



LDB
EMPRESAS

CARAGUATATUBA
DEZEMBRO 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	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,940000%)	2,93	0,12	0,86	5,24	20.446.133,96	2,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,33	0,13	0,86	10,91	10.437.787,18	1,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,34	0,16	0,91	11,08	5.163.325,54	0,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,37	0,23	0,94	10,60	17.056.461,33	2,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,37	0,23	0,96	10,88	19.950.108,91	2,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,40	0,29	1,01	10,83	32.620.125,14	4,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,41	0,30	1,02	10,88	10.846.005,72	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,41	0,30	1,02	10,90	10.828.026,57	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,43	0,34	1,07	10,98	10.810.233,44	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,44	0,31	1,07	11,02	10.452.679,54	1,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,32	0,10	0,83	10,80	5.622.998,29	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	0,32	0,10	0,83	10,82	10.628.957,20	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	0,32	0,10	0,85	11,00	5.313.437,94	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	0,32	0,10	0,87	10,06	20.762.619,82	2,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	0,32	0,10	0,88	11,40	21.619.550,06	3,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,680000%)	0,32	0,10	0,89	11,61	5.333.609,50	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,990300%)	2,98	0,10	0,91	5,92	30.856.986,93	4,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	0,33	0,14	0,91	9,76	15.522.579,04	2,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	0,34	0,15	0,93	9,78	15.524.051,75	2,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,35	0,19	0,91	10,71	11.104.938,84	1,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,39	0,26	0,98	10,73	945.690,54	0,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,39	0,26	0,99	10,86	11.133.249,80	1,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,42	0,32	1,04	10,86	11.192.802,30	1,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,42	0,32	1,05	10,93	10.818.732,82	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,42	0,32	1,05	10,97	11.117.474,27	1,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,42	0,32	1,06	11,07	3.990.999,52	0,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,43	0,30	1,06	11,08	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	11,04	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	Ano				
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	8,75	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	Ano				
LONGO PRAZO										
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,04	0,04	0,89	9,32	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	13,06	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	12,88	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	3,97	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	5,90	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	13,59	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	5,20	648.350,81	0,09	313.213.226,79	0,21
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,20	0,05	1,24	12,84	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	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,76	0,09	2,84	3,28	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	13,32	27.807.896,33	3,93	13.988.008.512,08	0,20
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,05	0,95	13,57	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	12,98	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	12,32	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	13,06	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	Ano				
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	112,52	2,25	2,25	274,45	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	274,45	1.515.913,89	0,21		

Renda Fixa			0,35	0,15	1,02	11,97	612.183.583,07	86,45		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	--------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A 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	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	15,36	-0,00	6,35	21,36	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	3,50	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	20,61	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	23,73	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	11,45	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	12,50	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	6,38	9.127.054,25	1,29	161.464.884,10	5,65
Sub-total Artigo 8º I			16,63	-0,01	6,02	15,52	54.611.311,81	7,71		
Renda Variável			16,63	-0,01	6,02	15,52	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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,18	-0,00	2,59	24,92	14.684.121,38	2,07	1.995.875.754,00	0,74
Sub-total Artigo 9º III			15,18	-0,00	2,59	24,92	14.684.121,38	2,07		
Investimentos no Exterior			14,99	-0,00	2,59	24,90	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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,39	0,05	0,90	11,39	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	19,45	26.652.090,23	3,76		
Investimentos Estruturados			4,46	0,04	1,70	19,45	26.652.090,23	3,76		
Total			1,79	0,13	1,45	12,95	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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,96 106,59	11,04 84,62	2,42 85,16	4,45 72,38	11,04 84,62	3.513.377,15	36.401.125,30
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,24 138,14	12,84 98,45	3,33 117,28	5,49 89,22	12,84 98,45	1.330.604,01	6.277.712,99
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,02 114,30	13,06 100,10	2,99 105,33	6,22 101,22	13,06 100,10	1.329.775,51	17.201.008,18
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	2,25 251,57	274,45 2.103,46	226,68 7.987,14	269,86 4.388,42	274,45 2.103,46	33.427,88	1.314.508,36
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,02 0,64	15,52 -6,76	12,54 -2,57	9,02 -4,62	15,52 -6,76	3.102.308,93	9.139.000,30
Artigo 9º II % do CDI	0,00 0,00	6,13 47,01	0,00 0,00	0,00 0,00	6,13 47,01	0,00	160.631,81
Artigo 9º III % do CDI	2,59 288,79	24,92 191,01	7,65 269,47	9,07 147,55	24,92 191,01	370.505,02	5.987.386,87
Artigo 10º I % do CDI	1,70 189,99	19,45 149,08	3,55 124,97	6,42 104,41	19,45 149,08	443.814,38	3.443.163,17
CARAGUATATUBA (Total)						10.123.812,88	79.924.536,98

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%)	20.272.511,38	0,00	0,00	0,00	20.446.133,96	173.622,58	1.041.088,97
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.348.862,51	0,00	0,00	0,00	10.437.787,18	88.924,67	1.068.542,45
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.116.796,31	0,00	0,00	0,00	5.163.325,54	46.529,23	535.747,65
NTN-B 150535 (5,560000%)	16.898.357,04	0,00	0,00	0,00	17.056.461,33	158.104,29	1.698.219,61
NTN-B 150535 (5,821000%)	19.760.250,92	0,00	0,00	0,00	19.950.108,91	189.857,99	2.034.414,38
NTN-B 150545 (5,710000%)	32.292.724,98	0,00	0,00	0,00	32.620.125,14	327.400,16	3.310.097,15
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.736.609,17	0,00	0,00	0,00	10.846.005,72	109.396,55	1.105.690,10
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.718.600,09	0,00	0,00	0,00	10.828.026,57	109.426,48	1.105.995,72
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.696.236,59	0,00	0,00	0,00	10.810.233,44	113.996,85	1.111.413,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.342.087,32	0,00	0,00	0,00	10.452.679,54	110.592,22	1.078.308,54
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.576.652,12	0,00	0,00	0,00	5.622.998,29	46.346,17	561.407,42
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.541.179,12	0,00	0,00	0,00	10.628.957,20	87.778,08	1.063.136,10
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.268.880,42	0,00	0,00	0,00	5.313.437,94	44.557,52	539.377,56
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.583.033,60	0,00	0,00	0,00	20.762.619,82	179.586,22	1.936.809,98
NTN-B 150824 (6,480000%)	21.432.003,33	0,00	0,00	0,00	21.619.550,06	187.546,73	2.266.653,27
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.286.537,49	0,00	0,00	0,00	5.333.609,50	47.072,01	568.503,84
NTN-B 150824 (6,990300%)	30.577.630,54	0,00	0,00	0,00	30.856.986,93	279.356,39	1.742.207,40
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.382.450,74	0,00	0,00	0,00	15.522.579,04	140.128,30	1.406.267,42
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.380.762,51	0,00	0,00	0,00	15.524.051,75	143.289,24	1.409.414,60
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.004.907,14	0,00	0,00	0,00	11.104.938,84	100.031,70	1.099.818,95
NTN-B 150840 (5,650000%)	936.546,82	0,00	0,00	0,00	945.690,54	9.143,72	93.748,86
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.024.293,81	0,00	0,00	0,00	11.133.249,80	108.955,99	1.115.774,62
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.077.779,70	0,00	0,00	0,00	11.192.802,30	115.022,60	1.121.296,61
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.706.839,20	0,00	0,00	0,00	10.818.732,82	111.893,62	1.090.439,66
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.002.118,12	0,00	0,00	0,00	11.117.474,27	115.356,15	1.124.088,28
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.949.194,69	0,00	0,00	0,00	3.990.999,52	41.804,83	407.198,96
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.577.432,79	0,00	0,00	0,00	10.689.467,83	112.035,04	1.091.222,27
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 Financ. Ano (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	1.579.777,96
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	216.658,64
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	589.571,33
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	1.180.984,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
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	353.173,41
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	471.701,30	400,00	0,00	0,00	476.424,05	4.322,75	54.506,47
SANTANDER RF ATIVO FIC	638.558,62	0,00	0,00	0,00	648.350,81	9.792,19	32.046,67
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	1.738.573,16
	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 Financ. Ano (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	4.802.184,81
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	16.985.997,81	0,00	0,00	0,00	17.144.776,98	158.779,17	2.144.776,98
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	6.153.853,92
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	3.400.584,03
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	7.029.882,85	0,00	0,00	0,00	7.229.266,22	199.383,37	229.301,39
	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 Financ. Ano (R\$)
FIDC ITALIA SENIOR	1.482.486,01	0,00	0,00	0,00	1.515.913,89	33.427,88	1.314.508,36
	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 Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.644.546,67	0,00	0,00	0,00	1.749.022,42	104.475,75	307.807,73
BRADERCO F I A SELECTION	5.616.709,88	0,00	0,00	0,00	5.968.033,78	351.323,90	663.206,31
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.443.289,99	0,00	0,00	0,00	5.756.910,02	313.620,03	194.840,55
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	1.460.484,79
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	3.199.387,41
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	6.317.954,02	0,00	0,00	0,00	6.782.606,91	464.652,89	696.708,30
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	8.663.371,91	0,00	0,00	0,00	9.127.054,25	463.682,34	546.980,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	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 Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14.313.616,36	0,00	0,00	0,00	14.684.121,38	370.505,02	5.987.386,87
	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 Financ. Ano (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	2.055.931,52
	21.208.275,85	10.000.000,00	-5.000.000,00	0,00	26.652.090,23	443.814,38	

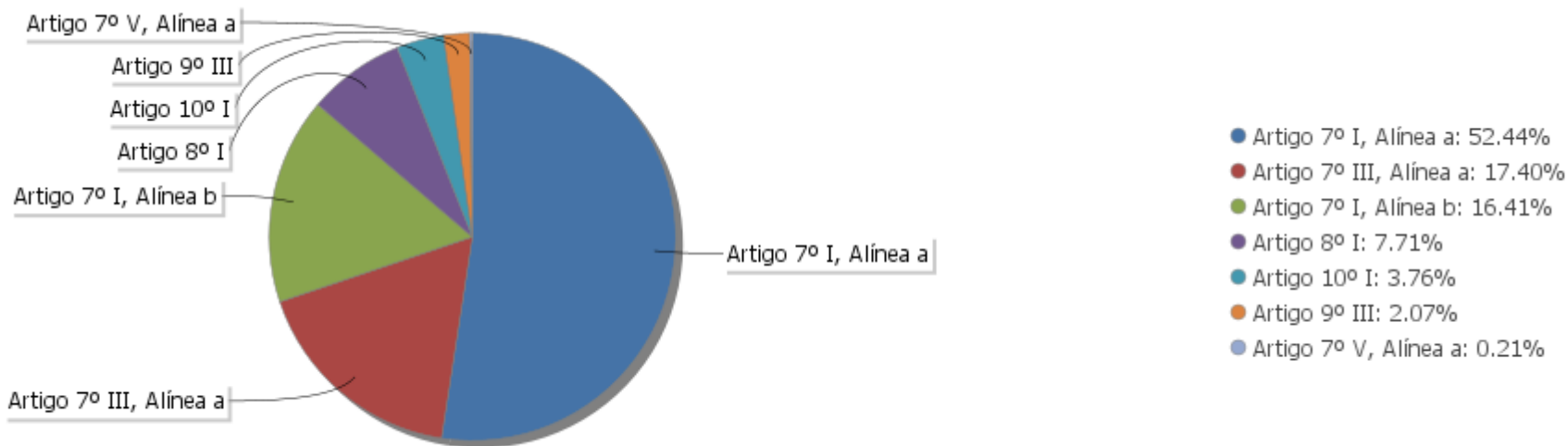
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

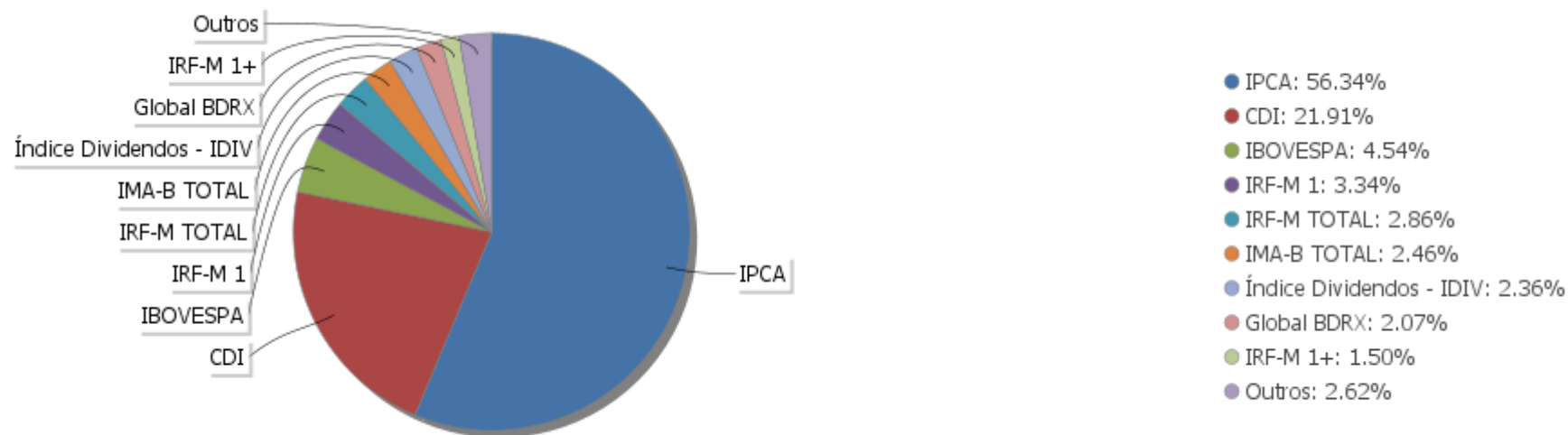
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	295.726.268,58	41,76	295.726.268,58	41,76	
de 31 dias a 365 dias	141.275.505,33	19,95	437.001.773,91	61,71	
acima de 365 dias	271.129.332,58	38,29	708.131.106,49	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

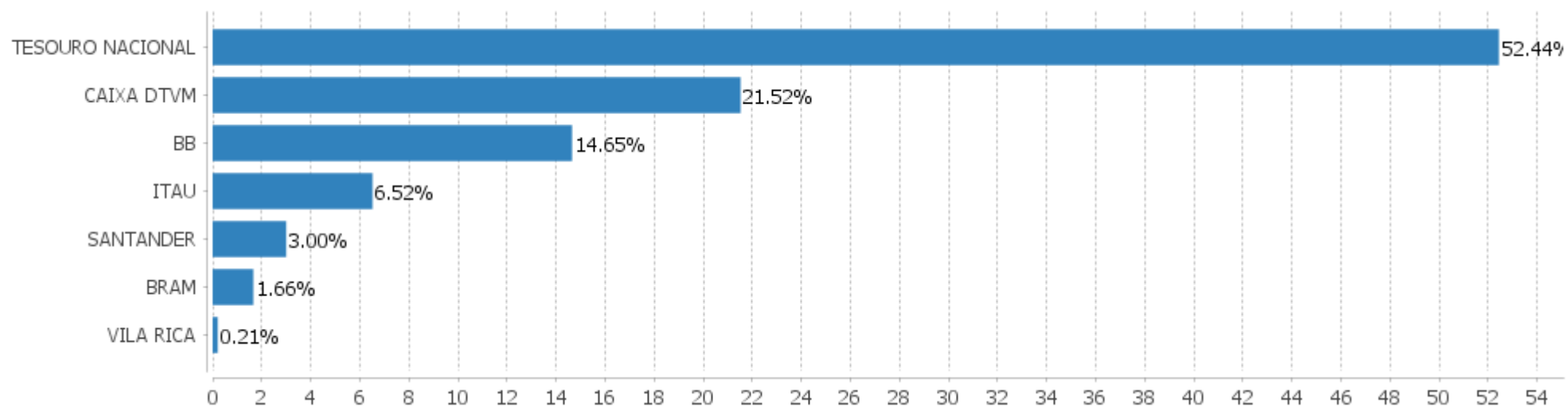


Alocação Por Estratégia



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

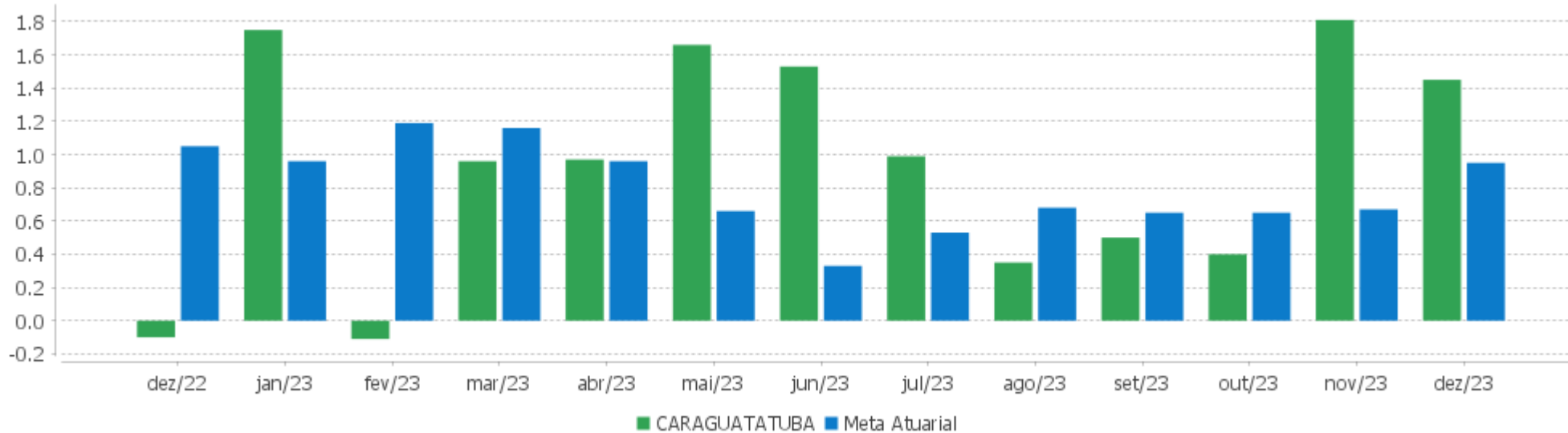


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150850 (5,970000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,50	4,86 0,24	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	7,69 3,07	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	10,60 5,98	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	10,73 6,11	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	10,71 6,09	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	10,86 6,24	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	11,32 6,70	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	11,61 6,99	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	10,88 6,25	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	11,08 6,46	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	11,00 6,38	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	10,90 6,28	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	10,80 6,18	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	11,37 6,74	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	11,02 6,40	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	10,82 6,20	2,27 1,19	4,27 2,57	10,82 6,20	17,12 6,45	
NTN-B 150850 (5,713000%)	1,04	10,86	2,45	4,40	10,86	20,53	32,98

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.	0,48	6,24	1,37	2,70	6,24	9,85	11,17
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,50	11,07 6,45	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	11,08 6,45	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	10,97 6,34	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	8,68 4,06	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	11,33 6,71	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	10,88 6,26	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	10,91 6,29	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	11,40 6,78	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	10,98 6,36	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	10,93 6,31	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	10,83 6,21	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	18,18 -0,33	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	13,06 -0,19	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	15,86 -0,20	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	13,38 102,54	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	12,88 -0,36	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	13,59 8,97	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	16,06	4,33	6,05	16,06	26,02	23,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,45	-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	14,99 10,37	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	16,49 4,37	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	12,90 98,84	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	217,62 1.667,91	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	13,57 104,01	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	15,65 -0,41	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	12,98 99,47	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	13,39 102,59	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	13,32 102,09	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	12,50 -9,78	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	20,61 -1,67	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	11,45 -10,83	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	23,73 -3,11	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	6,38 -15,91	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	21,36 -0,92	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	3,50 -13,62	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	24,92 -1,41	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	12,51	2,73	5,58	12,51	27,64	32,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	100,60	95,89	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	33,22 17,95	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	12,95 3,13	3,70 1,41	5,61 1,41	12,95 3,13	17,23 -4,76	15,51 -25,48
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,91	13,25	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	18,52	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	16,51	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	12,13	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	19,28	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	14,80	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	12,13	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	27,13	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Renda Variável

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

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	2,43	15,27	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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			72.424.212,01	73.178.950,52		

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 (%)