



LDB
EMPRESAS

CARAGUATATUBA
4º TRIMESTRE 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 29.12.2023.

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

86,45%

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

| Emissor | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira |
|------------------|--------------------------|---------------------|-------------------|------|-------|---------------|------------|
| | | | Dia | Mês | Trim. | | |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150525 (5,940000%) | 2,93 | 0,12 | 0,86 | 2,30 | 20.446.133,96 | 2,89 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150525 (5,980000%) | 0,33 | 0,13 | 0,86 | 2,31 | 10.437.787,18 | 1,47 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150527 (6,090000%) | 0,34 | 0,16 | 0,91 | 2,38 | 5.163.325,54 | 0,73 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (5,560000%) | 0,37 | 0,23 | 0,94 | 2,32 | 17.056.461,33 | 2,41 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (5,821000%) | 0,37 | 0,23 | 0,96 | 2,39 | 19.950.108,91 | 2,82 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,710000%) | 0,40 | 0,29 | 1,01 | 2,42 | 32.620.125,14 | 4,61 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,760000%) | 0,41 | 0,30 | 1,02 | 2,44 | 10.846.005,72 | 1,53 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,781000%) | 0,41 | 0,30 | 1,02 | 2,44 | 10.828.026,57 | 1,53 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,815000%) | 0,43 | 0,34 | 1,07 | 2,49 | 10.810.233,44 | 1,53 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,850000%) | 0,44 | 0,31 | 1,07 | 2,50 | 10.452.679,54 | 1,48 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (5,892000%) | 0,32 | 0,10 | 0,83 | 2,27 | 5.622.998,29 | 0,79 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (5,910000%) | 0,32 | 0,10 | 0,83 | 2,27 | 10.628.957,20 | 1,50 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,090000%) | 0,32 | 0,10 | 0,85 | 2,31 | 5.313.437,94 | 0,75 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,440000%) | 0,32 | 0,10 | 0,87 | 2,39 | 20.762.619,82 | 2,93 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,480000%) | 0,32 | 0,10 | 0,88 | 2,40 | 21.619.550,06 | 3,05 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Emissor | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira |
|--|--------------------------|---------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|
| | | | Dia | Mês | Trim. | | |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,680000%) | 0,32 | 0,10 | 0,89 | 2,45 | 5.333.609,50 | 0,75 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,990300%) | 2,98 | 0,10 | 0,91 | 2,52 | 30.856.986,93 | 4,36 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150826 (6,350000%) | 0,33 | 0,14 | 0,91 | 2,42 | 15.522.579,04 | 2,19 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150828 (6,350000%) | 0,34 | 0,15 | 0,93 | 2,44 | 15.524.051,75 | 2,19 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150830 (5,708000%) | 0,35 | 0,19 | 0,91 | 2,32 | 11.104.938,84 | 1,57 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,650000%) | 0,39 | 0,26 | 0,98 | 2,38 | 945.690,54 | 0,13 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,770000%) | 0,39 | 0,26 | 0,99 | 2,41 | 11.133.249,80 | 1,57 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,713000%) | 0,42 | 0,32 | 1,04 | 2,45 | 11.192.802,30 | 1,58 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,780000%) | 0,42 | 0,32 | 1,05 | 2,47 | 10.818.732,82 | 1,53 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,815000%) | 0,42 | 0,32 | 1,05 | 2,48 | 11.117.474,27 | 1,57 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,916000%) | 0,42 | 0,32 | 1,06 | 2,50 | 3.990.999,52 | 0,56 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,920000%) | 0,43 | 0,30 | 1,06 | 2,50 | 10.689.467,83 | 1,51 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,970000%) | 4,14 | 0,31 | 1,06 | 2,40 | 20.478.458,54 | 2,89 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 0,36 | 0,21 | 0,96 | 2,42 | 371.267.492,32 | 52,43 |

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 | Trim. | | | | |
| BB | BB | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 1,58 | 0,04 | 0,89 | 0,89 | 10.089.445,05 | 1,42 | 6.297.472.287,75 | 0,16 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA | 3,11 | 0,04 | 1,45 | 4,27 | 2.547.719,87 | 0,36 | 245.832.851,17 | 1,04 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|-----------|---|---------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| LONGO PRAZO | | | | | | | | | | |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 0,04 | 0,04 | 0,89 | 2,78 | 20.592.489,76 | 2,91 | 7.015.670.587,94 | 0,29 |
| BB | BB | BB PREV RF IRF M | 2,64 | 0,04 | | | 20.272.630,17 | 2,86 | 4.067.997.534,34 | 0,50 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI | 0,35 | 0,05 | 0,92 | 2,85 | 476.424,05 | 0,07 | 482.364.488,83 | 0,10 |
| BB | BB | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,36 | 0,04 | 0,89 | 2,80 | 23.191.158,11 | 3,27 | 7.852.193.725,16 | 0,30 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,45 | 0,10 | 2,73 | 4,71 | 10.216.658,64 | 1,44 | 5.157.397.073,53 | 0,20 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP | 3,89 | 0,04 | 1,71 | 5,00 | 10.589.571,33 | 1,50 | 1.537.705.344,55 | 0,69 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 1,30 | 0,08 | 1,21 | 2,92 | 17.551.924,60 | 2,48 | 5.290.529.627,75 | 0,33 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF ATIVO FIC | 1,80 | 0,06 | 1,53 | 3,97 | 648.350,81 | 0,09 | 313.213.226,79 | 0,21 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 1,20 | 0,05 | 1,24 | 3,33 | 116.176.372,39 | 16,41 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|--------|--|---------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| ITAU | ITAU | ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO | 4,76 | 0,09 | 2,84 | 4,53 | 7.229.266,22 | 1,02 | 506.987.845,30 | 1,43 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,07 | 0,04 | 0,92 | 2,94 | 27.807.896,33 | 3,93 | 13.988.008.512,08 | 0,20 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 0,10 | 0,05 | 0,95 | 3,03 | 22.582.387,58 | 3,19 | 5.862.946.011,56 | 0,39 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,08 | 0,04 | 0,90 | 2,83 | 48.459.477,36 | 6,84 | 16.475.113.370,57 | 0,29 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | 0,09 | 0,04 | 0,93 | 2,94 | 17.144.776,98 | 2,42 | 5.463.046.966,63 | 0,31 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 0,17 | 0,05 | 1,02 | 2,99 | 123.223.804,47 | 17,40 | | |

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|----------|--------------------|---------------------|-------------------|-------------|---------------|---------------------|-------------|---------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| VILA RICA | BRL DTVM | FIDC ITALIA SENIOR | 112,52 | 2,25 | 2,25 | 226,68 | 1.515.913,89 | 0,21 | 58.269.998,38 | 2,60 |
| Sub-total Artigo 7º V, Alínea a | | | 112,52 | 2,25 | 2,25 | 226,68 | 1.515.913,89 | 0,21 | | |

| | | | | | | | | | | |
|-------------------|--|--|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|--|--|
| Renda Fixa | | | 0,35 | 0,15 | 1,02 | 2,87 | 612.183.583,07 | 86,45 | | |
|-------------------|--|--|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|--|--|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

7,71%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|------------------------------|--------|--|---------------------|-------------------|-------------|--------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| BB | BB | BB AÇÕES DIVIDENDOS | 15,36 | -0,00 | 6,35 | 13,60 | 1.749.022,42 | 0,25 | 613.943.691,61 | 0,28 |
| BRAM | BEM | BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 21,66 | -0,01 | 5,76 | 10,29 | 5.756.910,02 | 0,81 | 751.899.438,06 | 0,77 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS | 17,35 | -0,01 | 5,87 | 14,33 | 8.547.298,67 | 1,21 | 716.164.953,12 | 1,19 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 14,51 | -0,01 | 5,91 | 12,66 | 16.680.385,76 | 2,36 | 1.019.487.668,90 | 1,64 |
| ITAU | ITAU | ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 15,75 | -0,01 | 7,35 | 16,32 | 6.782.606,91 | 0,96 | 1.403.792.198,31 | 0,48 |
| BRAM | BEM | BRADERCO F I A SELECTION | 17,01 | -0,01 | 6,25 | 11,91 | 5.968.033,78 | 0,84 | 454.422.244,72 | 1,31 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | 19,60 | -0,01 | 5,35 | 8,99 | 9.127.054,25 | 1,29 | 161.464.884,10 | 5,65 |
| Sub-total Artigo 8º I | | | 16,63 | -0,01 | 6,02 | 12,54 | 54.611.311,81 | 7,71 | | |
| Renda Variável | | | 16,63 | -0,01 | 6,02 | 12,54 | 54.611.311,81 | 7,71 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,07%

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 | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 15,18 | -0,00 | 2,59 | 7,65 | 14.684.121,38 | 2,07 | 1.995.875.754,00 | 0,74 |
| Sub-total Artigo 9º III | | | 15,18 | -0,00 | 2,59 | 7,65 | 14.684.121,38 | 2,07 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 14,99 | -0,00 | 2,59 | 7,65 | 14.684.121,38 | 2,07 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,76%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-------------------------------|--------|--|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP | 0,39 | 0,05 | 0,90 | 2,73 | 16.390.936,92 | 2,31 | 1.339.887.646,18 | 1,22 |
| CAIXA DTVM | CEF | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 13,23 | 0,04 | 4,56 | 4,56 | 10.261.153,31 | 1,45 | 1.635.814.462,49 | 0,63 |
| Sub-total Artigo 10º I | | | 4,46 | 0,04 | 1,70 | 3,55 | 26.652.090,23 | 3,76 | | |
| Investimentos Estruturados | | | 4,46 | 0,04 | 1,70 | 3,55 | 26.652.090,23 | 3,76 | | |
| Total | | | 1,79 | 0,13 | 1,45 | 3,70 | 708.131.106,49 | 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 | 371.267.492,32 | 52,43 | 0,00 | 50,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 116.176.372,39 | 16,41 | 0,00 | 17,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 123.223.804,47 | 17,40 | 0,00 | 18,63 | 60,00 | 0,00 | 75,00 |
| Artigo 7º V, Alínea a | FIDC Cota Sênior | 1.515.913,89 | 0,21 | 0,00 | 0,07 | 5,00 | 0,00 | 15,00 |
| | Total Renda Fixa | 612.183.583,07 | 86,45 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 54.611.311,81 | 7,71 | 0,00 | 7,00 | 30,00 | 0,00 | 45,00 |
| | Total Renda Variável | 54.611.311,81 | 7,71 | | | | | 45,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º III | Fundos de Ações - BDR Nível I | 14.684.121,38 | 2,07 | 0,00 | 3,80 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 14.684.121,38 | 2,07 | | | | | 10,00 |
| Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 26.652.090,23 | 3,76 | 0,00 | 3,50 | 10,00 | 0,00 | 15,00 |
| | Total Investimentos Estruturados | 26.652.090,23 | 3,76 | | | | | 20,00 |
| Total | | 708.131.106,49 | 100,00 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

| Estratégia Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Trimestre (R\$) |
|-------------------------------------|----------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|----------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea a % do CDI | 0,96 106,59 | 2,42 85,16 | 2,42 85,16 | 4,45 72,38 | 11,04 84,62 | 3.513.377,15 | 8.782.696,04 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,24 138,14 | 3,33 117,28 | 3,33 117,28 | 5,49 89,22 | 12,84 98,45 | 1.330.604,01 | 2.514.467,76 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 1,02 114,30 | 2,99 105,33 | 2,99 105,33 | 6,22 101,22 | 13,06 100,10 | 1.329.775,51 | 4.433.040,56 |
| Artigo 7º V, Alínea a % do CDI | 2,25 251,57 | 226,68 7.987,14 | 226,68 7.987,14 | 269,86 4.388,42 | 274,45 2.103,46 | 33.427,88 | 1.244.137,34 |
| Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p. | 6,02 0,64 | 12,54 -2,57 | 12,54 -2,57 | 9,02 -4,62 | 15,52 -6,76 | 3.102.308,93 | 6.332.080,34 |
| Artigo 9º II % do CDI | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 0,00 0,00 | 6,13 47,01 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 9º III % do CDI | 2,59 288,79 | 7,65 269,47 | 7,65 269,47 | 9,07 147,55 | 24,92 191,01 | 370.505,02 | 1.082.230,46 |
| Artigo 10º I % do CDI | 1,70 189,99 | 3,55 124,97 | 3,55 124,97 | 6,42 104,41 | 19,45 149,08 | 443.814,38 | 821.442,56 |
| CARAGUATATUBA (Total) | | | | | | 10.123.812,88 | 25.210.095,06 |

RESULTADO POR ATIVO

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| NTN-B 150525 (5,940000%) | 20.272.511,38 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20.446.133,96 | 173.622,58 | 465.913,62 |
| NTN-B 150525 (5,980000%) | 10.348.862,51 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.437.787,18 | 88.924,67 | 238.695,31 |
| NTN-B 150527 (6,090000%) | 5.116.796,31 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.163.325,54 | 46.529,23 | 121.502,21 |
| NTN-B 150535 (5,560000%) | 16.898.357,04 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 17.056.461,33 | 158.104,29 | 391.615,68 |
| NTN-B 150535 (5,821000%) | 19.760.250,92 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 19.950.108,91 | 189.857,99 | 471.026,90 |
| NTN-B 150545 (5,710000%) | 32.292.724,98 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 32.620.125,14 | 327.400,16 | 781.127,24 |
| NTN-B 150545 (5,760000%) | 10.736.609,17 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.846.005,72 | 109.396,55 | 261.108,21 |
| NTN-B 150545 (5,781000%) | 10.718.600,09 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.828.026,57 | 109.426,48 | 261.245,55 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--------------------------|----------------|------------|----------|-------------|----------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| NTN-B 150555 (5,815000%) | 10.696.236,59 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.810.233,44 | 113.996,85 | 266.055,77 |
| NTN-B 150555 (5,850000%) | 10.342.087,32 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.452.679,54 | 110.592,22 | 258.229,57 |
| NTN-B 150824 (5,892000%) | 5.576.652,12 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.622.998,29 | 46.346,17 | 124.631,69 |
| NTN-B 150824 (5,910000%) | 10.541.179,12 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.628.957,20 | 87.778,08 | 236.088,92 |
| NTN-B 150824 (6,090000%) | 5.268.880,42 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.313.437,94 | 44.557,52 | 120.069,44 |
| NTN-B 150824 (6,440000%) | 20.583.033,60 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20.762.619,82 | 179.586,22 | 485.632,52 |
| NTN-B 150824 (6,480000%) | 21.432.003,33 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 21.619.550,06 | 187.546,73 | 507.272,12 |
| NTN-B 150824 (6,680000%) | 5.286.537,49 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.333.609,50 | 47.072,01 | 127.572,00 |
| NTN-B 150824 (6,990300%) | 30.577.630,54 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 30.856.986,93 | 279.356,39 | 759.191,74 |
| NTN-B 150826 (6,350000%) | 15.382.450,74 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15.522.579,04 | 140.128,30 | 366.784,10 |
| NTN-B 150828 (6,350000%) | 15.380.762,51 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15.524.051,75 | 143.289,24 | 369.929,04 |
| NTN-B 150830 (5,708000%) | 11.004.907,14 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 11.104.938,84 | 100.031,70 | 251.449,94 |
| NTN-B 150840 (5,650000%) | 936.546,82 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 945.690,54 | 9.143,72 | 21.947,11 |
| NTN-B 150840 (5,770000%) | 11.024.293,81 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 11.133.249,80 | 108.955,99 | 261.674,75 |
| NTN-B 150850 (5,713000%) | 11.077.779,70 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 11.192.802,30 | 115.022,60 | 267.525,16 |
| NTN-B 150850 (5,780000%) | 10.706.839,20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.818.732,82 | 111.893,62 | 260.379,48 |
| NTN-B 150850 (5,815000%) | 11.002.118,12 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 11.117.474,27 | 115.356,15 | 268.514,12 |
| NTN-B 150850 (5,916000%) | 3.949.194,69 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.990.999,52 | 41.804,83 | 97.387,81 |
| NTN-B 150850 (5,920000%) | 10.577.432,79 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.689.467,83 | 112.035,04 | 261.002,91 |
| NTN-B 150850 (5,970000%) | 20.262.836,72 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20.478.458,54 | 215.621,82 | 479.123,13 |
| | 367.754.115,17 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 371.267.492,32 | 3.513.377,15 | |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--|----------------|---------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 0,00 | 10.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 10.089.445,05 | 89.445,05 | 89.445,05 |
| BB PREV RF IRF M | 0,00 | 20.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 20.272.630,17 | 272.630,17 | 272.630,17 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 12.992.229,31 | 10.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 23.191.158,11 | 198.928,80 | 441.271,23 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5.060.403,83 | 5.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 10.216.658,64 | 156.254,81 | 251.898,76 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--|----------------|---------------|----------|-------------|----------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP | 10.411.700,81 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.589.571,33 | 177.870,52 | 504.519,46 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 7.348.755,19 | 10.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 17.551.924,60 | 203.169,41 | 257.398,82 |
| FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO | 2.511.280,63 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.547.719,87 | 36.439,24 | 102.743,86 |
| ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI | 471.701,30 | 400,00 | 0,00 | 0,00 | 476.424,05 | 4.322,75 | 13.173,23 |
| SANTANDER RF ATIVO FIC | 638.558,62 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 648.350,81 | 9.792,19 | 24.753,26 |
| SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 20.410.738,69 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20.592.489,76 | 181.751,07 | 556.633,92 |
| | 59.845.368,38 | 55.000.400,00 | 0,00 | 0,00 | 116.176.372,39 | 1.330.604,01 | |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--|----------------|--------------|----------------|-------------|----------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 66.047.804,27 | 1.978.532,71 | -20.000.000,00 | 0,00 | 48.459.477,36 | 433.140,38 | 1.563.576,64 |
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | 16.985.997,81 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 17.144.776,98 | 158.779,17 | 489.674,38 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 70.219.385,35 | 5.441.373,88 | -48.178.950,52 | 0,00 | 27.807.896,33 | 326.087,62 | 1.406.314,57 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 22.366.097,19 | 3.905,42 | 0,00 | 0,00 | 22.582.387,58 | 212.384,97 | 660.432,83 |
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO | 7.029.882,85 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.229.266,22 | 199.383,37 | 313.042,14 |
| | 182.649.167,47 | 7.423.812,01 | -68.178.950,52 | 0,00 | 123.223.804,47 | 1.329.775,51 | |

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| FIDC ITALIA SENIOR | 1.482.486,01 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.515.913,89 | 33.427,88 | 1.244.137,34 |
| | 1.482.486,01 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.515.913,89 | 33.427,88 | |

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| BB AÇÕES DIVIDENDOS | 1.644.546,67 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.749.022,42 | 104.475,75 | 209.440,73 |
| BRADESCO F I A SELECTION | 5.616.709,88 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.968.033,78 | 351.323,90 | 634.913,31 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 5.443.289,99 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.756.910,02 | 313.620,03 | 537.110,51 |
| FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS | 8.073.690,92 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.547.298,67 | 473.607,75 | 1.071.529,31 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 15.749.439,49 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 16.680.385,76 | 930.946,27 | 1.875.086,71 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 6.317.954,02 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.782.606,91 | 464.652,89 | 951.547,34 |
| ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | 8.663.371,91 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.127.054,25 | 463.682,34 | 752.651,37 |
| | 51.509.002,88 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 54.611.311,81 | 3.102.308,93 | |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|-------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 14.313.616,36 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 14.684.121,38 | 370.505,02 | 1.082.230,46 |
| | 14.313.616,36 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 14.684.121,38 | 370.505,02 | |

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--|----------------|---------------|---------------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 0,00 | 10.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 10.261.153,31 | 261.153,31 | 261.153,31 |
| FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP | 21.208.275,85 | 0,00 | -5.000.000,00 | 0,00 | 16.390.936,92 | 182.661,07 | 560.289,25 |
| | 21.208.275,85 | 10.000.000,00 | -5.000.000,00 | 0,00 | 26.652.090,23 | 443.814,38 | |

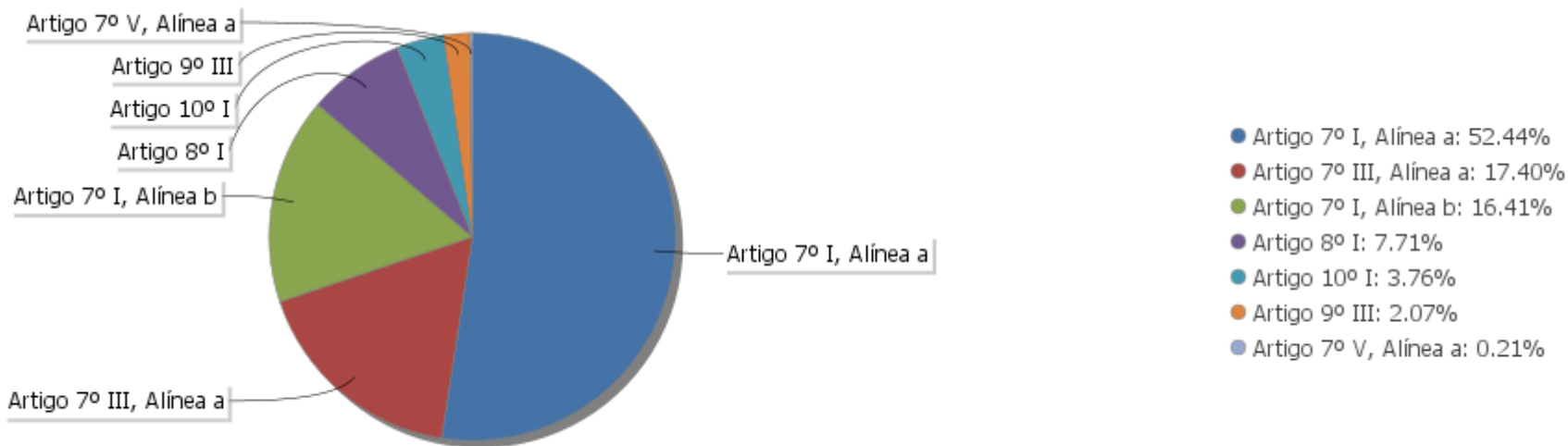
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

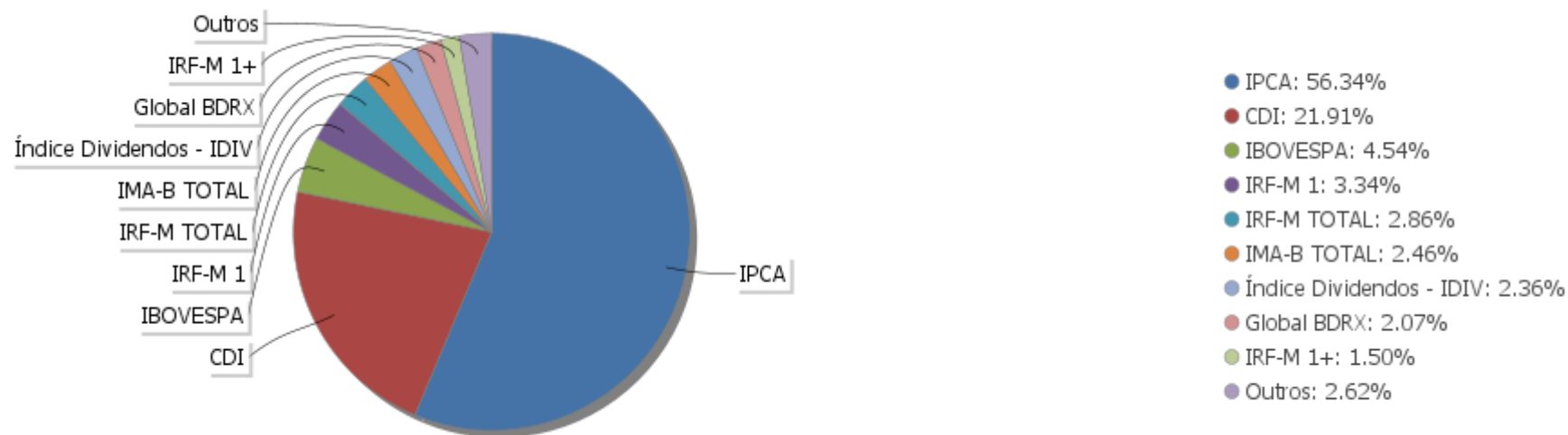
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo P.I. |
|-----------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|------------------------|
| de 0 a 30 dias | 295.726.268,58 | 41,76 | 295.726.268,58 | 41,76 | |
| de 31 dias a 365 dias | 141.275.505,33 | 19,95 | 437.001.773,91 | 61,71 | |
| acima de 365 dias | 271.129.332,58 | 38,29 | 708.131.106,49 | 100,00 | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

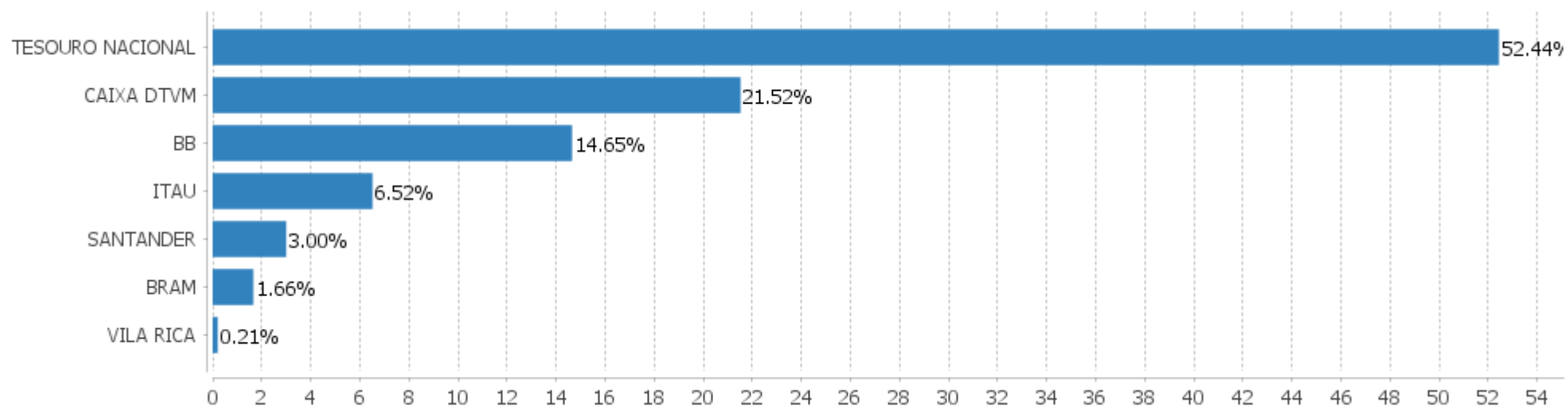


Alocação Por Estratégia



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 | 1,45 | 12,95 |
| IPCA + 5,03% | 0,96 | 1,19 | 1,16 | 0,96 | 0,66 | 0,33 | 0,53 | 0,68 | 0,65 | 0,65 | 0,67 | 0,95 | 9,82 |
| p.p. indexador | 0,79 | -1,30 | -0,20 | 0,00 | 1,00 | 1,20 | 0,46 | -0,33 | -0,15 | -0,25 | 1,14 | 0,50 | 3,13 |
| 2022 | -0,53 | -0,27 | 2,35 | -1,70 | 1,01 | -1,73 | 2,27 | 0,51 | -0,83 | 2,08 | 0,78 | -0,10 | 3,79 |
| IPCA + 4,99% | 0,95 | 1,38 | 2,05 | 1,43 | 0,90 | 1,08 | -0,28 | 0,08 | 0,12 | 0,98 | 0,80 | 1,05 | 11,04 |
| p.p. indexador | -1,48 | -1,65 | 0,30 | -3,13 | 0,11 | -2,81 | 2,54 | 0,42 | -0,95 | 1,10 | -0,02 | -1,15 | -7,25 |
| 2021 | -0,94 | -1,45 | 0,38 | 1,02 | 1,49 | 0,37 | -0,80 | -0,98 | -1,64 | -1,55 | 1,37 | 1,32 | -1,47 |
| IPCA + 5,46% | 0,67 | 1,24 | 1,42 | 0,73 | 1,28 | 0,98 | 1,43 | 1,34 | 1,61 | 1,68 | 1,38 | 1,22 | 16,05 |
| p.p. indexador | -1,61 | -2,69 | -1,04 | 0,29 | 0,21 | -0,60 | -2,23 | -2,32 | -3,25 | -3,23 | -0,00 | 0,10 | -17,51 |
| 2020 | 0,26 | -1,20 | -8,82 | 2,26 | 2,04 | 2,60 | 3,94 | -1,32 | -1,68 | -0,06 | 3,29 | 4,43 | 5,12 |
| IPCA + 5,89% | 0,71 | 0,66 | 0,57 | 0,14 | 0,07 | 0,74 | 0,89 | 0,72 | 1,12 | 1,34 | 1,35 | 1,86 | 10,65 |
| p.p. indexador | -0,45 | -1,86 | -9,40 | 2,11 | 1,97 | 1,86 | 3,06 | -2,04 | -2,80 | -1,40 | 1,94 | 2,58 | -5,52 |
| 2019 | 1,51 | 0,37 | 0,41 | 0,94 | 1,99 | 2,58 | 1,16 | 0,11 | 1,85 | 2,11 | -0,78 | 2,17 | 15,34 |
| IPCA + 6,00% | 0,83 | 0,90 | 1,19 | 1,06 | 0,64 | 0,45 | 0,72 | 0,62 | 0,45 | 0,63 | 0,98 | 1,64 | 10,59 |
| p.p. indexador | 0,68 | -0,53 | -0,78 | -0,12 | 1,35 | 2,13 | 0,44 | -0,51 | 1,40 | 1,47 | -1,75 | 0,52 | 4,75 |

Performance Sobre a Meta Atuarial

| | Quantidade | Perc. (%) |
|------------------------------|------------|-----------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 28 | 46,67 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 32 | 53,33 |

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

Relatório

| Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses | 3,70 | 2,29 | 1,41 | 1,53 |
| 06 meses | 5,61 | 4,21 | 1,41 | 1,48 |
| 12 meses | 12,95 | 9,82 | 3,13 | 1,79 |
| 24 meses | 17,23 | 21,95 | -4,71 | 3,91 |
| 36 meses | 15,51 | 41,51 | -26,00 | 4,64 |
| 48 meses | 21,43 | 56,58 | -35,15 | 7,66 |
| 60 meses | 40,06 | 73,16 | -33,10 | 7,00 |
| Desde 31/12/2018 | 40,06 | 73,16 | -33,10 | 7,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

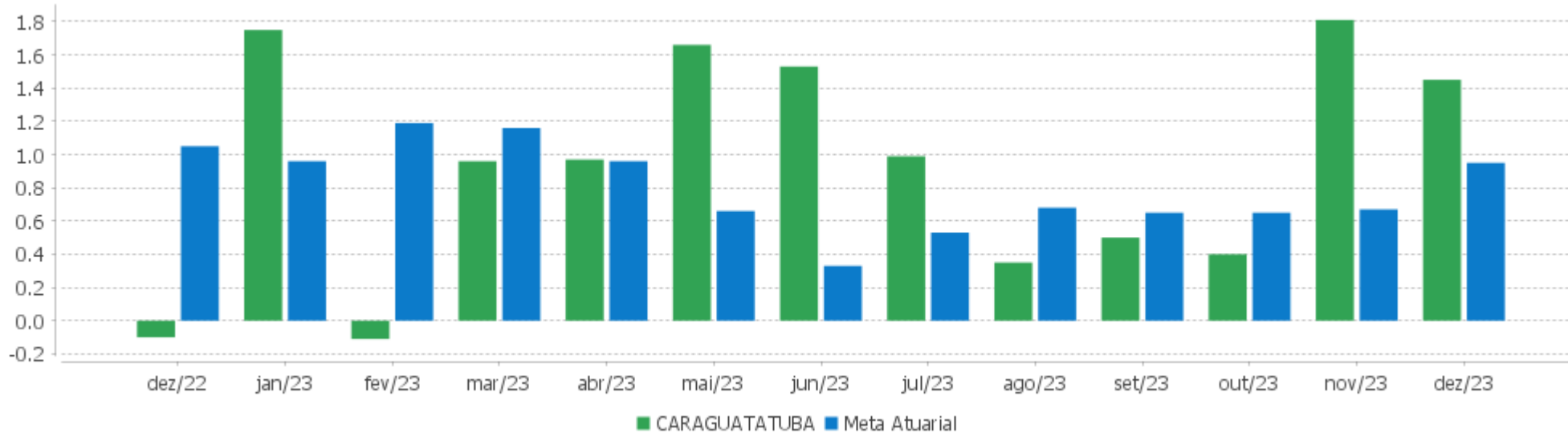


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--|--------------|--------------|--------------|---------------|---------------|----------------|----------------|
| NTN-B 150850 (5,970000%) Var. IPCA p.p. | 1,06 0,50 | 2,50 1,41 | 2,50 1,41 | 1,53 -0,17 | 4,86 0,24 | | |
| NTN-B 150525 (5,940000%) Var. IPCA p.p. | 0,86 0,30 | 2,30 1,22 | 2,30 1,22 | 4,30 2,60 | 7,69 3,07 | 13,85 3,18 | |
| NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p. | 0,94 0,38 | 2,32 1,24 | 2,32 1,24 | 4,23 2,53 | 10,60 5,98 | 23,48 12,80 | 36,04 14,23 |
| NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p. | 0,98 0,42 | 2,38 1,29 | 2,38 1,29 | 4,31 2,61 | 10,73 6,11 | 23,73 13,05 | 36,43 14,62 |
| NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p. | 0,91 0,35 | 2,32 1,23 | 2,32 1,23 | 4,26 2,56 | 10,71 6,09 | 20,29 9,62 | 32,57 10,76 |
| NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p. | 0,99 0,43 | 2,41 1,32 | 2,41 1,32 | 4,37 2,67 | 10,86 6,24 | 20,54 9,87 | 32,97 11,16 |
| NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p. | 0,91 0,35 | 2,42 1,34 | 2,42 1,34 | 4,53 2,83 | 11,32 6,70 | 18,03 7,36 | |
| NTN-B 150824 (6,680000%) Var. IPCA p.p. | 0,89 0,33 | 2,45 1,37 | 2,45 1,37 | 4,64 2,94 | 11,61 6,99 | 18,71 8,04 | |
| NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p. | 0,96 0,40 | 2,39 1,30 | 2,39 1,30 | 4,36 2,66 | 10,88 6,25 | 24,09 13,42 | 36,87 15,06 |
| NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p. | 1,06 0,50 | 2,50 1,42 | 2,50 1,42 | 4,51 2,80 | 11,08 6,46 | 20,88 10,20 | 33,42 11,61 |
| NTN-B 150824 (6,090000%) Var. IPCA p.p. | 0,85 0,29 | 2,31 1,23 | 2,31 1,23 | 4,35 2,65 | 11,00 6,38 | 17,50 6,82 | |
| NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p. | 1,02 0,46 | 2,44 1,36 | 2,44 1,36 | 4,41 2,71 | 10,90 6,28 | 24,07 13,40 | 36,89 15,08 |
| NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p. | 0,83 0,27 | 2,27 1,18 | 2,27 1,18 | 4,26 2,56 | 10,80 6,18 | 20,54 9,86 | 32,93 11,13 |
| NTN-B 150824 (6,440000%) Var. IPCA p.p. | 0,87 0,31 | 2,39 1,31 | 2,39 1,31 | 4,53 2,82 | 11,37 6,74 | 18,21 7,54 | |
| NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p. | 1,07 0,51 | 2,50 1,42 | 2,50 1,42 | 4,49 2,79 | 11,02 6,40 | 24,25 13,58 | 37,14 15,33 |
| NTN-B 150824 (5,910000%) Var. IPCA p.p. | 0,83 0,27 | 2,27 1,19 | 2,27 1,19 | 4,27 2,57 | 10,82 6,20 | 17,12 6,45 | |
| NTN-B 150850 (5,713000%) | 1,04 | 2,45 | 2,45 | 4,40 | 10,86 | 20,53 | 32,98 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|----------------|----------------|----------------|---------------|-----------------|----------------|----------------|
| Var. IPCA p.p. | 0,48 | 1,37 | 1,37 | 2,70 | 6,24 | 9,85 | 11,17 |
| NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p. | 1,06 0,50 | 2,50 1,42 | 2,50 1,42 | 4,50 2,80 | 11,07 6,45 | 20,90 10,23 | 33,44 11,63 |
| NTN-B 150527 (6,090000%) Var. IPCA p.p. | 0,91 0,35 | 2,38 1,29 | 2,38 1,29 | 4,42 2,72 | 11,08 6,45 | 21,04 10,36 | |
| NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p. | 1,05 0,49 | 2,48 1,39 | 2,48 1,39 | 4,45 2,75 | 10,97 6,34 | 20,71 10,04 | 33,21 11,40 |
| NTN-B 150824 (6,990300%) Var. IPCA p.p. | 0,91 0,35 | 2,52 1,44 | 2,52 1,44 | 4,79 3,09 | 8,68 4,06 | 15,89 5,21 | |
| NTN-B 150828 (6,350000%) Var. IPCA p.p. | 0,93 0,37 | 2,44 1,36 | 2,44 1,36 | 4,55 2,85 | 11,33 6,71 | 18,02 7,35 | |
| NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p. | 1,02 0,46 | 2,44 1,35 | 2,44 1,35 | 4,40 2,70 | 10,88 6,26 | 24,03 13,35 | 36,83 15,02 |
| NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p. | 0,86 0,30 | 2,31 1,22 | 2,31 1,22 | 4,32 2,62 | 10,91 6,29 | 20,76 10,09 | 33,28 11,47 |
| NTN-B 150824 (6,480000%) Var. IPCA p.p. | 0,88 0,32 | 2,40 1,32 | 2,40 1,32 | 4,54 2,84 | 11,40 6,78 | 18,30 7,63 | 31,06 9,26 |
| NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p. | 1,07 0,51 | 2,49 1,41 | 2,49 1,41 | 4,47 2,77 | 10,98 6,36 | 24,21 13,53 | 37,08 15,27 |
| NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p. | 1,05 0,49 | 2,47 1,38 | 2,47 1,38 | 4,43 2,73 | 10,93 6,31 | 20,65 9,98 | 33,13 11,32 |
| NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p. | 1,01 0,45 | 2,42 1,34 | 2,42 1,34 | 4,37 2,67 | 10,83 6,21 | 23,91 13,23 | 36,68 14,87 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p. | 1,71 -0,02 | 5,00 -0,05 | 5,00 -0,05 | 6,24 -0,14 | 18,18 -0,33 | 26,41 -0,89 | 19,70 -1,26 |
| ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p. | 0,92 0,00 | 2,85 -0,04 | 2,85 -0,04 | 6,09 -0,07 | 13,06 -0,19 | 26,46 -0,40 | 29,99 -0,58 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 2,73 -0,02 | 4,71 -0,05 | 4,71 -0,05 | 4,15 -0,06 | 15,86 -0,20 | 23,03 -0,41 | 21,15 -0,73 |
| SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI | 1,53 171,09 | 3,97 139,86 | 3,97 139,86 | 5,23 85,00 | 13,38 102,54 | 23,90 88,39 | 27,90 85,54 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p. | 0,89 -0,03 | 2,80 -0,09 | 2,80 -0,09 | 6,00 -0,16 | 12,88 -0,36 | 26,12 -0,73 | 29,46 -1,12 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p. | 1,21 0,65 | 2,92 1,84 | 2,92 1,84 | 4,92 3,22 | 13,59 8,97 | 25,74 15,07 | 25,60 3,79 |
| BB PREV RF IRF M | 1,46 | 4,33 | 4,33 | 6,05 | 16,06 | 26,02 | 23,15 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--|----------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------|
| Var. IRF-M TOTAL p.p. | -0,02 | -0,05 | -0,05 | -0,24 | -0,45 | -0,77 | -1,12 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p. | 0,95 0,39 | 2,92 1,84 | 2,92 1,84 | 5,73 4,03 | 14,99 10,37 | 25,68 15,01 | 26,35 4,54 |
| FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO Var. IDKA 2 p.p. | 1,45 -0,00 | 4,27 1,38 | 4,27 1,38 | 6,18 1,18 | 16,49 4,37 | | |
| SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI | 0,89 99,35 | 2,78 97,89 | 2,78 97,89 | 6,05 98,46 | 12,90 98,84 | 26,78 99,06 | 32,28 98,95 |
| FIDC ITALIA SENIOR % do CDI | 2,25 251,57 | 226,68 7.987,14 | 226,68 7.987,14 | 269,86 4.388,42 | 217,62 1.667,91 | 314,45 1.163,13 | 300,09 920,00 |
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI | 0,95 105,94 | 3,03 106,78 | 3,03 106,78 | 6,68 108,65 | 13,57 104,01 | 28,48 105,36 | 34,96 107,17 |
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p. | 2,84 0,09 | 4,53 -0,23 | 4,53 -0,23 | 3,50 -0,71 | 15,65 -0,41 | 21,36 -2,09 | 19,57 -2,31 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,90 100,65 | 2,83 99,76 | 2,83 99,76 | 6,15 99,95 | 12,98 99,47 | 27,20 100,61 | 33,08 101,42 |
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI | 0,93 104,29 | 2,94 103,59 | 2,94 103,59 | 6,46 105,08 | 13,39 102,59 | 27,85 103,01 | 33,62 103,08 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | 0,92 103,12 | 2,94 103,46 | 2,94 103,46 | 6,48 105,39 | 13,32 102,09 | 27,68 102,38 | 33,54 102,84 |
| BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p. | 6,25 0,87 | 11,91 -3,21 | 11,91 -3,21 | 6,56 -7,07 | 12,50 -9,78 | 20,56 -7,45 | -0,67 -13,41 |
| FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p. | 5,87 0,48 | 14,33 -0,78 | 14,33 -0,78 | 12,30 -1,33 | 20,61 -1,67 | 26,38 -1,64 | 7,15 -5,60 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p. | 7,35 1,97 | 16,32 1,20 | 16,32 1,20 | 13,22 -0,41 | 11,45 -10,83 | 17,20 -10,81 | 7,23 -5,51 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 5,91 -0,99 | 12,66 -1,95 | 12,66 -1,95 | 12,37 -3,68 | 23,73 -3,11 | 34,24 -8,64 | 20,15 -13,58 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p. | 5,35 -0,03 | 8,99 -6,13 | 8,99 -6,13 | 3,06 -10,57 | 6,38 -15,91 | -2,24 -30,25 | |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p. | 6,35 0,97 | 13,60 -1,51 | 13,60 -1,51 | 13,12 -0,51 | 21,36 -0,92 | 29,41 1,39 | 9,46 -3,29 |
| BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p. | 5,76 -1,29 | 10,29 -1,19 | 10,29 -1,19 | -0,68 -4,09 | 3,50 -13,62 | -5,04 -4,52 | -14,38 2,25 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p. | 2,59 -0,25 | 7,65 -0,12 | 7,65 -0,12 | 9,07 -0,65 | 24,92 -1,41 | -10,73 -1,62 | 16,51 -4,97 |
| FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP | 0,90 | 2,73 | 2,73 | 5,58 | 12,51 | 27,64 | 32,90 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|--------------|---------------|---------------|---------------|----------------|----------------|-----------------|
| % do CDI | 100,60 | 96,22 | 96,22 | 90,78 | 95,89 | 102,25 | 100,86 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p. | 5,19 2,76 | 12,99 5,45 | 12,99 5,45 | 10,86 3,19 | 33,22 17,95 | 17,27 30,45 | 55,76 37,46 |
| CARAGUATATUBA Var. IPCA + 4,99% p.p. | 1,45 0,50 | 3,70 1,41 | 3,70 1,41 | 5,61 1,41 | 12,95 3,13 | 17,23 -4,76 | 15,51 -25,48 |
| CDI | 0,90 | 2,84 | 2,84 | 6,15 | 13,05 | 27,03 | 32,62 |
| IBOVESPA | 5,38 | 15,12 | 15,12 | 13,63 | 22,28 | 28,01 | 12,74 |
| INPC + 6,00% | 1,02 | 2,20 | 2,20 | 3,95 | 9,85 | 23,32 | 43,97 |
| IPCA + 6,00% | 1,03 | 2,52 | 2,52 | 4,68 | 10,82 | 24,24 | 44,91 |

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 PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | D+0 | D+0 | D+3 du | D+3 du | | 0,30 |
| BB PREV RF IRF M | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| 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 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 1,20 |
| 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 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|--|---------------|---------------|-----------|------------|---|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS | D+1 du | D+0 | D+21 du | D+23 du | | 1,72 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | D+1 du | D+0 | D+30 du | D+32 du | | 1,72 |
| FIDC ITALIA SENIOR | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | D+0 | D+0 | D+21 du | D+23 du | O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 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 Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1 | 0,91 | 2,89 | 2,89 | 6,16 | 13,25 | 26,86 | 30,57 | 35,59 | 44,75 |
| IRF-M 1+ | 1,73 | 5,05 | 5,05 | 6,37 | 18,52 | 27,30 | 20,95 | 31,18 | 49,86 |
| IRF-M TOTAL | 1,48 | 4,38 | 4,38 | 6,28 | 16,51 | 26,79 | 24,26 | 32,58 | 48,53 |
| IMA-B 5 | 1,46 | 2,97 | 2,97 | 4,75 | 12,13 | 23,09 | 28,71 | 39,06 | 57,35 |
| IMA-B 5+ | 3,94 | 6,42 | 6,42 | 3,80 | 19,28 | 23,21 | 15,14 | 21,47 | 58,36 |
| IMA-B TOTAL | 2,75 | 4,76 | 4,76 | 4,21 | 16,05 | 23,45 | 21,89 | 29,69 | 59,46 |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,63 | 3,81 | 3,81 | 5,67 | 14,80 | 25,89 | 27,10 | 33,88 | 51,04 |
| IDKA 2 | 1,45 | 2,89 | 2,89 | 5,00 | 12,13 | 22,60 | 28,70 | 39,79 | 56,32 |
| IDKA 20 | 6,58 | 10,28 | 10,28 | 3,92 | 27,13 | 24,70 | 6,62 | 8,97 | 57,20 |
| CDI | 0,90 | 2,84 | 2,84 | 6,15 | 13,05 | 27,03 | 32,62 | 36,29 | 44,42 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | 5,38 | 15,12 | 15,12 | 13,63 | 22,28 | 28,01 | 12,74 | 16,03 | 52,68 |
| IBRX 100 | 5,48 | 14,95 | 14,95 | 13,77 | 21,27 | 26,15 | 12,05 | 15,97 | 54,69 |
| IBRX 50 | 5,31 | 14,43 | 14,43 | 14,39 | 20,06 | 26,93 | 13,55 | 17,66 | 51,96 |
| SMALL CAP | 7,05 | 11,48 | 11,48 | 3,40 | 17,12 | -0,52 | -16,63 | -17,18 | 31,02 |
| Índice Consumo - ICON | 5,98 | 12,32 | 12,32 | -1,29 | 6,98 | -20,15 | -40,99 | -40,51 | -7,65 |
| Índice Dividendos - IDIV | 6,90 | 14,61 | 14,61 | 16,04 | 26,84 | 42,88 | 33,72 | 32,38 | 92,17 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| S&P 500 | 2,43 | 7,54 | 7,54 | 7,67 | 15,27 | -13,18 | 18,31 | 77,33 | 137,73 |

Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX | 4,25 | 2,86 | 2,86 | 4,95 | 15,50 | 18,06 | 15,37 | 3,56 | 40,82 |

Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | 2,70 | 7,01 | 7,01 | 6,95 | 11,43 | -16,44 | 4,80 | 54,48 | 99,34 |

Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA | 0,56 | 1,08 | 1,08 | 1,70 | 4,62 | 10,67 | 21,81 | 27,31 | 32,79 |
| INPC | 0,55 | 0,77 | 0,77 | 0,99 | 3,71 | 9,86 | 21,02 | 27,61 | 33,33 |
| IGPM | 0,74 | 1,84 | 1,84 | 1,34 | -3,18 | 2,10 | 20,25 | 48,08 | 58,89 |
| SELIC | 0,90 | 2,84 | 2,84 | 6,15 | 13,05 | 27,03 | 32,62 | 36,29 | 44,42 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,87 | 2,05 | 2,05 | 3,70 | 8,75 | 19,63 | 36,91 | 48,80 | 61,44 |
| IPCA + 5,00% | 0,95 | 2,28 | 2,28 | 4,19 | 9,79 | 21,92 | 40,87 | 54,57 | 69,32 |
| IPCA + 5,50% | 0,99 | 2,40 | 2,40 | 4,44 | 10,30 | 23,08 | 42,88 | 57,51 | 73,37 |
| IPCA + 5,89% | 1,02 | 2,49 | 2,49 | 4,63 | 10,71 | 23,98 | 44,46 | 59,84 | 76,59 |
| IPCA + 6,00% | 1,03 | 2,52 | 2,52 | 4,68 | 10,82 | 24,24 | 44,91 | 60,50 | 77,50 |
| INPC + 4,00% | 0,86 | 1,73 | 1,73 | 2,98 | 7,80 | 18,75 | 36,03 | 49,15 | 62,09 |
| INPC + 6,00% | 1,02 | 2,20 | 2,20 | 3,95 | 9,85 | 23,32 | 43,97 | 60,89 | 78,22 |

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%) | 20.446.133,96 | 5,940000 | 20.563.102,00 | 5,484300 | 116.968,04 |
| NTN-B 150525 (5,980000%) | 10.437.787,18 | 5,980000 | 10.502.112,32 | 5,484300 | 64.325,14 |
| NTN-B 150527 (6,090000%) | 5.163.325,54 | 6,090000 | 5.289.190,80 | 5,263100 | 125.865,26 |
| NTN-B 150535 (5,560000%) | 17.056.461,33 | 5,560000 | 17.354.501,30 | 5,342800 | 298.039,97 |
| NTN-B 150535 (5,821000%) | 19.950.108,91 | 5,821000 | 20.723.054,50 | 5,342800 | 772.945,59 |
| NTN-B 150545 (5,710000%) | 32.620.125,14 | 5,710000 | 33.531.333,53 | 5,477000 | 911.208,39 |
| NTN-B 150545 (5,760000%) | 10.846.005,72 | 5,760000 | 11.214.583,05 | 5,477000 | 368.577,33 |
| NTN-B 150545 (5,781000%) | 10.828.026,57 | 5,781000 | 11.223.576,30 | 5,477000 | 395.549,73 |
| NTN-B 150555 (5,815000%) | 10.810.233,44 | 5,815000 | 11.343.476,59 | 5,472400 | 533.243,15 |
| NTN-B 150555 (5,850000%) | 10.452.679,54 | 5,850000 | 11.024.583,68 | 5,472400 | 571.904,14 |
| NTN-B 150824 (5,892000%) | 5.622.998,29 | 5,892000 | 5.599.513,64 | 6,618000 | -23.484,65 |
| NTN-B 150824 (5,910000%) | 10.628.957,20 | 5,910000 | 10.585.848,60 | 6,618000 | -43.108,60 |
| NTN-B 150824 (6,090000%) | 5.313.437,94 | 6,090000 | 5.297.182,49 | 6,618000 | -16.255,45 |
| NTN-B 150824 (6,440000%) | 20.762.619,82 | 6,440000 | 20.741.620,49 | 6,618000 | -20.999,33 |
| NTN-B 150824 (6,480000%) | 21.619.550,06 | 6,480000 | 21.601.773,92 | 6,618000 | -17.776,14 |
| NTN-B 150824 (6,680000%) | 5.333.609,50 | 6,680000 | 5.335.506,15 | 6,618000 | 1.896,65 |
| NTN-B 150824 (6,990300%) | 30.856.986,93 | 6,990300 | 30.922.941,49 | 6,618000 | 65.954,56 |
| NTN-B 150826 (6,350000%) | 15.522.579,04 | 6,350000 | 15.937.006,80 | 5,200000 | 414.427,76 |
| NTN-B 150828 (6,350000%) | 15.524.051,75 | 6,350000 | 16.205.791,52 | 5,220700 | 681.739,77 |
| NTN-B 150830 (5,708000%) | 11.104.938,84 | 5,708000 | 11.388.429,50 | 5,220000 | 283.490,66 |
| NTN-B 150840 (5,650000%) | 945.690,54 | 5,650000 | 971.735,01 | 5,381900 | 26.044,47 |
| NTN-B 150840 (5,770000%) | 11.133.249,80 | 5,770000 | 11.578.701,62 | 5,381900 | 445.451,82 |
| NTN-B 150850 (5,713000%) | 11.192.802,30 | 5,713000 | 11.549.218,79 | 5,471800 | 356.416,49 |
| NTN-B 150850 (5,780000%) | 10.818.732,82 | 5,780000 | 11.259.799,22 | 5,471800 | 441.066,40 |
| NTN-B 150850 (5,815000%) | 11.117.474,27 | 5,815000 | 11.622.722,17 | 5,471800 | 505.247,90 |
| NTN-B 150850 (5,916000%) | 3.990.999,52 | 5,916000 | 4.226.444,42 | 5,471800 | 235.444,90 |
| NTN-B 150850 (5,920000%) | 10.689.467,83 | 5,920000 | 11.328.708,64 | 5,471800 | 639.240,81 |
| NTN-B 150850 (5,970000%) | 20.478.458,54 | 5,970000 | 21.839.692,17 | 5,471800 | 1.361.233,63 |

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 | ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 1.952,71 | 0,00 | 0,46251104 | 4.221,9748760000 |
| 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 | ITAÚ 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 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|-----|------------|--|---------------|---------------|--------------------|------------------|
| 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 |
| 245 | 01/12/2023 | BB PREV RF IRF M | 20.000.000,00 | 0,00 | 2.677.664,49022000 | 7,4691956640 |
| 246 | 01/12/2023 | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 10.000.000,00 | 0,00 | 2.858.362,78841400 | 3,4985062220 |
| 247 | 01/12/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 20.000.000,00 | 6.584.998,81762800 | 3,0372063160 |
| 248 | 01/12/2023 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 10.000.000,00 | 0,00 | 7.487.082,69532600 | 1,3356337050 |
| 249 | 01/12/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 46.721,50 | 0,00 | 15.383,05112800 | 3,0372063130 |
| 250 | 01/12/2023 | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 5.000.000,00 | 0,00 | 2.519.356,21379055 | 1,9846340000 |
| 251 | 01/12/2023 | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 10.000.000,00 | 0,00 | 5.317.570,63594954 | 1,8805580000 |
| 252 | 01/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 35.000.000,00 | 7.070.130,03660200 | 4,9504039981 |
| 253 | 05/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 10.621,41 | 0,00 | 2.143,50668274 | 4,9551560000 |
| 254 | 07/12/2023 | ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI | 400,00 | 0,00 | 9,17545970 | 43,5945460000 |
| 255 | 07/12/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 713.358,87 | 0,00 | 234.435,80821400 | 3,0428750430 |
| 256 | 08/12/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 8.379,05 | 0,00 | 2.752,39786600 | 3,0442728150 |
| 257 | 08/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 51.824,98 | 0,00 | 10.443,59238700 | 4,9623710000 |
| 258 | 08/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 4.821,25 | 971,56178100 | 4,9623710000 |
| 259 | 08/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 45.000,00 | 9.068,24580427 | 4,9623710000 |
| 260 | 14/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 32.952,15 | 0,00 | 6.627,65888500 | 4,9719140000 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|--|-----------------------|-----------------------|--------------------|------------------|
| 261 | 14/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 3.772.944,23 | 758.851,46604200 | 4,9719140000 |
| 262 | 14/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 218.474,97 | 43.941,82401385 | 4,9719140000 |
| 263 | 15/12/2023 | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 1.952,71 | 0,00 | 0,45532201 | 4.288,6351630000 |
| 264 | 18/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 138.268,35 | 0,00 | 27.785,23307863 | 4,9763250000 |
| 265 | 19/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 5.296,59 | 1.063,89162600 | 4,9785050000 |
| 266 | 20/12/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 8.784,76 | 0,00 | 2.875,36676900 | 3,0551789400 |
| 267 | 20/12/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1.201.288,53 | 0,00 | 393.197,43739700 | 3,0551789400 |
| 268 | 21/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 4.319.520,59 | 0,00 | 866.872,46268673 | 4,9828790000 |
| 269 | 21/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 657.778,97 | 0,00 | 132.007,81516067 | 4,9828790000 |
| 270 | 22/12/2023 | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 5.000.000,00 | 0,00 | 2.425.537,22011120 | 2,0613990000 |
| 271 | 22/12/2023 | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5.000.000,00 | 0,00 | 1.121.302,50498980 | 4,4591000000 |
| 272 | 22/12/2023 | FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP | 0,00 | 5.000.000,00 | 1.787.704,38377294 | 2,7968830000 |
| 273 | 22/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 41.154,49 | 0,00 | 8.255,51926000 | 4,9850880000 |
| 274 | 22/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 5.000.000,00 | 1.002.991,32137800 | 4,9850880000 |
| 275 | 26/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 49.837,34 | 0,00 | 9.992,59938700 | 4,9874250000 |
| 276 | 27/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 106.463,48 | 0,00 | 21.337,56890741 | 4,9894850000 |
| 277 | 28/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 32.952,12 | 0,00 | 6.601,53967200 | 4,9915810000 |
| 278 | 28/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 3.907.293,94 | 782.776,82762235 | 4,9915810000 |
| 279 | 28/12/2023 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 225.119,54 | 45.099,84712259 | 4,9915810000 |
| 280 | 28/12/2023 | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 1.952,71 | 0,00 | 0,45365666 | 4.304,3785430000 |
| Total | | | 135.081.316,45 | 126.733.839,01 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.460.945,42

Value-At-Risk: 0,77%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | Limite ⁽⁵⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| CARAGUATATUBA | | 0,77 | | 0,77 | | | 708.131.106,49 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 7º I, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| NTN-B 150525 (5,940000%) | | 0,07 | 0,00 | 0,08 | | | 20.446.133,96 | 2,89 |
| NTN-B 150525 (5,980000%) | | 0,07 | 0,00 | 0,08 | | | 10.437.787,18 | 1,47 |
| NTN-B 150527 (6,090000%) | | 0,07 | 0,00 | 0,08 | | | 5.163.325,54 | 0,73 |
| NTN-B 150535 (5,560000%) | | 0,08 | 0,00 | 0,08 | | | 17.056.461,33 | 2,41 |
| NTN-B 150535 (5,821000%) | | 0,08 | 0,00 | 0,08 | | | 19.950.108,91 | 2,82 |
| NTN-B 150545 (5,710000%) | | 0,08 | 0,00 | 0,09 | | | 32.620.125,14 | 4,61 |
| NTN-B 150545 (5,760000%) | | 0,08 | 0,00 | 0,09 | | | 10.846.005,72 | 1,53 |
| NTN-B 150545 (5,781000%) | | 0,08 | 0,00 | 0,09 | | | 10.828.026,57 | 1,53 |
| NTN-B 150555 (5,815000%) | | 0,08 | 0,00 | 0,09 | | | 10.810.233,44 | 1,53 |
| NTN-B 150555 (5,850000%) | | 0,13 | 0,00 | 0,13 | | | 10.452.679,54 | 1,48 |
| NTN-B 150824 (5,892000%) | | 0,07 | 0,00 | 0,08 | | | 5.622.998,29 | 0,79 |
| NTN-B 150824 (5,910000%) | | 0,07 | 0,00 | 0,08 | | | 10.628.957,20 | 1,50 |
| NTN-B 150824 (6,090000%) | | 0,07 | 0,00 | 0,08 | | | 5.313.437,94 | 0,75 |
| NTN-B 150824 (6,440000%) | | 0,07 | 0,00 | 0,08 | | | 20.762.619,82 | 2,93 |
| NTN-B 150824 (6,480000%) | | 0,07 | 0,00 | 0,08 | | | 21.619.550,06 | 3,05 |
| NTN-B 150824 (6,680000%) | | 0,07 | 0,00 | 0,08 | | | 5.333.609,50 | 0,75 |
| NTN-B 150824 (6,990300%) | | 0,07 | 0,00 | 0,08 | | | 30.856.986,93 | 4,36 |
| NTN-B 150826 (6,350000%) | | 0,07 | 0,00 | 0,08 | | | 15.522.579,04 | 2,19 |
| NTN-B 150828 (6,350000%) | | 0,07 | 0,00 | 0,08 | | | 15.524.051,75 | 2,19 |
| NTN-B 150830 (5,708000%) | | 0,08 | 0,00 | 0,08 | | | 11.104.938,84 | 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%) | | 0,08 | 0,00 | 0,09 | | | 945.690,54 | 0,13 |
| NTN-B 150840 (5,770000%) | | 0,08 | 0,00 | 0,09 | | | 11.133.249,80 | 1,57 |
| NTN-B 150850 (5,713000%) | | 0,08 | 0,00 | 0,09 | | | 11.192.802,30 | 1,58 |
| NTN-B 150850 (5,780000%) | | 0,08 | 0,00 | 0,09 | | | 10.818.732,82 | 1,53 |
| NTN-B 150850 (5,815000%) | | 0,08 | 0,00 | 0,09 | | | 11.117.474,27 | 1,57 |
| NTN-B 150850 (5,916000%) | | 0,08 | 0,00 | 0,09 | | | 3.990.999,52 | 0,56 |
| NTN-B 150850 (5,920000%) | | 0,12 | 0,00 | 0,12 | | | 10.689.467,83 | 1,51 |
| NTN-B 150850 (5,970000%) | | 0,21 | 0,00 | 0,21 | | | 20.478.458,54 | 2,89 |
| Sub-total | 0,61 | 0,07 | 0,00 | | 0,10 | 0,96 | 371.267.492,32 | 52,43 |

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | | 0,20 | 0,00 | 0,21 | | | 10.089.445,05 | 1,42 |
| FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO | | 1,74 | 0,00 | 0,88 | | | 2.547.719,87 | 0,36 |
| SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | | 0,02 | -0,00 | 0,01 | | | 20.592.489,76 | 2,91 |
| BB PREV RF IRF M | | 1,35 | 0,03 | 0,03 | | | 20.272.630,17 | 2,86 |
| ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI | | 0,08 | 0,00 | 0,12 | | | 476.424,05 | 0,07 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | | 0,09 | 0,00 | 0,01 | | | 23.191.158,11 | 3,27 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 2,20 | 0,02 | 0,03 | | | 10.216.658,64 | 1,44 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP | | 1,96 | 0,02 | 0,02 | | | 10.589.571,33 | 1,50 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | | 0,72 | 0,01 | 0,71 | | | 17.551.924,60 | 2,48 |
| SANTANDER RF ATIVO FIC | | 1,18 | 0,00 | 1,18 | | | 648.350,81 | 0,09 |
| Sub-total | 0,69 | 0,76 | 0,09 | | 0,50 | 1,24 | 116.176.372,39 | 16,41 |

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 | | 2,22 | 0,02 | 0,19 | | | 7.229.266,22 | 1,02 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | | 0,03 | -0,00 | 0,02 | | | 27.807.896,33 | 3,93 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | | 0,04 | -0,00 | 0,04 | | | 22.582.387,58 | 3,19 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | | 0,02 | -0,00 | 0,01 | | | 48.459.477,36 | 6,84 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | | 0,03 | 0,00 | 0,03 | | | 17.144.776,98 | 2,42 |
| Sub-total | 0,19 | 0,13 | 0,02 | | 0,69 | 1,02 | 123.223.804,47 | 17,40 |

Artigo 7º V, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| FIDC ITALIA SENIOR | | 5,95 | 0,00 | 5,95 | | | 1.515.913,89 | 0,21 |
| Sub-total | 7,92 | 5,95 | 0,00 | | 0,17 | 2,25 | 1.515.913,89 | 0,21 |

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,45%

Artigo 8º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BB AÇÕES DIVIDENDOS | | 6,59 | 0,02 | 1,72 | | | 1.749.022,42 | 0,25 |
| BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | | 10,28 | 0,08 | 2,70 | | | 5.756.910,02 | 0,81 |
| FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS | | 7,37 | 0,09 | 1,22 | | | 8.547.298,67 | 1,21 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | | 6,32 | 0,14 | 1,41 | | | 16.680.385,76 | 2,36 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | | 7,33 | 0,06 | 2,89 | | | 6.782.606,91 | 0,96 |
| BRADESCO F I A SELECTION | | 7,56 | 0,06 | 2,05 | | | 5.968.033,78 | 0,84 |
| ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | | 9,44 | 0,12 | 3,64 | | | 9.127.054,25 | 1,29 |
| Sub-total | 13,27 | 7,45 | 0,55 | | 0,39 | 6,02 | 54.611.311,81 | 7,71 |

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,47%

Artigo 10º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP | | 0,14 | 0,00 | 0,14 | | | 16.390.936,92 | 2,31 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | | 6,36 | 0,07 | 5,46 | | | 10.261.153,31 | 1,45 |
| Sub-total | 1,78 | 2,47 | 0,07 | | 0,45 | 1,70 | 26.652.090,23 | 3,76 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,24%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | | 6,24 | 0,04 | 0,59 | | | 14.684.121,38 | 2,07 |
| Sub-total | 8,58 | 6,24 | 0,04 | | 0,20 | 2,59 | 14.684.121,38 | 2,07 |

(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 (%)