



**LDB**  
EMPRESAS

**CARAGUATATUBA**  
JULHO 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 31.07.2024.

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

86,95%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,22	0,04	0,78	6,49	5.816.288,71	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	0,22	0,04	0,78	6,51	10.995.564,27	1,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	0,22	0,04	0,80	6,61	5.501.814,02	0,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	0,22	0,04	0,83	6,82	21.539.727,94	2,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	0,22	0,04	0,83	6,84	22.432.672,95	2,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,680000%)	0,22	0,04	0,85	6,96	5.540.269,05	0,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,990300%)	0,22	0,04	0,88	7,14	32.105.586,67	4,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,940000%)	0,23	0,04	0,79	6,52	21.154.835,60	2,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,24	0,04	0,79	6,54	10.801.574,90	1,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,080000%)	2,93	0,04	0,80	3,50	20.104.323,89	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	0,25	0,03	0,82	6,76	16.093.123,77	2,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,28	0,04	0,80	6,61	5.346.341,61	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,221000%)	4,16	0,04	0,81	1,60	20.316.294,96	2,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	0,28	0,03	0,82	6,76	16.092.468,67	2,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,32	0,04	0,77	6,39	11.480.443,33	1,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,070000%)	4,14	0,05	0,80	2,94	41.163.174,49	5,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,39	0,04	0,75	6,30	17.628.623,02	2,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,40	0,04	0,78	6,45	20.637.316,71	2,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,46	0,04	0,76	6,35	977.951,31	0,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,46	0,04	0,77	6,42	11.516.740,47	1,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,52	0,04	0,77	6,39	33.743.025,60	4,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,52	0,04	0,77	6,42	11.220.625,49	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,53	0,04	0,77	6,43	11.202.566,53	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,57	0,04	0,77	6,39	11.579.598,55	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,57	0,04	0,77	6,43	11.194.002,73	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,58	0,04	0,78	6,45	11.503.876,31	1,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,58	0,04	0,78	6,51	4.130.482,44	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,55	0,01	0,78	6,51	11.063.183,55	1,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,970000%)	2,97	0,02	0,79	6,54	21.196.321,22	2,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,61	0,04	0,78	6,45	11.186.532,75	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,58	0,01	0,78	6,47	10.817.188,35	1,40
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,36</b>	<b>0,04</b>	<b>0,80</b>	<b>6,59</b>	<b>466.082.539,86</b>	<b>60,22</b>

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	0,60	0,09	1,04	4,91	10.585.105,29	1,37	6.518.185.291,57	0,16
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,57	0,00	-0,04	1,32	0,00	0,00	3.693.985.248,16	0,00
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,06	0,04	0,91	2,62	24.173.502,28	3,12	31.204.215.776,09	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,91	0,00	-0,39	-1,61	0,00	0,00	3.987.797.714,56	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,60	0,00	-0,21	-0,12	0,00	0,00	932.577.821,18	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,33	0,08	0,96	3,35	11.010.465,25	1,42	4.733.163.653,12	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2,93	0,22	1,01	2,09	575.050,47	0,07	240.978.946,09	0,24
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,38	0,05	0,87	5,40	505.021,79	0,07	590.814.067,12	0,09
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,80	0,09	1,04	3,08	57.254,51	0,01	262.922.546,01	0,02
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,06	0,04	0,89	6,10	11.588.304,41	1,50	7.130.754.638,24	0,16
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,29</b>	<b>0,06</b>	<b>0,90</b>	<b>3,86</b>	<b>58.494.704,00</b>	<b>7,56</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,13	0,03	1,00	2,73	21.259.630,49	2,75	2.191.872.467,26	0,97
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,97	6,26	21.073.156,29	2,72	17.211.240.215,08	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,11	0,04	0,96	6,25	26.110.811,44	3,37	5.517.362.915,13	0,47
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,04	0,97	6,39	35.977.049,98	4,65	16.238.092.008,01	0,22
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,04	0,95	6,49	31.581.293,62	4,08	5.989.851.072,56	0,53
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,28	0,00	-0,41	-2,82	0,00	0,00	263.784.752,92	0,00
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,04	0,94	2,71	10.887.386,31	1,41	3.055.735.513,04	0,36
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,19</b>	<b>0,04</b>	<b>0,97</b>	<b>6,16</b>	<b>146.889.328,13</b>	<b>18,98</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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				
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	110,87	-1,05	-1,05	2,63	1.479.324,47	0,19	56.027.774,26	2,64
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>110,87</b>	<b>-1,05</b>	<b>-1,05</b>	<b>2,63</b>	<b>1.479.324,47</b>	<b>0,19</b>		
Renda Fixa			0,37	0,04	0,84	6,05	672.945.896,46	86,95		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

6,70%

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	12,46	0,53	2,21	-4,24	1.674.906,79	0,22	571.267.092,33	0,29
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	14,63	1,34	4,15	-9,73	5.387.341,27	0,70	310.051.057,29	1,74
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,13	0,67	-0,15	-12,95	5.011.168,19	0,65	565.528.256,45	0,89
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	13,58	0,76	3,16	-5,94	8.039.776,27	1,04	771.675.501,65	1,04
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,53	0,43	2,96	-0,53	16.592.100,86	2,14	1.041.382.903,24	1,59
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	12,55	2,15	5,13	4,28	7.072.886,59	0,91	1.123.776.122,25	0,63
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	16,94	1,30	4,50	-11,45	8.081.830,95	1,04	117.854.301,80	6,86
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>13,37</b>	<b>0,97</b>	<b>3,31</b>	<b>-5,04</b>	<b>51.860.010,92</b>	<b>6,70</b>		
Renda Variável			13,37	0,97	3,31	-5,04	51.860.010,92	6,70		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,44%

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	14,92	4,01	0,51	40,23	26.643.206,97	3,44	2.714.087.550,41	0,98
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>14,92</b>	<b>4,01</b>	<b>0,51</b>	<b>40,23</b>	<b>26.643.206,97</b>	<b>3,44</b>		
Investimentos no Exterior			14,92	4,01	0,51	40,23	26.643.206,97	3,44		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,91%

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	11,52	1,48	1,38	18,31	22.533.630,07	2,91	1.927.124.130,10	1,17
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>11,52</b>	<b>1,48</b>	<b>1,38</b>	<b>14,38</b>	<b>22.533.630,07</b>	<b>2,91</b>		
Investimentos Estruturados			6,00	1,48	1,38	14,38	22.533.630,07	2,91		
Total			1,28	0,27	1,00	6,20	773.982.744,42	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	466.082.539,86	60,22	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	58.494.704,00	7,56	0,00	16,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	146.889.328,13	18,98	0,00	19,80	75,00	0,00	75,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.479.324,47	0,19	0,00	0,20	15,00	0,00	15,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>672.945.896,46</b>	<b>86,95</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	51.860.010,92	6,70	0,00	6,00	45,00	0,00	45,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>51.860.010,92</b>	<b>6,70</b>					45,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	26.643.206,97	3,44	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>26.643.206,97</b>	<b>3,44</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	22.533.630,07	2,91	0,00	8,00	15,00	0,00	15,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>22.533.630,07</b>	<b>2,91</b>					20,00
<b>Total</b>		<b>773.982.744,42</b>	<b>100,00</b>					

**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	0,80 87,82	6,59 106,68	2,57 100,90	5,47 106,09	10,78 93,70	3.683.754,11	26.215.404,93
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,90 98,69	3,86 62,52	1,88 73,71	3,18 61,56	8,59 74,64	513.341,27	3.432.612,40
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,97 106,43	6,16 99,71	2,64 103,64	5,21 101,02	11,56 100,45	1.397.436,31	8.158.346,86
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-1,05 -115,86	2,63 42,51	0,08 3,17	1,89 36,60	275,95 2.397,59	-15.713,03	39.735,61
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,31 0,28	-5,04 -0,17	1,69 0,31	-0,83 -0,75	0,35 -4,33	1.660.064,22	-2.751.300,89
Artigo 9º III % do CDI	0,51 56,00	40,23 651,34	20,99 822,91	34,11 661,13	49,78 432,51	134.661,69	6.959.085,59
Artigo 10º I % do CDI	1,38 152,03	14,38 232,82	10,67 418,44	13,00 251,96	20,53 178,34	294.719,15	2.729.442,29
<b>CARAGUATATUBA (Total)</b>						<b>7.668.263,72</b>	<b>44.783.326,79</b>

**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%)	20.989.785,52	0,00	0,00	0,00	21.154.835,60	165.050,08	1.320.756,46
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.716.978,12	0,00	0,00	0,00	10.801.574,90	84.596,78	676.380,07
NTN-B 150525 (6,080000%)	19.945.043,46	0,00	0,00	0,00	20.104.323,89	159.280,43	688.233,85
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.303.937,86	0,00	0,00	0,00	5.346.341,61	42.403,75	338.049,76
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.496.829,52	0,00	0,00	0,00	17.628.623,02	131.793,50	1.064.532,52
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.478.399,67	0,00	0,00	0,00	20.637.316,71	158.917,04	1.275.149,07
NTN-B 150545 (5,710000%)	33.486.420,20	0,00	0,00	0,00	33.743.025,60	256.605,40	2.064.338,74
NTN-B 150545 (5,760000%)	11.134.808,86	0,00	0,00	0,00	11.220.625,49	85.816,63	689.484,60
NTN-B 150545 (5,781000%)	11.116.686,09	0,00	0,00	0,00	11.202.566,53	85.880,44	689.657,29
NTN-B 150555 (5,815000%)	11.100.445,76	0,00	0,00	0,00	11.186.532,75	86.086,99	690.659,15

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.733.599,70	0,00	0,00	0,00	10.817.188,35	83.588,65	670.031,22
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.771.149,87	0,00	0,00	0,00	5.816.288,71	45.138,84	357.056,07
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.910.026,89	0,00	0,00	0,00	10.995.564,27	85.537,38	676.205,10
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.458.199,65	0,00	0,00	0,00	5.501.814,02	43.614,37	343.299,63
NTN-B 150824 (6,440000%)	21.362.452,25	0,00	0,00	0,00	21.539.727,94	177.275,69	1.383.725,99
NTN-B 150824 (6,480000%)	22.247.414,46	0,00	0,00	0,00	22.432.672,95	185.258,49	1.444.897,16
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.493.549,04	0,00	0,00	0,00	5.540.269,05	46.720,01	362.703,93
NTN-B 150824 (6,990300%)	31.826.430,86	0,00	0,00	0,00	32.105.586,67	279.155,81	2.152.984,67
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.961.892,23	0,00	0,00	0,00	16.093.123,77	131.231,54	1.026.473,29
NTN-B 150828 (6,221000%)	20.152.917,66	0,00	0,00	0,00	20.316.294,96	163.377,30	319.673,21
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.961.247,54	0,00	0,00	0,00	16.092.468,67	131.221,13	1.026.462,60
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.393.146,92	0,00	0,00	0,00	11.480.443,33	87.296,41	693.695,55
NTN-B 150832 (6,070000%)	40.837.500,67	0,00	0,00	0,00	41.163.174,49	325.673,82	1.175.943,76
NTN-B 150840 (5,650000%)	970.564,45	0,00	0,00	0,00	977.951,31	7.386,86	58.787,07
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.428.558,62	0,00	0,00	0,00	11.516.740,47	88.181,85	699.564,61
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.491.497,20	0,00	0,00	0,00	11.579.598,55	88.101,35	699.881,31
NTN-B 150850 (5,780000%)	11.108.206,29	0,00	0,00	0,00	11.194.002,73	85.796,44	680.509,16
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.415.347,21	0,00	0,00	0,00	11.503.876,31	88.529,10	701.479,69
NTN-B 150850 (5,916000%)	4.098.342,22	0,00	0,00	0,00	4.130.482,44	32.140,22	254.056,61
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.977.033,89	0,00	0,00	0,00	11.063.183,55	86.149,66	680.823,02
NTN-B 150850 (5,970000%)	21.030.373,07	0,00	0,00	0,00	21.196.321,22	165.948,15	1.309.909,77
	462.398.785,75	0,00	0,00	0,00	466.082.539,86	3.683.754,11	

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	10.476.592,19	0,00	0,00	0,00	10.585.105,29	108.513,10	495.660,24
BB PREV RF IRF M	10.552.165,07	0,00	-10.547.822,39	0,00	0,00	-4.342,68	275.192,22
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	13.416.889,15	10.547.822,39	0,00	0,00	24.173.502,28	208.790,74	432.675,56
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	211.021,65	0,00	-210.197,02	0,00	0,00	-824,63	-6.461,62

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5.624.418,97	0,00	-5.612.788,34	0,00	0,00	-11.630,63	23.217,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	10.905.330,23	0,00	0,00	0,00	11.010.465,25	105.135,02	458.540,65
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.574.973,79	0,00	-2.000.000,00	0,00	575.050,47	76,68	27.330,60
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	500.280,37	400,00	0,00	0,00	505.021,79	4.341,42	25.797,74
SANTANDER RF ATIVO FIC	56.665,35	0,00	0,00	0,00	57.254,51	589,16	8.903,70
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	11.485.611,32	0,00	0,00	0,00	11.588.304,41	102.693,09	995.814,65
	65.803.948,09	10.548.222,39	-18.370.807,75	0,00	58.494.704,00	513.341,27	

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	21.050.044,80	0,00	0,00	0,00	21.259.630,49	209.585,69	565.535,06
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	18.263.377,61	2.619.952,82	0,00	0,00	21.073.156,29	189.825,86	2.131.611,21
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	18.042.170,35	7.822.985,36	0,00	0,00	26.110.811,44	245.655,73	1.143.049,10
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	39.767.688,05	5.627.115,74	-9.773.864,93	0,00	35.977.049,98	356.111,12	2.353.572,70
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	31.092.162,63	193.000,10	0,00	0,00	31.581.293,62	296.130,89	1.715.761,79
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	191.483,46	0,00	-190.696,91	0,00	0,00	-786,55	-38.569,31
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	10.786.472,74	0,00	0,00	0,00	10.887.386,31	100.913,57	287.386,31
	139.193.399,64	16.263.054,02	-9.964.561,84	0,00	146.889.328,13	1.397.436,31	

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	1.495.037,50	0,00	0,00	0,00	1.479.324,47	-15.713,03	39.735,61
	1.495.037,50	0,00	0,00	0,00	1.479.324,47	-15.713,03	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.638.745,60	0,00	0,00	0,00	1.674.906,79	36.161,19	-74.115,63
BRADESCO F I A SELECTION	5.172.490,37	0,00	0,00	0,00	5.387.341,27	214.850,90	-580.692,51
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.018.702,02	0,00	0,00	0,00	5.011.168,19	-7.533,83	-745.741,83

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.793.593,72	0,00	0,00	0,00	8.039.776,27	246.182,55	-507.522,40
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	16.114.962,42	0,00	0,00	0,00	16.592.100,86	477.138,44	-88.284,90
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6.727.507,69	0,00	0,00	0,00	7.072.886,59	345.378,90	290.279,68
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	7.733.944,88	0,00	0,00	0,00	8.081.830,95	347.886,07	-1.045.223,30
	50.199.946,70	0,00	0,00	0,00	51.860.010,92	1.660.064,22	

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	26.508.545,28	0,00	0,00	0,00	26.643.206,97	134.661,69	6.959.085,59
	26.508.545,28	0,00	0,00	0,00	26.643.206,97	134.661,69	

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	17.238.910,92	5.000.000,00	0,00	0,00	22.533.630,07	294.719,15	2.272.476,76
	17.238.910,92	5.000.000,00	0,00	0,00	22.533.630,07	294.719,15	

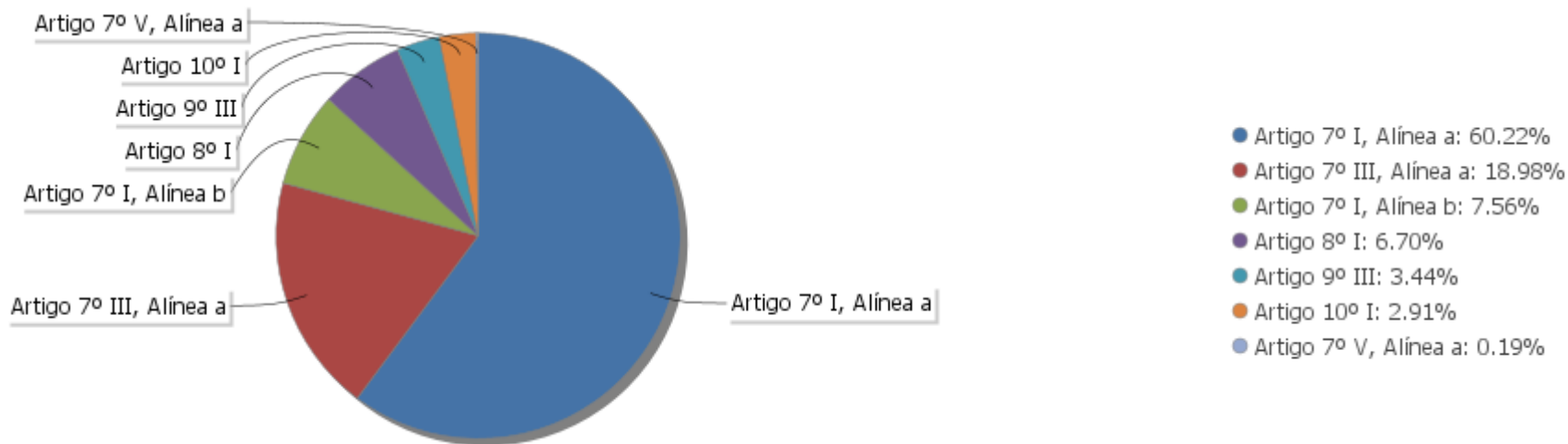
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

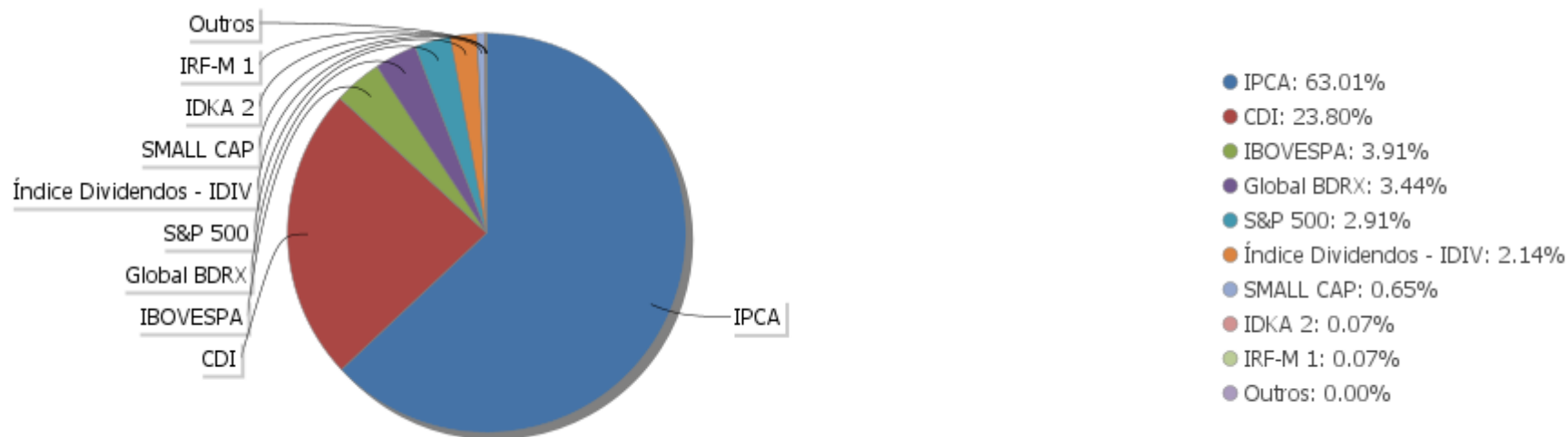
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	372.045.533,50	48,07		372.045.533,50	48,07	
de 31 dias a 365 dias	91.847.329,06	11,87		463.892.862,56	59,94	
acima de 365 dias	310.089.881,86	40,06		773.982.744,42	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



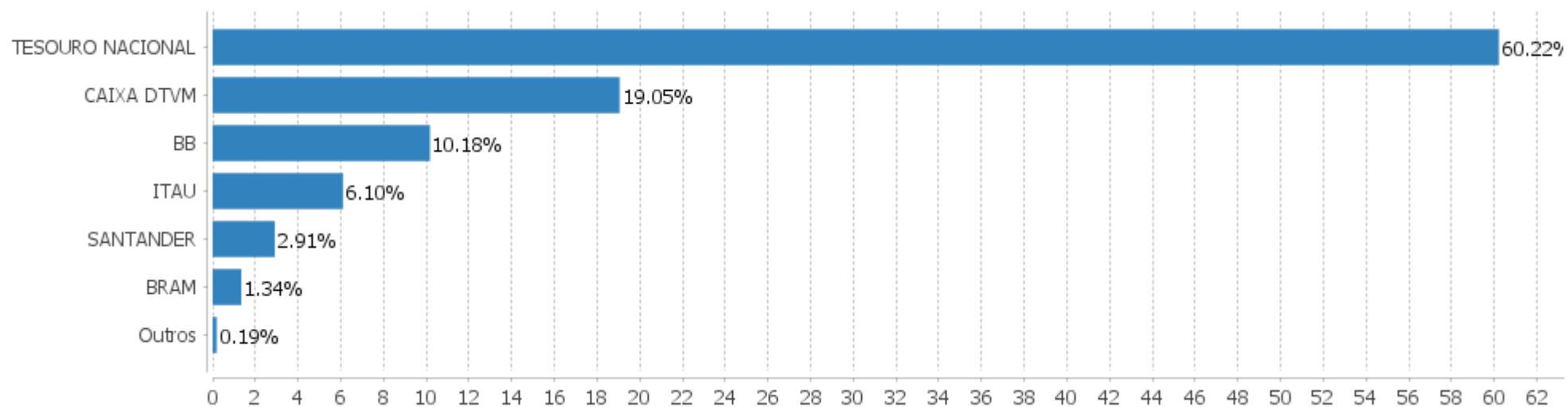
Alocação Por Estratégia





## 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	1,26	1,00						6,20
IPCA + 5,02%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83						5,86
p.p. indexador	-0,22	-0,08	0,36	-0,57	0,02	0,65	0,17						0,35
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	32	47,76
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	52,24

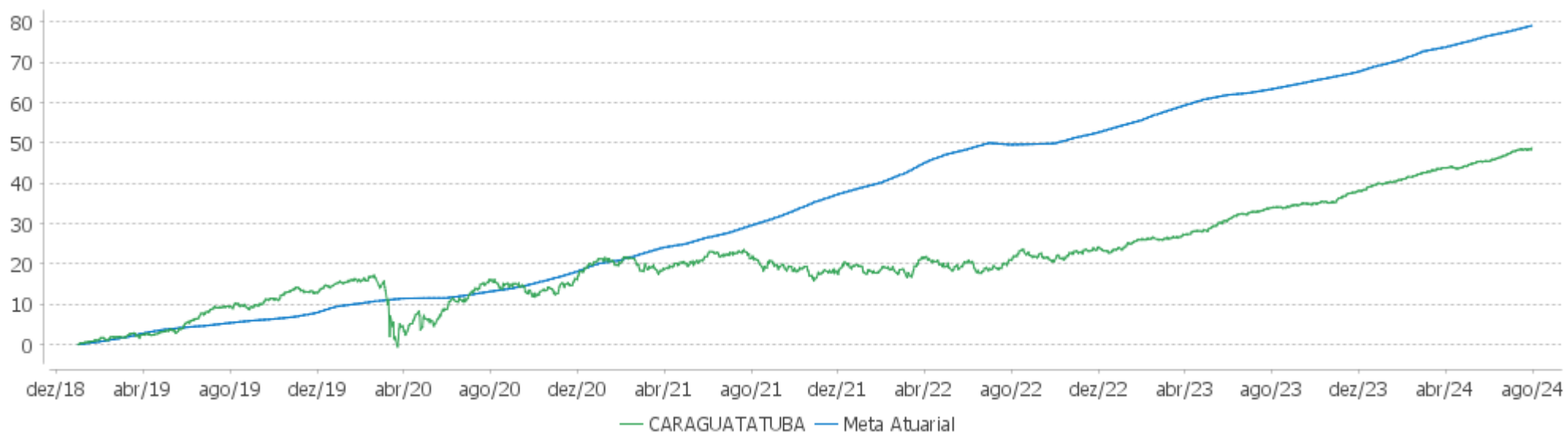
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03

**Relatório**

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,18	2,32	0,86	1,08
06 meses	5,53	4,96	0,57	1,11
12 meses	11,07	9,73	1,35	1,28
24 meses	22,90	19,80	3,09	2,42
36 meses	22,62	38,68	-16,06	4,01
48 meses	28,31	59,61	-31,30	4,56
60 meses	36,10	73,03	-36,92	6,93
Desde 31/12/2018	48,75	83,30	-34,55	6,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Evolução**

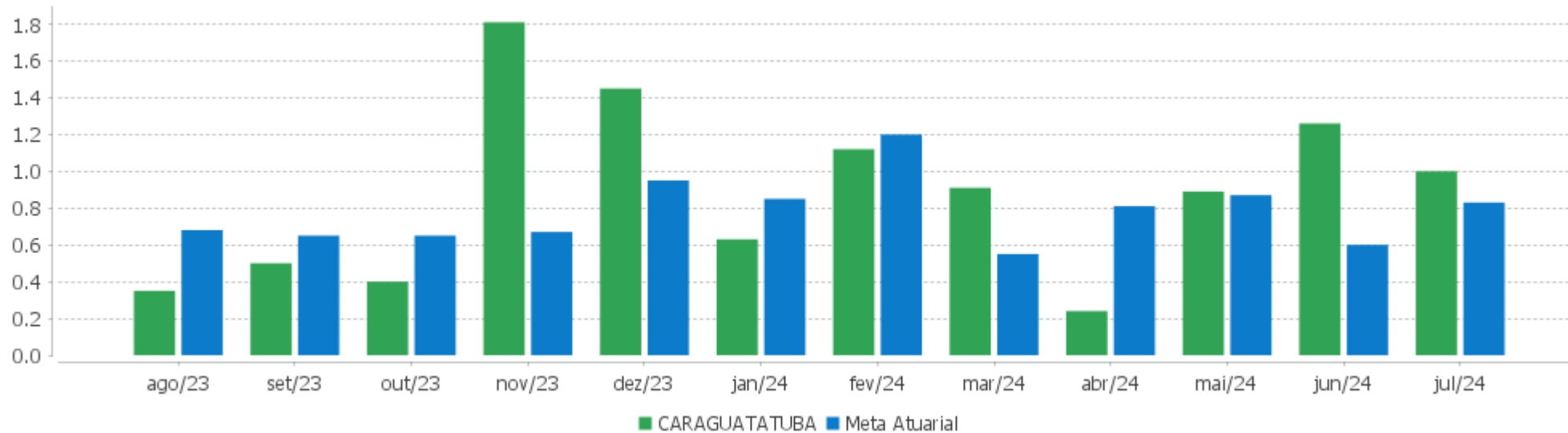


**Patrimônio Líquido**



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.	0,79 0,41	6,54 3,67	2,55 1,50	5,43 2,99	7,64 3,15	11,43 2,76	
NTN-B 150525 (5,940000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,41	6,52 3,65	2,54 1,49	5,42 2,97	10,57 6,07	14,39 5,72	
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	6,30 3,43	2,45 1,40	5,23 2,79	10,29 5,80	20,51 11,84	37,30 17,69
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	6,35 3,48	2,47 1,42	5,27 2,83	10,42 5,93	20,75 12,08	37,69 18,08
NTN-B 150828 (6,221000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,43	3,60 0,73	2,61 1,56	2,50 0,06	4,52 0,02		
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,39 3,51	2,49 1,43	5,30 2,86	10,41 5,91	20,80 12,13	33,87 14,26
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,42 3,55	2,50 1,45	5,33 2,89	10,55 6,05	21,03 12,36	34,25 14,64
NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,44	6,76 3,89	2,65 1,59	5,62 3,18	11,03 6,53	18,65 9,98	
NTN-B 150824 (6,680000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,47	6,96 4,08	2,73 1,67	5,78 3,34	11,32 6,82	19,34 10,67	33,18 13,57
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,45 3,58	2,52 1,46	5,36 2,92	10,57 6,07	21,11 12,44	38,23 18,62
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,51 3,64	2,54 1,49	5,41 2,97	10,77 6,28	21,44 12,77	34,76 15,15
NTN-B 150525 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,42	6,60 3,73	2,58 1,53	5,49 3,04	7,51 3,01		
NTN-B 150832 (6,070000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,42	3,54 0,67	2,58 1,52	2,46 0,01	4,41 -0,08		
NTN-B 150824 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,42	6,61 3,74	2,58 1,53	5,49 3,05	10,70 6,20	18,06 9,39	31,14 11,53
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,43 3,56	2,51 1,45	5,34 2,90	10,60 6,10	21,09 12,42	38,21 18,59
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,49 3,62	2,53 1,48	5,39 2,95	10,50 6,00	21,11 12,44	34,31 14,70
NTN-B 150824 (5,910000%)	0,78	6,51	2,54	5,40	10,52	17,68	30,52

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.	0,40	3,63	1,48	2,96	6,02	9,01	10,91
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,47 3,60	2,52 1,47	5,37 2,93	10,72 6,22	21,30 12,63	38,48 18,86
NTN-B 150824 (6,440000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,45	6,82 3,94	2,67 1,61	5,67 3,22	11,07 6,57	18,82 10,15	
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,51 3,64	2,54 1,49	5,41 2,96	10,77 6,27	21,43 12,76	34,78 15,17
NTN-B 150850 (5,713000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,39 3,52	2,49 1,44	5,31 2,86	10,55 6,05	20,96 12,29	34,21 14,60
NTN-B 150527 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,42	6,61 3,74	2,58 1,53	5,49 3,05	10,77 6,27	21,63 12,96	35,09 15,48
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,45 3,58	2,51 1,46	5,36 2,91	10,66 6,16	21,20 12,53	34,50 14,89
NTN-B 150824 (6,990300%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,50	7,14 4,26	2,80 1,75	5,93 3,49	11,64 7,14	16,52 7,85	
NTN-B 150828 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,44	6,76 3,89	2,65 1,59	5,62 3,18	11,05 6,55	18,65 9,98	
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,42 3,54	2,50 1,45	5,33 2,89	10,58 6,08	21,04 12,37	38,13 18,52
NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,41	6,54 3,67	2,55 1,50	5,44 2,99	10,61 6,11	21,34 12,67	34,66 15,05
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,45 3,58	2,51 1,46	5,36 2,91	10,68 6,18	21,22 12,55	38,40 18,78
NTN-B 150824 (6,480000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,45	6,84 3,96	2,68 1,62	5,68 3,24	11,10 6,61	18,91 10,24	32,49 12,88
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,43 3,56	2,51 1,45	5,34 2,90	10,62 6,13	21,12 12,45	34,40 14,79
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,39 3,51	2,49 1,43	5,30 2,86	10,52 6,02	20,93 12,26	37,96 18,35
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	1,54 -0,02	1,62 -0,15	1,37 -0,07	1,03 -0,14	7,10 -0,28	26,22 -0,87	27,07 -1,31
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,87 -0,07	5,40 -0,09	2,23 -0,14	4,54 -0,08	10,64 -0,16	25,77 -0,37	35,64 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,07 -0,02	0,82 -0,15	2,37 -0,08	1,30 -0,13	4,17 -0,21	20,10 -0,41	23,67 -0,76
SANTANDER RF ATIVO FIC	1,04	3,08	2,05	2,75	7,62	21,66	30,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	114,62	49,94	80,34	53,40	66,24	81,26	78,91
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,96 0,58	3,35 0,47	1,85 0,79	2,67 0,23	7,47 2,97	23,28 14,61	29,89 10,28
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,04 0,66	4,91 2,04	2,15 1,10	4,03 1,59	10,06 5,56	25,62 16,95	33,23 13,62
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,32 -0,02	2,70 -0,17	1,64 -0,06	2,03 -0,16	8,07 -0,30	25,34 -0,85	29,31 -1,19
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,91 100,00	6,15 99,59	2,54 99,56	5,14 99,61	11,45 99,49	26,56 99,63	38,53 99,95
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO Var. IDKA 2 p.p.	1,01 0,26	2,09 -1,89	1,00 -1,01	1,35 -1,80	7,38 -0,74		
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,89 98,57	6,10 98,70	2,51 98,54	5,09 98,65	11,35 98,62	26,35 98,87	38,17 99,02
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-1,05 -115,86	2,62 42,44	0,08 3,17	1,89 36,60	275,95 2.397,59	231,69 869,16	355,06 921,01
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,95 104,41	6,49 105,08	2,66 104,17	5,43 105,20	12,31 106,98	27,86 104,52	41,06 106,50
BB INSTITUCIONAL FI RF % do CDI	1,00 109,76	6,52 105,58	2,69 105,45	5,43 105,34	12,15 105,56	26,91 100,95	39,35 102,07
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,10	-0,47 -1,45	2,20 -0,25	0,08 -1,34	2,23 -2,15	17,23 -3,28	20,33 -4,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,97 107,18	6,26 101,42	2,62 102,65	5,25 101,68	11,61 100,84	26,75 100,36	39,03 101,23
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,97 107,18	6,39 103,43	2,65 104,11	5,33 103,33	12,00 104,30	27,35 102,61	39,82 103,29
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,96 105,97	6,25 101,13	2,61 102,20	5,19 100,54	11,83 102,77	27,22 102,10	39,75 103,10
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,94 103,14	6,47 104,77	2,61 102,43	5,37 104,16	12,17 105,75	27,54 103,30	40,37 104,71
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	4,15 1,13	-9,73 -4,86	-0,20 -1,57	-5,69 -5,61	-6,28 -10,96	7,78 -15,95	-10,85 -15,66
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	3,16 0,14	-5,94 -1,07	0,59 -0,78	-1,88 -1,80	2,09 -2,59	15,93 -7,80	-0,30 -5,11
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	5,13 2,11	4,28 9,15	3,86 2,49	6,72 6,80	15,06 10,38	26,25 2,52	2,80 -2,00
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	2,96	-0,53	3,23	2,62	8,79	27,50	18,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,07	1,05	0,33	0,62	-2,27	-4,36	-12,29
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	4,50 1,48	-11,45 -6,58	0,33 -1,04	-5,56 -5,48	-12,66 -17,34	-11,16 -34,90	
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	2,21 -0,82	-4,24 0,63	2,18 0,81	-0,07 0,01	5,44 0,75	20,60 -3,13	6,24 1,44
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-0,15 -1,64	-12,95 0,63	-0,42 1,90	-6,52 1,01	-15,99 -2,64	-10,35 -12,14	-32,03 -0,67
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,51 0,22	40,23 -1,25	20,99 -0,40	34,11 -0,91	49,78 -2,21	60,78 -4,23	43,02 -4,42
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	1,38 -1,63	18,31 -17,10	10,67 -9,39	16,35 -13,92	26,54 -17,16	52,86 6,95	54,59 15,69
CARAGUATATUBA Var. IPCA + 4,99% p.p.	1,00 0,17	6,20 0,35	3,18 0,86	5,53 0,57	11,07 1,35	22,90 3,09	22,62 -15,84
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36



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	0,94	5,49	2,37	4,62	10,81	26,14	36,37	39,08	46,74
IRF-M 1+	1,55	1,77	1,44	1,17	7,38	27,10	28,37	24,09	39,00
IRF-M TOTAL	1,34	2,87	1,71	2,19	8,37	26,19	30,49	28,67	41,29
IMA-B 5	0,91	4,27	2,37	3,56	8,16	20,37	32,46	39,16	51,45
IMA-B 5+	3,24	-1,97	2,52	-0,51	1,03	20,60	16,72	17,12	26,27
IMA-B TOTAL	2,09	0,97	2,45	1,43	4,38	20,51	24,43	27,57	37,98
IMA-GERAL TOTAL	1,36	3,81	2,36	3,33	8,64	24,49	31,89	34,10	43,92
IDKA 2	0,75	3,98	2,01	3,15	8,12	19,52	31,61	39,35	51,45
IDKA 20	6,19	-6,65	2,88	-3,43	-3,72	23,96	4,78	3,52	8,64
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80	24,04	25,38
IBRX 100	2,90	-4,51	1,13	0,00	5,15	22,39	2,42	23,65	26,33
IBRX 50	3,15	-3,17	1,57	1,02	6,82	24,69	4,81	28,10	28,40
SMALL CAP	1,49	-13,59	-2,33	-7,53	-13,35	1,79	-31,36	-17,55	-11,07
Índice Consumo - ICON	2,01	-12,31	0,40	-4,34	-15,32	-14,69	-47,16	-45,60	-38,99
Índice Dividendos - IDIV	1,89	-1,58	2,90	2,00	11,06	31,85	31,21	49,86	55,10

**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	3,01	35,40	20,06	30,27	43,70	45,91	38,90	83,71	178,66

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,52	1,61	-0,50	0,94	5,24	19,57	19,14	23,11	26,52

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,40	30,98	17,81	27,34	37,49	39,32	24,28	60,53	133,51

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,38	2,87	1,05	2,44	4,50	8,67	19,61	30,37	33,38
INPC	0,26	2,95	0,97	2,36	4,06	7,73	18,64	30,33	33,84
IGPM	0,61	1,71	2,33	1,64	3,82	-4,19	5,46	41,14	54,22
SELIC	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,74	5,25	2,07	4,46	8,66	17,50	34,49	52,40	62,17
IPCA + 5,00%	0,83	5,84	2,31	4,95	9,70	19,76	38,39	58,31	70,09
IPCA + 5,50%	0,87	6,14	2,44	5,20	10,22	20,90	40,36	61,34	74,17
IPCA + 5,89%	0,91	6,37	2,53	5,39	10,63	21,79	41,92	63,72	77,40
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36	64,40	78,32
INPC + 4,00%	0,62	5,33	1,98	4,37	8,21	16,49	33,39	52,35	62,74
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20	64,35	78,94

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%)	21.154.835,60	5,940000	21.094.661,54	6,333700	-60.174,06
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.801.574,90	5,980000	10.773.593,64	6,333700	-27.981,26
NTN-B 150525 (6,080000%)	20.104.323,89	6,080000	20.067.776,20	6,333700	-36.547,69
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.346.341,61	6,090000	5.292.301,41	6,511500	-54.040,20
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.628.623,02	5,560000	16.792.563,26	6,202900	-836.059,76
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.637.316,71	5,821000	20.052.042,85	6,202900	-585.273,86
NTN-B 150545 (5,710000%)	33.743.025,60	5,710000	31.633.058,80	6,278700	-2.109.966,80
NTN-B 150545 (5,760000%)	11.220.625,49	5,760000	10.579.703,45	6,278700	-640.922,04
NTN-B 150545 (5,781000%)	11.202.566,53	5,781000	10.588.187,58	6,278700	-614.378,95
NTN-B 150555 (5,815000%)	11.186.532,75	5,815000	10.561.341,10	6,242300	-625.191,65
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.817.188,35	5,850000	10.264.435,93	6,242300	-552.752,42
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.816.288,71	5,892000	5.813.100,21	7,231400	-3.188,50
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.995.564,27	5,910000	10.989.632,79	7,231400	-5.931,48
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.501.814,02	6,090000	5.499.237,00	7,231400	-2.577,02
NTN-B 150824 (6,440000%)	21.539.727,94	6,440000	21.532.784,11	7,231400	-6.943,83
NTN-B 150824 (6,480000%)	22.432.672,95	6,480000	22.425.747,03	7,231400	-6.925,92
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.540.269,05	6,680000	5.539.022,48	7,231400	-1.246,57
NTN-B 150824 (6,990300%)	32.105.586,67	6,990300	32.102.459,09	7,231400	-3.127,58
NTN-B 150826 (6,350000%)	16.093.123,77	6,350000	16.019.570,15	6,609700	-73.553,62
NTN-B 150828 (6,221000%)	20.316.294,96	6,221000	20.142.239,59	6,479500	-174.055,37
NTN-B 150828 (6,350000%)	16.092.468,67	6,350000	16.024.909,63	6,479500	-67.559,04
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.480.443,33	5,708000	11.185.243,76	6,260000	-295.199,57
NTN-B 150832 (6,070000%)	41.163.174,49	6,070000	40.719.029,55	6,250700	-444.144,94
NTN-B 150840 (5,650000%)	977.951,31	5,650000	931.614,41	6,149800	-46.336,90
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.516.740,47	5,770000	11.100.644,99	6,149800	-416.095,48
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.579.598,55	5,713000	10.790.140,75	6,280200	-789.457,80
NTN-B 150850 (5,780000%)	11.194.002,73	5,780000	10.519.743,43	6,280200	-674.259,30
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.503.876,31	5,815000	10.858.813,08	6,280200	-645.063,23

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (5,916000%)	4.130.482,44	5,916000	3.948.659,30	6,280200	-181.823,14
NTN-B 150850 (5,920000%)	11.063.183,55	5,920000	10.584.123,74	6,280200	-479.059,81
NTN-B 150850 (5,970000%)	21.196.321,22	5,970000	20.404.267,75	6,280200	-792.053,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
134	01/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.612.788,34	1.813.319,09161800	3,0953120000
135	01/07/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	5.251.896,55	0,00	2.570.121,38337100	2,0434430000
136	01/07/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	2.000.000,00	0,00	978.740,29273100	2,0434430000
137	01/07/2024	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.000.000,00	0,00	2.059.876,48980500	2,4273300000
138	01/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,00	2.000.000,00	1.680.663,79752700	1,1900060000
139	01/07/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	210.197,02	47.735,28357700	4,4033890000
140	01/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	5.000.000,00	949.889,52785100	5,2637700000
141	01/07/2024	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	400,00	0,00	8,72339000	45,8537590000
142	01/07/2024	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	0,00	190.696,91	14.161,78495000	13,4655990000
143	02/07/2024	BB PREV RF IRF M	0,00	10.547.822,39	1.374.973,04644200	7,6712939300
144	02/07/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	10.220.192,21	0,00	2.877.161,63577300	3,5521786760
145	02/07/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	571.088,81	0,00	279.354,19538400	2,0443180000
146	02/07/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	190.696,91	0,00	41,94205000	4.546,6759493158
147	04/07/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	327.630,18	0,00	92.160,91429300	3,5549797060
148	04/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.277,91	621,90673500	5,2707420000
149	04/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	24.000,00	4.553,43856200	5,2707420000
150	05/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	141.656,11	0,00	43.851,31352000	3,2303732460
151	05/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	69.278,64	0,00	13.138,25075300	5,2730490000
152	10/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	64.000,00	12.122,68150800	5,2793600000
153	11/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.530,89	0,00	289,85306900	5,2816070000
154	12/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	371.128,81057800	3,2368507800
155	15/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.587,24078400	3,2385969060
156	15/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.834,29	0,00	3.654,14108100	3,2385969060
157	19/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	2.708,09735300	3,2438937210
158	19/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	14.402,89171500	3,2438937210
159	19/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	370.323,03870500	3,2438937210
160	19/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.680.596,80	0,00	883.943,86614500	5,2951290000
161	19/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	837.446,62	0,00	158.154,14884100	5,2951290000

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
162	25/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	69.000,00	13.009,35142300	5,3038770000
163	29/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	248.153,19	46.748,64030600	5,3082440000
164	30/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.356.719,43	820.413,43980000	5,3103950000
165	30/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	38.262,79	0,00	7.205,26250800	5,3103950000
166	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	8.714,40	1.640,27301200	5,3127740000
167	31/07/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.303,19	0,00	0,50224000	4.585,8354571520
<b>Total</b>			<b>31.811.276,41</b>	<b>28.335.369,59</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.434.086,26

Value-At-Risk: 0,57%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,22	0,08		0,02	-0,31	0,84	672.945.896,46	86,95
Artigo 8º	10,13	5,93		0,30	0,24	3,31	51.860.010,92	6,70
Artigo 9º	21,18	7,37		0,12	-0,02	0,51	26.643.206,97	3,44
Artigo 10º	13,61	5,68		0,13	0,03	1,38	22.533.630,07	2,91
CARAGUATATUBA		0,57		0,57			773.982.744,42	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,08%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,892000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,55	0,78	5.816.288,71	0,75
NTN-B 150824 (5,910000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,55	0,78	10.995.564,27	1,42
NTN-B 150824 (6,090000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,48	0,80	5.501.814,02	0,71
NTN-B 150824 (6,440000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,34	0,83	21.539.727,94	2,78
NTN-B 150824 (6,480000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,33	0,83	22.432.672,95	2,90
NTN-B 150824 (6,680000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,25	0,85	5.540.269,05	0,72
NTN-B 150824 (6,990300%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,13	0,88	32.105.586,67	4,15
NTN-B 150525 (5,940000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,54	0,79	21.154.835,60	2,73
NTN-B 150525 (5,980000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,52	0,79	10.801.574,90	1,40
NTN-B 150525 (6,080000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,48	0,80	20.104.323,89	2,60
NTN-B 150826 (6,350000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,37	0,82	16.093.123,77	2,08
NTN-B 150527 (6,090000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,48	0,80	5.346.341,61	0,69
NTN-B 150828 (6,221000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,43	0,81	20.316.294,96	2,62
NTN-B 150828 (6,350000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,37	0,82	16.092.468,67	2,08
NTN-B 150830 (5,708000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,62	0,77	11.480.443,33	1,48
NTN-B 150832 (6,070000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,47	0,80	41.163.174,49	5,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,560000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,68	0,75	17.628.623,02	2,28
NTN-B 150535 (5,821000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,58	0,78	20.637.316,71	2,67
NTN-B 150840 (5,650000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,65	0,76	977.951,31	0,13
NTN-B 150840 (5,770000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,60	0,77	11.516.740,47	1,49
NTN-B 150545 (5,710000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,62	0,77	33.743.025,60	4,36
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,60	0,77	11.220.625,49	1,45
NTN-B 150545 (5,781000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,60	0,77	11.202.566,53	1,45
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,62	0,77	11.579.598,55	1,50
NTN-B 150850 (5,780000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,60	0,77	11.194.002,73	1,45
NTN-B 150850 (5,815000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,58	0,78	11.503.876,31	1,49
NTN-B 150850 (5,916000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,54	0,78	4.130.482,44	0,53
NTN-B 150850 (5,920000%)	0,26	0,12	0,00	0,12	-0,48	0,78	11.063.183,55	1,43
NTN-B 150850 (5,970000%)	0,24	0,11	0,00	0,12	-0,49	0,79	21.196.321,22	2,74
NTN-B 150555 (5,815000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,58	0,78	11.186.532,75	1,45
NTN-B 150555 (5,850000%)	0,26	0,12	0,00	0,13	-0,49	0,78	10.817.188,35	1,40
<b>Sub-total</b>	0,23	0,11	0,01		-0,49	0,80	466.082.539,86	60,22

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,92	0,43	0,00	0,43	0,14	1,04	10.585.105,29	1,37
BB PREV RF IRF M	2,96	NaN	0,00	NaN	0,14	1,32	0,00	0,00
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	0,01	0,00	0,01	0,01	0,91	24.173.502,28	3,12
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,46	NaN	0,00	NaN	0,26	2,07	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,19	NaN	0,00	NaN	0,15	1,54	0,00	0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,35	0,73	0,00	0,73	0,04	0,96	11.010.465,25	1,42
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	3,32	1,58	0,00	0,94	0,03	1,01	575.050,47	0,07
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,60	0,27	0,00	0,35	-0,07	0,87	505.021,79	0,07
SANTANDER RF ATIVO FIC	1,39	0,77	0,00	0,77	0,10	1,04	57.254,51	0,01
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	0,00	0,01	-1,76	0,89	11.588.304,41	1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>	0,56	0,22	0,01		-0,02	0,90	58.494.704,00	7,56

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB INSTITUCIONAL FI RF	0,15	0,08	0,00	0,08	0,58	1,00	21.259.630,49	2,75
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,02	-0,00	0,02	0,82	0,97	21.073.156,29	2,72
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,05	0,00	0,05	0,85	0,96	26.110.811,44	3,37
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,02	0,00	0,02	1,10	0,97	35.977.049,98	4,65
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,06	0,03	0,00	0,03	0,68	0,95	31.581.293,62	4,08
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,43	NaN	0,00	NaN	0,24	1,99	0,00	0,00
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,03	0,03	0,00	0,03	0,91	0,94	10.887.386,31	1,41
<b>Sub-total</b>	0,05	0,02	0,00		1,29	0,97	146.889.328,13	18,98

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR	3,50	0,05	-0,00	0,05	-0,56	-1,05	1.479.324,47	0,19
<b>Sub-total</b>	3,50	0,05	-0,00		-0,56	-1,05	1.479.324,47	0,19

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,93%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS	10,37	5,75	0,01	2,13	0,13	2,21	1.674.906,79	0,22
BRADERCO F I A SELECTION	12,11	7,52	0,04	3,16	0,27	4,15	5.387.341,27	0,70
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	14,95	8,16	0,04	3,23	-0,07	-0,15	5.011.168,19	0,65
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	9,92	5,86	0,04	1,31	0,23	3,16	8.039.776,27	1,04
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	9,41	5,54	0,08	1,76	0,22	2,96	16.592.100,86	2,14
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	11,44	5,16	0,04	2,86	0,37	5,13	7.072.886,59	0,91
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	10,55	7,16	0,05	3,23	0,34	4,50	8.081.830,95	1,04
<b>Sub-total</b>	10,13	5,93	0,30		0,24	3,31	51.860.010,92	6,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,37%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,18	7,37	0,12	1,06	-0,02	0,51	26.643.206,97	3,44
<b>Sub-total</b>	21,18	7,37	0,12		-0,02	0,51	26.643.206,97	3,44

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,68%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,61	5,68	0,13	5,37	0,03	1,38	22.533.630,07	2,91
<b>Sub-total</b>	13,61	5,68	0,13		0,03	1,38	22.533.630,07	2,91

(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 (%)