



**LDB**  
EMPRESAS

**CARAGUATATUBA**  
SETEMBRO 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 30.09.2024.

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**

**93,63%**

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%)	0,24	0,04	0,68	8,01	21.449.974,15	2,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,24	0,05	0,68	8,04	10.952.887,65	1,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,080000%)	2,93	0,04	0,69	4,97	20.389.459,21	2,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	0,26	0,04	0,71	8,33	15.856.788,67	2,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,400000%)	4,16	0,04	0,71	0,97	20.193.455,57	2,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,703000%)	4,18	0,05	0,27	0,27	20.052.812,49	2,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,28	0,04	0,69	8,12	5.422.246,11	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,220000%)	4,15	0,04	0,70	0,94	10.095.068,36	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,221000%)	2,95	0,05	0,70	3,06	20.013.517,71	2,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	0,28	0,04	0,71	8,33	15.853.938,18	2,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,33	0,04	0,66	7,83	11.307.325,39	1,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,070000%)	2,93	0,06	0,69	4,40	40.544.913,20	5,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,40	0,04	0,65	7,72	17.863.593,34	2,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,41	0,04	0,67	7,92	20.921.210,30	2,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,46	0,04	0,65	7,79	963.711,68	0,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,47	0,04	0,66	7,88	11.347.443,79	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,186000%)	4,19	0,05	0,48	0,48	15.070.385,37	1,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,53	0,04	0,66	7,83	34.201.087,82	4,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,53	0,04	0,66	7,87	11.373.866,67	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,53	0,04	0,66	7,89	11.355.940,65	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,57	0,04	0,66	7,83	11.413.190,51	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,58	0,04	0,66	7,89	11.031.678,37	1,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,58	0,04	0,67	7,91	11.336.268,57	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,58	0,04	0,67	7,99	4.069.477,48	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,56	0,02	0,68	7,99	10.899.641,05	1,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,970000%)	0,56	0,03	0,68	8,03	20.880.903,49	2,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,296000%)	4,26	0,05	0,49	0,49	35.171.295,67	4,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,62	0,04	0,67	7,91	11.340.303,33	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,59	0,02	0,67	7,94	10.966.541,29	1,39
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,36</b>	<b>0,04</b>	<b>0,68</b>	<b>8,08</b>	<b>462.338.926,07</b>	<b>58,62</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	0,65	0,02	0,71	6,65	10.760.851,82	1,36	6.153.638.080,30	0,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		FIC FI								
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,04	0,04	0,83	4,38	24.587.003,24	3,12	32.173.775.540,30	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,34	-0,01	0,52	4,59	11.143.124,69	1,41	4.436.237.468,68	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	3,11	-0,08	0,07	2,92	579.718,28	0,07	217.007.229,33	0,27
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,41	0,03	0,83	7,07	513.856,76	0,07	636.117.305,20	0,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,66	0,01	0,58	4,30	57.927,28	0,01	257.988.671,48	0,02
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,04	0,04	0,83	7,90	11.785.130,08	1,49	7.219.680.253,06	0,16
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,18</b>	<b>0,02</b>	<b>0,74</b>	<b>5,52</b>	<b>59.427.612,15</b>	<b>7,53</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	0,83	4,54	21.634.363,48	2,74	2.346.355.369,66	0,92
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,04	0,84	8,11	49.767.476,98	6,31	20.065.228.623,01	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,04	0,85	8,08	29.131.652,17	3,69	5.910.577.806,47	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,04	0,86	8,24	67.952.004,78	8,62	19.144.855.193,98	0,35
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,08	0,04	0,86	8,36	35.769.932,15	4,53	6.684.632.943,63	0,54
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,04	0,88	4,56	11.082.679,11	1,41	3.331.476.040,52	0,33
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,16</b>	<b>0,04</b>	<b>0,85</b>	<b>8,01</b>	<b>215.338.108,67</b>	<b>27,30</b>		

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	110,39	-5,84	0,45	6,46	1.438.509,39	0,18	56.027.774,26	2,57
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>110,39</b>	<b>-5,84</b>	<b>0,45</b>	<b>6,46</b>	<b>1.438.509,39</b>	<b>0,18</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,35

0,03

0,75

7,70

738.543.156,28

93,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

5,09%

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	12,12	-0,29	-1,91	0,02	1.749.420,56	0,22	584.717.081,00	0,30
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	14,00	-0,67	-2,32	-7,65	5.511.464,47	0,70	315.351.858,83	1,75
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	18,89	-0,65	-5,74	-14,75	4.907.491,36	0,62	522.893.263,26	0,94
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	13,07	-0,68	-3,17	-3,36	8.260.339,23	1,05	752.918.243,94	1,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,20	-0,45	-1,90	3,18	7.433.035,15	0,94	1.065.953.775,09	0,70
ITAU	ITAU	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,92	-0,88	-0,97	11,17	4.073.749,39	0,52	1.283.108.308,81	0,32
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	15,98	-0,56	-3,25	-10,31	8.186.154,37	1,04	119.670.067,67	6,84
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>12,93</b>	<b>-0,61</b>	<b>-2,82</b>	<b>-2,52</b>	<b>40.121.654,53</b>	<b>5,09</b>		
Renda Variável			12,93	-0,61	-2,82	-2,52	40.121.654,53	5,09		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,28%

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	12,47	0,39	0,89	11,98	10.088.852,14	1,28	2.032.300.517,82	0,50
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>12,47</b>	<b>0,39</b>	<b>0,89</b>	<b>8,27</b>	<b>10.088.852,14</b>	<b>1,28</b>		
Investimentos Estruturados			7,24	0,39	0,89	8,27	10.088.852,14	1,28		
Total			1,23	0,00	0,57	7,57	788.753.662,95	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	462.338.926,07	58,62	0,00	58,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	59.427.612,15	7,53	0,00	8,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	215.338.108,67	27,30	0,00	28,20	75,00	0,00	75,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.438.509,39	0,18	0,00	0,20	5,00	0,00	15,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>738.543.156,28</b>	<b>93,63</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	40.121.654,53	5,09	0,00	4,00	30,00	0,00	45,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>40.121.654,53</b>	<b>5,09</b>					45,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.088.852,14	1,28	0,00	1,30	15,00	0,00	15,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>10.088.852,14</b>	<b>1,28</b>					20,00
<b>Total</b>		<b>788.753.662,95</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	0,68 81,57	8,08 101,18	2,21 84,05	4,79 91,68	10,70 96,76	2.935.624,82	32.289.364,88
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,74 89,11	5,52 69,03	2,50 95,11	3,56 68,07	9,03 81,66	438.543,90	4.364.720,55
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,85 101,81	8,01 100,24	2,73 103,62	5,34 102,09	11,24 101,66	2.101.489,77	12.204.705,34
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,45 53,73	6,46 80,85	2,65 100,57	4,64 88,71	247,78 2.241,36	12.810,24	100.979,06
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,82 0,26	-2,52 -0,76	6,05 -0,34	0,52 -2,38	9,70 -3,38	-1.158.850,87	-989.657,28
Artigo 9º III % do CDI	0,00 0,00	31,19 390,34	-5,97 -226,80	14,10 269,62	41,22 372,88	0,00	5.242.275,10
Artigo 10º I % do CDI	0,89 106,51	8,27 103,45	-4,04 -153,47	2,41 46,12	12,11 109,50	88.852,14	1.426.254,79
<b>CARAGUATATUBA (Total)</b>						<b>4.418.470,00</b>	<b>54.638.642,44</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%)	21.305.779,30	0,00	0,00	0,00	21.449.974,15	144.194,85	1.615.895,01
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.878.959,27	0,00	0,00	0,00	10.952.887,65	73.928,38	827.692,82
NTN-B 150525 (6,080000%)	20.250.145,79	0,00	0,00	0,00	20.389.459,21	139.313,42	973.369,17
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.385.159,89	0,00	0,00	0,00	5.422.246,11	37.086,22	413.954,26
NTN-B 150527 (6,220000%)	10.025.005,20	0,00	0,00	0,00	10.095.068,36	70.063,16	94.460,02
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.748.842,70	0,00	0,00	0,00	17.863.593,34	114.750,64	1.299.502,84
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.782.526,77	0,00	0,00	0,00	20.921.210,30	138.683,53	1.559.042,66
NTN-B 150545 (5,710000%)	33.977.343,66	0,00	0,00	0,00	34.201.087,82	223.744,16	2.522.400,96
NTN-B 150545 (5,760000%)	11.299.009,73	0,00	0,00	0,00	11.373.866,67	74.856,94	842.725,78
NTN-B 150545 (5,781000%)	11.281.022,13	0,00	0,00	0,00	11.355.940,65	74.918,52	843.031,41

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,815000%)	11.265.187,72	0,00	0,00	0,00	11.340.303,33	75.115,61	844.429,73
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.893.581,00	0,00	0,00	0,00	10.966.541,29	72.960,29	819.384,16
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.745.098,90	0,00	0,00	0,00	15.856.788,67	111.689,77	1.257.205,35
NTN-B 150826 (6,400000%)	20.050.472,20	0,00	0,00	0,00	20.193.455,57	142.983,37	193.117,37
NTN-B 150826 (6,703000%)	0,00	19.999.414,39	0,00	0,00	20.052.812,49	53.398,10	53.398,10
NTN-B 150828 (6,221000%)	19.874.593,41	0,00	0,00	0,00	20.013.517,71	138.924,30	606.694,24
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.742.274,52	0,00	0,00	0,00	15.853.938,18	111.663,66	1.257.168,12
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.233.377,28	0,00	0,00	0,00	11.307.325,39	73.948,11	846.542,26
NTN-B 150832 (6,070000%)	40.268.313,36	0,00	0,00	0,00	40.544.913,20	276.599,84	1.747.485,35
NTN-B 150840 (5,650000%)	957.452,86	0,00	0,00	0,00	963.711,68	6.258,82	71.721,79
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.272.680,23	0,00	0,00	0,00	11.347.443,79	74.763,56	854.063,74
NTN-B 150840 (6,186000%)	0,00	14.998.280,56	0,00	0,00	15.070.385,37	72.104,81	72.104,81
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.338.506,30	0,00	0,00	0,00	11.413.190,51	74.684,21	854.207,18
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.958.912,92	0,00	0,00	0,00	11.031.678,37	72.765,45	830.881,23
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.261.169,02	0,00	0,00	0,00	11.336.268,57	75.099,55	856.647,13
NTN-B 150850 (5,916000%)	4.042.199,21	0,00	0,00	0,00	4.069.477,48	27.278,27	310.424,44
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.826.528,88	0,00	0,00	0,00	10.899.641,05	73.112,17	831.890,63
NTN-B 150850 (5,970000%)	20.740.046,94	0,00	0,00	0,00	20.880.903,49	140.856,55	1.601.003,18
NTN-B 150850 (6,296000%)	0,00	35.001.417,11	0,00	0,00	35.171.295,67	169.878,56	169.878,56
	389.404.189,19	69.999.112,06	0,00	0,00	462.338.926,07	2.935.624,82	

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	10.685.327,07	0,00	0,00	0,00	10.760.851,82	75.524,75	671.406,77
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	24.383.851,93	0,00	0,00	0,00	24.587.003,24	203.151,31	846.176,52
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	11.084.978,36	0,00	0,00	0,00	11.143.124,69	58.146,33	591.200,09
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	579.284,65	0,00	0,00	0,00	579.718,28	433,63	31.998,41
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	509.228,19	400,00	0,00	0,00	513.856,76	4.228,57	33.832,71
SANTANDER RF ATIVO FIC	57.595,21	0,00	0,00	0,00	57.927,28	332,07	9.576,47

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	11.688.402,84	0,00	0,00	0,00	11.785.130,08	96.727,24	1.192.640,32
	58.988.668,25	400,00	0,00	0,00	59.427.612,15	438.543,90	

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	21.456.545,65	0,00	0,00	0,00	21.634.363,48	177.817,83	940.268,05
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	47.852.204,65	1.507.826,12	0,00	0,00	49.767.476,98	407.446,21	2.883.883,18
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	83.652.919,20	0,00	-55.000.831,50	0,00	29.131.652,17	479.564,47	2.133.498,08
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	81.542.206,12	15.739.707,88	-29.968.625,90	0,00	67.952.004,78	638.716,68	3.505.210,82
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	31.863.907,05	3.604.361,72	0,00	0,00	35.769.932,15	301.663,38	2.297.735,41
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	10.986.397,91	0,00	0,00	0,00	11.082.679,11	96.281,20	482.679,11
	277.354.180,58	20.851.895,72	-84.969.457,40	0,00	215.338.108,67	2.101.489,77	

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	1.527.757,68	0,00	0,00	102.058,53	1.438.509,39	12.810,24	100.979,06
	1.527.757,68	0,00	0,00	102.058,53	1.438.509,39	12.810,24	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.783.523,12	0,00	0,00	0,00	1.749.420,56	-34.102,56	398,14
BRADERCO F I A SELECTION	5.642.627,56	0,00	0,00	0,00	5.511.464,47	-131.163,09	-456.569,31
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.206.585,34	0,00	0,00	0,00	4.907.491,36	-299.093,98	-849.418,66
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	8.530.391,94	0,00	0,00	0,00	8.260.339,23	-270.052,71	-286.959,44
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17.543.173,07	0,00	-10.000.000,00	0,00	7.433.035,15	-110.137,92	752.649,39
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	4.113.467,13	0,00	0,00	0,00	4.073.749,39	-39.717,74	791.142,48
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	8.460.737,24	0,00	0,00	0,00	8.186.154,37	-274.582,87	-940.899,88
	51.280.505,40	0,00	-10.000.000,00	0,00	40.121.654,53	-1.158.850,87	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	10.088.852,14	88.852,14	969.289,26
	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	10.088.852,14	88.852,14	

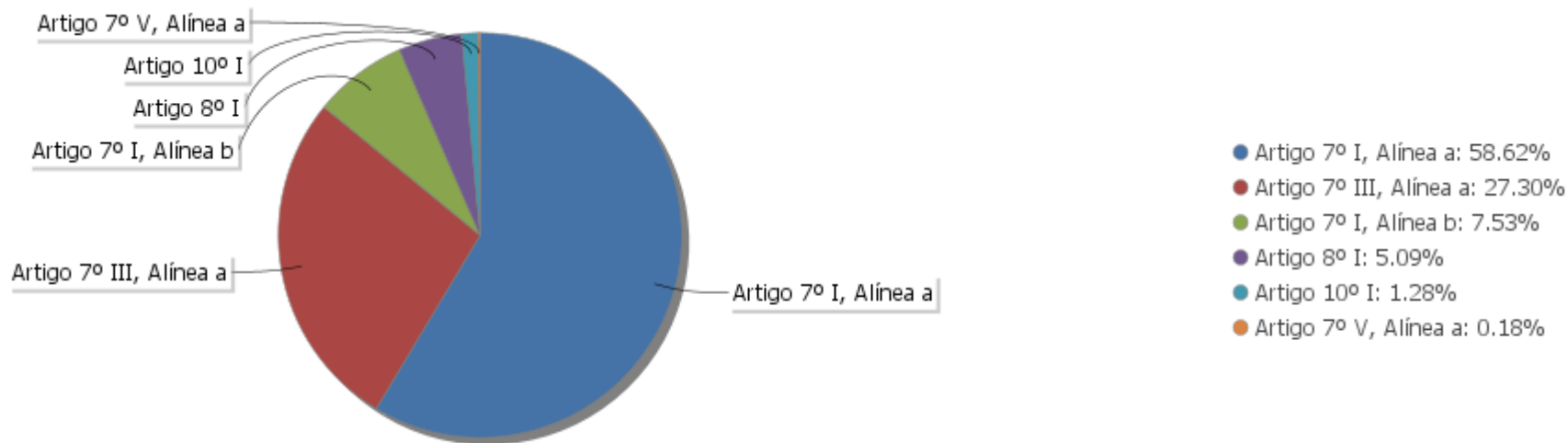
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

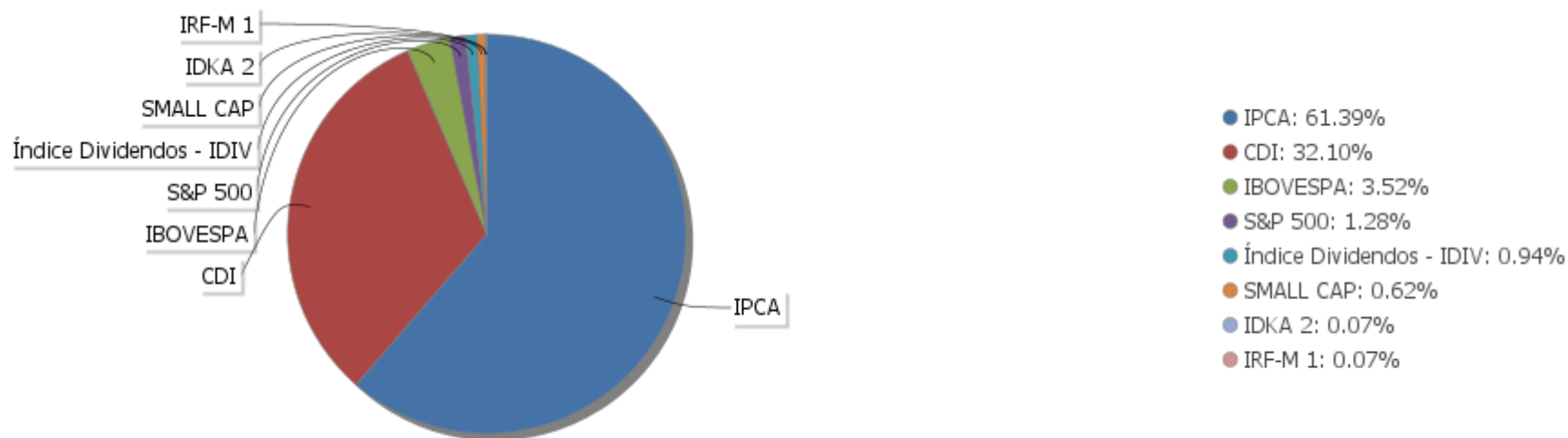
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	298.461.458,74	37,84		298.461.458,74	37,84	
de 31 dias a 365 dias	80.745.599,15	10,24		379.207.057,89	48,08	
acima de 365 dias	409.546.605,06	51,92		788.753.662,95	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

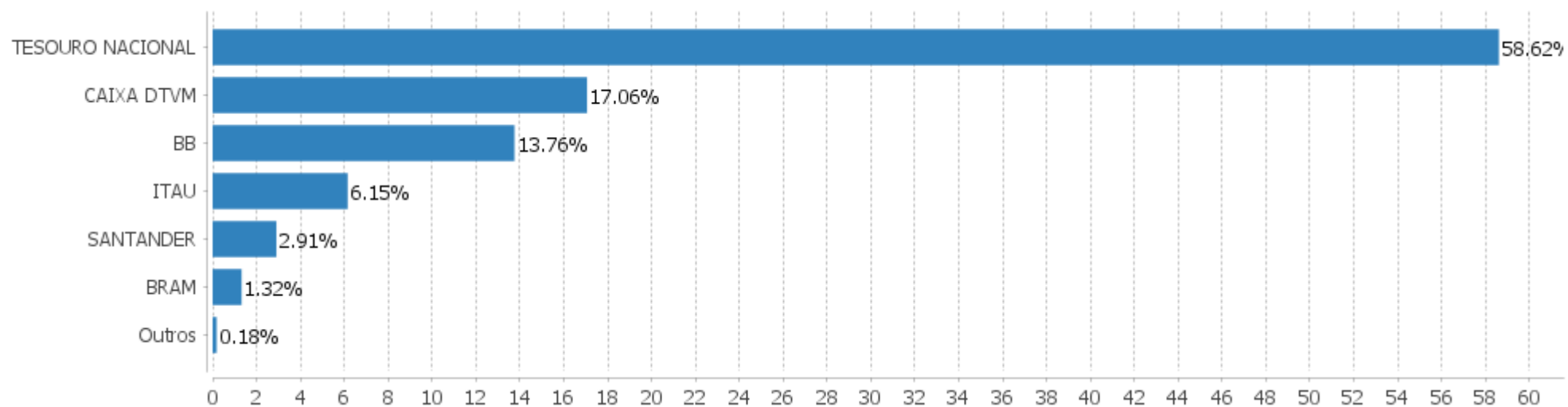


Alocação Por Estratégia



## 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	0,57				7,57
IPCA + 5,02%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41	0,85				7,19
p.p. indexador	-0,22	-0,08	0,36	-0,57	0,02	0,65	0,17	0,31	-0,28				0,38
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**

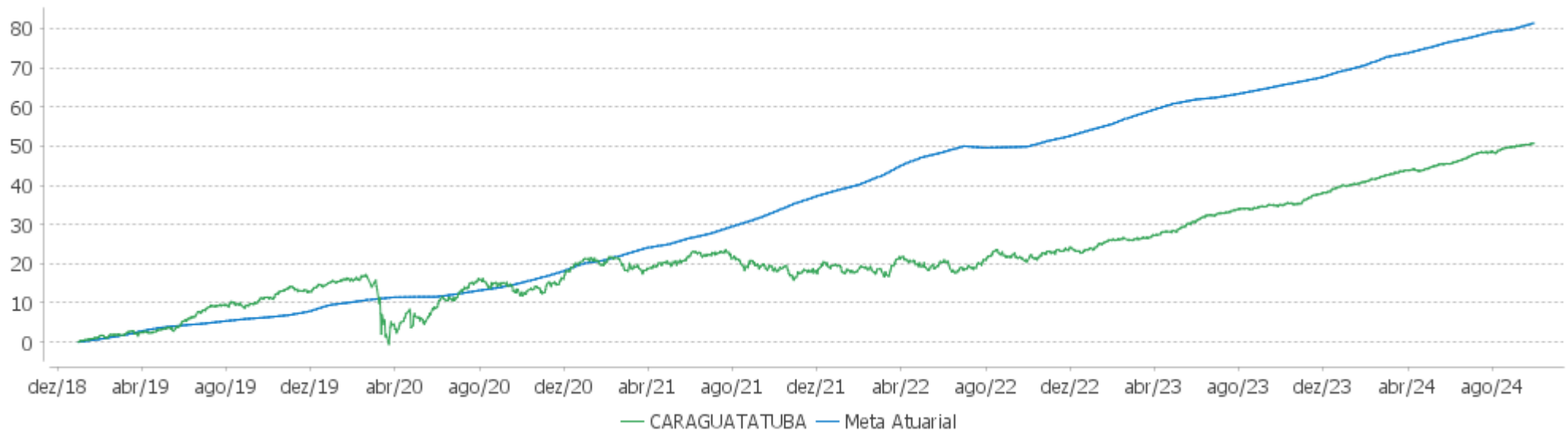
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	33	47,83
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	52,17
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03

**Relatório**

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,31	2,10	0,20	1,18
06 meses	4,76	4,45	0,31	1,12
12 meses	11,55	9,65	1,90	1,23
24 meses	24,89	21,08	3,81	2,03
36 meses	27,52	36,38	-8,86	3,70
48 meses	33,96	58,69	-24,74	4,28
60 meses	35,21	73,36	-38,15	6,89
Desde 31/12/2018	50,67	85,62	-34,95	6,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

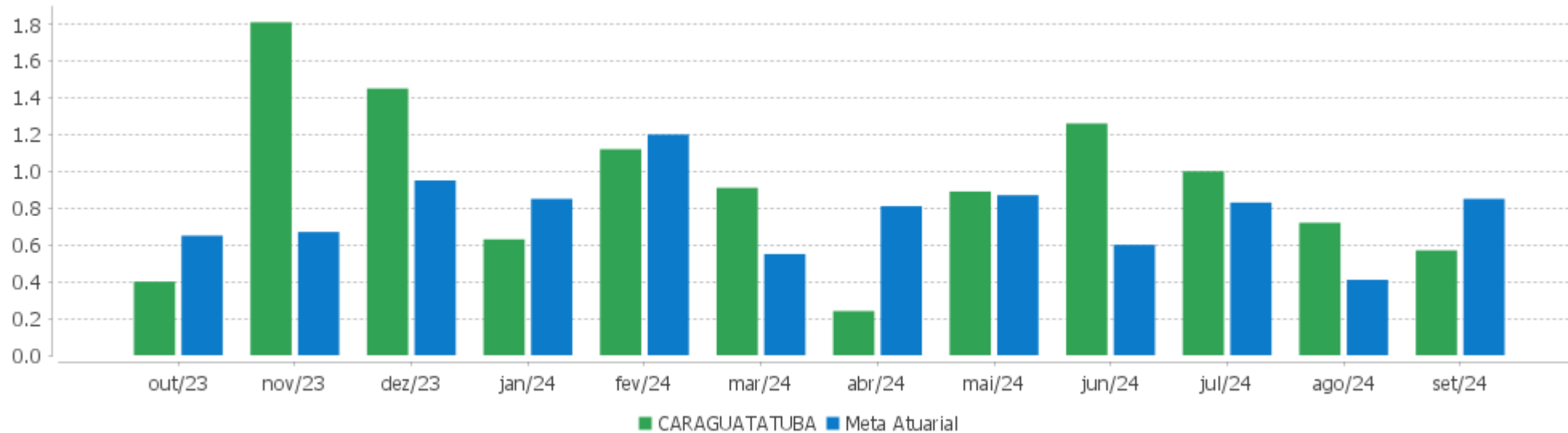


Patrimônio Líquido



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.	0,68 0,24	8,03 4,73	2,20 1,40	4,76 2,90	10,73 6,30	16,17 6,33	
NTN-B 150525 (5,940000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,24	8,01 4,70	2,19 1,39	4,75 2,88	10,49 6,07	15,86 6,02	
NTN-B 150840 (6,186000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,26	1,98 <b>-1,32</b>	<b>-0,72</b> <b>-1,53</b>	1,81 <b>-0,05</b>	4,36 <b>-0,06</b>		
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,21	7,72 4,41	2,10 1,29	4,55 2,69	10,22 5,79	22,05 12,21	35,12 17,41
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,21	7,79 4,48	2,12 1,32	4,60 2,73	10,35 5,92	22,30 12,46	39,36 21,64
NTN-B 150850 (6,296000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,26	1,96 <b>-1,35</b>	<b>-0,75</b> <b>-1,55</b>	1,82 <b>-0,05</b>	4,36 <b>-0,06</b>		
NTN-B 150828 (6,221000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,26	5,09 1,79	2,26 1,46	4,89 3,02	7,56 3,13		
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	7,83 4,53	2,13 1,33	4,63 2,76	10,33 5,90	22,35 12,51	35,56 17,85
NTN-B 150826 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	2,18 <b>-1,13</b>	<b>-0,65</b> <b>-1,45</b>	1,94 0,08	4,62 0,19		
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	7,88 4,57	2,15 1,35	4,66 2,80	10,47 6,05	22,58 12,74	35,92 18,21
NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	8,33 5,02	2,30 1,49	4,95 3,09	10,95 6,52	23,76 13,93	33,83 16,12
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	7,92 4,61	2,16 1,36	4,69 2,82	10,49 6,07	22,66 12,82	36,04 18,33
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,24	7,99 4,69	2,19 1,39	4,74 2,87	10,70 6,27	23,00 13,16	36,49 18,78
NTN-B 150527 (6,220000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,26	5,10 1,79	2,26 1,46	1,86 <b>-0,01</b>	4,46 0,03		
NTN-B 150525 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,25	8,12 4,81	2,23 1,43	4,82 2,95	7,44 3,01		
NTN-B 150832 (6,070000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,25	5,01 1,70	2,23 1,42	4,82 2,96	7,43 3,01		
NTN-B 150545 (5,781000%)	0,66	7,89	2,15	4,66	10,52	22,64	36,02

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.	0,22	4,58	1,35	2,80	6,10	12,80	18,30
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	7,94 4,63	2,17 1,37	4,70 2,84	10,64 6,22	22,86 13,02	36,28 18,57
NTN-B 150826 (6,703000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,30	2,36 -0,94	-0,59 -1,39	2,08 0,21	4,88 0,45		
NTN-B 150850 (5,713000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	7,83 4,53	2,13 1,33	4,63 2,77	10,47 6,05	22,51 12,68	35,83 18,12
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	7,99 4,69	2,19 1,38	4,73 2,87	10,69 6,27	22,99 13,15	36,51 18,80
NTN-B 150527 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,25	8,12 4,82	2,23 1,43	4,82 2,96	10,70 6,27	23,19 13,35	32,95 15,24
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	7,91 4,61	2,16 1,36	4,68 2,82	10,58 6,16	22,75 12,91	36,17 18,46
NTN-B 150828 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	8,33 5,02	2,30 1,49	4,95 3,09	10,97 6,55	23,78 13,94	33,82 16,10
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	7,87 4,57	2,15 1,35	4,65 2,79	10,50 6,07	22,60 12,76	35,94 18,23
NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,24	8,04 4,73	2,20 1,40	4,76 2,90	10,53 6,11	22,88 13,04	32,53 14,81
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	7,91 4,61	2,16 1,36	4,68 2,82	10,60 6,18	22,77 12,93	36,20 18,49
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	7,89 4,58	2,15 1,35	4,66 2,80	10,55 6,12	22,67 12,83	36,06 18,34
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	7,83 4,53	2,13 1,33	4,63 2,77	10,45 6,02	22,48 12,64	35,77 18,06
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,83 0,01	7,07 -0,10	2,47 -0,08	4,53 -0,07	10,12 -0,15	24,82 -0,38	36,86 -0,63
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,58 69,11	4,30 53,76	2,23 84,62	2,89 55,26	8,44 76,30	20,60 79,27	31,25 78,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,52 0,08	4,59 1,29	2,18 1,38	2,74 0,88	7,65 3,22	21,44 11,61	32,91 15,20
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	6,65 3,35	2,71 1,91	4,15 2,28	9,77 5,34	24,69 14,85	35,92 18,20
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,83 99,87	7,97 99,70	2,63 100,06	5,21 99,72	10,99 99,45	25,87 99,58	39,67 99,89
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,07	2,92	1,83	1,26	7,32	20,86	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IDKA 2 p.p.	-0,32	-2,09	0,08	-1,46	-0,74	0,46	
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,83 99,20	7,90 98,84	2,61 99,09	5,17 98,82	10,90 98,55	25,66 98,74	39,31 99,00
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,84 100,51	6,87 85,98	3,05 115,73	5,04 96,49	249,14 2.253,59	243,39 936,69	346,60 872,78
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,86 102,99	8,36 104,60	2,72 103,29	5,41 103,38	11,64 105,31	27,15 104,49	42,03 105,83
BB INSTITUCIONAL FI RF % do CDI	0,83 99,34	8,40 105,10	2,78 105,48	5,39 103,02	11,66 105,51	26,17 100,73	40,45 101,87
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,84 100,90	8,11 101,54	2,73 103,75	5,33 101,89	11,17 101,08	26,07 100,35	40,17 101,16
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,86 102,52	8,24 103,19	2,73 103,92	5,38 102,87	11,42 103,33	26,66 102,58	40,82 102,79
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,85 102,25	8,08 101,11	2,70 102,71	5,24 100,20	11,26 101,82	26,47 101,86	40,76 102,64
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,88 105,05	8,38 104,88	2,75 104,35	5,44 103,98	11,55 104,48	26,85 103,35	41,49 104,49
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-2,32 0,75	-7,65 -5,88	6,55 0,17	-4,77 -7,67	3,34 -9,74	2,93 -16,86	1,75 -17,03
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-3,17 -0,09	-3,36 -1,59	5,99 -0,39	0,22 -2,67	10,49 -2,59	11,68 -8,11	14,61 -4,17
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,97 2,11	11,17 12,93	12,08 5,69	9,59 6,69	29,31 16,22	27,61 7,82	19,88 1,11
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,90 -1,18	3,18 -1,07	6,80 -1,13	5,64 -2,74	16,25 -3,23	27,82 -8,57	33,68 -12,56
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,25 -0,17	-10,31 -8,54	5,85 -0,54	-5,03 -7,92	-2,25 -15,33	-14,40 -34,20	
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-1,91 1,17	0,02 1,79	6,75 0,37	4,42 1,52	13,63 0,55	19,29 -0,50	22,91 4,13
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-5,74 -1,34	-14,75 -1,09	-2,22 -3,61	-10,19 -0,20	-5,98 -2,23	-16,75 -10,16	-28,77 -4,97
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	2,33 4,06	24,07 -11,88	6,32 2,89	11,65 -7,94	40,19 -6,02	81,31 19,37	64,51 30,52
CARAGUATATUBA Var. IPCA + 4,99% p.p.	0,57 -0,28	7,57 0,38	2,31 0,20	4,76 0,31	11,55 1,90	24,89 3,81	27,52 -8,74
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

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
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 AÇÕES DUNAMIS FIC FI	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 100% DA	1,90



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
ITAU 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	0,82	7,18	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,50	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	3,90	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	5,30	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	-2,62	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	4,99	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	5,01	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	-9,14	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	-1,23	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	-0,22	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	-13,67	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	-11,22	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72

**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	-1,73	35,95	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-0,16	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	31,85	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	3,31	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	3,29	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	2,64	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	6,41	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	7,18	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	7,56	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	7,86	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	6,39	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

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%)	21.449.974,15	5,940000	21.495.275,46	5,566500	45.301,31
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.952.887,65	5,980000	10.978.197,62	5,566500	25.309,97
NTN-B 150525 (6,080000%)	20.389.459,21	6,080000	20.448.888,29	5,566500	59.429,08
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.422.246,11	6,090000	5.346.164,91	6,718200	-76.081,20
NTN-B 150527 (6,220000%)	10.095.068,36	6,220000	9.982.700,43	6,718200	-112.367,93
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.863.593,34	5,560000	16.670.286,82	6,498200	-1.193.306,52
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.921.210,30	5,821000	19.906.032,24	6,498200	-1.015.178,06
NTN-B 150545 (5,710000%)	34.201.087,82	5,710000	31.540.356,53	6,436600	-2.660.731,29
NTN-B 150545 (5,760000%)	11.373.866,67	5,760000	10.548.699,10	6,436600	-825.167,57
NTN-B 150545 (5,781000%)	11.355.940,65	5,781000	10.557.158,36	6,436600	-798.782,29
NTN-B 150555 (5,815000%)	11.340.303,33	5,815000	10.448.401,30	6,435900	-891.902,03
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.966.541,29	5,850000	10.154.671,14	6,435900	-811.870,15
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.856.788,67	6,350000	15.729.131,95	6,835800	-127.656,72
NTN-B 150826 (6,400000%)	20.193.455,57	6,400000	20.047.017,12	6,835800	-146.438,45
NTN-B 150826 (6,703000%)	20.052.812,49	6,703000	20.008.349,49	6,835800	-44.463,00
NTN-B 150828 (6,221000%)	20.013.517,71	6,221000	19.675.103,45	6,743900	-338.414,26
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.853.938,18	6,350000	15.653.262,06	6,743900	-200.676,12
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.307.325,39	5,708000	10.882.109,29	6,525800	-425.216,10
NTN-B 150832 (6,070000%)	40.544.913,20	6,070000	39.438.277,66	6,534100	-1.106.635,54
NTN-B 150840 (5,650000%)	963.711,68	5,650000	893.782,59	6,420000	-69.929,09
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.347.443,79	5,770000	10.649.860,16	6,420000	-697.583,63
NTN-B 150840 (6,186000%)	15.070.385,37	6,186000	14.732.726,17	6,420000	-337.659,20
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.413.190,51	5,713000	10.394.059,55	6,456600	-1.019.130,96
NTN-B 150850 (5,780000%)	11.031.678,37	5,780000	10.133.587,89	6,456600	-898.090,48
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.336.268,57	5,815000	10.460.211,09	6,456600	-876.057,48
NTN-B 150850 (5,916000%)	4.069.477,48	5,916000	3.803.713,12	6,456600	-265.764,36
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.899.641,05	5,920000	10.195.604,96	6,456600	-704.036,09
NTN-B 150850 (5,970000%)	20.880.903,49	5,970000	19.655.274,11	6,456600	-1.225.629,38

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (6,296000%)	35.171.295,67	6,296000	34.481.486,35	6,456600	-689.809,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
204	02/09/2024	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	400,00	0,00	8,57850000	46,6282500000
205	03/09/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	3.500.000,00	0,00	755,89989919	4.630,2427130000
206	06/09/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	102.058,53	0,00	22,01498000	4.635,8672950000
207	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.298,69	614,25233800	5,3702520000
208	06/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	242.652,28	0,00	73.739,43285900	3,2906719050
209	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	70.000,00	13.024,40678400	5,3745250000
210	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	14.998.280,56	2.788.395,55359808	5,3788210000
211	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	35.001.417,11	16.766.961,18195200	2,0875230000
212	13/09/2024	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	0,00	10.000.000,00	3.595.715,76938366	2,7810874500
213	13/09/2024	NTN-B 150840 (6,186000%)	14.998.280,56	0,00	3.511,00000000	4.271,7973682711
214	13/09/2024	NTN-B 150850 (6,296000%)	35.001.417,11	0,00	8.340,00000000	4.196,8126031175
215	13/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	68.428,20	0,00	12.716,69876700	5,3809720000
216	18/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.200,65	0,00	408,47111900	5,3875290000
217	18/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.000.000,00	0,00	1.856.138,50060018	5,3875290000
218	18/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.538,25181700	3,3011027280
219	18/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	14.153,28568957	3,3011027280
220	19/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.000.000,00	1.855.380,51064800	5,3897300000
221	19/09/2024	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10.000.000,00	0,00	3.918.679,56173488	2,5518800000
222	19/09/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	19.999.414,39	9.561.009,82049700	2,0917680000
223	20/09/2024	NTN-B 150826 (6,703000%)	19.999.414,39	0,00	4.657,00000000	4.294,4845157827
224	20/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	837.446,62	0,00	155.316,80434600	5,3918610000
225	20/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	2.659,02196600	3,3037636060
226	20/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	363.612,14761800	3,3037636060
227	20/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.687.049,78	0,00	869.282,38320600	5,3918610000
228	25/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	292.000,00	54.085,34173400	5,3988750000
229	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	240.817,07	44.568,69898900	5,4032780000
230	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.364.229,58	807.700,35822000	5,4032780000
231	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	104.788,95	0,00	19.393,58848400	5,4032780000

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
232	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	38.262,79	0,00	7.081,40317700	5,4032780000
233	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.530,89	0,00	283,32615800	5,4032780000
234	30/09/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.303,19	0,00	0,49358520	4.666,2461110000
<b>Total</b>			<b>100.851.407,78</b>	<b>94.969.457,40</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.744.969,63

Value-At-Risk: 0,35%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,25	0,05		0,01	-0,40	0,73	738.543.156,28	93,63
Artigo 8º	11,36	5,88		0,29	-0,32	-2,82	40.121.654,53	5,09
Artigo 10º	2,78	7,43		0,05	0,02	0,89	10.088.852,14	1,28
CARAGUATATUBA		0,35		0,35			788.753.662,95	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,05%

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%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,64	0,68	21.449.974,15	2,72
NTN-B 150525 (5,980000%)	0,25	0,07	0,00	0,09	-0,62	0,68	10.952.887,65	1,39
NTN-B 150525 (6,080000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,60	0,69	20.389.459,21	2,59
NTN-B 150826 (6,350000%)	0,24	0,07	0,00	0,09	-0,52	0,71	15.856.788,67	2,01
NTN-B 150826 (6,400000%)	0,24	0,20	-0,00	0,20	-0,49	0,71	20.193.455,57	2,56
NTN-B 150826 (6,703000%)	0,25	0,20	-0,00	0,20	-0,39	0,74	20.052.812,49	2,54
NTN-B 150527 (6,090000%)	0,24	0,07	0,00	0,09	-0,60	0,69	5.422.246,11	0,69
NTN-B 150527 (6,220000%)	0,24	0,20	-0,00	0,21	-0,55	0,70	10.095.068,36	1,28
NTN-B 150828 (6,221000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,55	0,70	20.013.517,71	2,54
NTN-B 150828 (6,350000%)	0,24	0,07	0,00	0,09	-0,52	0,71	15.853.938,18	2,01
NTN-B 150830 (5,708000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,71	0,66	11.307.325,39	1,43
NTN-B 150832 (6,070000%)	0,27	0,07	0,00	0,09	-0,55	0,69	40.544.913,20	5,14
NTN-B 150535 (5,560000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,76	0,65	17.863.593,34	2,26
NTN-B 150535 (5,821000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,68	0,67	20.921.210,30	2,65
NTN-B 150840 (5,650000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,73	0,65	963.711,68	0,12
NTN-B 150840 (5,770000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,69	0,66	11.347.443,79	1,44
NTN-B 150840 (6,186000%)	0,25	0,20	-0,00	0,20	-0,56	0,70	15.070.385,37	1,91



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 150545 (5,710000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,71	0,66	34.201.087,82	4,34
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,70	0,66	11.373.866,67	1,44
NTN-B 150545 (5,781000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,69	0,66	11.355.940,65	1,44
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,71	0,66	11.413.190,51	1,45
NTN-B 150850 (5,780000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,69	0,66	11.031.678,37	1,40
NTN-B 150850 (5,815000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,68	0,67	11.336.268,57	1,44
NTN-B 150850 (5,916000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,65	0,67	4.069.477,48	0,52
NTN-B 150850 (5,920000%)	0,25	0,12	0,00	0,13	-0,63	0,68	10.899.641,05	1,38
NTN-B 150850 (5,970000%)	0,24	0,09	0,00	0,11	-0,63	0,68	20.880.903,49	2,65
NTN-B 150850 (6,296000%)	0,25	0,20	-0,00	0,20	-0,52	0,70	35.171.295,67	4,46
NTN-B 150555 (5,815000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,68	0,67	11.340.303,33	1,44
NTN-B 150555 (5,850000%)	0,25	0,12	0,00	0,13	-0,65	0,67	10.966.541,29	1,39
<b>Sub-total</b>	0,25	0,07	0,00		-0,63	0,68	462.338.926,07	58,62

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	0,37	0,42	0,00	0,43	-0,34	0,71	10.760.851,82	1,36
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,01	0,01	0,00	0,01	-0,09	0,83	24.587.003,24	3,12
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,18	0,66	0,00	0,66	-0,26	0,52	11.143.124,69	1,41
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	3,23	1,62	0,00	0,97	-0,23	0,07	579.718,28	0,07
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,30	0,23	-0,00	0,32	-0,01	0,83	513.856,76	0,07
SANTANDER RF ATIVO FIC	0,58	0,67	0,00	0,67	-0,44	0,58	57.927,28	0,01
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	-0,00	0,01	-0,54	0,83	11.785.130,08	1,49
<b>Sub-total</b>	0,32	0,21	0,01		-0,29	0,74	59.427.612,15	7,53

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	0,07	0,04	0,00	0,04	-0,08	0,83	21.634.363,48	2,74
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	0,00	0,02	0,33	0,84	49.767.476,98	6,31

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
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,04	0,00	0,04	0,30	0,85	29.131.652,17	3,69
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,52	0,86	67.952.004,78	8,62
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,05	0,03	-0,00	0,03	0,54	0,86	35.769.932,15	4,53
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,06	0,02	-0,00	0,02	0,65	0,88	11.082.679,11	1,41
<b>Sub-total</b>	0,02	0,02	0,00		0,66	0,85	215.338.108,67	27,30

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	2,89	0,19	-0,00	0,19	0,00	0,84	1.438.509,39	0,18
<b>Sub-total</b>	31,36	0,19	-0,00		-0,01	0,45	1.438.509,39	0,18

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,88%

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	11,09	5,95	0,01	2,47	-0,25	-1,91	1.749.420,56	0,22
BRADESCO F I A SELECTION	11,21	6,68	0,04	3,09	-0,28	-2,32	5.511.464,47	0,70
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	15,25	8,21	0,05	3,52	-0,43	-5,74	4.907.491,36	0,62
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	11,79	6,00	0,06	1,61	-0,34	-3,17	8.260.339,23	1,05
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,15	5,45	0,05	1,89	-0,27	-1,90	7.433.035,15	0,94
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,75	5,70	0,03	3,46	-0,14	-0,97	4.073.749,39	0,52
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	11,80	5,85	0,06	2,55	-0,35	-3,25	8.186.154,37	1,04
<b>Sub-total</b>	11,36	5,88	0,29		-0,32	-2,82	40.121.654,53	5,09

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,43%

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	13,63	7,43	0,05	6,12	0,11	2,33	10.088.852,14	1,28
<b>Sub-total</b>	2,78	7,43	0,05		0,02	0,89	10.088.852,14	1,28

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (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 (%)