



CARAGUATATUBA
JANEIRO 2024



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.01.2024.

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

86,85%

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	0,06	1,05	1,05	20.660.444,28	2,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,30	0,07	1,05	1,05	10.547.486,90	1,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,31	0,10	1,06	1,06	5.218.093,53	0,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,38	0,17	1,02	1,02	17.229.840,63	2,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,39	0,17	1,04	1,04	20.157.237,27	2,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,47	0,24	1,03	1,03	32.955.781,51	4,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,47	0,24	1,03	1,03	10.958.057,69	1,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,47	0,24	1,03	1,03	10.940.087,20	1,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,53	0,28	1,04	1,04	10.922.414,64	1,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,51	0,25	1,04	1,04	10.561.468,01	1,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,29	0,04	1,04	1,04	5.681.711,40	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	0,29	0,04	1,05	1,05	10.740.124,70	1,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	0,29	0,04	1,06	1,06	5.369.775,09	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	0,29	0,04	1,09	1,09	20.988.900,95	2,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	0,29	0,05	1,09	1,09	21.855.747,43	3,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,680000%)	0,29	0,04	1,11	1,11	5.392.789,27	0,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,990300%)	2,97	0,04	1,14	1,14	31.207.279,48	4,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	0,30	0,08	1,08	1,08	15.690.603,85	2,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	0,32	0,10	1,08	1,08	15.692.104,14	2,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,34	0,13	1,03	1,03	11.219.192,32	1,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,42	0,20	1,02	1,02	955.374,06	0,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,43	0,21	1,03	1,03	11.248.362,34	1,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,50	0,26	1,03	1,03	11.308.002,39	1,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,50	0,26	1,03	1,03	10.930.684,59	1,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,50	0,26	1,04	1,04	11.232.849,53	1,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,51	0,26	1,05	1,05	4.032.752,03	0,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,49	0,24	1,05	1,05	10.801.349,08	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,970000%)	4,14	0,25	1,05	1,05	20.693.628,61	2,88
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,36	0,15	1,06	1,06	375.192.142,92	52,13

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	1,30	0,05	0,85	0,85	10.175.121,03	1,41	6.413.203.187,61	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA	2,90	0,16	0,73	0,73	2.566.301,99	0,36	254.666.937,87	1,01

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	0,05	0,04	0,96	0,96	20.789.620,60	2,89	7.976.227.392,61	0,26
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,43	0,17	0,66	0,66	20.406.064,12	2,84	4.127.932.079,70	0,49
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,33	0,03	0,82	0,82	480.745,23	0,07	499.198.947,25	0,10
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,33	0,05	0,86	0,86	23.391.668,44	3,25	7.961.364.534,06	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,15	0,20	-0,47	-0,47	10.169.125,19	1,41	5.008.664.499,36	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,55	0,22	0,59	0,59	10.651.790,99	1,48	1.608.068.056,62	0,66
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,31	0,11	0,66	0,66	17.666.902,46	2,45	5.336.453.186,66	0,33
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,80	0,13	0,32	0,32	650.428,15	0,09	330.883.273,79	0,20
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,17	0,11	0,66	0,66	116.947.768,20	16,25		

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	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,52	0,26	-0,56	-0,56	7.188.919,46	1,00	467.744.830,38	1,54
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	1,00	1,00	33.615.647,57	4,67	15.073.540.268,85	0,22
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,11	0,04	1,01	1,01	22.812.204,06	3,17	5.741.628.322,41	0,40
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,04	0,97	0,97	50.437.113,30	7,01	16.400.080.186,89	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,05	1,01	1,01	17.317.378,79	2,41	5.587.152.012,51	0,31
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,19	0,06	0,90	0,90	131.371.263,18	18,25		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	111,31	0,72	0,72	0,72	1.526.876,04	0,21	58.269.998,38	2,62
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			111,31	0,72	0,72	0,72	1.526.876,04	0,21		

Renda Fixa			0,36	0,12	0,95	0,95	625.038.050,34	86,85		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

7,27%

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	14,67	0,55	-4,17	-4,17	1.676.101,61	0,23	583.694.086,69	0,29
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	20,86	1,57	-6,88	-6,88	5.360.620,44	0,74	671.967.360,08	0,80
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	16,61	0,60	-4,13	-4,13	8.193.980,34	1,14	687.126.381,98	1,19
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13,72	0,66	-3,07	-3,07	16.167.942,34	2,25	988.361.606,80	1,64
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	14,88	-0,64	-2,29	-2,29	6.627.547,06	0,92	1.251.206.665,79	0,53
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	16,22	0,71	-4,28	-4,28	5.712.377,88	0,79	436.141.421,13	1,31
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	19,02	1,09	-6,24	-6,24	8.557.376,24	1,19	147.479.138,82	5,80
Sub-total Artigo 8º I			15,86	0,65	-4,24	-4,24	52.295.945,91	7,27		
Renda Variável			15,86	0,65	-4,24	-4,24	52.295.945,91	7,27		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,13%

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	14,62	-1,12	4,56	4,56	15.353.840,71	2,13	2.108.221.544,73	0,73
Sub-total Artigo 9º III			14,62	-1,12	4,56	4,56	15.353.840,71	2,13		
Investimentos no Exterior			14,47	-1,12	4,56	4,56	15.353.840,71	2,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,75%

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	0,31	0,06	0,93	0,93	16.543.351,69	2,30	1.343.835.456,65	1,23
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,77	-1,62	1,69	1,69	10.434.086,12	1,45	1.668.294.580,56	0,63
Sub-total Artigo 10º I			1,64	-0,59	1,22	1,22	26.977.437,81	3,75		
Investimentos Estruturados			1,64	-0,59	1,22	1,22	26.977.437,81	3,75		
Total			1,68	0,11	0,63	0,63	719.665.274,77	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	375.192.142,92	52,13	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	116.947.768,20	16,25	0,00	16,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	131.371.263,18	18,25	0,00	19,80	75,00	0,00	75,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.526.876,04	0,21	0,00	0,20	15,00	0,00	15,00
	Total Renda Fixa	625.038.050,34	86,85					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	52.295.945,91	7,27	0,00	6,00	45,00	0,00	45,00
	Total Renda Variável	52.295.945,91	7,27					45,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	15.353.840,71	2,13	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.353.840,71	2,13					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	26.977.437,81	3,75	0,00	8,00	15,00	0,00	15,00
	Total Investimentos Estruturados	26.977.437,81	3,75					20,00
Total		719.665.274,77	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	1,06 109,35	1,06 109,35	2,75 97,85	5,04 83,40	10,90 84,65	3.924.650,60	3.924.650,60
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,66 68,65	0,66 68,65	3,54 126,01	5,25 86,90	12,41 96,44	770.995,81	770.995,81
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,90 92,99	0,90 92,99	2,97 105,86	6,03 99,93	12,83 99,70	1.146.780,60	1.146.780,60
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,72 74,81	0,72 74,81	9,56 340,61	268,98 4.454,28	274,87 2.135,38	10.962,15	10.962,15
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,24 0,55	-4,24 0,55	13,06 0,15	1,20 -3,57	6,87 -5,76	-2.315.365,90	-2.315.365,90
Artigo 9º III % do CDI	4,56 471,80	4,56 471,80	14,15 504,32	11,69 193,50	25,21 195,87	669.719,33	669.719,33
Artigo 10º I % do CDI	1,22 126,28	1,22 126,28	3,92 139,83	6,66 110,31	13,61 105,75	325.347,58	325.347,58
CARAGUATATUBA (Total)						4.533.090,17	4.533.090,17

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%)	20.446.133,96	0,00	0,00	0,00	20.660.444,28	214.310,32	214.310,32
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.437.787,18	0,00	0,00	0,00	10.547.486,90	109.699,72	109.699,72
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.163.325,54	0,00	0,00	0,00	5.218.093,53	54.767,99	54.767,99
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.056.461,33	0,00	0,00	0,00	17.229.840,63	173.379,30	173.379,30
NTN-B 150535 (5,821000%)	19.950.108,91	0,00	0,00	0,00	20.157.237,27	207.128,36	207.128,36
NTN-B 150545 (5,710000%)	32.620.125,14	0,00	0,00	0,00	32.955.781,51	335.656,37	335.656,37
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.846.005,72	0,00	0,00	0,00	10.958.057,69	112.051,97	112.051,97
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.828.026,57	0,00	0,00	0,00	10.940.087,20	112.060,63	112.060,63
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.810.233,44	0,00	0,00	0,00	10.922.414,64	112.181,20	112.181,20
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.452.679,54	0,00	0,00	0,00	10.561.468,01	108.788,47	108.788,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.622.998,29	0,00	0,00	0,00	5.681.711,40	58.713,11	58.713,11
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.628.957,20	0,00	0,00	0,00	10.740.124,70	111.167,50	111.167,50
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.313.437,94	0,00	0,00	0,00	5.369.775,09	56.337,15	56.337,15
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.762.619,82	0,00	0,00	0,00	20.988.900,95	226.281,13	226.281,13
NTN-B 150824 (6,480000%)	21.619.550,06	0,00	0,00	0,00	21.855.747,43	236.197,37	236.197,37
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.333.609,50	0,00	0,00	0,00	5.392.789,27	59.179,77	59.179,77
NTN-B 150824 (6,990300%)	30.856.986,93	0,00	0,00	0,00	31.207.279,48	350.292,55	350.292,55
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.522.579,04	0,00	0,00	0,00	15.690.603,85	168.024,81	168.024,81
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.524.051,75	0,00	0,00	0,00	15.692.104,14	168.052,39	168.052,39
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.104.938,84	0,00	0,00	0,00	11.219.192,32	114.253,48	114.253,48
NTN-B 150840 (5,650000%)	945.690,54	0,00	0,00	0,00	955.374,06	9.683,52	9.683,52
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.133.249,80	0,00	0,00	0,00	11.248.362,34	115.112,54	115.112,54
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.192.802,30	0,00	0,00	0,00	11.308.002,39	115.200,09	115.200,09
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.818.732,82	0,00	0,00	0,00	10.930.684,59	111.951,77	111.951,77
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.117.474,27	0,00	0,00	0,00	11.232.849,53	115.375,26	115.375,26
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.990.999,52	0,00	0,00	0,00	4.032.752,03	41.752,51	41.752,51
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.689.467,83	0,00	0,00	0,00	10.801.349,08	111.881,25	111.881,25
NTN-B 150850 (5,970000%)	20.478.458,54	0,00	0,00	0,00	20.693.628,61	215.170,07	215.170,07
	371.267.492,32	0,00	0,00	0,00	375.192.142,92	3.924.650,60	

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	10.089.445,05	0,00	0,00	0,00	10.175.121,03	85.675,98	85.675,98
BB PREV RF IRF M	20.272.630,17	0,00	0,00	0,00	20.406.064,12	133.433,95	133.433,95
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	23.191.158,11	0,00	0,00	0,00	23.391.668,44	200.510,33	200.510,33
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.216.658,64	0,00	0,00	0,00	10.169.125,19	-47.533,45	-47.533,45
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	10.589.571,33	0,00	0,00	0,00	10.651.790,99	62.219,66	62.219,66
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	17.551.924,60	0,00	0,00	0,00	17.666.902,46	114.977,86	114.977,86
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.547.719,87	0,00	0,00	0,00	2.566.301,99	18.582,12	18.582,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	476.424,05	400,00	0,00	0,00	480.745,23	3.921,18	3.921,18
SANTANDER RF ATIVO FIC	648.350,81	0,00	0,00	0,00	650.428,15	2.077,34	2.077,34
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	20.592.489,76	0,00	0,00	0,00	20.789.620,60	197.130,84	197.130,84
	116.176.372,39	400,00	0,00	0,00	116.947.768,20	770.995,81	

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	48.459.477,36	1.502.960,13	0,00	0,00	50.437.113,30	474.675,81	474.675,81
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	17.144.776,98	0,00	0,00	0,00	17.317.378,79	172.601,81	172.601,81
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	27.807.896,33	9.976.568,58	-4.481.153,79	0,00	33.615.647,57	312.336,45	312.336,45
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	22.582.387,58	2.303,19	0,00	0,00	22.812.204,06	227.513,29	227.513,29
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	7.229.266,22	0,00	0,00	0,00	7.188.919,46	-40.346,76	-40.346,76
	123.223.804,47	11.481.831,90	-4.481.153,79	0,00	131.371.263,18	1.146.780,60	

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	1.515.913,89	0,00	0,00	0,00	1.526.876,04	10.962,15	10.962,15
	1.515.913,89	0,00	0,00	0,00	1.526.876,04	10.962,15	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.749.022,42	0,00	0,00	0,00	1.676.101,61	-72.920,81	-72.920,81
BRADESCO F I A SELECTION	5.968.033,78	0,00	0,00	0,00	5.712.377,88	-255.655,90	-255.655,90
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.756.910,02	0,00	0,00	0,00	5.360.620,44	-396.289,58	-396.289,58
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	8.547.298,67	0,00	0,00	0,00	8.193.980,34	-353.318,33	-353.318,33
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	16.680.385,76	0,00	0,00	0,00	16.167.942,34	-512.443,42	-512.443,42
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	6.782.606,91	0,00	0,00	0,00	6.627.547,06	-155.059,85	-155.059,85
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	9.127.054,25	0,00	0,00	0,00	8.557.376,24	-569.678,01	-569.678,01
	54.611.311,81	0,00	0,00	0,00	52.295.945,91	-2.315.365,90	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14.684.121,38	0,00	0,00	0,00	15.353.840,71	669.719,33	669.719,33
	14.684.121,38	0,00	0,00	0,00	15.353.840,71	669.719,33	

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	10.261.153,31	0,00	0,00	0,00	10.434.086,12	172.932,81	172.932,81
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	16.390.936,92	0,00	0,00	0,00	16.543.351,69	152.414,77	152.414,77
	26.652.090,23	0,00	0,00	0,00	26.977.437,81	325.347,58	

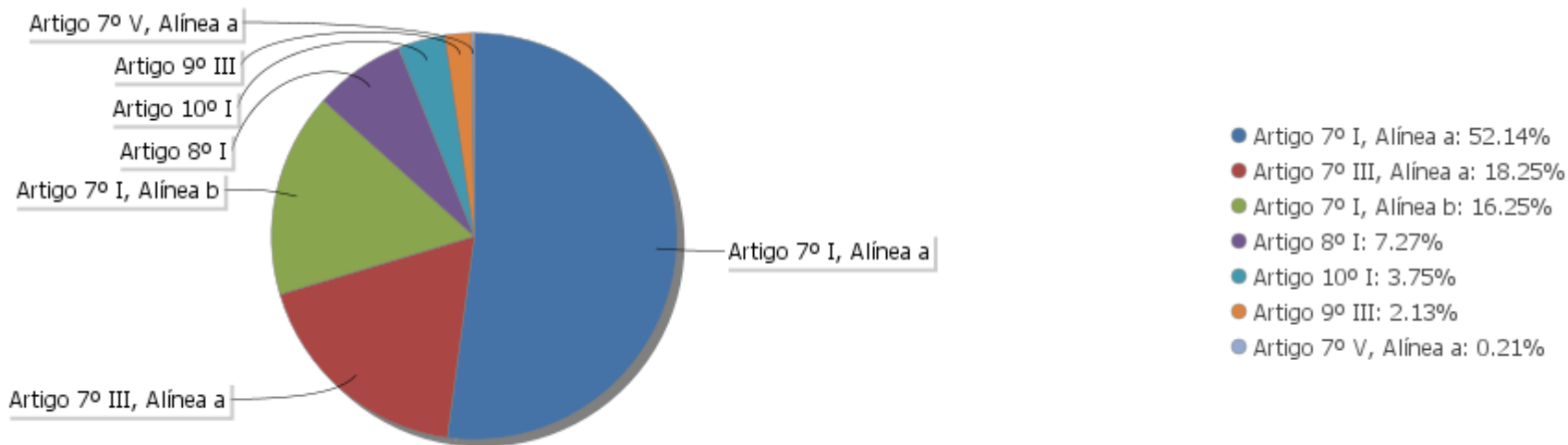
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

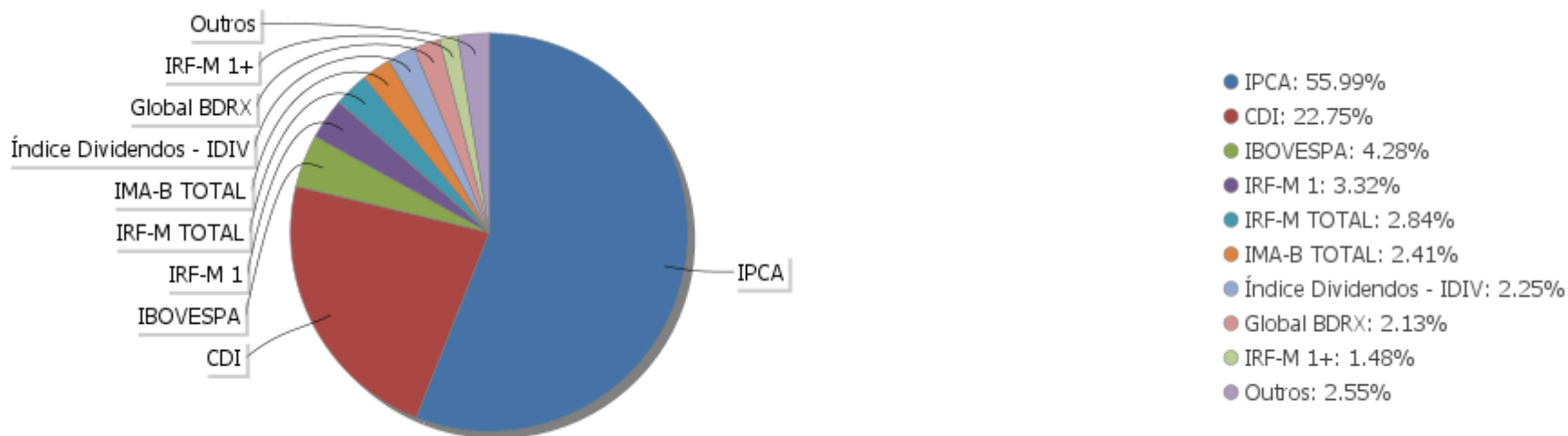
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	304.926.285,87	42,37	304.926.285,87	42,37	
de 31 dias a 365 dias	140.783.174,30	19,56	445.709.460,17	61,93	
acima de 365 dias	273.955.814,60	38,07	719.665.274,77	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

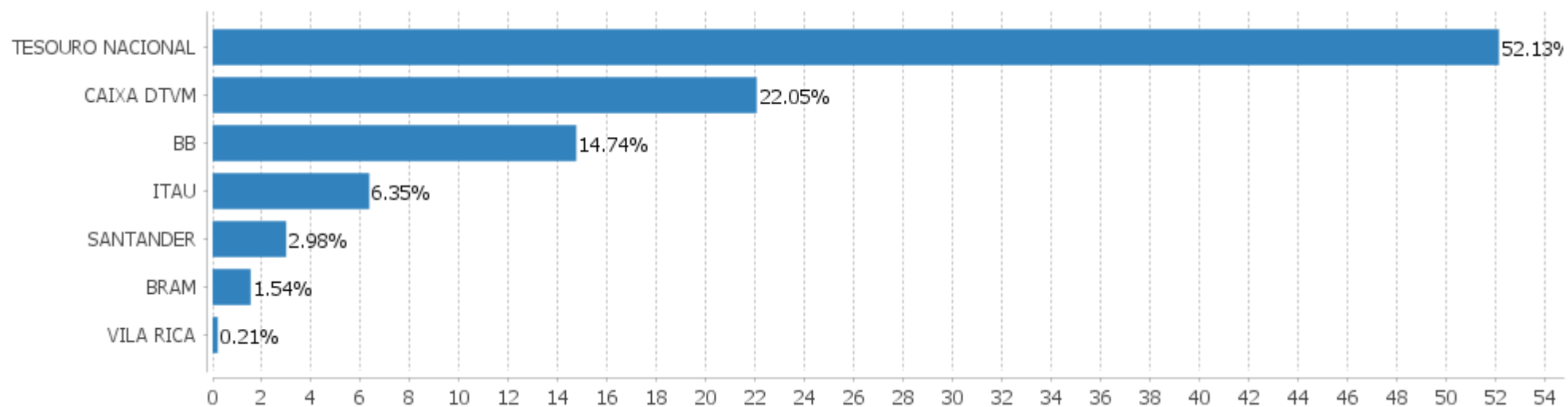


Alocação Por Estratégia



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
2024	0,63												0,63
IPCA + 5,02%	0,85												0,85
p.p. indexador	-0,22												-0,22
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	45,90
Meses abaixo - Meta Atuarial	33	54,10

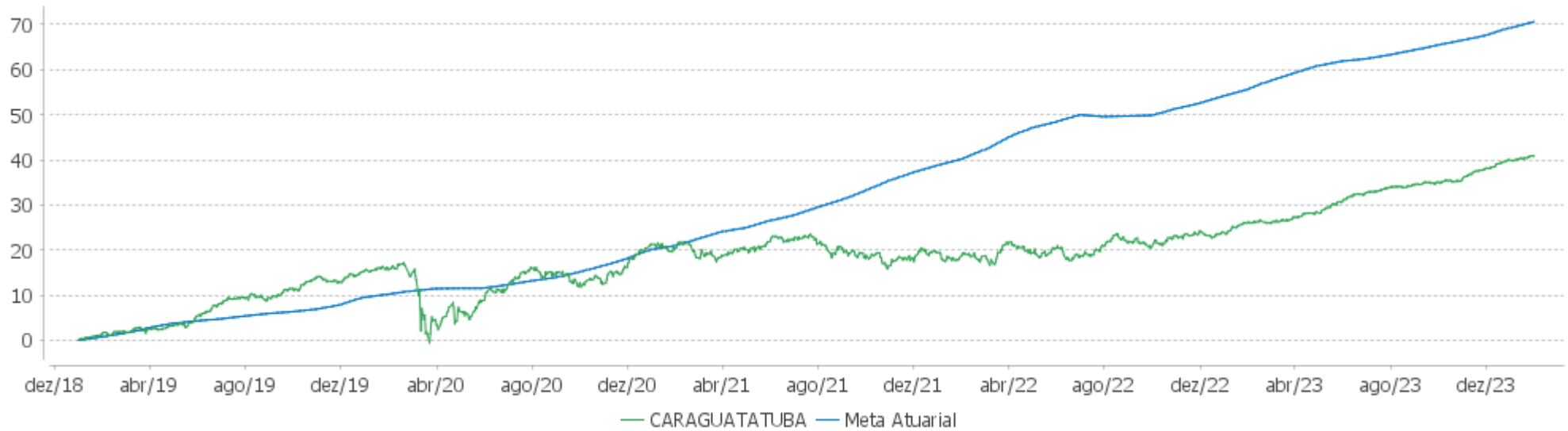
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03

Relatório

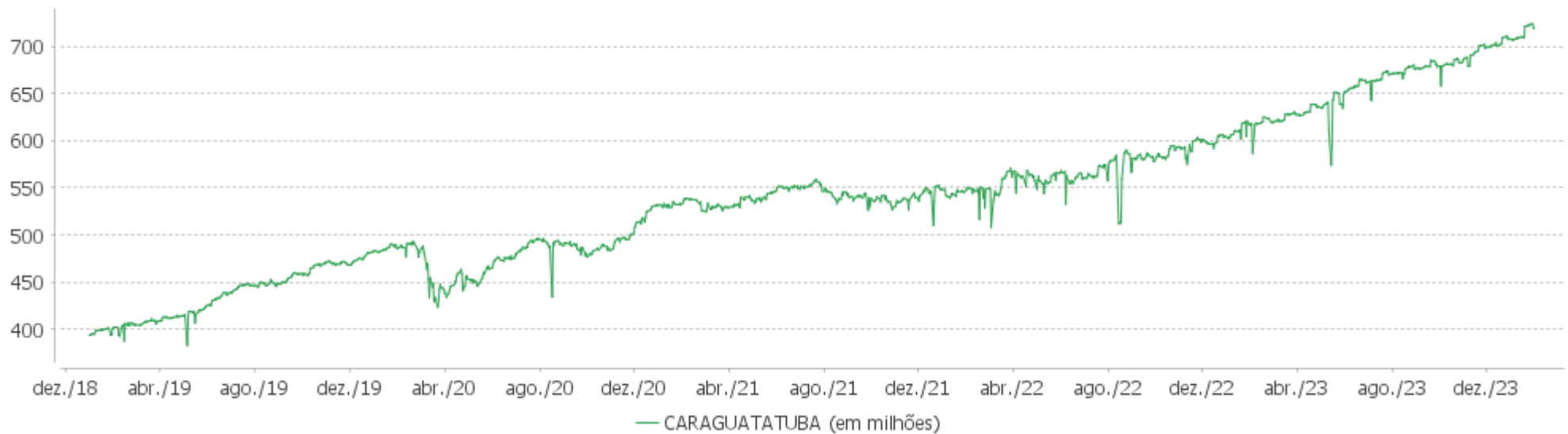
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,94	2,49	1,44	1,34
06 meses	5,25	4,54	0,71	1,44
12 meses	11,71	9,70	2,01	1,68
24 meses	18,61	21,83	-3,22	3,77
36 meses	17,35	41,76	-24,41	4,55
48 meses	21,88	56,80	-34,92	7,65
60 meses	38,85	73,20	-34,34	7,00
Desde 31/12/2018	40,95	74,64	-33,69	6,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

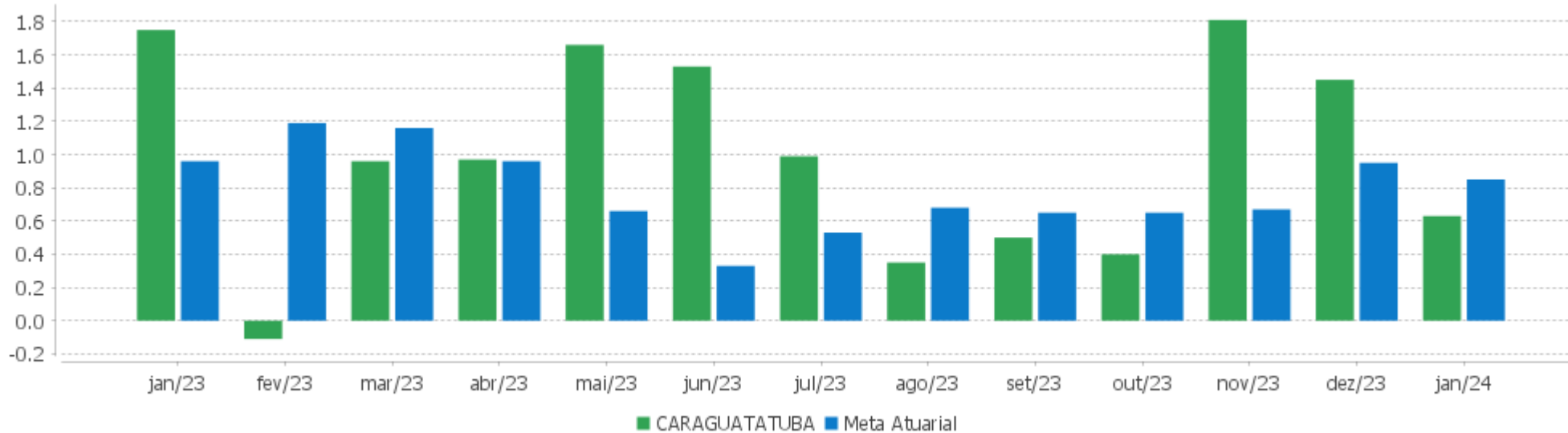


Patrimônio Líquido



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.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,84 1,58	2,10 0,09	4,71 0,20		
NTN-B 150525 (5,940000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,63 1,36	4,89 2,88	7,54 3,03	13,73 3,19	
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,60	1,02 0,60	2,65 1,38	4,81 2,81	10,44 5,93	23,35 12,81	35,67 13,66
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,60	1,02 0,60	2,70 1,44	4,89 2,89	10,57 6,06	23,60 13,06	36,06 14,04
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,64 1,38	4,85 2,84	10,55 6,04	20,16 9,62	32,21 10,19
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,74 1,47	4,95 2,95	10,70 6,19	20,42 9,87	32,61 10,59
NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,66	1,08 0,66	2,75 1,49	5,12 3,11	11,16 6,65	17,91 7,37	
NTN-B 150824 (6,680000%) Var. IPCA p.p.	1,11 0,69	1,11 0,69	2,78 1,52	5,23 3,23	11,45 6,95	18,59 8,05	
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,83 1,57	5,09 3,08	10,92 6,41	20,75 10,21	33,06 11,04
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,72 1,45	4,95 2,94	10,72 6,21	23,96 13,42	36,50 14,49
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,77 1,51	4,99 2,99	10,74 6,24	23,94 13,40	36,52 14,51
NTN-B 150824 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,64	1,06 0,64	2,64 1,38	4,94 2,93	10,84 6,33	17,37 6,83	
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,59 1,33	4,84 2,84	10,64 6,13	20,41 9,87	32,58 10,56
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,83 1,56	5,07 3,07	10,86 6,36	24,12 13,58	36,77 14,75
NTN-B 150824 (5,910000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,60 1,33	4,85 2,85	10,66 6,16	17,00 6,46	
NTN-B 150824 (6,440000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,67	1,09 0,67	2,73 1,46	5,11 3,11	11,21 6,70	18,09 7,55	
NTN-B 150850 (5,916000%)	1,05	1,05	2,83	5,09	10,91	20,77	33,08

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.	0,63	0,63	1,57	3,08	6,41	10,23	11,07
NTN-B 150850 (5,713000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,78 1,51	4,98 2,98	10,70 6,19	20,40 9,86	32,62 10,61
NTN-B 150527 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,64	1,06 0,64	2,71 1,44	5,01 3,00	10,92 6,41	20,91 10,37	
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,80 1,54	5,04 3,03	10,81 6,30	20,59 10,05	32,85 10,84
NTN-B 150824 (6,990300%) Var. IPCA p.p.	1,14 0,72	1,14 0,72	2,86 1,59	5,38 3,38	8,53 4,02	15,77 5,23	
NTN-B 150828 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,66	1,08 0,66	2,77 1,51	5,14 3,13	11,17 6,67	17,90 7,36	
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,76 1,50	4,98 2,98	10,72 6,21	23,90 13,35	36,46 14,45
NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,64 1,37	4,91 2,90	10,75 6,24	20,64 10,10	32,92 10,90
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,82 1,56	5,05 3,05	10,83 6,32	24,08 13,53	36,71 14,69
NTN-B 150824 (6,480000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,67	1,09 0,67	2,73 1,47	5,13 3,12	11,24 6,74	18,18 7,64	30,72 8,70
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,79 1,53	5,02 3,01	10,77 6,26	20,52 9,98	32,77 10,76
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,75 1,49	4,96 2,95	10,67 6,16	23,78 13,24	36,31 14,30
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,59 -0,01	0,59 -0,01	5,52 -0,03	6,01 -0,13	18,02 -0,35	27,84 -0,86	22,09 -1,30
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,82 -0,01	0,82 -0,01	2,74 -0,03	5,84 -0,08	12,78 -0,17	26,69 -0,43	30,98 -0,62
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,47 -0,02	-0,47 -0,02	4,92 -0,06	2,84 -0,07	15,36 -0,18	23,40 -0,40	21,65 -0,73
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,32 33,14	0,32 33,14	3,88 138,08	4,74 78,46	12,69 98,58	23,89 87,42	28,27 83,89
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,66 0,24	0,66 0,24	3,33 2,07	4,67 2,67	13,16 8,65	25,72 15,18	26,39 4,38
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,86 0,03	0,86 0,03	2,74 -0,03	5,80 -0,12	12,67 -0,28	26,44 -0,68	30,53 -1,07
BB PREV RF IRF M	0,66	0,66	4,64	5,92	15,88	27,01	24,96

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.	-0,01	-0,01	-0,04	-0,13	-0,43	-0,72	-1,15
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,85 0,43	0,85 0,43	2,92 1,65	5,79 3,79	15,22 10,71	26,51 15,96	28,02 6,01
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO Var. IDKA 2 p.p.	0,73 -0,08	0,73 -0,08	5,03 0,89	5,95 1,13	16,48 5,05		
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,96 99,03	0,96 99,03	2,77 98,57	5,96 98,66	12,72 98,79	27,04 98,92	33,29 98,79
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,72 74,81	0,72 74,81	9,56 340,61	268,98 4.454,28	274,87 2.135,38	316,32 1.157,40	302,69 898,18
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	1,01 104,22	1,01 104,22	2,97 105,99	6,53 108,15	13,43 104,34	28,71 105,04	36,14 107,25
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,56 -0,11	-0,56 -0,11	4,91 -0,06	2,15 -0,76	15,08 -0,46	22,01 -1,79	20,17 -2,21
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,97 100,00	0,97 100,00	2,81 100,09	6,04 100,08	12,80 99,46	27,43 100,36	34,15 101,32
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,00 103,77	1,00 103,77	2,92 104,11	6,34 104,91	13,22 102,68	27,95 102,27	34,67 102,87
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,01 104,14	1,01 104,14	2,96 105,32	6,31 104,56	13,28 103,17	28,05 102,63	34,74 103,08
BRANCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-4,28 0,51	-4,28 0,51	12,83 -0,08	-0,62 -5,39	3,61 -9,01	8,07 -5,84	-2,50 -13,53
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-4,13 0,66	-4,13 0,66	14,09 1,18	4,05 -0,71	12,06 -0,56	10,66 -3,25	6,05 -4,98
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-2,29 2,51	-2,29 2,51	18,75 5,84	7,82 3,05	6,33 -6,30	13,01 -0,91	6,34 -4,69
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,07 0,44	-3,07 0,44	12,60 -1,59	6,01 -2,87	15,84 0,26	19,58 -8,70	21,01 -14,92
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-6,24 -1,45	-6,24 -1,45	10,23 -2,68	-7,52 -12,28	-4,18 -16,81	-13,24 -27,16	
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-4,17 0,62	-4,17 0,62	12,71 -0,20	5,51 0,75	12,13 -0,50	15,40 1,48	9,71 -1,32
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-6,88 -0,33	-6,88 -0,33	11,22 -1,28	-10,14 -3,84	-6,75 -13,09	-14,94 -4,84	-18,08 1,24
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	4,56 -0,22	4,56 -0,22	14,15 -0,56	11,69 -0,89	25,21 -1,61	3,42 -2,20	15,15 -4,80
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,93	0,93	2,81	5,52	12,33	27,52	33,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	96,19	96,19	100,10	91,36	95,75	100,68	100,59
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	1,69 -2,26	1,69 -2,26	16,97 3,80	8,77 -1,55	27,16 11,70	25,92 26,70	58,47 40,45
CARAGUATATUBA Var. IPCA + 4,99% p.p.	0,63 -0,22	0,63 -0,22	3,94 1,45	5,25 0,71	11,71 2,02	18,61 -3,24	17,35 -23,90
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22

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		0,20

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	0,83	0,83	2,77	5,92	12,95	27,12	31,60	36,12	45,12
IRF-M 1+	0,60	0,60	5,55	6,14	18,37	28,70	23,39	30,51	48,22
IRF-M TOTAL	0,67	0,67	4,68	6,05	16,31	27,74	26,10	32,31	47,48
IMA-B 5	0,68	0,68	3,99	4,44	11,33	23,79	29,45	39,23	56,02
IMA-B 5+	-1,47	-1,47	5,89	1,54	19,03	23,38	15,40	19,65	46,36
IMA-B TOTAL	-0,45	-0,45	4,97	2,91	15,53	23,80	22,38	28,77	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,47	0,47	3,98	5,14	14,53	26,21	28,00	33,76	48,90
IDKA 2	0,81	0,81	4,15	4,81	11,43	23,53	29,55	40,17	55,62
IDKA 20	-3,34	-3,34	7,85	-0,30	28,79	24,16	6,04	6,79	36,82
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02	12,30	31,17
IBRX 100	-4,51	-4,51	13,20	5,15	11,88	12,72	10,34	12,15	33,43
IBRX 50	-4,15	-4,15	13,07	5,74	11,32	13,01	11,95	14,94	31,89
SMALL CAP	-6,55	-6,55	12,50	-6,30	6,34	-10,11	-19,32	-22,95	11,91
Índice Consumo - ICON	-8,33	-8,33	13,01	-11,48	-4,76	-28,41	-45,21	-47,39	-24,62
Índice Dividendos - IDIV	-3,51	-3,51	14,18	8,88	15,58	28,28	35,93	29,79	64,85

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	3,94	3,94	13,17	10,31	15,47	-0,78	18,02	74,30	143,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,67	0,67	5,63	4,26	18,16	20,04	15,77	8,33	38,34

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,86	2,86	12,43	7,98	9,50	-5,80	2,83	51,79	101,82

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,42	0,42	1,27	2,01	4,51	10,54	22,01	27,58	32,93
INPC	0,57	0,57	1,22	1,66	3,82	9,75	21,38	28,10	33,61
IGPM	0,07	0,07	1,41	2,15	-3,32	0,35	17,32	47,48	59,00
SELIC	0,97	0,97	2,80	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,76	0,76	2,25	4,03	8,64	19,51	37,19	49,11	61,60
IPCA + 5,00%	0,85	0,85	2,49	4,53	9,67	21,80	41,17	54,89	69,49
IPCA + 5,50%	0,89	0,89	2,61	4,77	10,18	22,96	43,18	57,84	73,54
IPCA + 5,89%	0,92	0,92	2,70	4,97	10,59	23,86	44,77	60,18	76,76
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22	60,84	77,68
INPC + 4,00%	0,91	0,91	2,21	3,67	7,92	18,65	36,48	49,72	62,43
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47	61,50	78,60

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%)	20.660.444,28	5,940000	20.747.533,58	5,580000	87.089,30
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.547.486,90	5,980000	10.596.306,34	5,580000	48.819,44
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.218.093,53	6,090000	5.319.285,46	5,410900	101.191,93
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.229.840,63	5,560000	17.148.730,36	5,620000	-81.110,27
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.157.237,27	5,821000	20.477.342,90	5,620000	320.105,63
NTN-B 150545 (5,710000%)	32.955.781,51	5,710000	33.000.047,29	5,698500	44.265,78
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.958.057,69	5,760000	11.036.893,92	5,698500	78.836,23
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.940.087,20	5,781000	11.045.744,67	5,698500	105.657,47
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.922.414,64	5,815000	11.111.866,66	5,690800	189.452,02
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.561.468,01	5,850000	10.799.484,87	5,690800	238.016,86
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.681.711,40	5,892000	5.662.583,33	6,574000	-19.128,07
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.740.124,70	5,910000	10.705.081,49	6,574000	-35.043,21
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.369.775,09	6,090000	5.356.846,89	6,574000	-12.928,20
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.988.900,95	6,440000	20.975.242,12	6,574000	-13.658,83
NTN-B 150824 (6,480000%)	21.855.747,43	6,480000	21.845.083,82	6,574000	-10.663,61
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.392.789,27	6,680000	5.395.602,21	6,574000	2.812,94
NTN-B 150824 (6,990300%)	31.207.279,48	6,990300	31.271.239,64	6,574000	63.960,16
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.690.603,85	6,350000	16.037.226,32	5,360100	346.622,47
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.692.104,14	6,350000	16.220.165,58	5,460200	528.061,44
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.219.192,32	5,708000	11.350.656,11	5,478300	131.463,79
NTN-B 150840 (5,650000%)	955.374,06	5,650000	955.842,39	5,645100	468,33
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.248.362,34	5,770000	11.389.333,24	5,645100	140.970,90
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.308.002,39	5,713000	11.323.221,77	5,702500	15.219,38
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.930.684,59	5,780000	11.039.465,62	5,702500	108.781,03
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.232.849,53	5,815000	11.395.286,83	5,702500	162.437,30
NTN-B 150850 (5,916000%)	4.032.752,03	5,916000	4.143.740,66	5,702500	110.988,63
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.801.349,08	5,920000	11.107.026,61	5,702500	305.677,53
NTN-B 150850 (5,970000%)	20.693.628,61	5,970000	21.412.329,48	5,702500	718.700,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	08/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	237.786,29	0,00	77.457,13254800	3,0699082470
2	10/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.727,03757200	3,0725759280
3	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	53.000,00	10.579,94883800	5,0094760000
4	10/01/2024	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	400,00	0,00	9,09786834	43,9663430000
5	18/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	15.165,57709000	3,0807564870
6	18/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	2.851,50093300	3,0807564870
7	19/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	389.757,15872900	3,0821462880
8	19/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.995.101,95	0,00	1.789.850,62726600	5,0256160000
9	19/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	837.446,62	0,00	166.635,61641000	5,0256160000
10	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.177.062,82	828.525,85772400	5,0415600000
11	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	107.059,93	0,00	21.235,47671700	5,0415600000
12	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	36.960,08	0,00	7.331,08006200	5,0415600000
13	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	251.090,97	49.804,22126500	5,0415600000
14	31/01/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.303,19	0,00	0,52950424	4.349,7102070000
Total			11.482.231,90	4.481.153,79		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.300.421,56

Value-At-Risk: 0,74%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		0,74		0,74			719.665.274,77	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%)		0,09	-0,00	0,09			20.660.444,28	2,87
NTN-B 150525 (5,980000%)		0,09	0,00	0,09			10.547.486,90	1,47
NTN-B 150527 (6,090000%)		0,09	0,00	0,09			5.218.093,53	0,73
NTN-B 150535 (5,560000%)		0,09	0,00	0,10			17.229.840,63	2,39
NTN-B 150535 (5,821000%)		0,10	0,00	0,10			20.157.237,27	2,80
NTN-B 150545 (5,710000%)		0,10	0,00	0,10			32.955.781,51	4,58
NTN-B 150545 (5,760000%)		0,10	0,00	0,10			10.958.057,69	1,52
NTN-B 150545 (5,781000%)		0,10	0,00	0,10			10.940.087,20	1,52
NTN-B 150555 (5,815000%)		0,10	0,00	0,10			10.922.414,64	1,52
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,14	0,00	0,14			10.561.468,01	1,47
NTN-B 150824 (5,892000%)		0,09	-0,00	0,09			5.681.711,40	0,79
NTN-B 150824 (5,910000%)		0,09	-0,00	0,09			10.740.124,70	1,49
NTN-B 150824 (6,090000%)		0,09	-0,00	0,09			5.369.775,09	0,75
NTN-B 150824 (6,440000%)		0,09	-0,00	0,09			20.988.900,95	2,92
NTN-B 150824 (6,480000%)		0,09	-0,00	0,09			21.855.747,43	3,04
NTN-B 150824 (6,680000%)		0,09	-0,00	0,09			5.392.789,27	0,75
NTN-B 150824 (6,990300%)		0,09	-0,00	0,09			31.207.279,48	4,34
NTN-B 150826 (6,350000%)		0,09	0,00	0,09			15.690.603,85	2,18
NTN-B 150828 (6,350000%)		0,09	0,00	0,09			15.692.104,14	2,18
NTN-B 150830 (5,708000%)		0,09	0,00	0,10			11.219.192,32	1,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,650000%)		0,10	0,00	0,10			955.374,06	0,13
NTN-B 150840 (5,770000%)		0,10	0,00	0,10			11.248.362,34	1,56
NTN-B 150850 (5,713000%)		0,10	0,00	0,10			11.308.002,39	1,57
NTN-B 150850 (5,780000%)		0,10	0,00	0,10			10.930.684,59	1,52
NTN-B 150850 (5,815000%)		0,10	0,00	0,10			11.232.849,53	1,56
NTN-B 150850 (5,916000%)		0,10	0,00	0,10			4.032.752,03	0,56
NTN-B 150850 (5,920000%)		0,14	0,00	0,13			10.801.349,08	1,50
NTN-B 150850 (5,970000%)		0,11	0,00	0,11			20.693.628,61	2,88
Sub-total	0,56	0,09	0,00		0,16	1,06	375.192.142,92	52,13

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	0,20			10.175.121,03	1,41
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO		1,76	0,00	0,90			2.566.301,99	0,36
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,02	-0,00	0,02			20.789.620,60	2,89
BB PREV RF IRF M		1,48	0,03	0,04			20.406.064,12	2,84
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,09	0,00	0,12			480.745,23	0,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,11	0,00	0,03			23.391.668,44	3,25
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,16	0,02	0,03			10.169.125,19	1,41
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,03	0,02	0,02			10.651.790,99	1,48
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,73	0,01	0,73			17.666.902,46	2,45
SANTANDER RF ATIVO FIC		1,18	0,00	1,18			650.428,15	0,09
Sub-total	0,93	0,79	0,09		-0,33	0,66	116.947.768,20	16,25

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		2,19	0,02	0,22			7.188.919,46	1,00
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	0,00	0,03			33.615.647,57	4,67
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,04	0,00	0,04			22.812.204,06	3,17
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			50.437.113,30	7,01

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			17.317.378,79	2,41
Sub-total	0,20	0,12	0,02		-0,34	0,90	131.371.263,18	18,25

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		5,97	0,00	5,97			1.526.876,04	0,21
Sub-total	2,44	5,97	0,00		-0,10	0,72	1.526.876,04	0,21

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,27%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		6,64	0,01	1,57			1.676.101,61	0,23
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		10,36	0,07	2,62			5.360.620,44	0,74
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		7,19	0,08	1,39			8.193.980,34	1,14
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,22	0,13	1,58			16.167.942,34	2,25
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		7,32	0,06	3,23			6.627.547,06	0,92
BRADESCO F I A SELECTION		7,11	0,05	1,99			5.712.377,88	0,79
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,14	0,10	3,94			8.557.376,24	1,19
Sub-total	12,19	7,27	0,51		-0,43	-4,24	52.295.945,91	7,27

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,53%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP		0,13	0,00	0,13			16.543.351,69	2,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,50	0,07	5,35			10.434.086,12	1,45
Sub-total	4,16	2,53	0,07		0,06	1,22	26.977.437,81	3,75

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,80%

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		5,80	0,04	0,61			15.353.840,71	2,13
Sub-total	11,95	5,80	0,04		0,30	4,56	15.353.840,71	2,13

(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 (%)