



LDB
EMPRESAS

CARAGUATATUBA
NOVEMBRO 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 30.11.2023.

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

87,54%

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%)	2,92	0,04	0,70	4,35	20.272.511,38	2,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,33	0,04	0,70	9,97	10.348.862,51	1,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,33	0,03	0,71	10,07	5.116.796,31	0,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,33	0,04	0,67	9,57	16.898.357,04	2,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,33	0,04	0,69	9,82	19.760.250,92	2,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,33	0,04	0,68	9,72	32.292.724,98	4,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,33	0,04	0,69	9,76	10.736.609,17	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,33	0,04	0,69	9,78	10.718.600,09	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,33	0,04	0,69	9,81	10.696.236,59	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,36	0,01	0,69	9,85	10.342.087,32	1,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,33	0,04	0,70	9,89	5.576.652,12	0,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	0,50	0,04	0,70	9,91	10.541.179,12	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	0,50	0,04	0,71	10,07	5.268.880,42	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	0,33	0,04	0,74	9,11	20.583.033,60	2,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	0,33	0,04	0,74	10,44	21.432.003,33	3,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,680000%)	0,54	0,04	0,76	10,63	5.286.537,49	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,990300%)	2,97	0,04	0,78	4,96	30.577.630,54	4,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	0,33	0,03	0,73	8,77	15.382.450,74	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	0,34	0,03	0,73	8,77	15.380.762,51	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,33	0,04	0,68	9,71	11.004.907,14	1,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,33	0,04	0,68	9,66	936.546,82	0,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,33	0,04	0,69	9,77	11.024.293,81	1,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,33	0,04	0,68	9,72	11.077.779,70	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,33	0,04	0,69	9,78	10.706.839,20	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,33	0,04	0,69	9,81	11.002.118,12	1,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,33	0,04	0,70	9,91	3.949.194,69	0,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,36	0,01	0,70	9,91	10.577.432,79	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,970000%)	4,11	0,02	0,70	1,32	20.262.836,72	2,90
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,33	0,03	0,71	9,99	367.754.115,17	52,63

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	3,35	0,18	2,78	7,20	2.511.280,63	0,36	216.226.550,03	1,16
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM	0,04	0,05	0,89	8,35	20.410.738,69	2,92	7.354.811.380,37	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	0,35	0,05	0,98	12,04	471.701,30	0,07	446.852.437,88	0,11
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,36	0,05	0,97	11,89	12.992.229,31	1,86	7.341.410.946,33	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,62	0,13	2,61	1,21	5.060.403,83	0,72	5.111.389.321,24	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	0,14	3,14	4,12	10.411.700,81	1,49	1.641.347.327,61	0,63
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,07	1,43	12,23	7.348.755,19	1,05	5.184.189.770,00	0,14
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,84	0,09	1,98	3,61	638.558,62	0,09	296.011.153,80	0,22
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,20	0,08	1,60	11,46	59.845.368,38	8,56		
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	4,90	0,17	2,59	0,43	7.029.882,85	1,01	475.966.166,26	1,48
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	0,97	12,28	70.219.385,35	10,05	14.627.876.402,56	0,48
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,05	0,99	12,50	22.366.097,19	3,20	5.804.446.423,32	0,39
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,91	11,97	66.047.804,27	9,45	15.351.200.547,79	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,05	0,99	11,28	16.985.997,81	2,43	5.804.930.459,21	0,29
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,17	0,05	1,02	11,91	182.649.167,47	26,14		
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	112,06	0,00	6,37	266,19	1.482.486,01	0,21	56.027.774,26	2,65
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			112,06	0,00	6,37	266,19	1.482.486,01	0,21		
Renda Fixa			0,34	0,04	0,90	10,84	611.731.137,03	87,54		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

7,37%

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	15,99	0,88	10,59	14,11	1.644.546,67	0,24	591.092.005,35	0,28
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	22,47	0,71	12,94	-2,14	5.443.289,99	0,78	739.225.645,67	0,74
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	17,79	0,00	10,12	11,87	0,00	0,00	796.131.839,92	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	18,01	1,11	12,42	13,93	8.073.690,92	1,16	676.669.722,78	1,19
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	15,17	0,99	9,68	16,83	15.749.439,49	2,25	962.555.775,71	1,64
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	16,25	0,61	13,20	3,81	6.317.954,02	0,90	1.353.294.943,21	0,47
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	17,40	1,27	10,94	5,88	5.616.709,88	0,80	429.344.563,75	1,31
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	20,38	0,75	11,59	0,97	8.663.371,91	1,24	153.261.972,93	5,65
Sub-total Artigo 8º I			17,26	0,92	11,36	8,96	51.509.002,88	7,37		
Renda Variável			17,26	0,92	11,36	8,96	51.509.002,88	7,37		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,05%

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	16,34	0,20	6,42	21,77	14.313.616,36	2,05	1.957.059.984,27	0,73
Sub-total Artigo 9º III			16,34	0,20	6,42	21,77	14.313.616,36	2,05		
Investimentos no Exterior			16,09	0,20	6,42	21,75	14.313.616,36	2,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,04%

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	0,41	0,06	0,95	10,39	21.208.275,85	3,04	1.350.857.847,39	1,57
Sub-total Artigo 10º I			0,41	0,06	0,95	17,45	21.208.275,85	3,04		
Investimentos Estruturados			6,87	0,06	0,95	17,45	21.208.275,85	3,04		
Total			1,93	0,11	1,81	11,34	698.762.032,12	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
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	367.754.115,17	52,63	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	59.845.368,38	8,56	0,00	17,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	182.649.167,47	26,14	0,00	18,63	60,00	0,00	75,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.482.486,01	0,21	0,00	0,07	5,00	0,00	15,00
	Total Renda Fixa	611.731.137,03	87,54					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	51.509.002,88	7,37	0,00	7,00	30,00	0,00	45,00
	Total Renda Variável	51.509.002,88	7,37					45,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	14.313.616,36	2,05	0,00	3,80	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	14.313.616,36	2,05					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	21.208.275,85	3,04	0,00	3,50	10,00	0,00	15,00
	Total Investimentos Estruturados	21.208.275,85	3,04					20,00
Total		698.762.032,12	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	0,71 77,30	9,99 82,95	2,17 74,53	3,96 62,49	10,94 82,25	2.604.908,20	32.887.748,15
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,60 173,92	11,46 95,20	2,48 85,09	5,73 90,52	12,51 94,05	940.209,79	4.947.108,98
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,02 111,01	11,91 98,92	2,86 98,11	6,33 99,96	13,18 99,09	1.749.185,24	15.871.232,67
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	6,37 694,55	266,19 2.210,30	257,06 8.809,63	261,59 4.129,92	211,56 1.590,43	105.607,37	1.281.080,48
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	11,36 -1,18	8,96 -7,07	5,96 -4,06	11,03 -6,51	6,17 -7,02	5.730.067,77	6.036.691,37
Artigo 9º II % do CDI	0,00 0,00	6,13 50,93	0,00 0,00	0,00 0,00	2,16 16,24	0,00	160.631,81
Artigo 9º III % do CDI	6,42 699,58	21,77 180,76	1,18 40,45	6,82 107,65	15,93 119,78	1.041.951,69	5.616.881,85
Artigo 10º I % do CDI	0,95 103,74	17,45 144,90	2,68 91,99	5,92 93,43	11,80 88,69	200.019,20	2.999.348,79
CARAGUATATUBA (Total)						12.371.949,26	69.800.724,10

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%)	20.725.550,90	0,00	0,00	596.210,29	20.272.511,38	143.170,77	867.466,39
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.579.996,00	0,00	0,00	304.500,14	10.348.862,51	73.366,65	979.617,78
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.231.095,16	0,00	0,00	151.020,26	5.116.796,31	36.721,41	489.218,42
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.263.541,99	0,00	0,00	479.624,62	16.898.357,04	114.439,67	1.540.115,32
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.195.235,84	0,00	0,00	572.720,98	19.760.250,92	137.736,06	1.844.556,39
NTN-B 150545 (5,710000%)	32.987.456,32	0,00	0,00	917.066,86	32.292.724,98	222.335,52	2.982.696,99
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.968.981,36	0,00	0,00	306.713,79	10.736.609,17	74.341,60	996.293,55
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.951.170,86	0,00	0,00	306.959,75	10.718.600,09	74.388,98	996.569,24
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.927.960,70	0,00	0,00	306.221,87	10.696.236,59	74.497,76	997.416,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.567.365,47	0,00	0,00	297.613,22	10.342.087,32	72.335,07	967.716,32
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.538.002,57	0,00	0,00	0,00	5.576.652,12	38.649,55	515.061,25
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.467.960,90	0,00	0,00	0,00	10.541.179,12	73.218,22	975.358,02
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.231.604,78	0,00	0,00	0,00	5.268.880,42	37.275,64	494.820,04
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.431.969,57	0,00	0,00	0,00	20.583.033,60	151.064,03	1.757.223,76
NTN-B 150824 (6,480000%)	21.274.200,87	0,00	0,00	0,00	21.432.003,33	157.802,46	2.079.106,54
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.246.807,51	0,00	0,00	0,00	5.286.537,49	39.729,98	521.431,83
NTN-B 150824 (6,990300%)	30.340.846,26	0,00	0,00	0,00	30.577.630,54	236.784,28	1.462.851,01
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.270.568,63	0,00	0,00	0,00	15.382.450,74	111.882,11	1.266.139,12
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.268.903,79	0,00	0,00	0,00	15.380.762,51	111.858,72	1.266.125,36
NTN-B 150830 (5,708000%)	10.930.147,12	0,00	0,00	0,00	11.004.907,14	74.760,02	999.787,25
NTN-B 150840 (5,650000%)	930.224,99	0,00	0,00	0,00	936.546,82	6.321,83	84.605,14
NTN-B 150840 (5,770000%)	10.948.901,11	0,00	0,00	0,00	11.024.293,81	75.392,70	1.006.818,63
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.002.490,25	0,00	0,00	0,00	11.077.779,70	75.289,45	1.006.274,01
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.633.528,82	0,00	0,00	0,00	10.706.839,20	73.310,38	978.546,04
NTN-B 150850 (5,815000%)	10.926.501,70	0,00	0,00	0,00	11.002.118,12	75.616,42	1.008.732,13
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.921.753,18	0,00	0,00	0,00	3.949.194,69	27.441,51	365.394,13
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.503.886,95	0,00	0,00	0,00	10.577.432,79	73.545,84	979.187,23
NTN-B 150850 (5,970000%)	20.121.205,15	0,00	0,00	0,00	20.262.836,72	141.631,57	263.501,31
	369.387.858,75	0,00	0,00	4.238.651,78	367.754.115,17	2.604.908,20	

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	12.867.717,96	0,00	0,00	0,00	12.992.229,31	124.511,35	1.380.849,16
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.931.770,84	0,00	0,00	0,00	5.060.403,83	128.632,99	60.403,83
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	10.094.311,87	0,00	0,00	0,00	10.411.700,81	317.388,94	411.700,81
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	7.244.802,86	0,00	0,00	0,00	7.348.755,19	103.952,33	977.815,01
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.443.297,96	0,00	0,00	0,00	2.511.280,63	67.982,67	316.734,17
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	466.317,70	805,88	0,00	0,00	471.701,30	4.577,72	50.183,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER RF ATIVO FIC	626.162,57	0,00	0,00	0,00	638.558,62	12.396,05	22.254,48
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	20.229.970,95	0,00	0,00	0,00	20.410.738,69	180.767,74	1.556.822,09
	58.904.352,71	805,88	0,00	0,00	59.845.368,38	940.209,79	

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	59.041.042,53	6.445.246,84	0,00	0,00	66.047.804,27	561.514,90	4.369.044,43
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	16.820.170,41	0,00	0,00	0,00	16.985.997,81	165.827,40	1.985.997,81
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	54.449.353,70	19.368.787,36	-4.224.968,28	0,00	70.219.385,35	626.212,57	5.827.766,30
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	21.866.024,54	281.811,07	0,00	0,00	22.366.097,19	218.261,58	3.188.199,06
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6.852.514,06	0,00	0,00	0,00	7.029.882,85	177.368,79	29.918,02
	159.029.105,24	26.095.845,27	-4.224.968,28	0,00	182.649.167,47	1.749.185,24	

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	1.656.737,00	0,00	0,00	279.858,36	1.482.486,01	105.607,37	1.281.080,48
	1.656.737,00	0,00	0,00	279.858,36	1.482.486,01	105.607,37	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.487.105,77	0,00	0,00	0,00	1.644.546,67	157.440,90	203.331,98
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	4.703.875,48	0,00	-5.180.073,00	0,00	0,00	476.197,52	2.014.103,57
BRADERCO F I A SELECTION	5.062.819,75	0,00	0,00	0,00	5.616.709,88	553.890,13	311.882,41
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	4.819.736,13	0,00	0,00	0,00	5.443.289,99	623.553,86	-118.779,48
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.181.789,38	0,00	0,00	0,00	8.073.690,92	891.901,54	986.877,04
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	14.359.271,35	0,00	0,00	0,00	15.749.439,49	1.390.168,14	2.268.441,14
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.581.082,67	0,00	0,00	0,00	6.317.954,02	736.871,35	232.055,41
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	7.763.327,58	0,00	0,00	0,00	8.663.371,91	900.044,33	83.298,62
	50.959.008,11	0,00	-5.180.073,00	0,00	51.509.002,88	5.730.067,77	

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	23.271.664,67	0,00	-10.000.000,00	0,00	14.313.616,36	1.041.951,69	5.616.881,85
	23.271.664,67	0,00	-10.000.000,00	0,00	14.313.616,36	1.041.951,69	

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	21.008.256,65	0,00	0,00	0,00	21.208.275,85	200.019,20	1.873.270,45
	21.008.256,65	0,00	0,00	0,00	21.208.275,85	200.019,20	

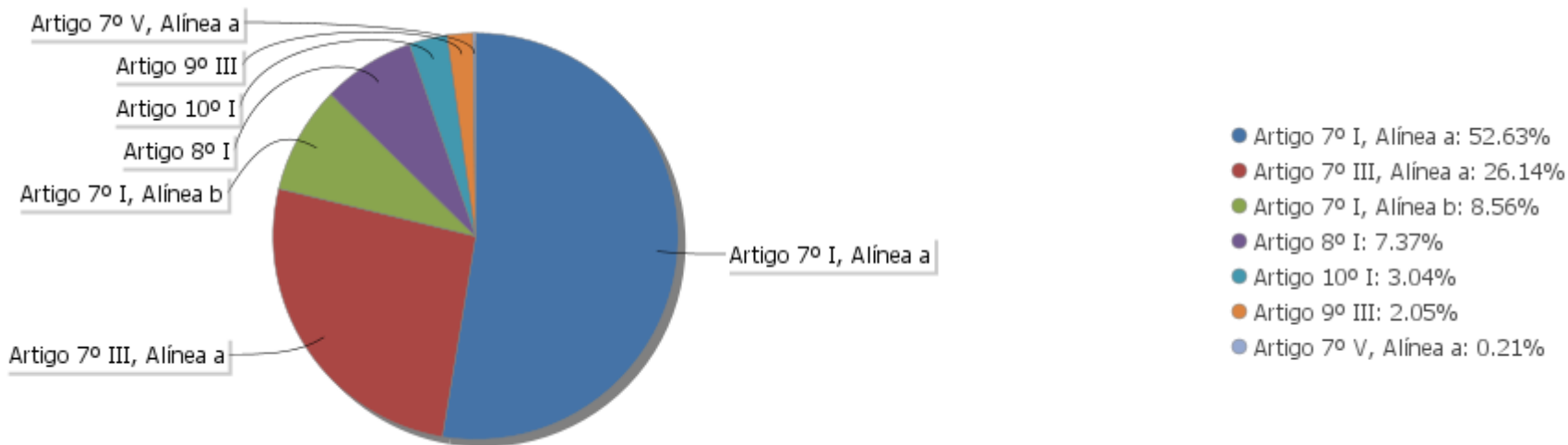
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

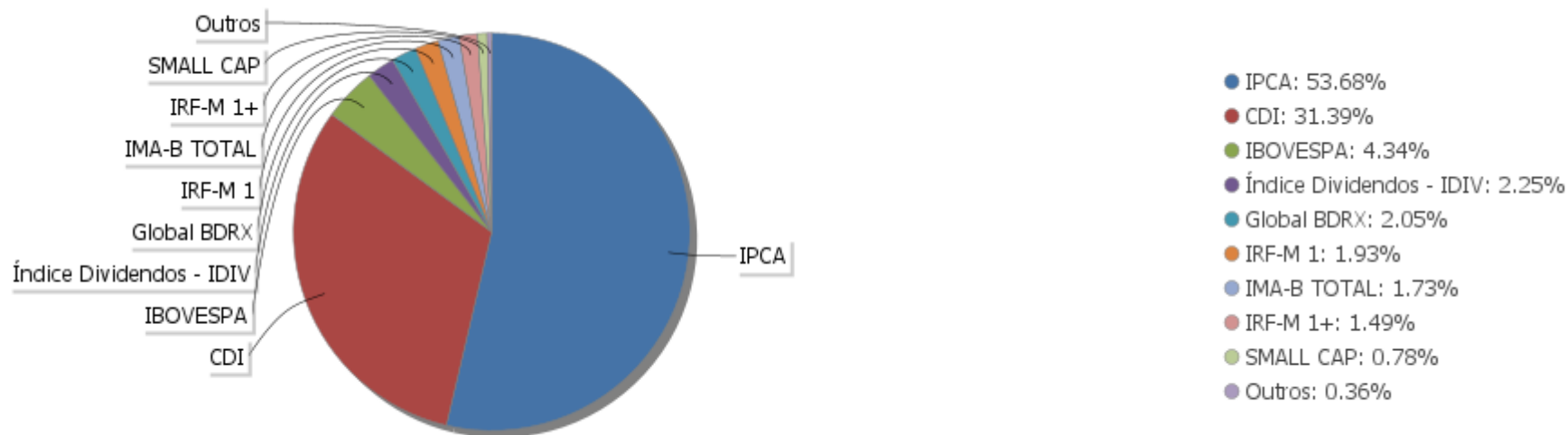
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	292.203.460,61	41,82	292.203.460,61	41,82	
de 31 dias a 365 dias	138.070.372,96	19,76	430.273.833,57	61,58	
acima de 365 dias	268.488.198,55	38,42	698.762.032,12	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

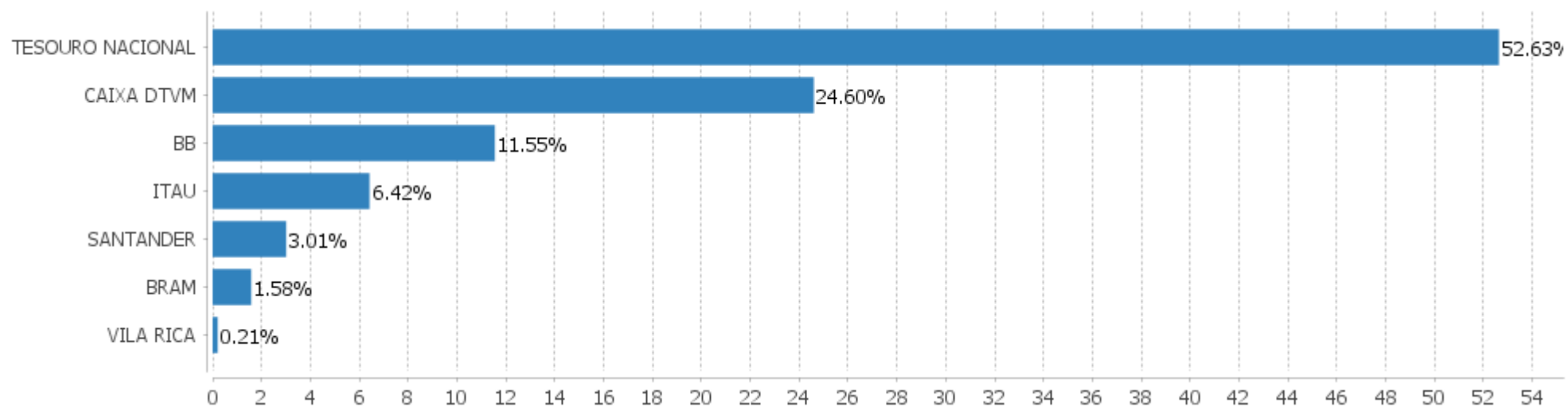


Alocação Por Estratégia



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	1,81		11,34
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		8,78
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		2,56
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	27	45,76
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	54,24

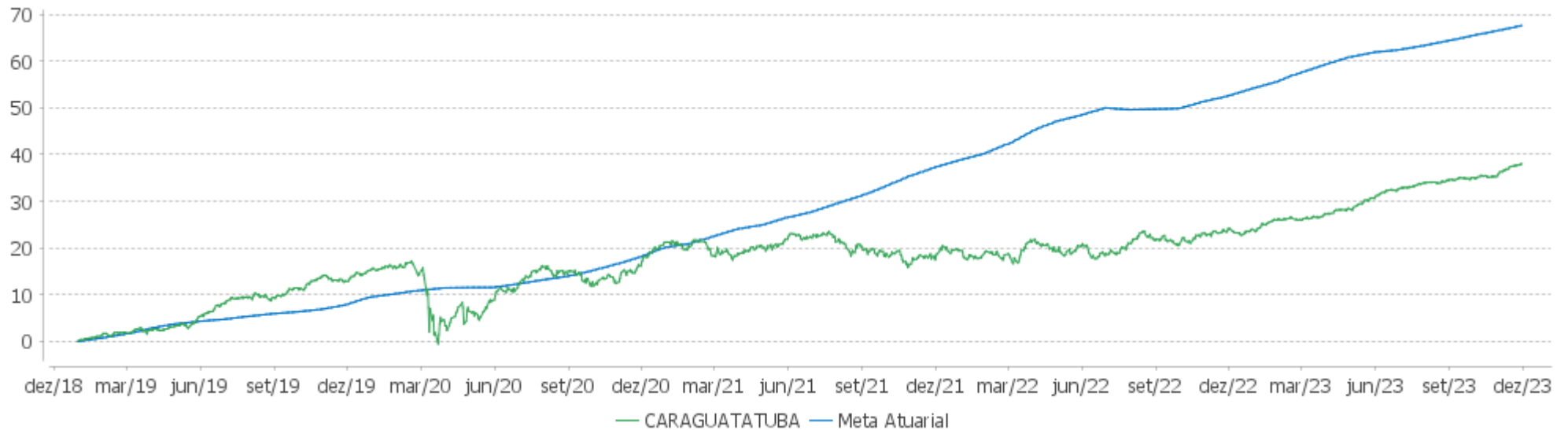
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,73	1,99	0,75	1,64
06 meses	5,70	3,56	2,14	1,55
12 meses	11,23	9,92	1,31	1,93
24 meses	17,09	22,27	-5,18	4,06
36 meses	18,91	42,78	-23,87	4,70
48 meses	22,29	57,65	-35,36	7,66
Desde 31/12/2018	38,06	71,53	-33,47	7,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

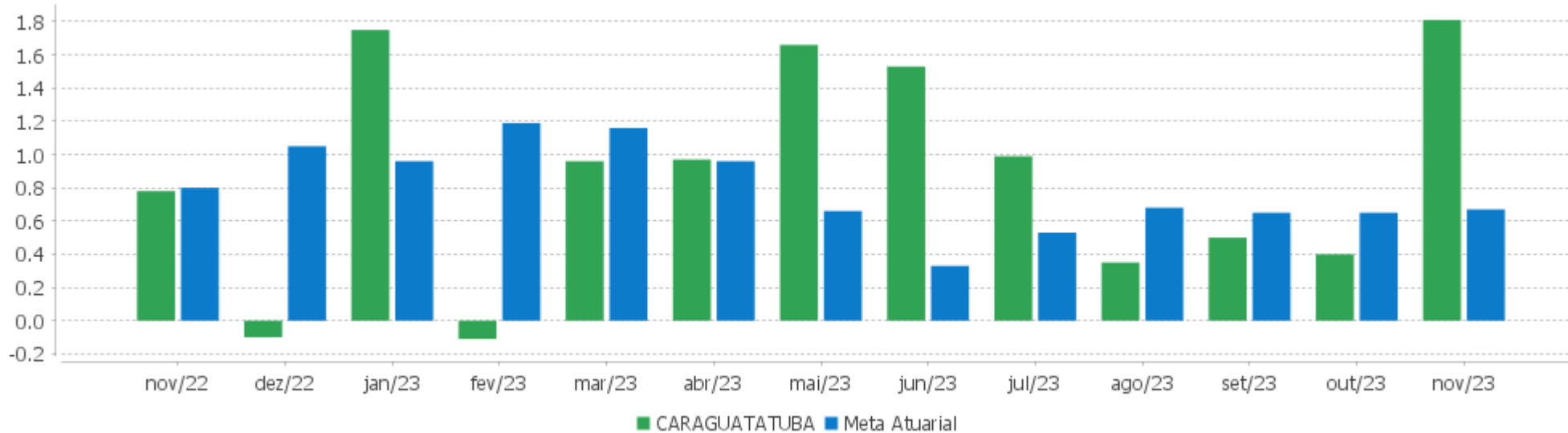


Patrimônio Líquido



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.	0,70 0,42	3,76 -0,28	2,14 1,36	0,93 -0,12	4,66 -0,02		
NTN-B 150525 (5,940000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	6,78 2,74	2,15 1,37	3,90 2,85	7,71 3,02		
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,39	9,57 5,54	2,06 1,28	3,72 2,66	10,49 5,81	23,87 13,01	36,99 14,22
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,40	9,66 5,62	2,08 1,30	3,76 2,71	10,59 5,90	24,08 13,22	37,33 14,56
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,40	9,71 5,68	2,10 1,31	3,79 2,74	10,65 5,96	20,72 9,86	33,54 10,77
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,41	9,77 5,73	2,11 1,33	3,82 2,77	10,71 6,03	20,89 10,03	33,84 11,08
NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,45	10,31 6,27	2,25 1,46	4,11 3,05	11,31 6,62	18,52 7,66	
NTN-B 150824 (6,680000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,48	10,63 6,59	2,32 1,54	4,27 3,21	11,66 6,98	19,26 8,40	
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,91 5,88	2,15 1,36	3,90 2,84	10,87 6,18	21,15 10,29	34,22 11,45
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,41	9,82 5,78	2,12 1,34	3,85 2,79	10,76 6,08	24,48 13,62	37,82 15,05
NTN-B 150824 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,43	10,07 6,03	2,19 1,41	3,98 2,92	11,04 6,36	18,03 7,17	
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,41	9,78 5,74	2,11 1,33	3,83 2,77	10,72 6,04	24,39 13,53	37,75 14,98
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,89 5,85	2,14 1,36	3,88 2,83	10,84 6,15	21,08 10,22	34,03 11,27
NTN-B 150824 (6,440000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,46	10,40 6,36	2,27 1,48	4,15 3,10	11,41 6,72	18,76 7,90	
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,41	9,85 5,81	2,13 1,35	3,86 2,81	10,80 6,11	24,52 13,66	37,94 15,17
NTN-B 150824 (5,910000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,91 5,87	2,14 1,36	3,89 2,84	10,86 6,18	17,65 6,79	
NTN-B 150850 (5,916000%)	0,70	9,91	2,14	3,89	10,86	21,17	34,24

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.	0,42	5,87	1,36	2,84	6,18	10,31	11,48
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,68	9,72	2,10	3,79	10,65	20,80	33,78
Var. IPCA p.p.	0,40	5,68	1,31	2,74	5,97	9,94	11,02
NTN-B 150527 (6,090000%)	0,71	10,07	2,17	3,98	11,05	21,51	
Var. IPCA p.p.	0,43	6,04	1,39	2,92	6,36	10,65	
NTN-B 150824 (6,990300%)	0,78	7,70	2,39	4,42	8,73		
Var. IPCA p.p.	0,50	3,66	1,61	3,36	4,05		
NTN-B 150850 (5,815000%)	0,69	9,81	2,12	3,84	10,76	20,99	34,01
Var. IPCA p.p.	0,41	5,78	1,34	2,79	6,07	10,13	11,25
NTN-B 150828 (6,350000%)	0,73	10,31	2,25	4,11	11,30	18,49	
Var. IPCA p.p.	0,45	6,27	1,46	3,05	6,62	7,63	
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,69	9,76	2,11	3,82	10,70	24,34	37,69
Var. IPCA p.p.	0,41	5,72	1,33	2,76	6,02	13,48	14,92
NTN-B 150525 (5,980000%)	0,70	9,97	2,16	3,92	10,93	21,28	34,35
Var. IPCA p.p.	0,42	5,93	1,38	2,87	6,24	10,42	11,58
NTN-B 150555 (5,815000%)	0,69	9,81	2,12	3,84	10,76	24,47	37,88
Var. IPCA p.p.	0,41	5,78	1,34	2,79	6,07	13,61	15,11
NTN-B 150824 (6,480000%)	0,74	10,44	2,27	4,17	11,45	18,84	32,15
Var. IPCA p.p.	0,46	6,40	1,49	3,11	6,76	7,98	9,39
NTN-B 150850 (5,780000%)	0,69	9,78	2,11	3,83	10,72	20,93	33,94
Var. IPCA p.p.	0,41	5,74	1,33	2,77	6,04	10,07	11,17
NTN-B 150545 (5,710000%)	0,68	9,72	2,10	3,79	10,65	24,22	37,54
Var. IPCA p.p.	0,40	5,68	1,31	2,74	5,97	13,36	14,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,14	16,20	3,06	7,20	18,03	27,10	21,26
Var. IRF-M 1+ p.p.	0,00	-0,30	-0,05	-0,13	-0,36	-0,89	-1,26
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,98	12,04	2,83	6,34	13,33	26,36	29,25
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,19	-0,08	-0,11	-0,22	-0,46	-0,54
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,61	12,78	0,95	3,77	12,52	20,02	23,64
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,17	-0,04	-0,08	-0,21	-0,39	-0,73
SANTANDER RF ATIVO FIC	1,98	11,67	2,59	5,49	12,65	22,97	26,74
% do CDI	215,71	96,87	88,77	86,60	95,07	85,48	84,47
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,43	12,23	2,11	5,85	13,51	25,26	25,74
Var. IPCA p.p.	1,15	8,19	1,32	4,80	8,83	14,40	2,98
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,97	11,89	2,82	6,29	13,19	26,07	28,72
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,33	-0,09	-0,17	-0,36	-0,74	-1,07
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2,78	14,83	2,83	6,95	17,01		

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.	0,95	4,31	1,12	2,45	5,12		
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,89 97,36	11,90 98,81	2,86 97,92	6,25 98,69	13,12 98,66	26,60 99,01	31,45 99,34
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	6,37 694,55	210,62 1.748,84	257,06 8.809,63	261,59 4.129,92	211,56 1.590,43	307,23 1.143,50	292,02 922,48
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,99 107,74	12,50 103,81	3,13 107,43	6,91 109,11	13,77 103,53	28,30 105,31	33,94 107,22
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,59 -0,04	12,46 -0,49	0,36 -0,63	3,24 -0,61	12,18 -0,55	18,11 -2,30	22,02 -2,36
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,91 99,64	11,97 99,37	2,90 99,39	6,35 100,19	13,22 99,42	27,07 100,75	32,22 101,79
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,97 105,33	12,28 101,98	3,04 104,19	6,68 105,50	13,57 102,04	27,46 102,21	32,80 103,62
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,99 107,42	12,34 102,42	3,03 103,69	6,70 105,72	13,60 102,27	27,62 102,80	32,92 103,99
BRANCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	10,94 -1,60	5,88 -10,16	4,31 -5,71	8,33 -9,21	3,15 -10,05	15,74 -9,20	0,87 -16,06
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	12,42 -0,12	13,93 -2,11	8,08 -1,93	14,96 -2,57	9,98 -3,22	19,44 -5,50	10,40 -6,53
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	13,20 0,66	3,81 -12,22	8,13 -1,88	11,02 -6,51	5,68 -7,52	10,23 -14,70	6,17 -10,76
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	9,68 -1,01	16,83 -1,82	6,95 -1,68	14,67 -3,41	13,99 -2,74	26,34 -9,46	24,07 -12,20
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	11,59 -0,95	0,97 -15,06	2,87 -7,14	5,48 -12,05	-3,88 -17,08	-8,69 -33,62	
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	10,59 -1,95	14,11 -1,93	8,04 -1,98	14,76 -2,77	11,73 -1,47	23,66 -1,28	10,81 -6,12
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	12,16 -0,13	13,94 -1,73	9,08 -0,30	16,47 -0,84	10,95 -1,75	20,71 -3,20	12,27 -3,95
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	12,94 0,47	-2,14 -11,54	1,70 0,52	-0,01 -4,50	-4,69 -10,81	-6,71 -3,17	-12,07 4,19
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	6,42 -0,04	21,77 -1,07	1,18 0,02	6,82 -0,39	15,93 -1,73	-11,50 -1,39	14,35 -4,87
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP % do CDI	0,95 103,74	11,51 95,54	2,68 91,99	5,92 93,43	12,80 96,26	27,50 102,36	32,00 101,08
CARAGUATATUBA	1,81	11,34	2,73	5,70	11,23	17,09	18,91

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.	1,14	2,56	0,75	2,14	1,30	-5,18	-23,24
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB 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	1,00	12,22	2,91	6,45	13,55	26,81	29,79	34,92	44,24
IRF-M 1+	3,14	16,50	3,11	7,34	18,39	28,00	22,52	29,87	50,14
IRF-M TOTAL	2,47	14,81	3,03	6,96	16,50	27,30	24,84	31,46	48,61
IMA-B 5	1,80	10,51	1,62	4,32	11,55	22,27	29,18	38,75	57,20
IMA-B 5+	3,39	14,75	0,42	3,23	13,39	18,13	19,09	19,90	55,21
IMA-B TOTAL	2,62	12,95	0,99	3,85	12,73	20,41	24,38	28,75	57,75
IMA-GERAL TOTAL	1,84	12,96	2,33	5,79	13,83	24,95	27,59	32,92	50,36
IDKA 2	1,83	10,52	1,71	4,50	11,89	21,85	29,05	39,45	56,01
IDKA 20	4,68	19,28	-0,18	3,26	15,32	14,32	11,40	6,27	50,57
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66	35,59	43,85

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93	17,65	42,26
IBRX 100	12,38	14,97	9,89	17,42	11,95	23,34	15,95	17,94	44,76
IBRX 50	12,01	14,01	9,98	18,15	11,10	25,06	17,97	19,06	41,25
SMALL CAP	12,46	9,41	1,19	4,49	6,11	-3,54	-16,27	-12,84	24,96
Índice Consumo - ICON	16,33	0,95	1,71	2,02	-4,39	-24,66	-41,54	-39,36	-12,99
Índice Dividendos - IDIV	10,70	18,65	8,63	18,08	16,73	35,80	36,27	36,20	80,93

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	6,29	12,53	1,61	5,84	4,37	-12,16	16,75	69,92	111,42

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,66	10,79	-1,13	5,41	10,79	23,20	13,10	9,91	38,08

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	6,44	8,50	1,48	4,05	2,60	-16,06	3,97	48,41	80,72

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,28	4,04	0,78	1,05	4,68	10,86	22,77	28,06	32,25
INPC	0,10	3,14	0,33	0,34	3,85	10,06	22,12	28,46	32,79
IGPM	0,59	-3,89	1,46	-1,35	-3,46	2,23	20,51	50,06	56,02
SELIC	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,65	35,58	43,84

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	7,81	1,74	3,06	8,85	19,89	38,03	49,69	60,78
IPCA + 5,00%	0,67	8,75	1,98	3,55	9,90	22,20	42,03	55,50	68,63
IPCA + 5,50%	0,71	9,23	2,10	3,80	10,42	23,36	44,06	58,47	72,66
IPCA + 5,89%	0,74	9,59	2,19	3,99	10,82	24,28	45,66	60,82	75,87
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11	61,48	76,78
INPC + 4,00%	0,41	6,88	1,29	2,33	7,99	19,02	37,30	50,17	61,43
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34	62,00	77,50

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%)	20.272.511,38	5,940000	20.296.807,44	5,849800	24.296,06
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.348.862,51	5,980000	10.366.108,75	5,849800	17.246,24
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.116.796,31	6,090000	5.200.218,22	5,550000	83.421,91
NTN-B 150535 (5,560000%)	16.898.357,04	5,560000	16.814.295,23	5,622000	-84.061,81
NTN-B 150535 (5,821000%)	19.760.250,92	5,821000	20.077.993,05	5,622000	317.742,13
NTN-B 150545 (5,710000%)	32.292.724,98	5,710000	32.270.917,32	5,715700	-21.807,66
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.736.609,17	5,760000	10.793.035,78	5,715700	56.426,61
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.718.600,09	5,781000	10.801.690,98	5,715700	83.090,89
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.696.236,59	5,815000	10.792.457,13	5,751000	96.220,54
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.342.087,32	5,850000	10.489.054,72	5,751000	146.967,40
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.576.652,12	5,892000	5.547.344,05	6,701600	-29.308,07
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.541.179,12	5,910000	10.487.222,28	6,701600	-53.956,84
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.268.880,42	6,090000	5.247.829,65	6,701600	-21.050,77
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.583.033,60	6,440000	20.548.374,79	6,701600	-34.658,81
NTN-B 150824 (6,480000%)	21.432.003,33	6,480000	21.400.514,33	6,701600	-31.489,00
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.286.537,49	6,680000	5.285.796,27	6,701600	-741,22
NTN-B 150824 (6,990300%)	30.577.630,54	6,990300	30.634.838,37	6,701600	57.207,83
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.382.450,74	6,350000	15.694.294,48	5,503700	311.843,74
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.380.762,51	6,350000	15.887.894,70	5,515400	507.132,19
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.004.907,14	5,708000	11.128.695,08	5,494700	123.787,94
NTN-B 150840 (5,650000%)	936.546,82	5,650000	931.637,20	5,701700	-4.909,62
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.024.293,81	5,770000	11.100.916,53	5,701700	76.622,72
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.077.779,70	5,713000	11.015.056,63	5,756800	-62.723,07
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.706.839,20	5,780000	10.739.022,99	5,756800	32.183,79
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.002.118,12	5,815000	11.085.160,41	5,756800	83.042,29
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.949.194,69	5,916000	4.030.967,42	5,756800	81.772,73
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.577.432,79	5,920000	10.804.745,29	5,756800	227.312,50
NTN-B 150850 (5,970000%)	20.262.836,72	5,970000	20.829.586,01	5,756800	566.749,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
223	01/11/2023	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	805,88	0,00	18,70030252	43,0944900000
224	06/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	2.916,03536700	3,0125766300
225	06/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	50.914,23	0,00	10.373,11802900	4,9082860000
226	07/11/2023	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	10.000.000,00	1.753.427,12952478	5,7031169600
227	08/11/2023	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	279.858,36	0,00	66,08722739	4.234,6815120000
228	10/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.776,37695300	3,0179727540
229	10/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	22.568,75	4.589,04707700	4,9179600000
230	10/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	63.000,00	12.810,18951300	4,9179600000
231	10/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.000.000,00	0,00	2.033.363,42711205	4,9179600000
232	16/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.238.651,80	0,00	860.668,44445816	4,9248370000
233	17/11/2023	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	0,00	5.180.073,00	1.624.322,99732000	3,1890658470
234	17/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	397.325,47030000	3,0234371310
235	17/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.282.056,69	0,00	869.054,34054627	4,9272600000
236	17/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	657.778,97	0,00	133.497,92176585	4,9272600000
237	21/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.180.073,00	0,00	1.711.741,44051200	3,0262006150
238	21/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	15.438,97974500	3,0262006150
239	24/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.608,70	2.148,06625800	4,9387210000
240	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.926.416,25	793.919,34488100	4,9456110000
241	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	202.374,58	40.920,03585500	4,9456110000
242	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	32.922,19	0,00	6.656,84988164	4,9456110000
243	30/11/2023	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.952,71	0,00	0,45775736	4.265,8189390000
244	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	106.463,48	0,00	21.516,25853266	4,9480480000
Total			26.096.651,15	19.405.041,28		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.329.468,42

Value-At-Risk: 0,62%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		0,62		0,62			698.762.032,12	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,10%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,940000%)		0,06	0,00	0,06			20.272.511,38	2,90
NTN-B 150525 (5,980000%)		0,06	0,00	0,06			10.348.862,51	1,48
NTN-B 150527 (6,090000%)		0,06	-0,00	0,06			5.116.796,31	0,73
NTN-B 150535 (5,560000%)		0,06	0,00	0,06			16.898.357,04	2,42
NTN-B 150535 (5,821000%)		0,06	0,00	0,06			19.760.250,92	2,83
NTN-B 150545 (5,710000%)		0,06	0,00	0,06			32.292.724,98	4,62
NTN-B 150545 (5,760000%)		0,06	0,00	0,06			10.736.609,17	1,54
NTN-B 150545 (5,781000%)		0,06	0,00	0,06			10.718.600,09	1,53
NTN-B 150555 (5,815000%)		0,06	0,00	0,06			10.696.236,59	1,53
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,11	0,00	0,10			10.342.087,32	1,48
NTN-B 150824 (5,892000%)		0,06	0,00	0,06			5.576.652,12	0,80
NTN-B 150824 (5,910000%)		0,06	0,00	0,06			10.541.179,12	1,51
NTN-B 150824 (6,090000%)		0,06	0,00	0,06			5.268.880,42	0,75
NTN-B 150824 (6,440000%)		0,06	0,00	0,06			20.583.033,60	2,95
NTN-B 150824 (6,480000%)		0,06	0,00	0,06			21.432.003,33	3,07
NTN-B 150824 (6,680000%)		0,06	0,00	0,06			5.286.537,49	0,76
NTN-B 150824 (6,990300%)		0,06	0,00	0,06			30.577.630,54	4,38
NTN-B 150826 (6,350000%)		0,06	0,00	0,06			15.382.450,74	2,20
NTN-B 150828 (6,350000%)		0,06	0,00	0,06			15.380.762,51	2,20
NTN-B 150830 (5,708000%)		0,06	0,00	0,06			11.004.907,14	1,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,650000%)		0,06	0,00	0,06			936.546,82	0,13
NTN-B 150840 (5,770000%)		0,06	0,00	0,06			11.024.293,81	1,58
NTN-B 150850 (5,713000%)		0,06	0,00	0,06			11.077.779,70	1,59
NTN-B 150850 (5,780000%)		0,06	0,00	0,06			10.706.839,20	1,53
NTN-B 150850 (5,815000%)		0,06	0,00	0,06			11.002.118,12	1,57
NTN-B 150850 (5,916000%)		0,06	0,00	0,06			3.949.194,69	0,57
NTN-B 150850 (5,920000%)		0,10	0,00	0,10			10.577.432,79	1,51
NTN-B 150850 (5,970000%)		0,18	0,00	0,18			20.262.836,72	2,90
Sub-total	0,10	0,06	0,00		-2,16	0,71	367.754.115,17	52,63

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO		1,72	0,00	0,92			2.511.280,63	0,36
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,02	-0,00	0,02			20.410.738,69	2,92
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,12	-0,00	0,17			471.701,30	0,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,11	0,00	0,00			12.992.229,31	1,86
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,01	0,01	0,03			5.060.403,83	0,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,92	0,02	0,02			10.411.700,81	1,49
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,71	0,00	0,71			7.348.755,19	1,05
SANTANDER RF ATIVO FIC		1,15	0,00	1,15			638.558,62	0,09
Sub-total	1,14	0,66	0,04		0,60	1,60	59.845.368,38	8,56

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,15	0,01	0,23			7.029.882,85	1,01
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	-0,00	0,03			70.219.385,35	10,05
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,05	-0,00	0,05			22.366.097,19	3,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			66.047.804,27	9,45
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			16.985.997,81	2,43
	0,17	0,09	0,01		0,58	1,02	182.649.167,47	26,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

Sub-total

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		5,89	0,00	5,89			1.482.486,01	0,21
Sub-total	21,94	5,89	0,00		0,25	6,37	1.482.486,01	0,21

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,32%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		6,69	0,01	1,71			1.644.546,67	0,24
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		10,06	0,07	2,62			5.443.289,99	0,78
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		7,49	0,08	1,25			8.073.690,92	1,16
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,37	0,14	1,37			15.749.439,49	2,25
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,41	0,05	2,79			6.317.954,02	0,90
BRADESCO F I A SELECTION		7,74	0,06	2,42			5.616.709,88	0,80
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,26	0,11	3,79			8.663.371,91	1,24
Sub-total	16,08	7,32	0,53		0,65	11,36	51.509.002,88	7,37

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,15%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP		0,15	0,00	0,15			21.208.275,85	3,04
Sub-total	0,15	0,15	0,00		0,22	0,95	21.208.275,85	3,04

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,70%

Artigo 9º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,70	0,04	0,67			14.313.616,36	2,05
Sub-total	9,80	6,70	0,04		0,56	6,42	14.313.616,36	2,05

(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 (%)