



**LDB**  
EMPRESAS

**CARAGUATATUBA**  
OUTUBRO 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 31.10.2023.

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**

**86,08%**

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%)	4,11	0,04	0,72	3,62	20.725.550,90	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,36	0,04	0,73	9,20	10.579.996,00	1,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,36	0,03	0,74	9,30	5.231.095,16	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,36	0,03	0,69	8,84	17.263.541,99	2,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,36	0,04	0,72	9,06	20.195.235,84	2,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,36	0,03	0,71	8,97	32.987.456,32	4,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,36	0,03	0,71	9,01	10.968.981,36	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,36	0,04	0,71	9,03	10.951.170,86	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,36	0,04	0,71	9,06	10.927.960,70	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,38	0,01	0,72	9,09	10.567.365,47	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,36	0,04	0,72	9,13	5.538.002,57	0,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	0,52	0,03	0,72	9,14	10.467.960,90	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	0,52	0,04	0,74	9,29	5.231.604,78	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	0,36	0,04	0,76	8,31	20.431.969,57	2,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	0,36	0,04	0,77	9,62	21.274.200,87	3,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,680000%)	0,58	0,04	0,78	9,80	5.246.807,51	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,990300%)	2,97	0,04	0,81	4,15	30.340.846,26	4,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	0,36	0,03	0,76	7,97	15.270.568,63	2,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	0,36	0,03	0,76	7,97	15.268.903,79	2,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,36	0,03	0,71	8,97	10.930.147,12	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,36	0,03	0,70	8,92	930.224,99	0,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,36	0,04	0,71	9,02	10.948.901,11	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,36	0,03	0,71	8,97	11.002.490,25	1,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,36	0,04	0,71	9,03	10.633.528,82	1,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,36	0,04	0,71	9,06	10.926.501,70	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,36	0,04	0,72	9,15	3.921.753,18	0,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,38	0,01	0,72	9,15	10.503.886,95	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,970000%)	4,12	0,02	0,61	0,61	20.121.205,15	2,94
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,35</b>	<b>0,03</b>	<b>0,73</b>	<b>9,21</b>	<b>369.387.858,75</b>	<b>53,99</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				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	3,78	0,01	-0,00	4,29	2.443.297,96	0,36	206.429.417,85	1,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM	0,03	0,05	0,97	7,39	20.229.970,95	2,96	7.255.038.120,30	0,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
FIC FI										
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,37	0,03	0,93	10,95	466.317,70	0,07	397.435.163,61	0,12
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,06	0,92	10,82	12.867.717,96	1,88	7.179.042.508,92	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,19	-0,09	-0,66	-1,36	4.931.770,84	0,72	5.036.600.197,80	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,04	0,09	0,94	10.094.311,87	1,48	1.646.050.653,70	0,61
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,50	0,01	0,26	10,64	7.244.802,86	1,06	5.136.324.306,86	0,14
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,98	0,05	0,41	1,60	626.162,57	0,09	303.682.805,99	0,21
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,31</b>	<b>0,03</b>	<b>0,46</b>	<b>9,71</b>	<b>58.904.352,71</b>	<b>8,61</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				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,60	-0,06	-0,92	-2,11	6.852.514,06	1,00	471.797.994,42	1,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,02	11,21	54.449.353,70	7,96	14.076.402.461,33	0,39
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,05	1,06	11,40	21.866.024,54	3,20	5.391.477.708,44	0,41
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,99	10,95	59.041.042,53	8,63	15.296.039.303,73	0,39
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,05	0,99	10,20	16.820.170,41	2,46	5.784.928.154,82	0,29
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,16</b>	<b>0,04</b>	<b>0,92</b>	<b>10,78</b>	<b>159.029.105,24</b>	<b>23,24</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	111,91	200,33	200,33	244,25	1.656.737,00	0,24	56.027.774,26	2,96
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>111,91</b>	<b>200,33</b>	<b>200,33</b>	<b>244,25</b>	<b>1.656.737,00</b>	<b>0,24</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,34</b>	<b>0,22</b>	<b>0,92</b>	<b>9,85</b>	<b>588.978.053,70</b>	<b>86,08</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

7,45%

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	17,29	0,14	-3,41	3,18	1.487.105,77	0,22	544.339.620,40	0,27
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	23,58	1,44	-7,66	-13,35	4.819.736,13	0,70	626.989.168,61	0,77
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	18,92	0,41	-3,61	1,59	4.703.875,48	0,69	730.788.793,77	0,64
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	19,31	0,44	-3,93	1,34	7.181.789,38	1,05	636.425.761,76	1,13
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,51	0,12	-3,01	6,51	14.359.271,35	2,10	898.947.192,31	1,60
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,17	0,37	-4,29	-8,29	5.581.082,67	0,82	1.245.165.684,45	0,45
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	18,38	0,50	-5,07	-4,56	5.062.819,75	0,74	406.505.009,85	1,25
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	21,88	0,88	-7,30	-9,52	7.763.327,58	1,13	137.339.469,08	5,65
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>18,45</b>	<b>0,50</b>	<b>-4,68</b>	<b>-2,15</b>	<b>50.959.008,11</b>	<b>7,45</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>18,45</b>	<b>0,50</b>	<b>-4,68</b>	<b>-2,15</b>	<b>50.959.008,11</b>	<b>7,45</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,40%

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	20,25	0,45	-1,40	14,42	23.271.664,67	3,40	1.935.277.303,73	1,20
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>20,25</b>	<b>0,45</b>	<b>-1,40</b>	<b>14,42</b>	<b>23.271.664,67</b>	<b>3,40</b>		
Investimentos no Exterior			19,86	0,45	-1,40	14,41	23.271.664,67	3,40		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,07%

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	0,45	0,04	0,85	9,35	21.008.256,65	3,07	1.378.652.401,38	1,52
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>0,45</b>	<b>0,04</b>	<b>0,85</b>	<b>16,34</b>	<b>21.008.256,65</b>	<b>3,07</b>		
Investimentos Estruturados			10,70	0,04	0,85	16,34	21.008.256,65	3,07		
Total			2,20	0,25	0,40	9,36	684.216.983,13	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	369.387.858,75	53,99	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	58.904.352,71	8,61	0,00	17,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	159.029.105,24	23,24	0,00	18,63	60,00	0,00	75,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.656.737,00	0,24	0,00	0,07	5,00	0,00	15,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>588.978.053,70</b>	<b>86,08</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	50.959.008,11	7,45	0,00	7,00	30,00	0,00	45,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>50.959.008,11</b>	<b>7,45</b>					45,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.271.664,67	3,40	0,00	3,80	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>23.271.664,67</b>	<b>3,40</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	21.008.256,65	3,07	0,00	3,50	10,00	0,00	15,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>21.008.256,65</b>	<b>3,07</b>					20,00
<b>Total</b>		<b>684.216.983,13</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	0,73 73,49	9,21 83,59	2,23 70,88	4,34 66,19	11,36 84,69	2.664.410,69	30.282.839,95
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,46 46,23	9,71 88,11	1,65 52,57	5,23 79,88	11,13 82,97	243.653,96	4.006.899,19
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,92 91,90	10,78 97,83	2,98 94,64	6,50 99,23	13,20 98,39	1.354.079,81	14.122.047,43
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	200,33 20.081,98	244,25 2.215,55	236,79 7.531,73	241,16 3.681,50	193,29 1.440,62	1.105.102,09	1.175.473,11
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,68 -1,74	-2,15 -5,26	-10,49 -3,27	3,71 -4,63	-10,37 -7,87	-2.500.296,36	306.623,60
Artigo 9º II % do CDI	0,00 0,00	6,13 55,64	0,00 0,00	0,00 0,00	9,76 72,75	0,00	160.631,81
Artigo 9º III % do CDI	-1,40 -140,26	14,42 130,83	-2,16 -68,81	6,20 94,66	16,47 122,72	-330.226,25	4.574.930,16
Artigo 10º I % do CDI	0,85 85,47	16,34 148,24	2,63 83,76	6,23 95,13	17,45 130,08	177.608,98	2.799.329,59
<b>CARAGUATATUBA (Total)</b>						<b>2.714.332,92</b>	<b>57.428.774,84</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150525 (5,940000%)	20.576.430,63	0,00	0,00	0,00	20.725.550,90	149.120,27	724.295,62
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.503.592,01	0,00	0,00	0,00	10.579.996,00	76.403,99	906.251,13
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.192.843,59	0,00	0,00	0,00	5.231.095,16	38.251,57	452.497,01
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.144.470,27	0,00	0,00	0,00	17.263.541,99	119.071,72	1.425.675,65
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.051.802,99	0,00	0,00	0,00	20.195.235,84	143.432,85	1.706.820,33
NTN-B 150545 (5,710000%)	32.756.064,76	0,00	0,00	0,00	32.987.456,32	231.391,56	2.760.361,47
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.891.611,30	0,00	0,00	0,00	10.968.981,36	77.370,06	921.951,95
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.873.740,77	0,00	0,00	0,00	10.951.170,86	77.430,09	922.180,26
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.850.399,54	0,00	0,00	0,00	10.927.960,70	77.561,16	922.919,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.492.063,19	0,00	0,00	0,00	10.567.365,47	75.302,28	895.381,25
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.498.366,60	0,00	0,00	0,00	5.538.002,57	39.635,97	476.411,70
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.392.868,28	0,00	0,00	0,00	10.467.960,90	75.092,62	902.139,80
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.193.368,50	0,00	0,00	0,00	5.231.604,78	38.236,28	457.544,40
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.276.987,30	0,00	0,00	0,00	20.431.969,57	154.982,27	1.606.159,73
NTN-B 150824 (6,480000%)	21.112.277,94	0,00	0,00	0,00	21.274.200,87	161.922,93	1.921.304,08
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.206.037,50	0,00	0,00	0,00	5.246.807,51	40.770,01	481.701,85
NTN-B 150824 (6,990300%)	30.097.795,19	0,00	0,00	0,00	30.340.846,26	243.051,07	1.226.066,73
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.155.794,94	0,00	0,00	0,00	15.270.568,63	114.773,69	1.154.257,01
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.154.122,71	0,00	0,00	0,00	15.268.903,79	114.781,08	1.154.266,64
NTN-B 150830 (5,708000%)	10.853.488,90	0,00	0,00	0,00	10.930.147,12	76.658,22	925.027,23
NTN-B 150840 (5,650000%)	923.743,43	0,00	0,00	0,00	930.224,99	6.481,56	78.283,31
NTN-B 150840 (5,770000%)	10.871.575,05	0,00	0,00	0,00	10.948.901,11	77.326,06	931.425,93
NTN-B 150850 (5,713000%)	10.925.277,14	0,00	0,00	0,00	11.002.490,25	77.213,11	930.984,56
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.558.353,34	0,00	0,00	0,00	10.633.528,82	75.175,48	905.235,66
NTN-B 150850 (5,815000%)	10.848.960,15	0,00	0,00	0,00	10.926.501,70	77.541,55	933.115,71
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.893.611,71	0,00	0,00	0,00	3.921.753,18	28.141,47	337.952,62
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.428.464,92	0,00	0,00	0,00	10.503.886,95	75.422,03	905.641,39
NTN-B 150850 (5,970000%)	0,00	19.999.335,41	0,00	0,00	20.121.205,15	121.869,74	121.869,74
	346.724.112,65	19.999.335,41	0,00	0,00	369.387.858,75	2.664.410,69	

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	12.749.886,88	0,00	0,00	0,00	12.867.717,96	117.831,08	1.256.337,81
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.964.759,88	0,00	0,00	0,00	4.931.770,84	-32.989,04	-68.229,16
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	10.085.051,87	0,00	0,00	0,00	10.094.311,87	9.260,00	94.311,87
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	27.293.861,20	0,00	-19.999.335,42	0,00	7.244.802,86	-49.722,92	873.862,68
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	12.444.976,01	0,00	-10.000.000,00	0,00	2.443.297,96	-1.678,05	248.751,50
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	461.170,96	873,98	0,00	0,00	466.317,70	4.272,76	45.606,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER RF ATIVO FIC	623.597,55	0,00	0,00	0,00	626.162,57	2.565,02	9.858,43
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	20.035.855,84	0,00	0,00	0,00	20.229.970,95	194.115,11	1.376.054,35
	88.659.160,19	873,98	-29.999.335,42	0,00	58.904.352,71	243.653,96	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	56.971.651,79	1.500.469,38	0,00	0,00	59.041.042,53	568.921,36	3.807.529,53
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	16.655.102,60	0,00	0,00	0,00	16.820.170,41	165.067,81	1.820.170,41
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	43.088.029,30	15.057.821,81	-4.150.511,79	0,00	54.449.353,70	454.014,38	5.201.553,73
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	21.634.285,55	1.952,71	0,00	0,00	21.866.024,54	229.786,28	2.969.937,48
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6.916.224,08	0,00	0,00	0,00	6.852.514,06	-63.710,02	-147.450,77
	145.265.293,32	16.560.243,90	-4.150.511,79	0,00	159.029.105,24	1.354.079,81	

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	551.634,91	0,00	0,00	0,00	1.656.737,00	1.105.102,09	1.175.473,11
	551.634,91	0,00	0,00	0,00	1.656.737,00	1.105.102,09	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.539.581,69	0,00	0,00	0,00	1.487.105,77	-52.475,92	45.891,08
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	4.880.271,94	0,00	0,00	0,00	4.703.875,48	-176.396,46	1.537.906,05
BRADESCO F I A SELECTION	5.333.120,47	0,00	0,00	0,00	5.062.819,75	-270.300,72	-242.007,72
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.219.799,51	0,00	0,00	0,00	4.819.736,13	-400.063,38	-742.333,34
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.475.769,36	0,00	0,00	0,00	7.181.789,38	-293.979,98	94.975,50
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	14.805.299,05	0,00	0,00	0,00	14.359.271,35	-446.027,70	878.273,00
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.831.059,57	0,00	0,00	0,00	5.581.082,67	-249.976,90	-504.815,94
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	8.374.402,88	0,00	0,00	0,00	7.763.327,58	-611.075,30	-816.745,71
	53.459.304,47	0,00	0,00	0,00	50.959.008,11	-2.500.296,36	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	23.601.890,92	0,00	0,00	0,00	23.271.664,67	-330.226,25	4.574.930,16
	23.601.890,92	0,00	0,00	0,00	23.271.664,67	-330.226,25	

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	20.830.647,67	0,00	0,00	0,00	21.008.256,65	177.608,98	1.673.251,25
	20.830.647,67	0,00	0,00	0,00	21.008.256,65	177.608,98	

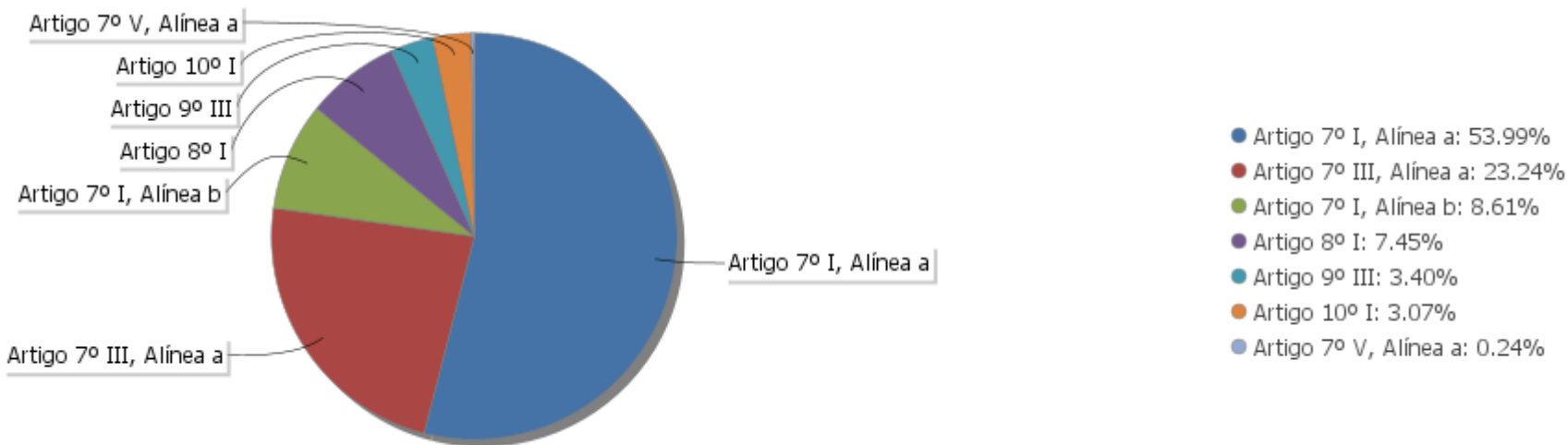
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

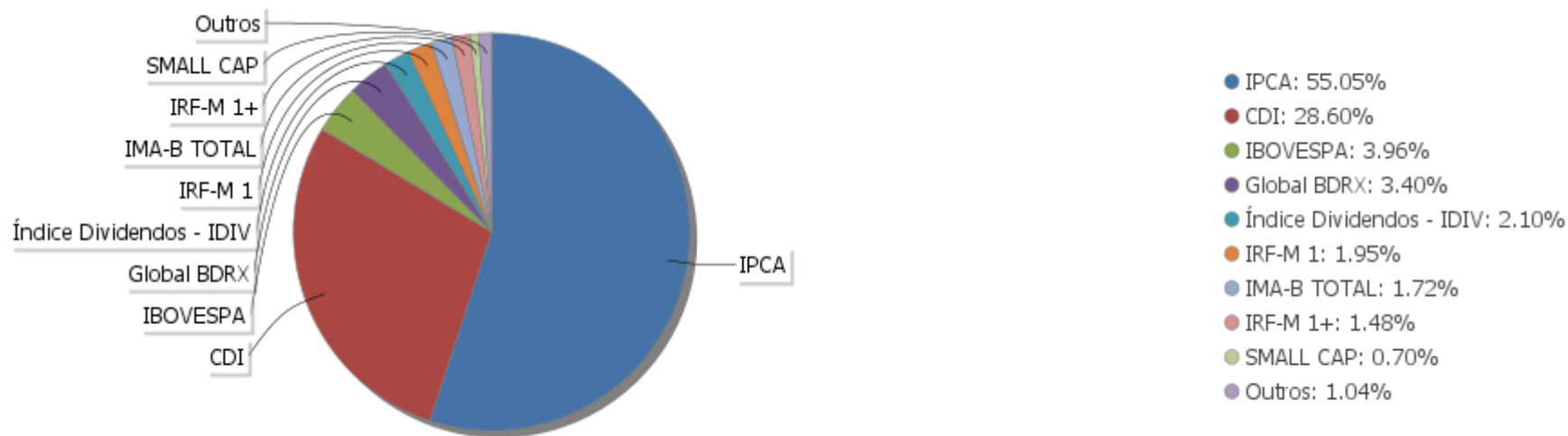
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	279.943.653,40	40,91	279.943.653,40	40,91	
de 31 dias a 365 dias	133.416.863,44	19,50	413.360.516,84	60,41	
acima de 365 dias	270.856.466,29	39,59	684.216.983,13	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

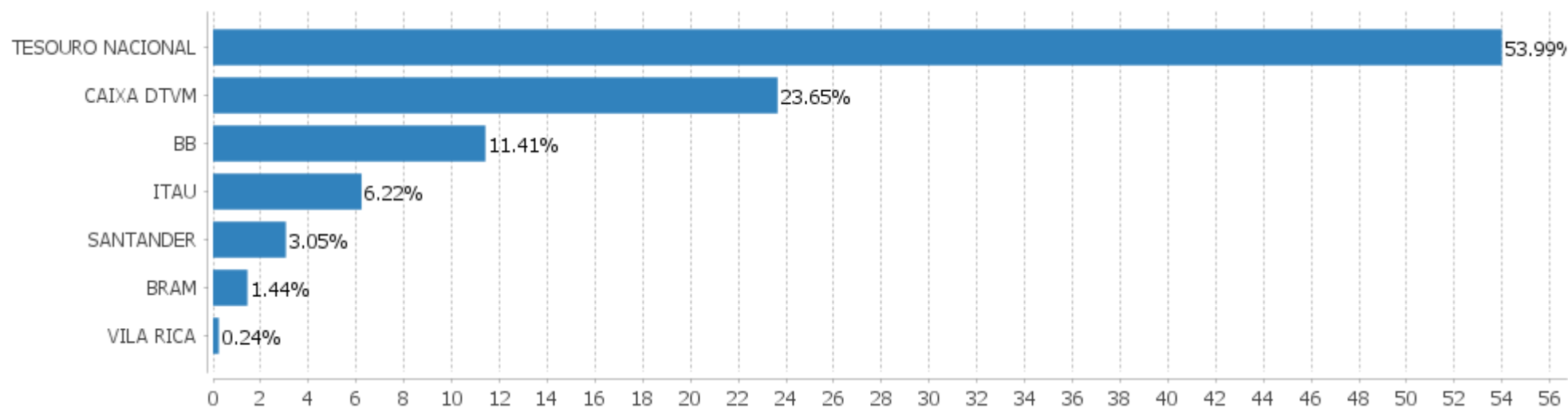


Alocação Por Estratégia



## 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	0,96	0,97	1,66	1,53	0,99	0,35	0,50	0,40			9,36
IPCA + 5,03%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68	0,65	0,65			8,06
p.p. indexador	0,79	-1,30	-0,20	0,00	1,00	1,20	0,46	-0,33	-0,15	-0,25			1,30
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	26	44,83
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	55,17

	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	1,26	2,00	-0,74	1,47
06 meses	5,55	3,55	2,00	1,71
12 meses	10,11	10,06	0,05	2,20
24 meses	16,59	23,13	-6,54	4,25
36 meses	20,64	43,74	-23,10	4,79
48 meses	19,18	58,13	-38,94	7,67
Desde 31/12/2018	35,61	70,39	-34,78	7,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

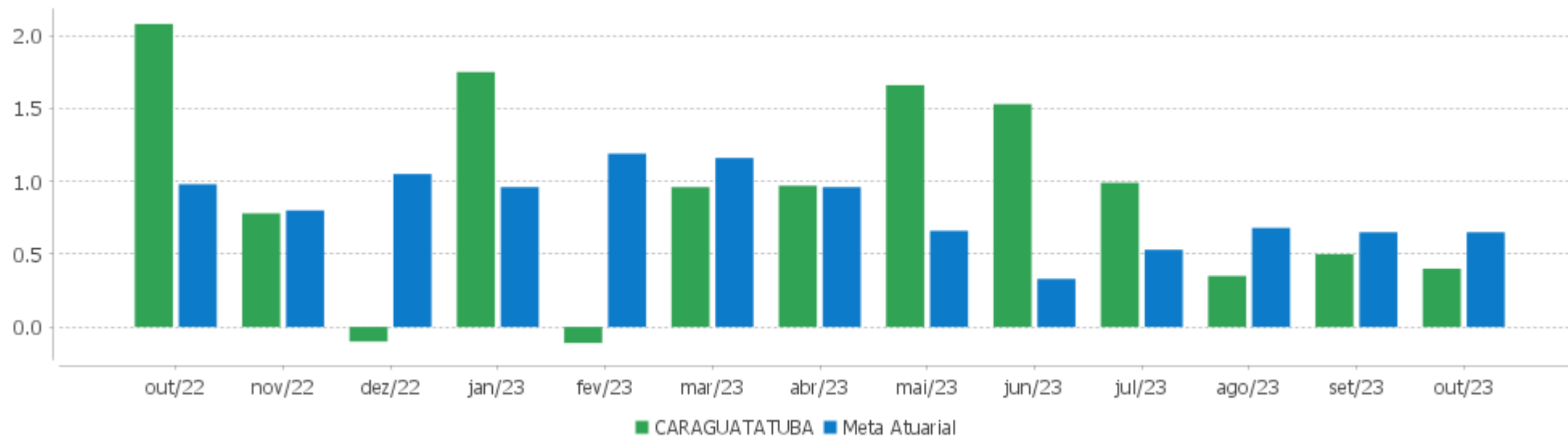


Patrimônio Líquido



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.	0,71 0,47	3,03 -0,72	-0,73 -1,46	1,30 0,30	5,07 0,25		
NTN-B 150525 (5,940000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	6,04 2,29	2,20 1,47	1,29 0,29	5,03 0,21		
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,45	8,84 5,09	2,11 1,38	4,09 3,09	10,92 6,10	21,67 10,06	33,96 10,45
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,46	8,92 5,17	2,13 1,40	4,14 3,14	11,02 6,20	25,33 13,73	38,10 14,59
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	8,97 5,22	2,15 1,41	4,17 3,17	11,08 6,26	21,94 10,33	34,29 10,77
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	9,02 5,27	2,16 1,43	4,20 3,20	11,14 6,32	22,10 10,50	34,59 11,08
NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,52	9,51 5,76	2,30 1,57	4,49 3,49	11,74 6,92	19,71 8,11	
NTN-B 150824 (6,680000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,54	9,80 6,05	2,38 1,65	4,65 3,65	12,09 7,28	20,46 8,86	
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,15 5,40	2,20 1,46	4,28 3,27	11,30 6,48	22,37 10,77	34,97 11,46
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,06 5,32	2,17 1,44	4,23 3,22	11,20 6,38	22,19 10,59	34,68 11,17
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	9,03 5,28	2,16 1,43	4,21 3,20	11,15 6,33	22,13 10,53	34,66 11,15
NTN-B 150824 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,50	9,29 5,54	2,24 1,51	4,36 3,35	11,48 6,66	19,22 7,62	
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,13 5,38	2,19 1,46	4,26 3,26	11,27 6,45	22,30 10,70	34,78 11,27
NTN-B 150824 (5,910000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,14 5,40	2,20 1,46	4,27 3,27	11,29 6,47	18,83 7,23	
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,09 5,34	2,18 1,45	4,24 3,24	11,23 6,41	22,24 10,64	34,82 11,31
NTN-B 150824 (6,440000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,52	9,59 5,84	2,32 1,59	4,54 3,53	11,84 7,02	19,95 8,35	
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,71	8,97	2,15	4,17	11,08	22,02	34,53

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.	0,47	5,22	1,41	3,17	6,26	10,42	11,02
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,15 5,40	2,20 1,46	4,27 3,27	11,30 6,48	22,39 10,79	34,99 11,48
NTN-B 150527 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,50	9,30 5,55	2,24 1,51	4,36 3,36	11,47 6,65	19,20 7,59	
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	9,06 5,31	2,17 1,44	4,22 3,22	11,19 6,37	22,21 10,61	34,76 11,25
NTN-B 150824 (6,990300%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,57	6,86 3,12	2,46 1,73	4,81 3,80	9,15 4,33		
NTN-B 150828 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,52	9,50 5,76	2,30 1,57	4,49 3,49	11,74 6,92	19,68 8,08	
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	9,01 5,26	2,16 1,43	4,19 3,19	11,13 6,31	22,09 10,49	34,61 11,10
NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,49	9,20 5,45	2,21 1,48	4,30 3,30	11,36 6,54	18,99 7,39	31,23 7,72
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	9,06 5,31	2,17 1,44	4,22 3,22	11,19 6,37	22,21 10,61	34,78 11,27
NTN-B 150824 (6,480000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,53	9,62 5,88	2,33 1,60	4,55 3,55	11,88 7,06	20,04 8,44	32,89 9,38
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	9,03 5,28	2,16 1,43	4,20 3,20	11,15 6,33	22,14 10,54	34,68 11,17
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	8,97 5,22	2,15 1,41	4,17 3,17	11,08 6,26	22,00 10,40	34,49 10,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,09 -0,03	12,66 -0,30	0,46 -0,10	6,89 -0,14	12,72 -0,44	25,93 -0,89	18,07 -1,27
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,93 -0,03	10,95 -0,17	3,01 -0,05	6,48 -0,12	13,27 -0,22	26,21 -0,34	28,23 -0,57
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,66 -0,01	9,92 -0,14	-1,98 -0,01	3,69 -0,06	8,75 -0,23	20,99 -0,41	22,90 -0,72
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,41 41,23	9,50 86,16	0,83 26,42	5,07 77,36	10,70 79,77	22,21 83,96	24,45 79,77
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,92 -0,03	10,82 -0,30	2,97 -0,09	6,45 -0,16	13,13 -0,36	25,83 -0,72	27,74 -1,06
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,26 0,02	10,64 6,90	1,30 0,56	6,24 5,23	12,00 7,18	24,61 13,01	24,98 1,47
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	-0,00	11,72	0,87	6,44	12,28		

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.	0,41	3,19	0,23	3,53	3,25		
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,97 97,12	10,91 98,95	3,11 98,77	6,51 99,31	13,24 98,66	26,21 99,08	30,39 99,14
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	200,33 20.081,98	192,00 1.741,64	236,79 7.531,73	241,16 3.681,50	193,29 1.440,62	283,96 1.073,51	267,90 873,94
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	1,06 106,47	11,40 103,41	3,45 109,84	7,09 108,28	13,86 103,33	27,84 105,24	32,83 107,10
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,92 -0,27	9,62 -0,44	-2,63 -0,67	3,42 -0,34	7,74 -1,23	19,61 -1,79	21,41 -2,21
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,99 99,06	10,95 99,36	3,15 100,06	6,60 100,68	13,35 99,46	26,71 100,98	31,23 101,88
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,02 101,94	11,21 101,66	3,32 105,49	6,91 105,45	13,65 101,76	27,03 102,18	31,73 103,52
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,99 99,35	11,24 101,94	3,26 103,75	6,97 106,34	13,64 101,62	27,19 102,77	31,84 103,87
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-5,07 -2,13	-4,56 -7,67	-11,92 -4,71	3,40 -4,94	-10,62 -8,13	2,28 -7,04	-1,62 -22,05
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-3,93 -1,00	1,34 -1,77	-8,80 -1,59	6,05 -2,29	-8,21 -5,72	6,92 -2,40	10,93 -9,49
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-4,29 -1,35	-8,29 -11,40	-9,21 -1,99	-1,31 -9,65	-14,59 -12,10	-4,03 -13,35	5,31 -15,12
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,01 0,14	6,51 -0,67	-5,85 -1,20	6,96 -0,60	0,57 -5,71	16,55 -7,23	29,25 -11,58
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-7,30 -4,36	-9,52 -12,63	-16,10 -8,89	-0,75 -9,10	-24,00 -21,51	-21,02 -30,33	
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-3,61 -0,11	1,59 -1,43	-7,80 -0,36	8,08 -0,78	-4,91 -1,56	5,72 -2,73	15,45 -4,13
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-3,41 -0,47	3,18 0,08	-6,39 0,83	6,19 -2,15	-3,58 -1,08	9,76 0,45	13,84 -6,58
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-7,66 -0,27	-13,35 -10,63	-19,20 -2,49	-2,92 -8,41	-24,59 -8,35	-20,02 -3,83	-15,57 -2,41
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-1,40 0,17	14,42 -0,97	-2,16 -0,29	6,20 -0,45	16,47 -1,90	-17,58 -1,45	10,07 -4,78
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP % do CDI	0,85 85,47	10,45 94,83	2,63 83,76	6,34 96,81	12,57 93,67	26,96 101,93	30,96 100,99
CARAGUATATUBA	0,40	9,36	1,26	5,55	10,11	16,59	20,64

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.	-0,25	1,30	-0,74	2,00	0,04	-6,50	-22,38
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00

## 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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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 CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		20,00
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	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
RPPS						
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 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	1,90
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		
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 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 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	0,96	11,12	3,06	6,61	13,48	26,55	28,80	34,03	43,59
IRF-M 1+	0,12	12,95	0,56	7,03	13,15	26,82	19,34	24,87	47,27
IRF-M TOTAL	0,37	12,04	1,31	6,68	12,95	26,45	22,28	27,70	46,46
IMA-B 5	-0,31	8,55	0,43	3,06	9,21	23,11	28,57	35,91	54,63
IMA-B 5+	-0,98	10,98	-4,11	3,97	8,37	19,37	18,16	11,25	52,40
IMA-B TOTAL	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40	23,62	22,38	55,11
IMA-GERAL TOTAL	0,30	10,92	1,11	5,71	11,71	24,89	26,20	29,58	48,76
IDKA 2	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65	28,32	36,96	53,47
IDKA 20	-1,16	13,95	-7,55	5,69	7,85	15,86	10,01	-4,59	48,02
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43	5,52	29,42
IBRX 100	-3,03	2,31	-7,11	8,24	-3,47	7,90	19,13	5,97	32,25
IBRX 50	-2,99	1,78	-6,48	8,57	-2,99	9,63	22,40	7,19	28,83
SMALL CAP	-7,40	-2,72	-16,71	5,49	-16,24	-16,19	-13,16	-18,52	16,44
Índice Consumo - ICON	-8,90	-13,22	-21,67	-1,55	-29,56	-40,09	-45,26	-46,32	-22,15
Índice Dividendos - IDIV	-3,15	7,18	-4,65	7,57	6,28	23,78	40,83	25,93	75,34

**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	-1,22	5,87	-2,52	1,73	4,20	-18,39	12,38	74,39	110,39

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,97	10,06	-1,30	10,41	5,49	17,94	14,06	13,03	40,73

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,10	1,94	-3,96	-1,70	4,45	-23,43	1,25	50,47	78,73

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,24	3,75	0,73	1,00	4,82	11,60	23,51	28,35	31,61
INPC	0,12	3,04	0,43	0,60	4,14	10,87	23,15	29,03	32,32
IGPM	0,50	-4,46	0,73	-3,74	-4,57	1,65	23,73	49,63	54,34
SELIC	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	7,18	1,74	3,04	9,00	20,69	38,87	50,04	59,99
IPCA + 5,00%	0,65	8,03	1,99	3,54	10,04	23,02	42,90	55,86	67,80
IPCA + 5,50%	0,69	8,46	2,11	3,79	10,56	24,19	44,94	58,84	71,82
IPCA + 5,89%	0,72	8,79	2,21	3,98	10,97	25,11	46,55	61,19	75,01
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00	61,85	75,91
INPC + 4,00%	0,45	6,44	1,44	2,62	8,29	19,90	38,47	50,83	60,87
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58	62,71	76,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150525 (5,940000%)	20.725.550,90	5,940000	20.637.485,75	6,252800	-88.065,15
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.579.996,00	5,980000	10.540.102,05	6,252800	-39.893,95
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.231.095,16	6,090000	5.217.300,68	6,180000	-13.794,48
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.263.541,99	5,560000	16.840.128,28	5,875700	-423.413,71
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.195.235,84	5,821000	20.108.840,35	5,875700	-86.395,49
NTN-B 150545 (5,710000%)	32.987.456,32	5,710000	32.078.110,03	5,952700	-909.346,29
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.968.981,36	5,760000	10.728.551,22	5,952700	-240.430,14
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.951.170,86	5,781000	10.737.154,71	5,952700	-214.016,15
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.927.960,70	5,815000	10.656.778,78	6,000700	-271.181,92
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.567.365,47	5,850000	10.357.190,63	6,000700	-210.174,84
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.538.002,57	5,892000	5.503.119,78	6,763200	-34.882,79
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.467.960,90	5,910000	10.403.616,56	6,763200	-64.344,34
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.231.604,78	6,090000	5.205.993,16	6,763200	-25.611,62
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.431.969,57	6,440000	20.384.560,04	6,763200	-47.409,53
NTN-B 150824 (6,480000%)	21.274.200,87	6,480000	21.229.906,19	6,763200	-44.294,68
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.246.807,51	6,680000	5.243.657,10	6,763200	-3.150,41
NTN-B 150824 (6,990300%)	30.340.846,26	6,990300	30.390.612,81	6,763200	49.766,55
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.270.568,63	6,350000	15.339.734,17	6,167000	69.165,54
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.268.903,79	6,350000	15.496.378,79	5,977300	227.475,00
NTN-B 150830 (5,708000%)	10.930.147,12	5,708000	10.833.436,41	5,875600	-96.710,71
NTN-B 150840 (5,650000%)	930.224,99	5,650000	903.098,10	5,940400	-27.126,89
NTN-B 150840 (5,770000%)	10.948.901,11	5,770000	10.760.859,10	5,940400	-188.042,01
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.002.490,25	5,713000	10.593.259,37	6,006200	-409.230,88
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.633.528,82	5,780000	10.327.795,83	6,006200	-305.732,99
NTN-B 150850 (5,815000%)	10.926.501,70	5,815000	10.660.678,68	6,006200	-265.823,02
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.921.753,18	5,916000	3.876.610,43	6,006200	-45.142,75
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.503.886,95	5,920000	10.391.001,43	6,006200	-112.885,52
NTN-B 150850 (5,970000%)	20.121.205,15	5,970000	20.031.963,03	6,006200	-89.242,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
203	03/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	2.946,31270900	2,9816183370
204	03/10/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	19.999.335,42	10.858.746,58772000	1,8417720000
205	04/10/2023	NTN-B 150850 (5,970000%)	19.999.335,41	0,00	4.754,00000000	4.206,8437968000
206	06/10/2023	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	873,98	0,00	20,43395513	42,7709660000
207	09/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	235.295,54	0,00	78.763,33877000	2,9873738680
208	10/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.803,51144100	2,9887625480
209	10/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	60.000,00	12.326,55246200	4,8675410000
210	20/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	15.582,26390023	2,9983736830
211	20/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	400.646,71952365	2,9983736830
212	20/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.261.335,30	0,00	872.550,00847700	4,8837720000
213	20/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	657.778,97	0,00	134.686,66637100	4,8837720000
214	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	6.170,80	1.261,00011200	4,8935760000
215	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.873.186,00	791.483,77382920	4,8935760000
216	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	32.836,33	0,00	6.710,08890000	4,8935760000
217	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	202.654,99	41.412,45379600	4,8935760000
218	27/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	105.871,21	0,00	21.624,62675100	4,8958630000
219	30/10/2023	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,00	10.000.000,00	8.832.143,35224000	1,1322280000
220	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.000.000,00	0,00	2.041.553,36896100	4,8982310000
221	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	8.500,00	1.735,32030800	4,8982310000
222	30/10/2023	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.952,71	0,00	0,46251104	4.221,9748760000
<b>Total</b>			<b>36.560.453,29</b>	<b>34.149.847,21</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.204.898,41

Value-At-Risk: 0,61%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		0,61		0,61			684.216.983,13	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,10%

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%)		0,05	-0,00	0,06			20.725.550,90	3,03
NTN-B 150525 (5,980000%)		0,05	-0,00	0,06			10.579.996,00	1,55
NTN-B 150527 (6,090000%)		0,05	-0,00	0,06			5.231.095,16	0,76
NTN-B 150535 (5,560000%)		0,05	-0,00	0,06			17.263.541,99	2,52
NTN-B 150535 (5,821000%)		0,05	-0,00	0,06			20.195.235,84	2,95
NTN-B 150545 (5,710000%)		0,05	-0,00	0,06			32.987.456,32	4,82
NTN-B 150545 (5,760000%)		0,05	-0,00	0,06			10.968.981,36	1,60
NTN-B 150545 (5,781000%)		0,05	-0,00	0,06			10.951.170,86	1,60
NTN-B 150555 (5,815000%)		0,05	-0,00	0,06			10.927.960,70	1,60
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,10	-0,00	0,09			10.567.365,47	1,54
NTN-B 150824 (5,892000%)		0,05	-0,00	0,06			5.538.002,57	0,81
NTN-B 150824 (5,910000%)		0,05	-0,00	0,06			10.467.960,90	1,53
NTN-B 150824 (6,090000%)		0,05	0,00	0,06			5.231.604,78	0,76
NTN-B 150824 (6,440000%)		0,05	-0,00	0,06			20.431.969,57	2,99
NTN-B 150824 (6,480000%)		0,05	-0,00	0,06			21.274.200,87	3,11
NTN-B 150824 (6,680000%)		0,05	-0,00	0,06			5.246.807,51	0,77
NTN-B 150824 (6,990300%)		0,05	-0,00	0,06			30.340.846,26	4,43
NTN-B 150826 (6,350000%)		0,05	-0,00	0,06			15.270.568,63	2,23
NTN-B 150828 (6,350000%)		0,06	-0,00	0,06			15.268.903,79	2,23
NTN-B 150830 (5,708000%)		0,05	-0,00	0,06			10.930.147,12	1,60

## 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 150840 (5,650000%)		0,05	-0,00	0,06			930.224,99	0,14
NTN-B 150840 (5,770000%)		0,05	-0,00	0,06			10.948.901,11	1,60
NTN-B 150850 (5,713000%)		0,05	-0,00	0,06			11.002.490,25	1,61
NTN-B 150850 (5,780000%)		0,05	-0,00	0,06			10.633.528,82	1,55
NTN-B 150850 (5,815000%)		0,05	-0,00	0,06			10.926.501,70	1,60
NTN-B 150850 (5,916000%)		0,05	-0,00	0,06			3.921.753,18	0,57
NTN-B 150850 (5,920000%)		0,10	-0,00	0,09			10.503.886,95	1,54
NTN-B 150850 (5,970000%)		0,19	0,00	0,20			20.121.205,15	2,94
<b>Sub-total</b>	0,19	0,05	0,00		-1,38	0,73	369.387.858,75	53,99

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
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO		1,67	0,00	0,90			2.443.297,96	0,36
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,02	0,00	0,02			20.229.970,95	2,96
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,12	-0,00	0,18			466.317,70	0,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,13	0,00	0,01			12.867.717,96	1,88
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,00	0,01	0,03			4.931.770,84	0,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,85	0,02	0,02			10.094.311,87	1,48
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,84	0,00	0,85			7.244.802,86	1,06
SANTANDER RF ATIVO FIC		1,14	0,00	1,14			626.162,57	0,09
<b>Sub-total</b>	2,32	0,66	0,03		-0,23	0,46	58.904.352,71	8,61

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
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,17	0,01	0,21			6.852.514,06	1,00
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	0,00	0,02			54.449.353,70	7,96
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,05	-0,00	0,05			21.866.024,54	3,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			59.041.042,53	8,63
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI			0,04	0,04			16.820.170,41	2,46
	0,32	0,10	0,01		-0,25	0,92	159.029.105,24	23,24

**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
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

**Sub-total**

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		5,61	0,00	5,61			1.656.737,00	0,24
<b>Sub-total</b>	380,95	5,61	0,00		0,52	200,33	1.656.737,00	0,24

**Renda Variável**

Value-At-Risk: 7,35%

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		6,56	0,01	1,73			1.487.105,77	0,22
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		9,54	0,06	2,76			4.819.736,13	0,70
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		7,81	0,05	0,38			4.703.875,48	0,69
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		7,67	0,07	1,34			7.181.789,38	1,05
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,58	0,12	1,35			14.359.271,35	2,10
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,46	0,04	2,71			5.581.082,67	0,82
BRADESCO F I A SELECTION		7,78	0,05	2,63			5.062.819,75	0,74
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,20	0,09	4,24			7.763.327,58	1,13
<b>Sub-total</b>	16,43	7,35	0,51		-0,35	-4,68	50.959.008,11	7,45

**Investimentos no Exterior**

Value-At-Risk: 6,90%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,90	0,06	0,71			23.271.664,67	3,40
<b>Sub-total</b>	16,49	6,90	0,06		-0,15	-1,40	23.271.664,67	3,40

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 0,15%

Artigo 10º I



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 JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP		0,15	0,00	0,15			21.008.256,65	3,07
<b>Sub-total</b>	0,30	0,15	0,00		-0,48	0,85	21.008.256,65	3,07

(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 (%)