



**LDB**  
EMPRESAS

**CARAGUATATUBA**  
AGOSTO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.08.2024.

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

93,41%

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%)	0,23	0,02	0,71	7,28	21.305.779,30	2,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,24	0,03	0,72	7,31	10.878.959,27	1,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,080000%)	2,94	0,02	0,73	4,25	20.250.145,79	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,28	0,02	0,73	7,39	5.385.159,89	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,52	0,02	0,69	7,13	33.977.343,66	4,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,52	0,02	0,70	7,16	11.299.009,73	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,61	0,02	0,70	7,20	11.265.187,72	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,58	-0,00	0,71	7,22	10.893.581,00	1,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,25	0,00	0,45	6,98	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	0,25	0,00	0,45	6,99	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	0,25	0,00	0,46	7,10	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	0,25	0,00	0,48	7,33	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	0,25	0,00	0,48	7,35	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,680000%)	0,25	0,00	0,49	7,48	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,990300%)	0,26	0,00	0,50	7,67	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	0,25	0,02	0,75	7,56	15.745.098,90	2,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,400000%)	4,16	0,02	0,25	0,25	20.050.472,20	2,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,220000%)	4,16	0,02	0,24	0,24	10.025.005,20	1,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,221000%)	2,95	0,02	0,74	2,35	19.874.593,41	2,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	0,28	0,01	0,75	7,56	15.742.274,52	2,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,32	0,02	0,69	7,13	11.233.377,28	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,070000%)	2,94	0,04	0,72	3,69	40.268.313,36	5,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,39	0,02	0,68	7,02	17.748.842,70	2,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,40	0,02	0,70	7,20	20.782.526,77	2,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,46	0,02	0,69	7,09	957.452,86	0,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,46	0,02	0,70	7,17	11.272.680,23	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,53	0,02	0,70	7,17	11.281.022,13	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,57	0,02	0,69	7,13	11.338.506,30	1,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,58	0,02	0,70	7,17	10.958.912,92	1,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,58	0,02	0,70	7,20	11.261.169,02	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,58	0,02	0,71	7,27	4.042.199,21	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,55	-0,00	0,71	7,27	10.826.528,88	1,39
TESOURO	NTN-B 150850 (5,970000%)	0,56	0,00	0,72	7,30	20.740.046,94	2,66

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,36</b>	<b>0,02</b>	<b>0,72</b>	<b>7,35</b>	<b>389.404.189,19</b>	<b>50,02</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,65	0,02	0,95	5,91	10.685.327,07	1,37	6.458.247.673,10	0,17
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,05	0,04	0,87	3,51	24.383.851,93	3,13	32.995.563.494,35	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,34	-0,00	0,68	4,05	11.084.978,36	1,42	4.604.965.566,98	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	3,08	-0,19	0,74	2,84	579.284,65	0,07	232.822.922,38	0,25
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,40	0,01	0,75	6,19	509.228,19	0,07	593.630.240,92	0,09
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,73	-0,02	0,60	3,70	57.595,21	0,01	250.910.720,22	0,02
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,05	0,04	0,86	7,01	11.688.402,84	1,50	7.436.483.772,61	0,16
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>		<b>1,25</b>	<b>0,03</b>	<b>0,84</b>	<b>4,74</b>	<b>58.988.668,25</b>	<b>7,58</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	0,04	0,93	3,68	21.456.545,65	2,76	2.325.089.571,98	0,92
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,89	7,21	47.852.204,65	6,15	20.250.525.135,03	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,04	0,86	7,16	83.652.919,20	10,74	5.962.159.642,36	1,40
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,04	0,88	7,33	81.542.206,12	10,47	18.688.563.354,91	0,44
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,09	0,04	0,89	7,43	31.863.907,05	4,09	7.241.319.247,76	0,44
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,04	0,91	3,65	10.986.397,91	1,41	3.601.057.030,35	0,31
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>		<b>0,17</b>	<b>0,04</b>	<b>0,89</b>	<b>7,10</b>	<b>277.354.180,58</b>	<b>35,62</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	111,12	3,27	3,27	5,99	1.527.757,68	0,20	56.027.774,26	2,73
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>111,12</b>	<b>3,27</b>	<b>3,27</b>	<b>5,99</b>	<b>1.527.757,68</b>	<b>0,20</b>		
Renda Fixa			0,36	0,04	0,80	6,90	727.274.795,70	93,41		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

6,59%

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	12,45	0,42	6,48	1,97	1.783.523,12	0,23	599.691.925,89	0,30
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	14,58	0,11	4,74	-5,45	5.642.627,56	0,72	322.114.174,01	1,75
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,19	-0,87	3,90	-9,56	5.206.585,34	0,67	558.947.959,76	0,93
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	13,43	-0,10	6,10	-0,20	8.530.391,94	1,10	818.765.874,95	1,04
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,46	0,17	5,73	5,17	17.543.173,07	2,25	1.095.515.178,29	1,60
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	12,80	0,66	7,64	12,25	4.113.467,13	0,53	1.212.463.107,40	0,34
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	16,61	-0,23	4,69	-7,30	8.460.737,24	1,09	123.684.083,36	6,84
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>13,26</b>	<b>0,04</b>	<b>5,63</b>	<b>0,31</b>	<b>51.280.505,40</b>	<b>6,59</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>13,26</b>	<b>0,04</b>	<b>5,63</b>	<b>0,31</b>	<b>51.280.505,40</b>	<b>6,59</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,00%

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	15,12	0,00	-6,44	31,19	0,00	0,00	2.663.493.555,95	0,00
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>15,12</b>	<b>0,00</b>	<b>-6,44</b>	<b>31,19</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
Investimentos no Exterior			14,62	0,00	-6,44	31,19	0,00	0,00		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,00%

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	12,34	0,00	-6,18	11,00	0,00	0,00	1.941.348.598,98	0,00
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>12,34</b>	<b>0,00</b>	<b>-6,18</b>	<b>7,31</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
Investimentos Estruturados			7,21	0,00	-6,18	7,31	0,00	0,00		
<b>Total</b>			<b>1,29</b>	<b>0,04</b>	<b>0,72</b>	<b>6,96</b>	<b>778.555.301,10</b>	<b>100,00</b>		

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	389.404.189,19	50,02	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	58.988.668,25	7,58	0,00	16,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	277.354.180,58	35,62	0,00	19,80	75,00	0,00	75,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.527.757,68	0,20	0,00	0,20	15,00	0,00	15,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>727.274.795,70</b>	<b>93,41</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	51.280.505,40	6,59	0,00	6,00	45,00	0,00	45,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>51.280.505,40</b>	<b>6,59</b>					45,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	0,00	0,00	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	0,00	0,00	0,00	8,00	15,00	0,00	15,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>					20,00
<b>Total</b>		<b>778.555.301,10</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	0,72 82,85	7,35 103,63	2,39 92,43	5,15 98,49	10,74 95,78	3.138.335,13	29.353.740,06
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,84 97,26	4,74 66,75	2,00 77,38	3,42 65,40	8,67 77,32	493.564,25	3.926.176,65
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,89 102,33	7,10 100,05	2,69 103,96	5,31 101,58	11,29 100,76	1.944.868,71	10.103.215,57
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	3,27 377,41	5,99 84,34	2,87 110,91	4,48 85,78	286,96 2.559,94	48.433,21	88.168,82
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,63 -0,91	0,31 -1,05	10,45 -0,94	3,19 -2,22	12,69 -4,82	2.920.494,48	169.193,59
Artigo 9º III % do CDI	-6,44 -742,79	31,19 439,49	6,00 232,28	18,06 345,57	36,17 322,70	-1.716.810,49	5.242.275,10
Artigo 10º I % do CDI	-6,18 -712,11	7,31 103,04	-1,17 -45,41	3,31 63,29	12,07 107,67	-1.392.039,64	1.337.402,65
<b>CARAGUATATUBA (Total)</b>						<b>5.436.845,65</b>	<b>50.220.172,44</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%)	21.154.835,60	0,00	0,00	0,00	21.305.779,30	150.943,70	1.471.700,16
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.801.574,90	0,00	0,00	0,00	10.878.959,27	77.384,37	753.764,44
NTN-B 150525 (6,080000%)	20.104.323,89	0,00	0,00	0,00	20.250.145,79	145.821,90	834.055,75
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.346.341,61	0,00	0,00	0,00	5.385.159,89	38.818,28	376.868,04
NTN-B 150527 (6,220000%)	0,00	10.000.608,34	0,00	0,00	10.025.005,20	24.396,86	24.396,86
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.628.623,02	0,00	0,00	0,00	17.748.842,70	120.219,68	1.184.752,20
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.637.316,71	0,00	0,00	0,00	20.782.526,77	145.210,06	1.420.359,13
NTN-B 150545 (5,710000%)	33.743.025,60	0,00	0,00	0,00	33.977.343,66	234.318,06	2.298.656,80
NTN-B 150545 (5,760000%)	11.220.625,49	0,00	0,00	0,00	11.299.009,73	78.384,24	767.868,84
NTN-B 150545 (5,781000%)	11.202.566,53	0,00	0,00	0,00	11.281.022,13	78.455,60	768.112,89

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,815000%)	11.186.532,75	0,00	0,00	0,00	11.265.187,72	78.654,97	769.314,12
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.817.188,35	0,00	0,00	0,00	10.893.581,00	76.392,65	746.423,87
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.816.288,71	0,00	-5.842.646,92	0,00	0,00	26.358,21	383.414,28
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.995.564,27	0,00	-11.045.490,67	0,00	0,00	49.926,40	726.131,50
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.501.814,02	0,00	-5.527.188,41	0,00	0,00	25.374,39	368.674,02
NTN-B 150824 (6,440000%)	21.539.727,94	0,00	-21.642.230,52	0,00	0,00	102.502,58	1.486.228,57
NTN-B 150824 (6,480000%)	22.432.672,95	0,00	-22.539.732,18	0,00	0,00	107.059,23	1.551.956,39
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.540.269,05	0,00	-5.567.176,11	0,00	0,00	26.907,06	389.610,99
NTN-B 150824 (6,990300%)	32.105.586,67	0,00	-32.265.628,83	0,00	0,00	160.042,16	2.313.026,83
NTN-B 150826 (6,350000%)	16.093.123,77	0,00	0,00	467.067,16	15.745.098,90	119.042,29	1.145.515,58
NTN-B 150826 (6,400000%)	0,00	20.000.338,20	0,00	0,00	20.050.472,20	50.134,00	50.134,00
NTN-B 150828 (6,221000%)	20.316.294,96	0,00	0,00	589.798,28	19.874.593,41	148.096,73	467.769,94
NTN-B 150828 (6,350000%)	16.092.468,67	0,00	0,00	469.236,01	15.742.274,52	119.041,86	1.145.504,46
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.480.443,33	0,00	0,00	325.964,65	11.233.377,28	78.898,60	772.594,15
NTN-B 150832 (6,070000%)	41.163.174,49	0,00	0,00	1.189.802,88	40.268.313,36	294.941,75	1.470.885,51
NTN-B 150840 (5,650000%)	977.951,31	0,00	0,00	27.174,35	957.452,86	6.675,90	65.462,97
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.516.740,47	0,00	0,00	323.795,81	11.272.680,23	79.735,57	779.300,18
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.579.598,55	0,00	0,00	320.733,91	11.338.506,30	79.641,66	779.522,97
NTN-B 150850 (5,780000%)	11.194.002,73	0,00	0,00	312.696,43	10.958.912,92	77.606,62	758.115,78
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.503.876,31	0,00	0,00	322.775,18	11.261.169,02	80.067,89	781.547,58
NTN-B 150850 (5,916000%)	4.130.482,44	0,00	0,00	117.372,79	4.042.199,21	29.089,56	283.146,17
NTN-B 150850 (5,920000%)	11.063.183,55	0,00	0,00	314.610,11	10.826.528,88	77.955,44	758.778,46
NTN-B 150850 (5,970000%)	21.196.321,22	0,00	0,00	606.511,14	20.740.046,94	150.236,86	1.460.146,63
	466.082.539,86	30.000.946,54	-104.430.093,64	5.387.538,70	389.404.189,19	3.138.335,13	

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	10.585.105,29	0,00	0,00	0,00	10.685.327,07	100.221,78	595.882,02
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	24.173.502,28	0,00	0,00	0,00	24.383.851,93	210.349,65	643.025,21

**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	11.010.465,25	0,00	0,00	0,00	11.084.978,36	74.513,11	533.053,76
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	575.050,47	0,00	0,00	0,00	579.284,65	4.234,18	31.564,78
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	505.021,79	400,00	0,00	0,00	509.228,19	3.806,40	29.604,14
SANTANDER RF ATIVO FIC	57.254,51	0,00	0,00	0,00	57.595,21	340,70	9.244,40
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	11.588.304,41	0,00	0,00	0,00	11.688.402,84	100.098,43	1.095.913,08
	58.494.704,00	400,00	0,00	0,00	58.988.668,25	493.564,25	

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	21.259.630,49	0,00	0,00	0,00	21.456.545,65	196.915,16	762.450,22
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	21.073.156,29	26.434.222,60	0,00	0,00	47.852.204,65	344.825,76	2.476.436,97
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	26.110.811,44	87.032.169,81	-30.000.946,56	0,00	83.652.919,20	510.884,51	1.653.933,61
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	35.977.049,98	49.783.206,34	-4.730.971,64	0,00	81.542.206,12	512.921,44	2.866.494,14
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	31.581.293,62	2.303,19	0,00	0,00	31.863.907,05	280.310,24	1.996.072,03
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	10.887.386,31	0,00	0,00	0,00	10.986.397,91	99.011,60	386.397,91
	146.889.328,13	163.251.901,94	-34.731.918,20	0,00	277.354.180,58	1.944.868,71	

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	1.479.324,47	0,00	0,00	0,00	1.527.757,68	48.433,21	88.168,82
	1.479.324,47	0,00	0,00	0,00	1.527.757,68	48.433,21	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.674.906,79	0,00	0,00	0,00	1.783.523,12	108.616,33	34.500,70
BRANCO F I A SELECTION	5.387.341,27	0,00	0,00	0,00	5.642.627,56	255.286,29	-325.406,22
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.011.168,19	0,00	0,00	0,00	5.206.585,34	195.417,15	-550.324,68
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	8.039.776,27	0,00	0,00	0,00	8.530.391,94	490.615,67	-16.906,73
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	16.592.100,86	0,00	0,00	0,00	17.543.173,07	951.072,21	862.787,31

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	7.072.886,59	0,00	-3.500.000,00	0,00	4.113.467,13	540.580,54	830.860,22
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	8.081.830,95	0,00	0,00	0,00	8.460.737,24	378.906,29	-666.317,01
	51.860.010,92	0,00	-3.500.000,00	0,00	51.280.505,40	2.920.494,48	

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	26.643.206,97	0,00	-24.926.396,48	0,00	0,00	-1.716.810,49	5.242.275,10
	26.643.206,97	0,00	-24.926.396,48	0,00	0,00	-1.716.810,49	

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	22.533.630,07	0,00	-21.141.590,43	0,00	0,00	-1.392.039,64	880.437,12
	22.533.630,07	0,00	-21.141.590,43	0,00	0,00	-1.392.039,64	

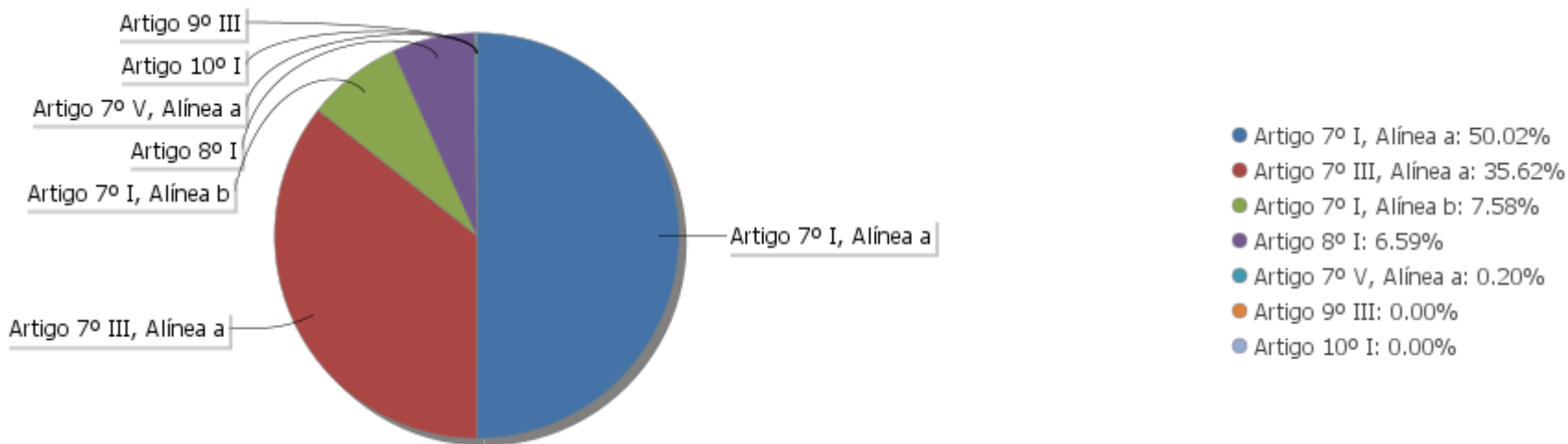
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

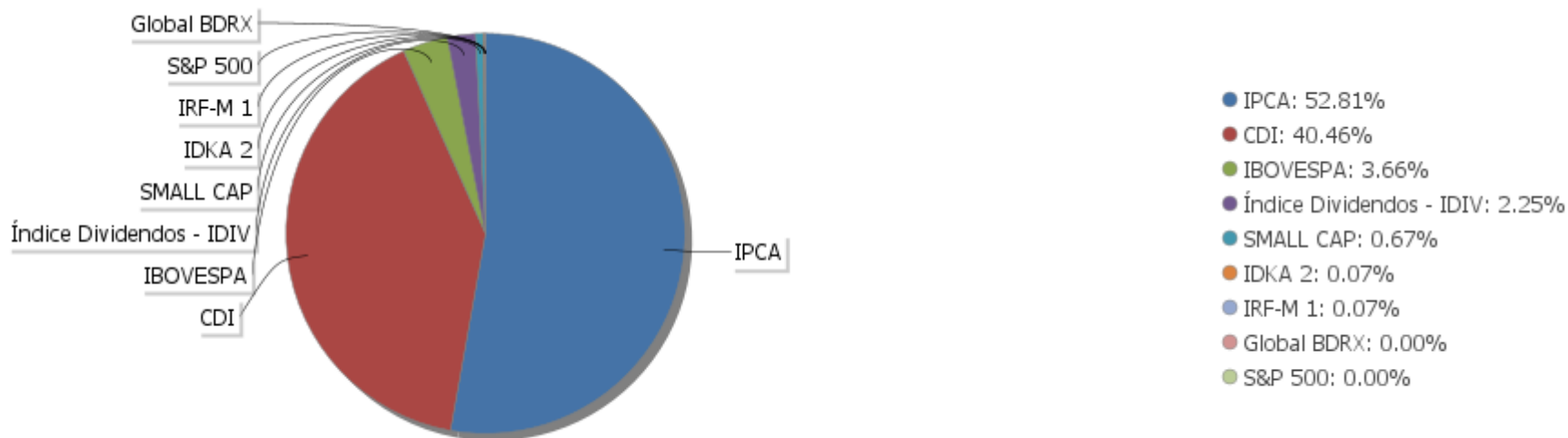
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	350.503.342,53	45,02		350.503.342,53	45,02	
de 31 dias a 365 dias	91.082.653,74	11,70		441.585.996,27	56,72	
acima de 365 dias	336.969.304,83	43,28		778.555.301,10	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



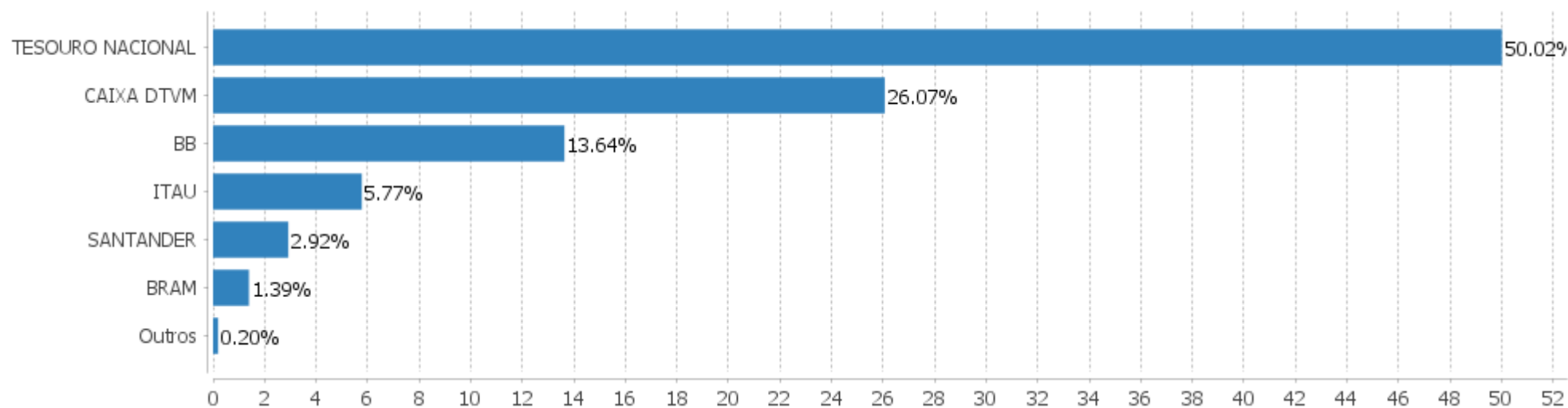
Alocação Por Estratégia





## 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	0,72					6,96
IPCA + 5,02%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41					6,29
p.p. indexador	-0,22	-0,08	0,36	-0,57	0,02	0,65	0,17	0,31					0,68
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	33	48,53
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	51,47

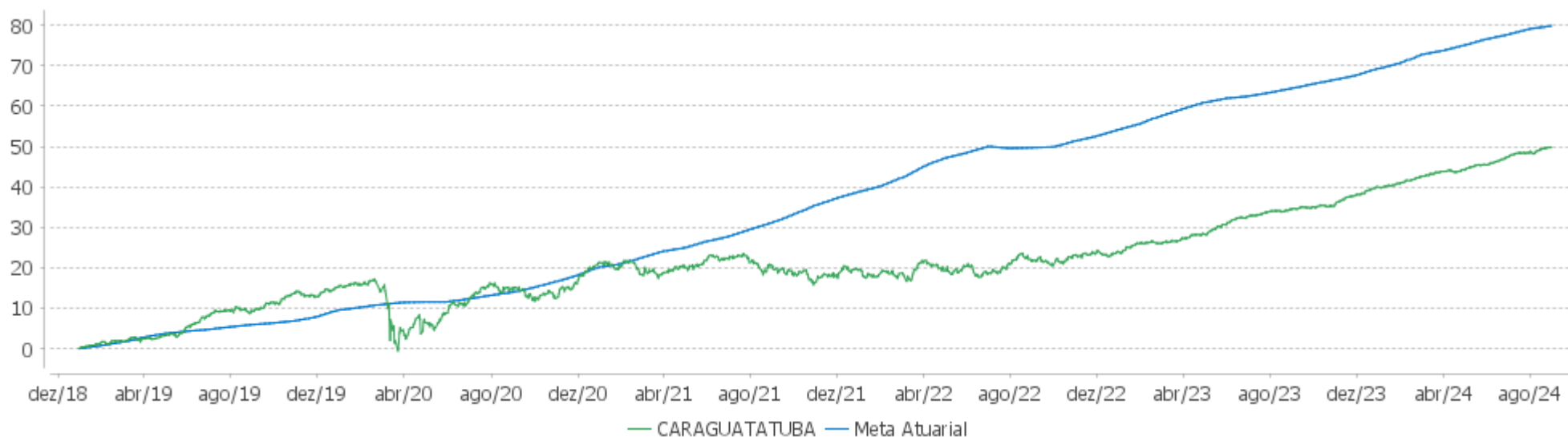
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03

**Relatório**

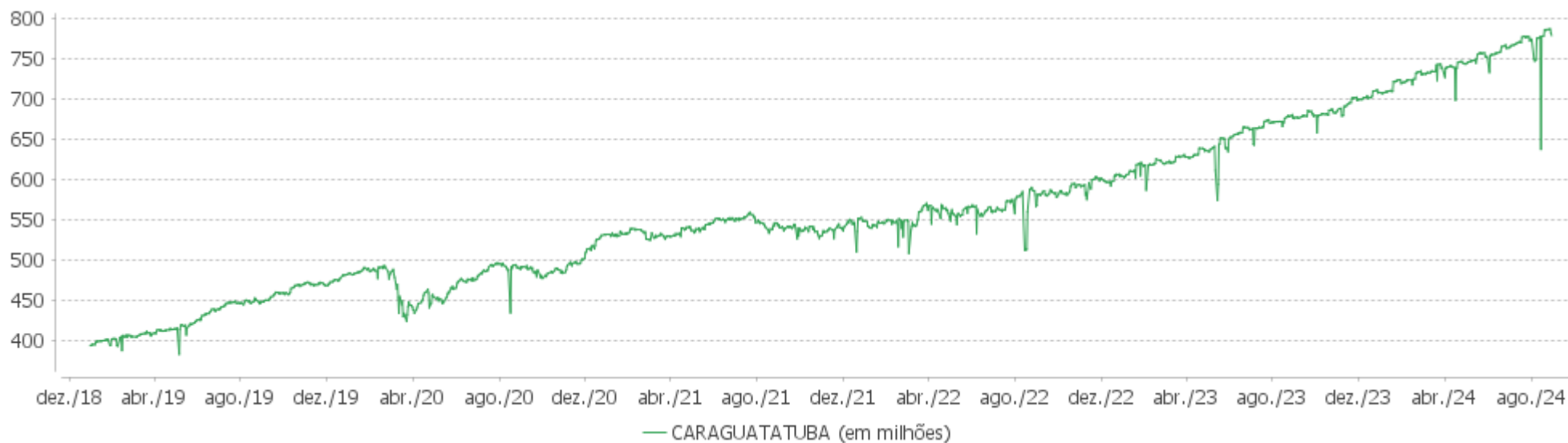
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,00	1,85	1,15	1,21
06 meses	5,11	4,14	0,97	1,17
12 meses	11,48	9,43	2,05	1,29
24 meses	23,15	20,19	2,96	2,23
36 meses	24,73	37,41	-12,68	3,86
48 meses	30,97	59,12	-28,15	4,45
60 meses	36,93	72,66	-35,74	6,90
Desde 31/12/2018	49,81	84,05	-34,24	6,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

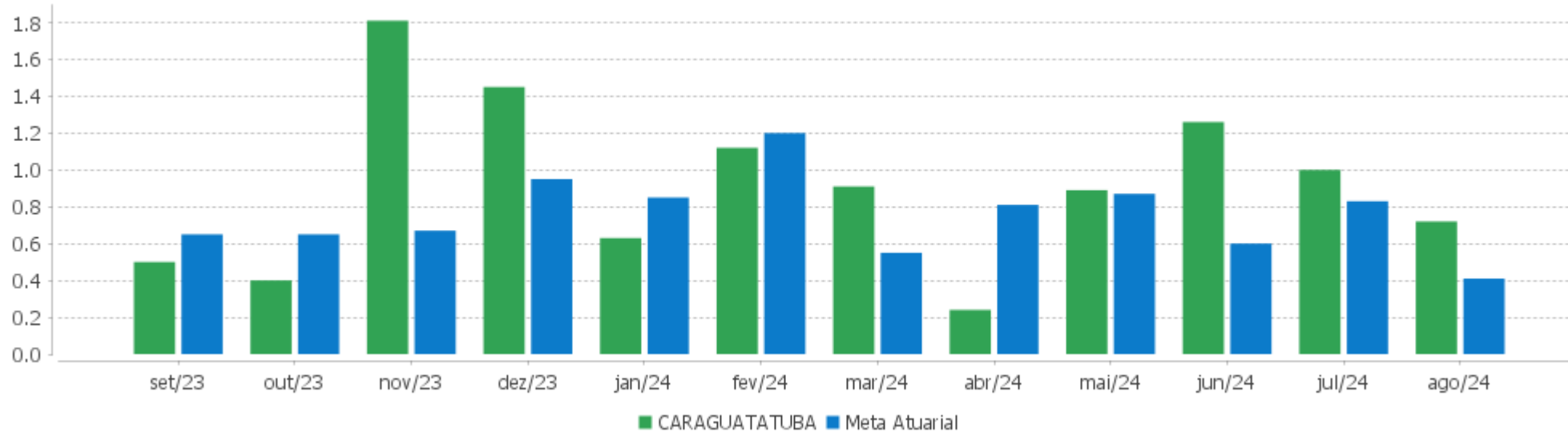


Patrimônio Líquido



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.	0,72 0,74	7,30 4,45	2,37 1,80	5,11 3,53	10,76 6,52	15,54 6,50	
NTN-B 150525 (5,940000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,73	7,28 4,43	2,36 1,79	5,10 3,52	10,53 6,29	15,23 6,19	
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,70	7,02 4,17	2,27 1,70	4,90 3,32	10,25 6,01	21,39 12,35	36,44 17,88
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,71	7,09 4,23	2,29 1,72	4,95 3,37	10,38 6,14	21,64 12,60	40,71 22,15
NTN-B 150828 (6,221000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,76	4,36 1,51	2,43 1,86	5,24 3,66	7,59 3,35		
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,71	7,13 4,27	2,31 1,74	4,98 3,40	10,36 6,13	21,69 12,64	36,88 18,32
NTN-B 150826 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	-2,16 -2,14	1,46 -1,40	-0,49 -1,06	2,28 0,70	4,65 0,41		
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,72	7,17 4,31	2,32 1,75	5,01 3,43	10,51 6,27	21,92 12,88	37,25 18,69
NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,77	7,56 4,71	2,47 1,90	5,30 3,72	10,98 6,74	23,10 14,05	
NTN-B 150824 (6,680000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,51	7,48 4,62	2,25 1,68	5,17 3,59	10,95 6,71	23,45 14,41	35,94 17,38
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,73	7,27 4,42	2,36 1,79	5,09 3,51	10,73 6,49	22,33 13,29	37,82 19,26
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,72	7,20 4,35	2,33 1,76	5,04 3,46	10,53 6,29	22,00 12,96	37,36 18,81
NTN-B 150527 (6,220000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,75	4,37 1,52	2,43 1,86	2,20 0,62	4,49 0,25		
NTN-B 150525 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,75	7,38 4,52	2,40 1,83	5,16 3,59	7,47 3,23		
NTN-B 150832 (6,070000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,74	4,29 1,44	2,40 1,83	5,17 3,59	7,47 3,23		
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,72	7,17 4,32	2,32 1,75	5,02 3,44	10,56 6,32	21,98 12,94	37,34 18,78
NTN-B 150824 (6,090000%)	0,46	7,10	2,13	4,89	10,38	22,13	33,83

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.	0,48	4,25	1,56	3,31	6,14	13,09	15,27
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,47	6,98 4,12	2,09 1,52	4,80 3,22	10,17 5,94	21,69 12,64	37,05 18,49
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,73	7,22 4,37	2,34 1,77	5,05 3,47	10,68 6,44	22,19 13,15	37,61 19,05
NTN-B 150824 (6,440000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,50	7,33 4,47	2,21 1,63	5,06 3,48	10,72 6,48	22,91 13,87	35,08 16,52
NTN-B 150824 (5,910000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,47	6,99 4,14	2,10 1,53	4,81 3,23	10,19 5,96	21,73 12,68	33,19 14,63
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,73	7,27 4,41	2,36 1,79	5,08 3,50	10,73 6,49	22,32 13,28	37,84 19,28
NTN-B 150850 (5,713000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,71	7,13 4,28	2,31 1,74	4,98 3,40	10,51 6,27	21,85 12,81	37,15 18,60
NTN-B 150527 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,75	7,39 4,53	2,40 1,83	5,17 3,59	10,72 6,48	22,52 13,48	34,24 15,69
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,72	7,20 4,35	2,33 1,76	5,03 3,45	10,62 6,38	22,09 13,05	37,50 18,94
NTN-B 150824 (6,990300%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,52	7,67 4,82	2,32 1,75	5,31 3,73	11,26 7,02	20,54 11,50	
NTN-B 150828 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,77	7,56 4,71	2,47 1,90	5,30 3,72	11,00 6,77	23,12 14,07	
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,72	7,16 4,31	2,32 1,75	5,01 3,43	10,53 6,30	21,93 12,89	37,27 18,71
NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,74	7,31 4,45	2,37 1,80	5,11 3,53	10,56 6,33	22,21 13,17	33,82 15,26
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,72	7,20 4,35	2,33 1,76	5,03 3,45	10,64 6,40	22,11 13,07	37,53 18,97
NTN-B 150824 (6,480000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,50	7,35 4,49	2,21 1,64	5,07 3,49	10,75 6,51	22,99 13,95	35,22 16,66
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,72	7,17 4,32	2,32 1,75	5,02 3,44	10,58 6,34	22,01 12,97	37,38 18,82
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,71	7,13 4,27	2,31 1,74	4,98 3,40	10,48 6,24	21,82 12,78	37,10 18,54
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,75 -0,01	6,19 -0,11	2,33 -0,03	4,54 -0,08	10,20 -0,20	25,18 -0,39	36,28 -0,64
SANTANDER RF ATIVO FIC	0,60	3,70	1,80	2,75	8,01	21,19	30,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	68,59	52,10	69,74	52,62	71,50	80,63	78,90
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,68 0,70	4,05 1,19	1,82 1,25	2,80 1,22	7,52 3,28	22,31 13,27	32,69 14,13
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,95 0,97	5,91 3,05	2,38 1,81	4,21 2,63	9,96 5,72	25,37 16,33	35,11 16,55
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,87 100,31	7,07 99,68	2,59 100,05	5,21 99,68	11,15 99,47	26,18 99,62	39,14 99,95
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO Var. IDKA 2 p.p.	0,74 0,14	2,84 -1,76	1,19 -0,34	1,69 -1,65	7,29 -0,65		
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,86 99,57	7,01 98,81	2,56 99,10	5,16 98,77	11,05 98,57	25,97 98,82	38,79 99,04
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	3,27 377,41	5,98 84,28	2,87 110,91	4,48 85,78	286,96 2.559,94	241,13 917,48	370,31 945,56
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,89 102,31	7,43 104,76	2,68 103,82	5,45 104,28	11,85 105,75	27,48 104,56	41,57 106,14
BB INSTITUCIONAL FI RF % do CDI	0,93 106,77	7,51 105,78	2,77 107,00	5,50 105,27	11,85 105,71	26,53 100,95	39,95 102,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,89 102,80	7,21 101,61	2,68 103,55	5,34 102,13	11,32 100,95	26,39 100,41	39,64 101,22
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,88 101,77	7,33 103,24	2,70 104,36	5,39 103,15	11,61 103,59	26,97 102,62	40,36 103,07
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,86 99,69	7,16 100,95	2,64 102,28	5,23 100,14	11,44 102,04	26,79 101,95	40,29 102,87
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,91 104,83	7,44 104,81	2,69 103,90	5,42 103,75	11,71 104,46	27,16 103,34	40,97 104,60
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	4,74 -1,80	-5,45 -6,81	8,95 -2,44	-3,09 -8,50	4,79 -12,72	3,95 -20,23	-4,46 -18,96
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	6,10 -0,44	-0,20 -1,55	10,96 -0,43	3,04 -2,37	14,19 -3,31	16,81 -7,37	8,91 -5,59
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	7,64 1,10	12,25 10,89	15,21 3,82	11,73 6,32	30,30 12,80	27,56 3,38	13,16 -1,34
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	4,69 -1,85	-7,30 -8,66	10,52 -0,86	-1,06 -6,47	0,47 -17,04	-12,95 -37,13	
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,73 -0,95	5,17 0,17	10,80 -0,08	6,59 -1,26	19,13 -2,81	30,18 -4,74	27,42 -13,27
BB AÇÕES DIVIDENDOS	6,48	1,97	10,57	5,42	17,17	21,58	17,74

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.	-0,06	0,62	-0,82	0,00	-0,34	-2,60	3,24
<b>BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS</b>	<b>3,90</b>	<b>-9,56</b>	<b>3,71</b>	<b>-4,83</b>	<b>-2,72</b>	<b>-12,85</b>	<b>-27,38</b>
Var. SMALL CAP p.p.	-0,61	0,13	-1,94	-1,01	-0,54	-8,78	-1,96
<b>FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I</b>	<b>0,57</b>	<b>41,02</b>	<b>13,95</b>	<b>26,91</b>	<b>46,38</b>	<b>68,28</b>	<b>40,40</b>
Var. Global BDRX p.p.	0,02	-1,23	0,21	-0,81	-1,62	-2,86	-4,54
<b>CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP</b>	<b>2,48</b>	<b>21,25</b>	<b>7,95</b>	<b>12,81</b>	<b>30,89</b>	<b>61,90</b>	<b>53,31</b>
Var. S&P 500 p.p.	0,31	-17,11	-7,54	-12,99	-13,11	5,93	15,97
<b>CARAGUATATUBA</b>	<b>0,72</b>	<b>6,96</b>	<b>3,00</b>	<b>5,11</b>	<b>11,48</b>	<b>23,15</b>	<b>24,73</b>
Var. IPCA + 4,99% p.p.	0,31	0,68	1,15	0,97	2,05	2,96	-12,52
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11



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 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 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 PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A	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	100% DA VARIÇÃO 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
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	0,77	6,30	2,36	4,62	10,39	25,57	36,92	39,98	47,06
IRF-M 1+	0,60	2,39	1,43	1,43	7,39	24,61	30,60	26,26	39,69
IRF-M TOTAL	0,66	3,54	1,70	2,39	8,26	24,46	32,14	30,49	41,85
IMA-B 5	0,59	4,88	1,91	3,56	8,14	21,08	33,04	39,39	52,27
IMA-B 5+	0,77	-1,21	1,69	-0,25	3,11	18,58	20,29	22,46	28,23
IMA-B TOTAL	0,52	1,49	1,63	1,40	5,32	19,81	26,45	30,58	39,25
IMA-GERAL TOTAL	0,79	4,63	2,21	3,49	8,81	23,74	33,48	35,98	44,83
IDKA 2	0,60	4,60	1,53	3,33	7,94	20,67	32,05	38,75	52,22
IDKA 20	0,42	-6,26	1,27	-3,24	-0,28	18,04	10,08	10,85	10,58
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50	36,87	34,48
IBRX 100	6,60	1,79	11,34	5,58	18,00	22,90	12,85	36,41	34,88
IBRX 50	6,51	3,14	11,66	6,63	19,46	24,91	15,69	41,27	38,19
SMALL CAP	4,51	-9,69	5,65	-3,81	-2,18	-4,07	-25,42	-12,75	-7,50
Índice Consumo - ICON	6,25	-6,83	9,13	1,55	0,43	-15,02	-41,58	-41,33	-37,96
Índice Dividendos - IDIV	6,69	5,00	10,87	7,85	21,94	34,91	40,69	67,98	61,87

**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	2,18	38,35	15,49	25,80	44,00	55,98	37,34	66,82	163,79

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,86	2,48	0,33	1,00	5,63	14,02	23,41	21,98	27,74

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,29	33,98	14,52	24,30	39,63	48,51	23,68	47,36	123,03

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,02	2,85	0,57	1,58	4,24	9,04	18,56	30,03	33,20
INPC	-0,14	2,80	0,37	1,40	3,71	7,92	17,44	29,68	33,49
IGPM	0,29	2,00	1,72	2,46	4,26	-3,24	5,07	37,76	55,70
SELIC	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,32	5,59	1,59	3,62	8,37	17,88	33,30	52,03	61,96
IPCA + 5,00%	0,41	6,27	1,84	4,13	9,41	20,15	37,17	57,93	69,87
IPCA + 5,50%	0,45	6,61	1,97	4,38	9,92	21,29	39,13	60,95	73,94
IPCA + 5,89%	0,48	6,88	2,07	4,58	10,33	22,18	40,67	63,33	77,17
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11	64,01	78,09
INPC + 4,00%	0,20	5,54	1,39	3,44	7,82	16,67	32,04	51,61	62,31
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78	63,57	78,48

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%)	21.305.779,30	5,940000	21.273.160,99	6,178800	-32.618,31
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.878.959,27	5,980000	10.864.757,97	6,178800	-14.201,30
NTN-B 150525 (6,080000%)	20.250.145,79	6,080000	20.237.586,33	6,178800	-12.559,46
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.385.159,89	6,090000	5.329.030,80	6,540000	-56.129,09
NTN-B 150527 (6,220000%)	10.025.005,20	6,220000	9.950.706,54	6,540000	-74.298,66
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.748.842,70	5,560000	16.870.098,13	6,239600	-878.744,57
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.782.526,77	5,821000	20.144.627,44	6,239600	-637.899,33
NTN-B 150545 (5,710000%)	33.977.343,66	5,710000	31.994.335,91	6,243000	-1.983.007,75
NTN-B 150545 (5,760000%)	11.299.009,73	5,760000	10.700.532,89	6,243000	-598.476,84
NTN-B 150545 (5,781000%)	11.281.022,13	5,781000	10.709.113,91	6,243000	-571.908,22
NTN-B 150555 (5,815000%)	11.265.187,72	5,815000	10.643.126,60	6,239600	-622.061,12
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.893.581,00	5,850000	10.343.922,24	6,239600	-549.658,76
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.745.098,90	6,350000	15.650.378,92	6,697100	-94.719,98
NTN-B 150826 (6,400000%)	20.050.472,20	6,400000	19.946.645,19	6,697100	-103.827,01
NTN-B 150828 (6,221000%)	19.874.593,41	6,221000	19.696.206,63	6,490600	-178.386,78
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.742.274,52	6,350000	15.670.051,48	6,490600	-72.223,04
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.233.377,28	5,708000	10.941.126,96	6,260100	-292.250,32
NTN-B 150832 (6,070000%)	40.268.313,36	6,070000	39.794.228,04	6,264400	-474.085,32
NTN-B 150840 (5,650000%)	957.452,86	5,650000	912.906,15	6,130500	-44.546,71
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.272.680,23	5,770000	10.877.726,77	6,130500	-394.953,46
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.338.506,30	5,713000	10.578.679,74	6,257400	-759.826,56
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.958.912,92	5,780000	10.313.581,56	6,257400	-645.331,36
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.261.169,02	5,815000	10.646.006,26	6,257400	-615.162,76
NTN-B 150850 (5,916000%)	4.042.199,21	5,916000	3.871.275,00	6,257400	-170.924,21
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.826.528,88	5,920000	10.376.700,17	6,257400	-449.828,71
NTN-B 150850 (5,970000%)	20.740.046,94	5,970000	20.004.392,79	6,257400	-735.654,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
168	01/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	109.256,61	0,00	20.557,11974600	5,3147820000
169	02/08/2024	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	400,00	0,00	8,63774996	46,3083560000
170	05/08/2024	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	21.141.590,43	9.178.686,74335257	2,3033350000
171	06/08/2024	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	24.926.396,48	3.107.001,20447793	8,0226542700
172	06/08/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	21.141.590,43	0,00	10.235.515,54989003	2,0655130000
173	06/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.418,66	0,00	266,63769700	5,3205530000
174	07/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	242.652,28	0,00	74.396,03795100	3,2616290690
175	09/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	24.926.396,48	0,00	7.636.067,25742000	3,2642976600
176	09/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	68.428,20	0,00	12.844,63254600	5,3273770000
177	09/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	67.000,00	12.576,54564338	5,3273770000
178	15/08/2024	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,00	5.842.646,92	1.315,00000000	4.443,0775057030
179	15/08/2024	NTN-B 150824 (6,480000%)	0,00	22.539.732,18	5.073,00000000	4.443,0775044350
180	15/08/2024	NTN-B 150824 (5,910000%)	0,00	11.045.490,67	2.486,00000000	4.443,0775020110
181	15/08/2024	NTN-B 150824 (6,090000%)	0,00	5.527.188,41	1.244,00000000	4.443,0775000000
182	15/08/2024	NTN-B 150824 (6,990300%)	0,00	32.265.628,83	7.262,00000000	4.443,0775034430
183	15/08/2024	NTN-B 150824 (6,680000%)	0,00	5.567.176,11	1.253,00000000	4.443,0775019950
184	15/08/2024	NTN-B 150824 (6,440000%)	0,00	21.642.230,52	4.871,00000000	4.443,0775035930
185	15/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.562,78301900	3,2695042600
186	15/08/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	30.000.946,56	14.484.806,91154552	2,0712010000
187	16/08/2024	NTN-B 150826 (6,400000%)	20.000.338,20	0,00	4.666,00000000	4.286,3990998710
188	16/08/2024	NTN-B 150527 (6,220000%)	10.000.608,34	0,00	2.293,00000000	4.361,3643000440
189	16/08/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	65.890.579,38	0,00	31.802.452,65269894	2,0718710000
190	16/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	43.927.052,92	0,00	8.229.174,35592500	5,3379660000
191	19/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	14.278,86742600	3,2720697380
192	20/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	366.980,86176500	3,2734365880
193	20/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	2.683,65669000	3,2734365880
194	20/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.668.499,39	0,00	873.868,54552000	5,3423360000
195	20/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	837.446,62	0,00	156.756,63604835	5,3423360000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
196	22/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	107.000,00	20.012,61730059	5,3466270000
197	27/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	256.849,32	47.980,05399335	5,3532520000
198	28/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	131.980,02	0,00	24.644,46287600	5,3553620000
199	29/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	38.262,79	0,00	7.141,92733600	5,3574880000
200	29/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.300.122,32	802.637,78892500	5,3574880000
201	30/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	861,13	0,00	160,66820400	5,3596790000
202	30/08/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.303,19	0,00	0,49782616	4.626,4945510000
203	30/08/2024	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	0,00	3.500.000,00	128.717,93006564	27,1912390000
<b>Total</b>			<b>193.253.248,48</b>	<b>188.729.998,75</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.264.768,52

Value-At-Risk: 0,42%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,17	0,04		0,02	-0,41	0,80	727.274.795,70	93,41
Artigo 8º	11,92	6,15		0,40	0,40	5,63	51.280.505,40	6,59
Artigo 9º	NaN	NaN		0,00	NaN	NaN	0,00	0,00
Artigo 10º	NaN	NaN		0,00	NaN	NaN	0,00	0,00
CARAGUATATUBA		0,42		0,42			778.555.301,10	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,04%

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 150525 (5,940000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,85	0,71	21.305.779,30	2,74
NTN-B 150525 (5,980000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,84	0,72	10.878.959,27	1,40
NTN-B 150525 (6,080000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,78	0,73	20.250.145,79	2,60
NTN-B 150527 (6,090000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,77	0,73	5.385.159,89	0,69
NTN-B 150545 (5,710000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,95	0,69	33.977.343,66	4,36
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,93	0,70	11.299.009,73	1,45
NTN-B 150555 (5,815000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,91	0,70	11.265.187,72	1,45
NTN-B 150555 (5,850000%)	0,24	0,13	0,00	0,13	-0,66	0,71	10.893.581,00	1,40
NTN-B 150824 (5,892000%)	0,35	NaN	0,00	NaN	-1,18	0,45	0,00	0,00
NTN-B 150824 (5,910000%)	0,35	NaN	0,00	NaN	-1,18	0,45	0,00	0,00
NTN-B 150824 (6,090000%)	0,36	NaN	0,00	NaN	-1,14	0,46	0,00	0,00
NTN-B 150824 (6,440000%)	0,37	NaN	0,00	NaN	-1,07	0,48	0,00	0,00
NTN-B 150824 (6,480000%)	0,37	NaN	0,00	NaN	-1,06	0,48	0,00	0,00
NTN-B 150824 (6,680000%)	0,37	NaN	0,00	NaN	-1,02	0,49	0,00	0,00
NTN-B 150824 (6,990300%)	0,38	NaN	0,00	NaN	-0,96	0,50	0,00	0,00
NTN-B 150826 (6,350000%)	0,19	0,06	0,00	0,08	-0,64	0,75	15.745.098,90	2,02



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 150826 (6,400000%)	9,91	0,16	0,00	0,16	-0,31	-2,16	20.050.472,20	2,58
NTN-B 150527 (6,220000%)	0,18	0,16	-0,00	0,18	-0,73	0,73	10.025.005,20	1,29
NTN-B 150828 (6,221000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,72	0,74	19.874.593,41	2,55
NTN-B 150828 (6,350000%)	0,20	0,06	0,00	0,08	-0,61	0,75	15.742.274,52	2,02
NTN-B 150830 (5,708000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,96	0,69	11.233.377,28	1,44
NTN-B 150832 (6,070000%)	0,18	0,07	0,00	0,08	-0,80	0,72	40.268.313,36	5,17
NTN-B 150535 (5,560000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-1,02	0,68	17.748.842,70	2,28
NTN-B 150535 (5,821000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,90	0,70	20.782.526,77	2,67
NTN-B 150840 (5,650000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,98	0,69	957.452,86	0,12
NTN-B 150840 (5,770000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,93	0,70	11.272.680,23	1,45
NTN-B 150545 (5,781000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,92	0,70	11.281.022,13	1,45
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,95	0,69	11.338.506,30	1,46
NTN-B 150850 (5,780000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,92	0,70	10.958.912,92	1,41
NTN-B 150850 (5,815000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,91	0,70	11.261.169,02	1,45
NTN-B 150850 (5,916000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,86	0,71	4.042.199,21	0,52
NTN-B 150850 (5,920000%)	0,24	0,12	0,00	0,12	-0,65	0,71	10.826.528,88	1,39
NTN-B 150850 (5,970000%)	0,22	0,10	0,00	0,11	-0,69	0,72	20.740.046,94	2,66
<b>Sub-total</b>	0,19	0,06	0,00		-0,80	0,72	389.404.189,19	50,02

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	0,86	0,44	0,00	0,45	0,09	0,95	10.685.327,07	1,37
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,01	0,00	-0,00	0,00	0,19	0,87	24.383.851,93	3,13
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,35	0,64	0,01	0,64	-0,14	0,68	11.084.978,36	1,42
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	4,04	1,69	0,00	1,03	-0,03	0,74	579.284,65	0,07
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,64	0,28	-0,00	0,38	-0,18	0,75	509.228,19	0,07
SANTANDER RF ATIVO FIC	1,76	0,79	0,00	0,79	-0,16	0,60	57.595,21	0,01
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,02	0,01	-0,00	0,00	-0,24	0,86	11.688.402,84	1,50
<b>Sub-total</b>	0,44	0,21	0,01		-0,05	0,84	58.988.668,25	7,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,06	0,03	0,00	0,04	0,97	0,93	21.456.545,65	2,76
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	0,00	0,02	1,07	0,89	47.852.204,65	6,15
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	0,00	0,05	-0,03	0,86	83.652.919,20	10,74
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05	0,02	0,00	0,03	0,33	0,88	81.542.206,12	10,47
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,03	0,03	0,00	0,02	0,65	0,89	31.863.907,05	4,09
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,02	-0,00	0,02	0,51	0,91	10.986.397,91	1,41
<b>Sub-total</b>	0,03	0,02	0,00		0,69	0,89	277.354.180,58	35,62

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	10,90	0,15	-0,00	0,15	0,22	3,27	1.527.757,68	0,20
<b>Sub-total</b>	10,90	0,15	-0,00		0,22	3,27	1.527.757,68	0,20

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,15%

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	12,04	5,99	0,01	2,37	0,47	6,48	1.783.523,12	0,23
BRADESCO F I A SELECTION	13,49	7,72	0,05	3,62	0,29	4,74	5.642.627,56	0,72
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	17,89	8,64	0,05	3,41	0,17	3,90	5.206.585,34	0,67
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	12,66	6,09	0,07	1,55	0,41	6,10	8.530.391,94	1,10
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,21	5,53	0,12	1,88	0,43	5,73	17.543.173,07	2,25
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	13,14	5,74	0,03	3,27	0,52	7,64	4.113.467,13	0,53
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	12,49	7,19	0,07	3,14	0,31	4,69	8.460.737,24	1,09
<b>Sub-total</b>	11,92	6,15	0,40		0,40	5,63	51.280.505,40	6,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: NaN%

Artigo 9º III

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
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	19,49	NaN	0,00	NaN	-0,02	0,57	0,00	0,00
<b>Sub-total</b>	12,49	NaN	0,00		-0,59	-6,44	0,00	0,00

Investimentos Estruturados Value-At-Risk: NaN%

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	19,55	NaN	0,00	NaN	0,08	2,48	0,00	0,00
<b>Sub-total</b>	12,50	NaN	0,00		-0,56	-6,18	0,00	0,00

(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 (%)