 150826 (6,350000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,65	0,92	15.823.071,68	2,10
NTN-B 150828 (6,350000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,62	0,92	15.822.431,43	2,10
NTN-B 150830 (5,708000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,28	0,87	11.299.511,89	1,50
NTN-B 150832 (6,070000%)	0,15	0,22	-0,00	0,25	0,44	0,90	40.490.935,60	5,38
NTN-B 150840 (5,650000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,25	0,87	962.629,53	0,13
NTN-B 150840 (5,770000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,32	0,88	11.334.098,66	1,51
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,29	0,87	11.397.015,66	1,52
NTN-B 150850 (5,780000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,33	0,88	11.016.311,58	1,46
NTN-B 150850 (5,815000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,35	0,88	11.320.621,04	1,51
NTN-B 150850 (5,916000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,41	0,89	4.064.023,86	0,54
NTN-B 150850 (5,920000%)	0,18	0,15	-0,00	0,18	0,31	0,89	10.885.067,10	1,45
NTN-B 150850 (5,970000%)	0,16	0,15	-0,00	0,18	0,37	0,89	20.853.419,41	2,77
Sub-total	0,14	0,09	0,00		0,48	0,90	438.498.339,82	58,31

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	0,74	0,34	0,00	0,35	-0,15	0,72	10.436.626,00	1,39
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2,82	1,22	0,00	0,89	-0,10	0,55	2.589.378,59	0,34
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	0,00	0,00	-1,21	0,82	11.396.477,38	1,52
BB PREV RF IRF M	2,79	1,29	0,01	0,02	-0,07	0,64	10.585.593,31	1,41
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,47	0,18	0,00	0,24	-0,39	0,65	496.455,10	0,07
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	1,18	0,00	0,01	0,17	1,30	213.142,62	0,03
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,01	0,01	0,00	0,00	-0,96	0,82	13.312.140,81	1,77
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,90	1,76	0,01	0,03	-0,06	0,58	5.666.712,83	0,75
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,96	0,63	0,00	0,63	-0,14	0,70	10.886.773,37	1,45
SANTANDER RF ATIVO FIC	1,40	0,62	0,00	0,62	0,00	0,84	56.575,33	0,01
Sub-total	1,17	0,55	0,02		-0,09	0,72	65.639.875,34	8,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2,92	1,34	0,00	0,28	0,16	1,30	193.574,53	0,03
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05	0,02	0,00	0,02	0,15	0,84	58.364.789,89	7,76
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,06	0,04	0,00	0,03	0,49	0,86	30.835.388,88	4,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,04	0,02	0,00	0,01	0,01	0,83	17.811.196,20	2,37
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,05	0,00	0,05	-0,06	0,83	17.899.890,00	2,38
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,03	0,04	0,00	0,03	0,12	0,84	10.699.050,31	1,42
BB INSTITUCIONAL FI RF	0,12	0,05	0,00	0,04	0,15	0,85	20.879.075,36	2,78
Sub-total	0,05	0,02	0,00		0,21	0,84	156.682.965,17	20,84

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR	1,65	0,14	0,00	0,14	-0,22	0,48	1.485.180,54	0,20
Sub-total	1,65	0,14	0,00		-0,22	0,48	1.485.180,54	0,20

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,98%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS	11,15	6,53	0,01	2,04	-0,22	-1,60	1.613.033,26	0,21
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	14,82	8,07	0,04	2,75	-0,07	-0,24	5.020.480,27	0,67
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	11,02	6,27	0,05	1,38	-0,42	-3,81	7.687.978,14	1,02
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,99	5,71	0,09	2,09	-0,21	-1,49	15.833.690,52	2,11
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	8,70	5,03	0,04	3,93	-0,44	-2,96	6.608.575,58	0,88
BRADESCO F I A SELECTION	12,90	6,77	0,04	2,77	-0,38	-4,06	5.179.132,84	0,69
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	14,51	7,72	0,06	3,77	-0,40	-4,96	7.655.059,44	1,02
Sub-total	11,18	5,98	0,34		-0,32	-2,75	49.597.950,05	6,60

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,64%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	9,51	5,64	0,06	0,82	0,63	6,78	23.514.565,90	3,13
Sub-total	9,51	5,64	0,06		0,63	6,78	23.514.565,90	3,13

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,13%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8,53	5,13	0,08	3,87	0,50	5,07	16.591.761,23	2,21
Sub-total	8,53	5,13	0,08		0,50	5,07	16.591.761,23	2,21

(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 (%)