



LDB
EMPRESAS

CARAGUATATUBA
FEVEREIRO 2023



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 28.02.2023.

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

79,81%

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 150523 (5,831000%)	0,63	0,07	0,96	2,15	20.661.460,94	3,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,900000%)	0,63	0,07	0,96	2,16	41.144.673,92	6,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	2,95	0,07	0,97	2,17	10.192.166,18	1,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	2,96	0,06	0,97	2,19	5.036.172,34	0,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,63	0,06	0,94	2,11	16.657.115,51	2,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,63	0,06	0,96	2,15	19.465.373,80	3,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,63	0,06	0,95	2,13	31.799.544,44	5,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,63	0,06	0,95	2,14	10.572.395,34	1,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,63	0,06	0,95	2,15	10.554.555,68	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,63	0,07	0,96	2,15	10.529.878,77	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,64	0,04	0,96	2,16	10.181.523,67	1,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,63	0,07	0,96	2,16	5.337.715,27	0,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	3,06	0,06	0,96	2,17	10.088.085,94	1,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	3,07	0,07	0,97	2,19	5.036.467,83	0,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	3,06	0,06	1,00	1,05	19.627.598,73	3,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	3,06	0,07	1,00	2,25	20.432.590,92	3,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,680000%)	3,11	0,07	1,01	2,28	5.033.022,03	0,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	3,07	0,06	0,79	0,79	14.679.934,12	2,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	3,08	0,05	0,79	0,79	14.680.338,37	2,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,63	0,06	0,95	2,13	10.542.327,53	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,63	0,06	0,94	2,13	897.027,64	0,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,63	0,06	0,95	2,14	10.553.799,13	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,63	0,06	0,95	2,13	10.605.016,33	1,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,63	0,06	0,95	2,15	10.247.557,55	1,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,63	0,06	0,96	2,15	10.528.909,92	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,63	0,07	0,96	2,17	3.778.042,05	0,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,64	0,04	0,96	2,17	10.118.819,38	1,63
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,62	0,06	0,96	2,16	348.982.113,33	56,34

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				
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,44	0,10	1,00	2,09	422.350,58	0,07	230.132.035,89	0,18
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,44	0,04	0,96	2,03	11.846.912,02	1,91	6.481.837.661,08	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,65	0,01	1,39	2,78	591.359,19	0,10	835.837.223,61	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,97	0,00	1,50	2,93	2.140.620,53	0,35	6.865.433.667,15	0,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,78	0,05	0,97	2,01	1.397.829,70	0,23	5.085.339.032,83	0,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,45	0,03	1,05	2,11	16.399.072,02	2,65		

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,05	0,80	1,90	42.334.336,76	6,83	15.513.886.886,32	0,27
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,12	0,05	0,82	1,96	26.699.234,09	4,31	4.003.075.067,69	0,67
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,05	0,85	1,99	23.667.531,15	3,82	13.891.144.708,98	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	0,79	0,95	20.189.706,52	3,26	5.618.748.319,92	0,36
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,05	0,81	1,87	15.594.702,50	2,52	2.976.038.258,45	0,52
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,03	0,05	0,82	1,93	128.485.511,02	20,74		

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	29,97	-0,11	-0,11	0,50	483.685,10	0,08	18.916.364,87	2,56
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			29,97	-0,11	-0,11	0,50	483.685,10	0,08		
Renda Fixa			0,88	0,06	0,93	2,09	494.350.381,47	79,81		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

11,04%

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	19,61	-0,45	-7,40	-3,95	1.384.283,13	0,22	547.789.623,96	0,25
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	26,45	-1,07	-8,74	-5,68	5.245.988,87	0,85	803.783.693,55	0,65
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,69	-0,69	-6,91	-3,78	710.563,23	0,11	445.758.167,51	0,16
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,85	-0,71	-7,74	-4,40	22.147.421,99	3,58	783.163.513,62	2,83
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	21,64	-0,58	-6,89	-3,93	6.808.270,67	1,10	627.712.001,69	1,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	19,54	-0,42	-6,28	-2,98	13.079.637,75	2,11	871.759.853,34	1,50
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,67	-0,76	-6,80	-4,55	5.809.157,08	0,94	1.687.120.867,12	0,34
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	21,71	-1,04	-7,48	-3,85	5.100.555,68	0,82	420.232.220,21	1,21
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	23,29	-1,19	-9,22	-5,51	8.107.518,84	1,31	195.858.750,12	4,14
Sub-total Artigo 8º I			21,15	-0,75	-7,52	-4,27	68.393.397,24	11,04		
Renda Variável			21,15	-0,75	-7,52	-4,27	68.393.397,24	11,04		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,16%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,64	0,36	0,45	2,37	1.218.916,40	0,20	922.059.325,60	0,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	23,05	-0,23	-1,64	4,18	1.494.952,01	0,24	365.742.430,63	0,41
Sub-total Artigo 9º II			19,83	0,04	-0,71	3,36	2.713.868,41	0,44		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	26,14	0,39	0,75	5,10	35.415.097,69	5,72	1.983.611.681,32	1,79
Sub-total Artigo 9º III			26,14	0,39	0,75	5,10	35.415.097,69	5,72		
Investimentos no Exterior			25,46	0,36	0,64	4,97	38.128.966,10	6,16		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,00%

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	FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,53	0,05	0,82	0,91	16.499.973,05	2,66	1.678.694.629,43	0,98
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	23,71	-0,11	-1,78	4,59	2.059.469,78	0,33	1.139.873.707,23	0,18
Sub-total Artigo 10º I			23,27	0,04	0,53	6,98	18.559.442,83	3,00		
Investimentos Estruturados			23,27	0,04	0,53	6,98	18.559.442,83	3,00		
Total			4,90	-0,01	-0,11	1,64	619.432.187,64	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	348.982.113,33	56,34	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	16.399.072,02	2,65	0,00	11,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	128.485.511,02	20,74	0,00	25,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	483.685,10	0,08	0,00	0,10	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	494.350.381,47	79,81					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	68.393.397,24	11,04	0,00	5,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	68.393.397,24	11,04					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	2.713.868,41	0,44	0,00	0,90	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	35.415.097,69	5,72	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	38.128.966,10	6,16					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	18.559.442,83	3,00	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	18.559.442,83	3,00					15,00
Total		619.432.187,64	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,96 105,04	2,16 105,48	3,05 95,29	4,88 75,69	11,90 91,59	3.299.122,82	6.836.484,34
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,05 114,21	2,11 102,76	3,07 95,89	5,68 88,18	11,25 86,56	170.178,11	363.198,39
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,82 89,18	1,93 94,01	3,08 96,40	6,40 99,37	14,30 109,99	1.055.417,46	2.824.162,38
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,11 -11,45	0,50 24,52	-14,49 -453,14	-13,61 -211,20	11,32 87,08	-509,14	2.421,21
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-7,52 -0,03	-4,27 0,10	-6,72 -0,01	-7,00 -2,81	-8,41 -1,15	-5.563.470,49	-3.052.945,92
Artigo 9º II % do CDI	-0,71 -77,49	3,36 163,76	-0,51 -15,94	4,50 69,77	-5,43 -41,79	-19.446,01	88.219,67
Artigo 9º III % do CDI	0,75 81,66	5,10 248,54	0,06 1,92	0,40 6,18	-10,41 -80,08	263.538,93	1.718.363,18
Artigo 10º I % do CDI	0,53 57,51	6,98 340,40	1,84 57,38	7,30 113,31	1,71 13,17	97.484,71	1.144.474,42
CARAGUATATUBA (Total)						-697.683,61	9.924.377,67

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 150523 (5,831000%)	20.465.603,73	0,00	0,00	0,00	20.661.460,94	195.857,21	435.424,50
NTN-B 150523 (5,900000%)	40.752.777,81	0,00	0,00	0,00	41.144.673,92	391.896,11	871.253,80
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.094.569,18	0,00	0,00	0,00	10.192.166,18	97.597,00	216.947,25
NTN-B 150527 (6,090000%)	4.987.559,32	0,00	0,00	0,00	5.036.172,34	48.613,02	108.054,74
NTN-B 150535 (5,560000%)	16.502.242,34	0,00	0,00	0,00	16.657.115,51	154.873,17	344.390,99
NTN-B 150535 (5,821000%)	19.280.999,89	0,00	0,00	0,00	19.465.373,80	184.373,91	409.928,92
NTN-B 150545 (5,710000%)	31.500.662,15	0,00	0,00	0,00	31.799.544,44	298.882,29	664.496,40
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.472.677,63	0,00	0,00	0,00	10.572.395,34	99.717,71	221.700,21
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.454.861,60	0,00	0,00	0,00	10.554.555,68	99.694,08	221.655,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.430.180,26	0,00	0,00	0,00	10.529.878,77	99.698,51	221.658,54
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.084.865,09	0,00	0,00	0,00	10.181.523,67	96.658,58	214.883,86
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.442.822,90	0,00	0,00	156.703,36	5.337.715,27	51.595,73	115.579,78
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.286.676,86	0,00	0,00	296.246,81	10.088.085,94	97.655,89	218.756,15
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.135.361,49	0,00	0,00	148.242,57	5.036.467,83	49.348,91	110.531,02
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.010.987,05	0,00	0,00	580.457,85	19.627.598,73	197.069,53	207.102,31
NTN-B 150824 (6,480000%)	20.831.519,31	0,00	0,00	604.529,39	20.432.590,92	205.601,00	460.345,95
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.130.994,94	0,00	0,00	149.315,06	5.033.022,03	51.342,15	114.941,15
NTN-B 150826 (6,350000%)	0,00	14.999.539,65	0,00	436.266,92	14.679.934,12	116.661,39	116.661,39
NTN-B 150828 (6,350000%)	0,00	15.001.966,48	0,00	438.292,74	14.680.338,37	116.664,63	116.664,63
NTN-B 150830 (5,708000%)	10.746.239,04	0,00	0,00	304.469,26	10.542.327,53	100.557,75	225.274,94
NTN-B 150840 (5,650000%)	913.891,78	0,00	0,00	25.382,36	897.027,64	8.518,22	19.081,39
NTN-B 150840 (5,770000%)	10.755.142,78	0,00	0,00	302.443,45	10.553.799,13	101.099,80	226.466,73
NTN-B 150850 (5,713000%)	10.803.439,19	0,00	0,00	299.583,46	10.605.016,33	101.160,60	226.583,51
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.441.400,42	0,00	0,00	292.076,00	10.247.557,55	98.233,13	220.028,75
NTN-B 150850 (5,815000%)	10.729.217,11	0,00	0,00	301.490,12	10.528.909,92	101.182,93	226.643,41
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.851.102,18	0,00	0,00	109.632,77	3.778.042,05	36.572,64	81.921,30
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.314.685,93	0,00	0,00	293.863,48	10.118.819,38	97.996,93	219.506,87
					348.982.113,33	0,00	0,00

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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.734.108,90	0,00	0,00	0,00	11.846.912,02	112.803,12	235.531,87
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.108.905,80	0,00	0,00	0,00	2.140.620,53	31.714,73	61.013,68
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.384.469,56	0,00	0,00	0,00	1.397.829,70	13.360,14	27.554,10
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	417.512,08	642,19	0,00	0,00	422.350,58	4.196,31	8.637,59
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	583.255,38	0,00	0,00	0,00	591.359,19	8.103,81	16.022,21
					16.399.072,02	0,00	0,00

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	21.963.421,98	1.511.559,11	0,00	0,00	23.667.531,15	192.550,06	426.496,25
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	20.030.900,22	0,00	0,00	0,00	20.189.706,52	158.806,30	189.706,52
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	36.138.489,48	9.805.340,50	-3.924.189,64	0,00	42.334.336,76	314.696,42	1.103.270,54
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	56.434.171,43	2.067,58	-30.001.506,13	0,00	26.699.234,09	264.501,21	819.113,34
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	15.469.839,03	0,00	0,00	0,00	15.594.702,50	124.863,47	285.540,56
					128.485.511,02	0,00	0,00

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	484.194,24	0,00	0,00	0,00	483.685,10	-509,14	2.421,21
					483.685,10	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.494.840,97	0,00	0,00	0,00	1.384.283,13	-110.557,84	-56.931,56
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	24.004.683,10	0,00	0,00	0,00	22.147.421,99	-1.857.261,11	-1.018.547,44
BRADESCO F I A SELECTION	5.513.107,63	0,00	0,00	0,00	5.100.555,68	-412.551,95	-204.271,79
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.748.372,13	0,00	0,00	0,00	5.245.988,87	-502.383,26	-316.080,60
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.312.031,17	0,00	0,00	0,00	6.808.270,67	-503.760,50	-278.543,21
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13.956.706,57	0,00	0,00	0,00	13.079.637,75	-877.068,82	-401.360,60
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6.233.026,71	0,00	0,00	0,00	5.809.157,08	-423.869,63	-276.741,53
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	763.278,02	0,00	0,00	0,00	710.563,23	-52.714,79	-27.914,74
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	8.930.821,43	0,00	0,00	0,00	8.107.518,84	-823.302,59	-472.554,45
					68.393.397,24	0,00	0,00

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.213.507,15	0,00	0,00	0,00	1.218.916,40	5.409,25	28.211,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	1.519.807,27	0,00	0,00	0,00	1.494.952,01	-24.855,26	60.008,09
					2.713.868,41	0,00	0,00

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	35.151.558,76	0,00	0,00	0,00	35.415.097,69	263.538,93	1.718.363,18
					35.415.097,69	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	16.365.070,52	0,00	0,00	0,00	16.499.973,05	134.902,53	148.742,52
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	2.096.887,60	0,00	0,00	0,00	2.059.469,78	-37.417,82	995.731,90
					18.559.442,83	0,00	0,00

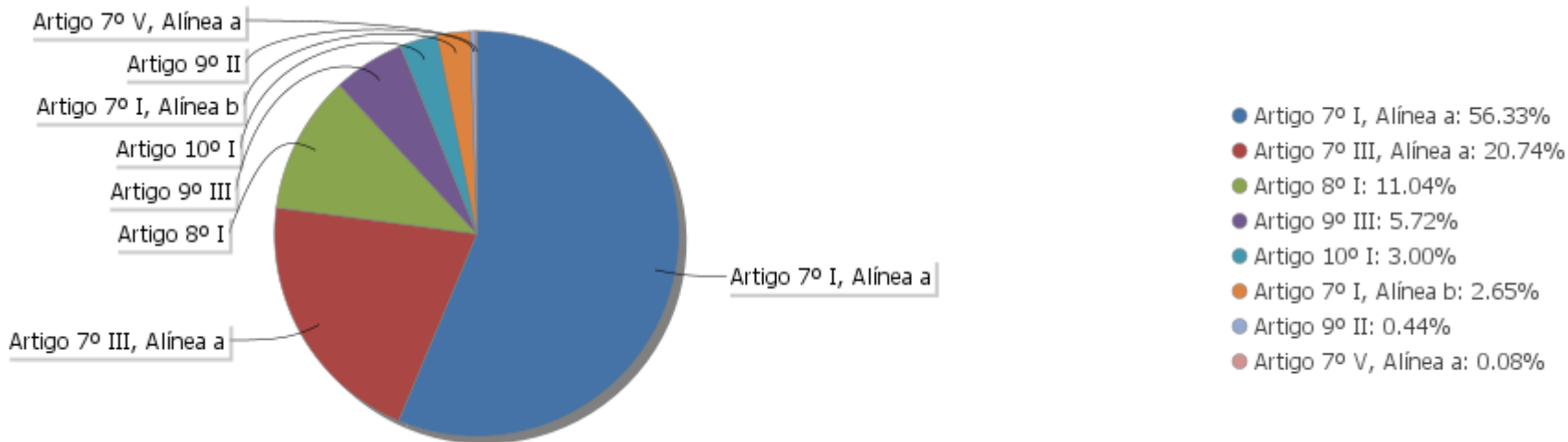
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

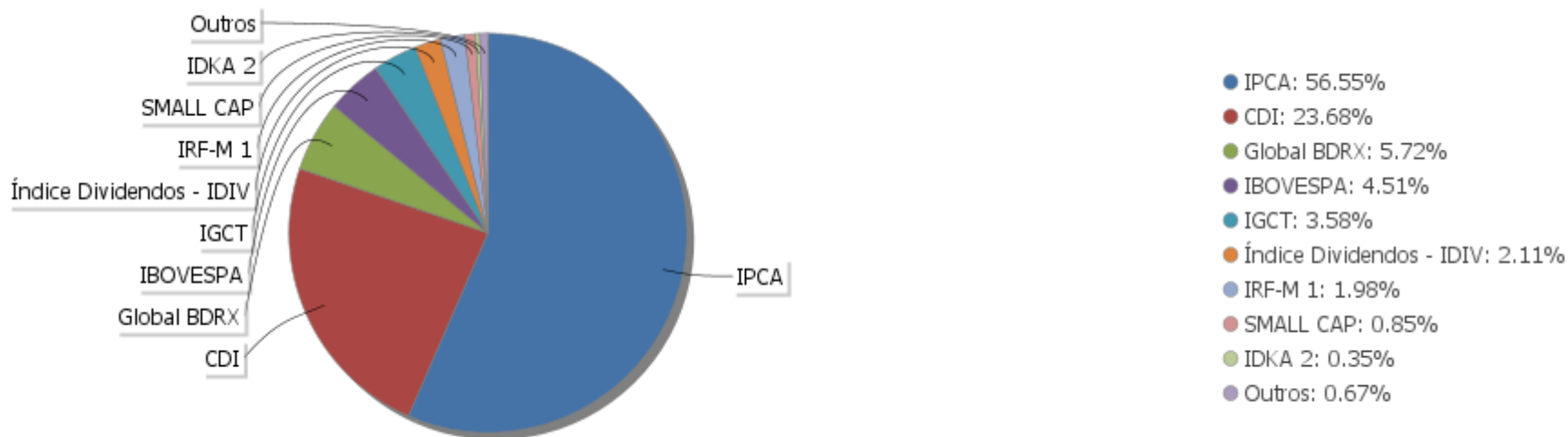
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	236.645.489,97	38,20	236.645.489,97	38,20
de 31 a 365 dias	95.610.719,20	15,44	332.256.209,17	53,64
acima de 365 dias	287.175.978,47	46,36	619.432.187,64	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

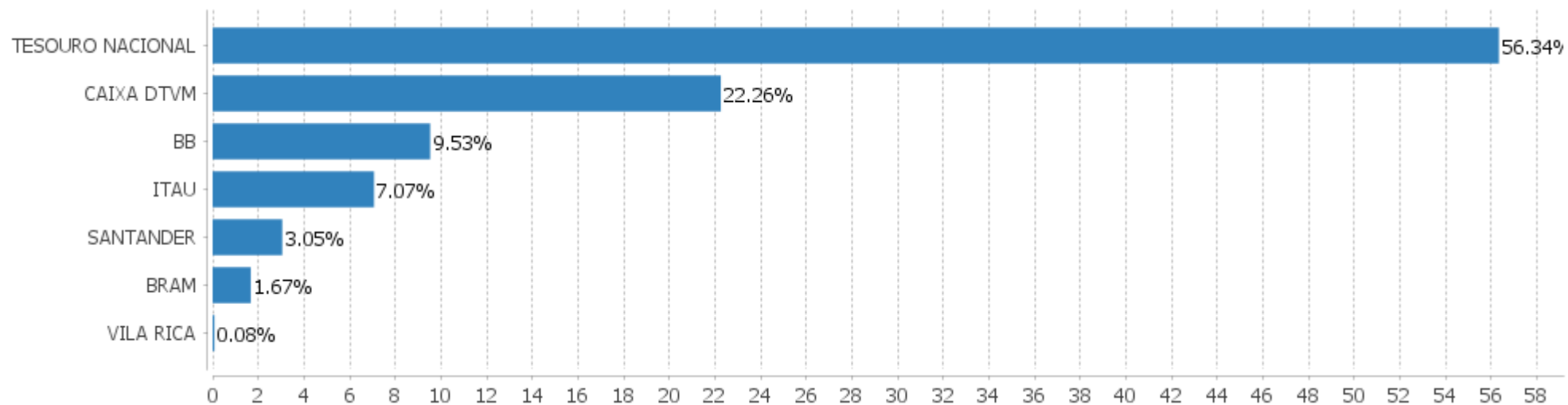


Alocação Por Estratégia



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
2023	1,75	-0,11											1,64
IPCA + 4,99%	0,96	1,19											2,16
p.p. indexador	0,80	-1,30											-0,52
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	22	44,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	56,00

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

Relatório

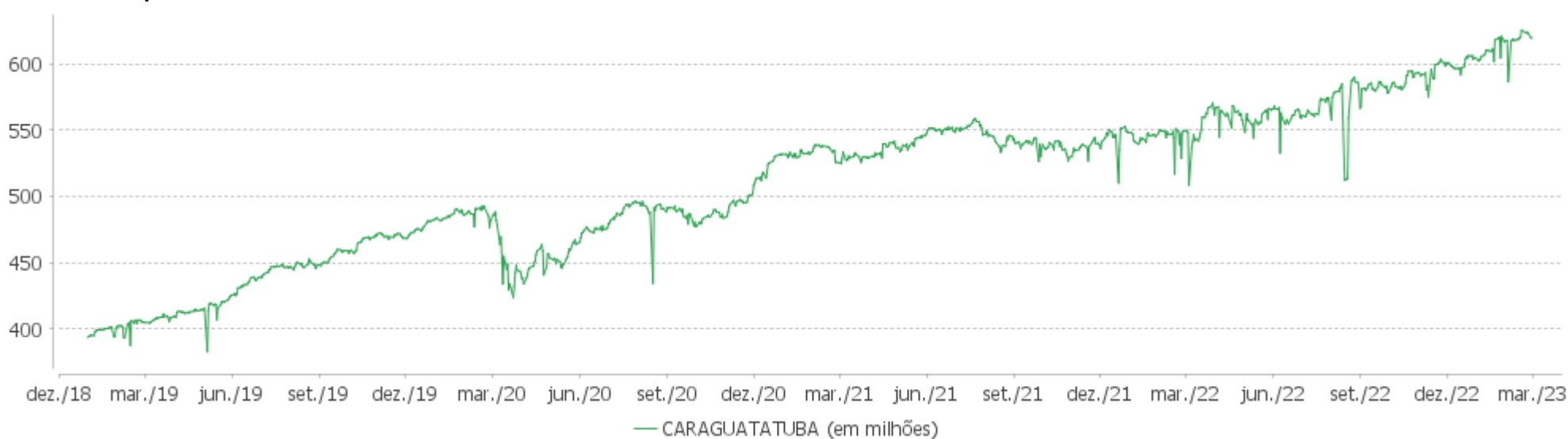
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,54	3,23	-1,69	2,43
06 meses	3,60	5,20	-1,59	3,70
12 meses	6,35	10,84	-4,49	4,90
24 meses	6,47	29,16	-22,68	5,31
36 meses	10,31	43,68	-33,37	8,70
48 meses	23,71	58,34	-34,63	7,78
Desde 31/12/2018	26,04	61,09	-35,05	7,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

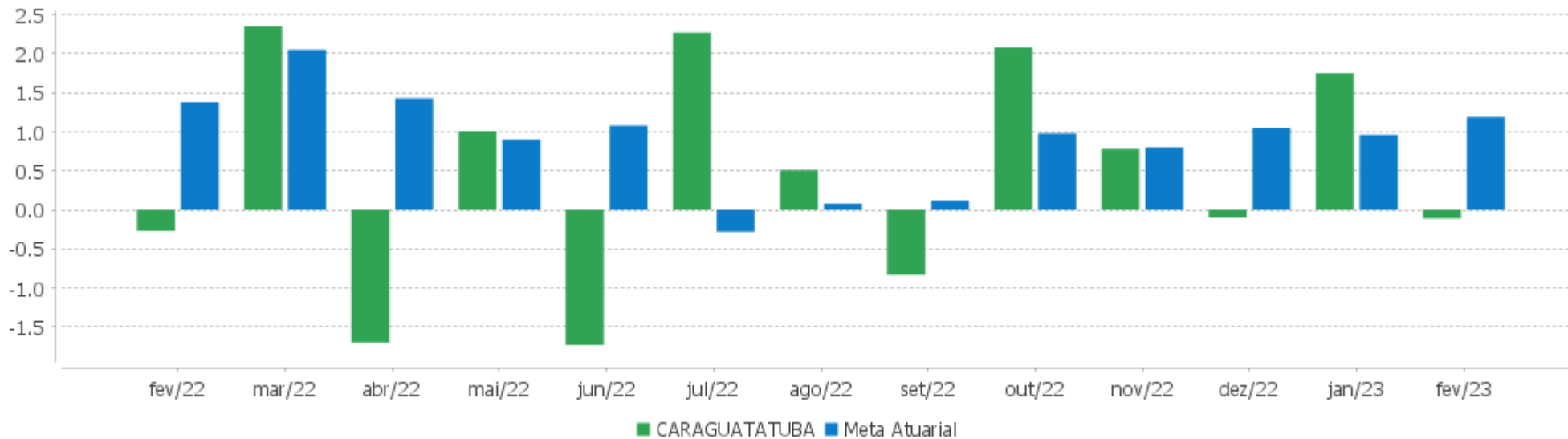


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,10	2,11 0,74	2,97 0,96	4,72 1,99	11,50 5,90	23,07 6,34	28,64 5,84
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,10	2,13 0,75	2,99 0,99	4,76 2,04	11,60 6,00	26,78 10,05	32,60 9,81
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,11	2,13 0,76	3,00 1,00	4,79 2,07	11,66 6,06	23,28 6,55	28,87 6,08
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,11	2,14 0,77	3,02 1,01	4,82 2,10	11,72 6,13	23,47 6,74	29,19 6,39
NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,14	2,22 0,85	3,15 1,14	5,09 2,37	9,06 3,46		
NTN-B 150824 (6,680000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,17	2,28 0,91	3,23 1,23	5,26 2,53	9,41 3,81		
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,17 0,79	3,05 1,05	4,90 2,17	11,85 6,25	23,69 6,96	29,49 6,70
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,15 0,78	3,03 1,03	4,85 2,12	11,77 6,18	23,52 6,79	29,24 6,45
NTN-B 150523 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,15 0,78	3,03 1,03	4,85 2,13	11,79 6,19	23,44 6,71	29,07 6,27
NTN-B 150824 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,13	2,19 0,82	3,09 1,09	4,98 2,26	8,84 3,25		
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,11	2,15 0,77	3,02 1,02	4,83 2,10	11,73 6,14	23,51 6,78	29,26 6,46
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,16 0,79	3,05 1,04	4,88 2,15	11,85 6,25	23,58 6,85	29,29 6,49
NTN-B 150824 (6,440000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,16	2,24 0,87	3,18 1,17	5,14 2,42	9,17 3,58		
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,16 0,78	3,04 1,03	4,86 2,13	11,77 6,18	23,59 6,86	29,39 6,60
NTN-B 150824 (5,910000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,17 0,79	3,05 1,05	4,89 2,16	8,66 3,06		
NTN-B 150523 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,16 0,79	3,05 1,05	4,89 2,16	11,86 6,26	23,59 6,86	29,30 6,50
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,95	2,13	3,00	4,79	11,66	23,43	29,18

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.	0,11	0,76	1,00	2,07	6,07	6,70	6,39
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,17 0,79	3,05 1,05	4,89 2,17	11,87 6,28	23,71 6,98	29,52 6,73
NTN-B 150527 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,13	2,19 0,82	3,09 1,09	4,97 2,25	8,83 3,23		
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,15 0,78	3,03 1,03	4,84 2,12	11,77 6,17	23,57 6,84	29,35 6,56
NTN-B 150828 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,14	2,22 0,84	3,14 1,14	5,09 2,36	9,04 3,44		
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,11	2,14 0,77	3,02 1,01	4,82 2,09	11,71 6,11	23,47 6,74	29,22 6,42
NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,13	2,17 0,80	3,07 1,06	4,92 2,20	8,74 3,15	20,24 3,51	25,87 3,07
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,12	2,15 0,78	3,03 1,03	4,84 2,12	11,77 6,17	23,58 6,85	29,37 6,58
NTN-B 150824 (6,480000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,16	2,25 0,88	3,19 1,18	5,16 2,44	9,22 3,62	21,25 4,52	27,40 4,61
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,11	2,15 0,77	3,02 1,02	4,83 2,10	11,73 6,14	23,52 6,79	29,29 6,50
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,11	2,13 0,76	3,00 1,00	4,79 2,07	11,66 6,06	23,40 6,67	29,13 6,33
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,00 0,02	2,09 -0,00	3,27 -0,03	6,44 -0,05	12,61 -0,20	17,24 -0,37	20,54 -0,69
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,39 -0,02	2,78 -0,04	3,73 -0,06	5,76 -0,11	11,34 -0,23	18,12 -0,50	25,26 -0,75
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,96 -0,02	2,03 -0,06	3,21 -0,09	6,32 -0,17	12,47 -0,34	16,97 -0,65	20,14 -1,10
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,97 0,13	2,01 0,64	3,17 1,17	5,58 2,85	11,28 5,68	13,35 -3,38	18,61 -4,18
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,50 -0,11	2,93 -0,14	4,20 -0,15	5,90 -0,15	10,95 -0,31	17,94 -0,77	25,57 -1,38
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-0,11 -11,45	-14,75 -718,88	-14,49 -453,14	-13,61 -211,20	11,32 87,08	7,86 40,55	1.626,42 7.322,72
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,82 89,54	1,96 95,64	3,11 97,32	6,53 101,31	13,29 102,25	20,83 107,51	23,44 105,52
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,85	1,99	3,13	6,42	13,03	19,82	22,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	93,00	96,86	97,93	99,60	100,24	102,28	100,19
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,80	1,90	3,07	6,38	12,99	19,80	22,20
% do CDI	87,07	92,72	96,12	99,03	99,95	102,18	99,96
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,79	1,90	3,05	6,33	12,95	19,81	22,41
% do CDI	86,35	92,67	95,45	98,29	99,63	102,21	100,88
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,81	1,87	3,02	6,37	13,14	20,38	22,46
% do CDI	87,91	90,90	94,56	98,90	101,09	105,16	101,12
BRADERCO F I A SELECTION	-7,48	-3,85	-6,33	-6,03	-1,59	-10,03	-6,86
Var. IBOVESPA p.p.	0,01	0,53	0,38	-1,84	5,67	-5,39	-7,59
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	-6,89	-3,93	-7,26	-6,78	-8,93	-7,84	-8,04
Var. IBOVESPA p.p.	0,60	0,45	-0,54	-2,58	-1,67	-3,20	-8,77
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-6,80	-4,55	-2,83	-2,67	0,27	-7,23	-2,97
Var. IBOVESPA p.p.	0,69	-0,17	3,89	1,52	7,52	-2,60	-3,70
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-6,28	-2,98	-5,33	-2,94	-2,57	2,31	2,12
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,27	-0,87	-1,64	-2,10	-7,62	-12,39	-8,52
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-6,91	-3,78	-5,83	-4,46	-6,37	-10,56	-7,61
Var. IBOVESPA p.p.	0,59	0,60	0,89	-0,26	0,89	-5,92	-8,34
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-9,22	-5,51	-10,05	-16,58	-18,76		
Var. IBOVESPA p.p.	-1,73	-1,13	-3,33	-12,39	-11,50		
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-7,74	-4,40	-6,90	-5,59	-8,95	-7,83	-2,88
Var. IGCT p.p.	-0,08	-0,08	-0,13	-0,44	-0,81	-1,69	-2,80
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-7,40	-3,95	-5,95	-5,64	-4,47	-4,89	-12,24
Var. IBOVESPA p.p.	0,10	0,43	0,76	-1,44	2,78	-0,25	-12,97
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-8,74	-5,68	-8,15	-12,20	-15,55	-19,21	-18,21
Var. SMALL CAP p.p.	1,78	2,22	2,53	4,28	4,67	11,63	11,11
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,75	5,10	0,06	0,40	-10,41	-10,52	51,00
Var. Global BDRX p.p.	-0,40	-0,47	-1,05	-0,13	-0,81	-2,57	-4,73
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,45	2,37	0,17	5,06	-7,98	-14,71	46,97
% do CDI	48,55	115,48	5,44	78,57	-61,39	-75,93	211,50
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	-1,64	4,18	-1,06	4,04	-3,25	12,03	
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,72	0,47	0,86	0,87	5,50	21,89	
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,82	1,93	3,12	6,15	13,21	20,11	23,36
% do CDI	89,78	94,06	97,45	95,37	101,61	103,78	105,18
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	-1,78	4,59	-0,45	4,90	-0,57	19,27	48,81
Var. S&P 500 p.p.	-1,25	1,38	3,83	3,96	7,68	21,17	-6,76
CARAGUATATUBA	-0,11	1,64	1,54	3,60	6,35	6,47	10,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 4,99% p.p.	-1,30	-0,52	-1,69	-1,59	-4,49	-22,20	-31,72
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15

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 AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+0	A taxa de performance será apurada e provisionada diariamente, devendo ser paga à ADMINISTRADORA semestralmente, por período vencido, no primeiro dia útil do mês subsequente a cada semestre civil	0,70
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 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	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+8 du		1,00
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	D+0	D+1	D+1	D+6		1,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL 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	0,98	2,09	3,30	6,49	12,81	17,61	21,23	29,14	38,03
IRF-M 1+	0,79	1,51	3,16	4,25	9,06	7,22	10,24	25,91	40,07
IRF-M TOTAL	0,86	1,71	3,21	4,93	10,13	10,66	13,99	27,51	40,19
IMA-B 5	1,41	2,82	3,79	5,87	11,57	18,62	26,01	41,34	55,61
IMA-B 5+	1,17	-0,11	-1,30	0,52	4,86	0,42	1,37	23,71	45,02
IMA-B TOTAL	1,28	1,28	1,08	3,02	7,94	8,94	12,38	32,61	51,33
IMA-GERAL TOTAL	1,03	1,74	2,52	4,81	10,51	13,70	17,46	30,71	43,72
IDKA 2	1,62	3,08	4,36	6,05	11,25	18,71	26,96	41,17	55,55
IDKA 20	0,79	-3,83	-7,02	-4,75	-2,27	-14,73	-16,36	6,39	31,39
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,30

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73	9,78	22,94
IBRX 100	-7,59	-4,34	-6,85	-4,76	-8,23	-5,60	0,93	12,19	26,64
IBRX 50	-7,54	-4,41	-6,85	-3,59	-7,74	-3,34	4,52	11,43	23,50
SMALL CAP	-10,52	-7,90	-10,68	-16,48	-20,21	-30,84	-29,32	-4,09	7,17
Índice Consumo - ICON	-9,78		-12,01	-20,80	-30,44	-45,20	-44,63	-25,38	-25,80
Índice Dividendos - IDIV	-7,55	-2,11	-3,69	-0,84	5,04	14,70	10,65	34,58	57,47

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	-0,54	3,21	-4,28	0,94	-8,25	-1,90	55,57	98,62	134,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,45	-2,05	-2,05	-5,64	2,45	-2,71	-5,24	15,36	21,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,92	3,71	-1,93	3,17	-8,75	-9,86	42,01	74,04	94,86

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,84	1,37	2,00	2,73	5,60	16,73	22,79	27,71	32,68
INPC	0,77	1,23	1,93	2,47	5,47	16,86	24,12	28,99	34,07
IGPM	-0,06	0,15	0,60	-1,88	1,86	18,28	52,51	62,91	75,30
SELIC	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,31

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,12	2,01	2,99	4,71	9,80	26,26	38,06	49,31	61,33
IPCA + 5,00%	1,19	2,16	3,23	5,20	10,85	28,69	42,07	55,11	69,21
IPCA + 5,50%	1,23	2,24	3,36	5,45	11,38	29,92	44,10	58,08	73,26
IPCA + 5,89%	1,25	2,30	3,45	5,64	11,79	30,89	45,70	60,42	76,48
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15	61,08	77,39
INPC + 4,00%	1,05	1,87	2,92	4,45	9,67	26,39	39,56	50,81	63,02
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73	62,70	79,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
27	01/02/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	94.048,71	0,00	21.101,90711800	4,4568820000
28	02/02/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.738,06	838,34600700	4,4588510000
29	02/02/2023	ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	642,19	0,00	16,35398333	39,2681090000
30	03/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	30.001.506,13	7.811,57364603	3.840,6481830000
31	06/02/2023	NTN-B 150826 (6,350000%)	14.999.539,65	0,00	3.661,00000000	4.097,1154466000
32	06/02/2023	NTN-B 150828 (6,350000%)	15.001.966,48	0,00	3.678,00000000	4.078,8380859200
33	07/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	246.385,24	0,00	89.696,65523500	2,7468721030
34	07/02/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	30.143,45	0,00	6.750,27102125	4,4655170000
35	10/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	3.045,77638000	2,7510325620
36	10/02/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	62.000,00	13.866,83676653	4,4710990000
37	15/02/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.738.995,60	0,00	1.058.702,67137800	4,4762290000
38	17/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	435.579,13132000	2,7579112350
39	17/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,81	0,00	3.185,31281500	2,7579112350
40	17/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	16.940,88243500	2,7579112350
41	17/02/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.254.919,47	0,00	949.785,73499740	4,4798730000
42	17/02/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	657.778,97	0,00	146.829,82530978	4,4798730000
43	27/02/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	29.454,30	0,00	6.562,19776800	4,4884810000
44	27/02/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.652.381,37	813.723,25515024	4,4884810000
45	27/02/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	206.070,21	45.910,90170594	4,4884810000
46	28/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.067,58	0,00	0,53478626	3.866,1801380000
Total			41.321.115,51	33.925.695,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.177.760,14

Value-At-Risk: 1,16%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		1,16	1,16			619.432.187,64	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,11%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150523 (5,831000%)		0,17	0,00	0,19			20.661.460,94	3,34
NTN-B 150523 (5,900000%)		0,17	0,00	0,19			41.144.673,92	6,64
NTN-B 150525 (5,980000%)		0,17	0,00	0,19			10.192.166,18	1,65
NTN-B 150527 (6,090000%)		0,17	0,00	0,19			5.036.172,34	0,81
NTN-B 150535 (5,560000%)		0,17	0,00	0,19			16.657.115,51	2,69
NTN-B 150535 (5,821000%)		0,17	0,00	0,19			19.465.373,80	3,14
NTN-B 150545 (5,710000%)		0,17	0,00	0,19			31.799.544,44	5,13
NTN-B 150545 (5,760000%)		0,17	0,00	0,19			10.572.395,34	1,71
NTN-B 150545 (5,781000%)		0,17	0,00	0,19			10.554.555,68	1,70
NTN-B 150555 (5,815000%)		0,17	0,00	0,19			10.529.878,77	1,70
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,17	0,00	0,19			10.181.523,67	1,64
NTN-B 150824 (5,892000%)		0,17	0,00	0,19			5.337.715,27	0,86
NTN-B 150824 (5,910000%)		0,17	0,00	0,19			10.088.085,94	1,63
NTN-B 150824 (6,090000%)		0,17	0,00	0,19			5.036.467,83	0,81
NTN-B 150824 (6,440000%)		0,17	0,00	0,19			19.627.598,73	3,17
NTN-B 150824 (6,480000%)		0,17	0,00	0,19			20.432.590,92	3,30
NTN-B 150824 (6,680000%)		0,17	0,00	0,19			5.033.022,03	0,81
NTN-B 150826 (6,350000%)		0,17	0,00	0,19			14.679.934,12	2,37
NTN-B 150828 (6,350000%)		0,17	0,00	0,19			14.680.338,37	2,37
NTN-B 150830 (5,708000%)		0,17	0,00	0,19			10.542.327,53	1,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,650000%)		0,17	0,00	0,19			897.027,64	0,14
NTN-B 150840 (5,770000%)		0,17	0,00	0,19			10.553.799,13	1,70
NTN-B 150850 (5,713000%)		0,17	0,00	0,19			10.605.016,33	1,71
NTN-B 150850 (5,780000%)		0,17	0,00	0,19			10.247.557,55	1,65
NTN-B 150850 (5,815000%)		0,17	0,00	0,19			10.528.909,92	1,70
NTN-B 150850 (5,916000%)		0,17	0,00	0,19			3.778.042,05	0,61
NTN-B 150850 (5,920000%)		0,17	0,00	0,19			10.118.819,38	1,63
Sub-total	0,18	0,16	0,01		0,25	0,96	348.982.113,33	56,34

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,22	-0,00	0,30			422.350,58	0,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,24	0,00	0,03			11.846.912,02	1,91
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,36	0,00	0,01			591.359,19	0,10
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,00	0,36			2.140.620,53	0,35
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,40	0,00	0,40			1.397.829,70	0,23
Sub-total	0,98	0,42	0,01		0,13	1,05	16.399.072,02	2,65

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	0,00	0,04			42.334.336,76	6,83
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,02	0,00	0,02			26.699.234,09	4,31
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			23.667.531,15	3,82
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	-0,00	0,04			20.189.706,52	3,26
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,07	-0,00	0,07			15.594.702,50	2,52
Sub-total	0,08	0,03	-0,00		-1,27	0,82	128.485.511,02	20,74

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		0,68	-0,00	0,68			483.685,10	0,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,39	0,68	-0,00		-2,60	-0,11	483.685,10	0,08

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,50%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		10,41	0,02	2,25			1.384.283,13	0,22
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		14,33	0,09	2,83			5.245.988,87	0,85
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		11,18	0,01	1,83			710.563,23	0,11
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		11,54	0,34	0,18			22.147.421,99	3,58
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		12,19	0,11	2,52			6.808.270,67	1,10
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		10,96	0,18	2,94			13.079.637,75	2,11
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		11,31	0,08	5,57			5.809.157,08	0,94
BRADESCO F I A SELECTION		9,91	0,07	1,91			5.100.555,68	0,82
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		13,62	0,14	5,82			8.107.518,84	1,31
Sub-total	16,62	11,50	1,03		-0,51	-7,52	68.393.397,24	11,04

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,41%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,29	-0,00	9,29			1.218.916,40	0,20
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI		8,25	0,01	7,15			1.494.952,01	0,24
Sub-total	11,70	7,93	0,01		-0,14	-0,71	2.713.868,41	0,44

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		11,72	0,09	1,42			35.415.097,69	5,72
Sub-total	21,06	11,72	0,09		-0,01	0,75	35.415.097,69	5,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,16%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP		0,20	0,00	0,20			16.499.973,05	2,66
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		10,34	0,02	7,79			2.059.469,78	0,33
Sub-total	1,89	1,16	0,02		-0,21	0,53	18.559.442,83	3,00