



CARAGUATATUBA
2º TRIMESTRE 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 28.06.2024.

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

RENTA FIXA **87,68%**

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 150824 (5,892000%)	0,22	0,04	0,84	2,49	5.771.149,87	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	0,22	0,04	0,84	2,49	10.910.026,89	1,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	0,22	0,04	0,86	2,53	5.458.199,65	0,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	0,22	0,04	0,88	2,62	21.362.452,25	2,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	0,22	0,04	0,89	2,63	22.247.414,46	2,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,680000%)	0,22	0,04	0,90	2,68	5.493.549,04	0,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,990300%)	0,22	0,04	0,93	2,75	31.826.430,86	4,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,940000%)	0,23	0,04	0,85	2,50	20.989.785,52	2,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,24	0,04	0,85	2,51	10.716.978,12	1,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,080000%)	2,94	0,04	0,86	2,53	19.945.043,46	2,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	0,25	0,03	0,88	2,60	15.961.892,23	2,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,28	0,04	0,86	2,53	5.303.937,86	0,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,221000%)	4,18	0,04	0,78	0,78	20.152.917,66	2,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	0,28	0,03	0,88	2,60	15.961.247,54	2,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,33	0,04	0,83	2,44	11.393.146,92	1,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,070000%)	4,16	0,05	0,86	2,13	40.837.500,67	5,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,39	0,04	0,82	2,41	17.496.829,52	2,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,40	0,04	0,84	2,47	20.478.399,67	2,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,46	0,04	0,82	2,43	970.564,45	0,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,46	0,04	0,83	2,46	11.428.558,62	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,52	0,04	0,83	2,44	33.486.420,20	4,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,53	0,04	0,83	2,45	11.134.808,86	1,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,53	0,04	0,83	2,46	11.116.686,09	1,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,57	0,04	0,83	2,44	11.491.497,20	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,58	0,04	0,83	2,46	11.108.206,29	1,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,58	0,04	0,84	2,47	11.415.347,21	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,58	0,04	0,84	2,49	4.098.342,22	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,56	0,01	0,84	2,49	10.977.033,89	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,970000%)	2,98	0,02	0,85	2,51	21.030.373,07	2,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,62	0,04	0,84	2,47	11.100.445,76	1,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,58	0,01	0,84	2,48	10.733.599,70	1,41
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,36	0,04	0,86	2,53	462.398.785,75	60,62

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,61	-0,08	0,38	1,40	10.476.592,19	1,37	6.543.333.888,45	0,16
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,50	-0,28	-0,32	-0,24	10.552.165,07	1,38	3.792.665.736,98	0,28
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,06	0,04	0,79	1,70	13.416.889,15	1,76	31.640.362.924,77	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,80	-0,51	-1,00	-1,35	211.021,65	0,03	4.133.113.700,82	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,51	-0,40	-0,75	-1,20	5.624.418,97	0,74	963.696.117,89	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	-0,14	0,17	0,55	10.905.330,23	1,43	4.858.229.912,84	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2,85	-0,37	-0,56	-0,56	2.574.973,79	0,34	256.894.368,77	1,00
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,35	0,04	0,69	2,01	500.280,37	0,07	572.668.094,57	0,09
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,87	-0,15	0,16	0,65	56.665,35	0,01	285.872.986,61	0,02
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,06	0,04	0,78	2,49	11.485.611,32	1,51	7.377.738.310,48	0,16
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,36	-0,12	0,25	1,03	65.803.948,09	8,63		

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.				
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,13	0,04	0,82	1,72	21.050.044,80	2,76	2.288.014.326,67	0,92
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,04	0,79	2,53	18.263.377,61	2,39	17.821.452.916,03	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,12	0,03	0,79	2,47	18.042.170,35	2,37	5.436.885.879,50	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,04	0,82	2,57	39.767.688,05	5,21	16.508.104.382,05	0,24
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,04	0,83	2,62	31.092.162,63	4,08	5.723.870.469,63	0,54
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,20	-0,50	-1,08	-2,13	191.483,46	0,03	340.383.364,37	0,06
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,04	0,82		10.786.472,74	1,41	2.969.679.625,74	0,36
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,20	0,04	0,81	2,54	139.193.399,64	18,25		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	111,30	0,66	0,66	1,94	1.495.037,50	0,20	58.208.969,73	2,57
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			111,30	0,66	0,66	1,94	1.495.037,50	0,20		
Renda Fixa			0,37	0,02	0,79	2,33	668.891.170,98	87,68		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

6,58%

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	12,79	-0,34	1,59	-2,19	1.638.745,60	0,21	567.596.143,42	0,29
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	14,89	-0,75	-0,13	-10,63	5.172.490,37	0,68	305.744.233,44	1,69
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,36	-1,35	-0,04	-8,16	5.018.702,02	0,66	572.598.578,35	0,88
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	14,09	-0,38	1,37	-5,44	7.793.593,72	1,02	748.046.356,69	1,04
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,92	-0,44	1,78	-1,09	16.114.962,42	2,11	1.013.802.736,53	1,59
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	12,89	-0,20	1,80	-2,22	6.727.507,69	0,88	1.114.262.445,89	0,60
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	17,33	-0,75	1,03	-10,27	7.733.944,88	1,01	114.389.853,59	6,76
Sub-total Artigo 8º I			13,77	-0,57	1,21	-5,21	50.199.946,70	6,58		
Renda Variável			13,77	-0,57	1,21	-5,21	50.199.946,70	6,58		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,47%

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	13,96	0,88	12,73	21,34	26.508.545,28	3,47	2.736.870.167,13	0,97
Sub-total Artigo 9º III			13,96	0,88	12,73	21,34	26.508.545,28	3,47		
Investimentos no Exterior			13,96	0,88	12,73	21,34	26.508.545,28	3,47		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,26%

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	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,06	-0,28	3,90	5,01	17.238.910,92	2,26	1.972.213.735,46	0,87
Sub-total Artigo 10º I			11,06	-0,28	3,90	6,72	17.238.910,92	2,26		
Investimentos Estruturados			4,45	-0,28	3,90	6,72	17.238.910,92	2,26		
Total			1,29	0,01	1,26	2,40	762.838.573,88	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 3
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	462.398.785,75	60,62	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	65.803.948,09	8,63	0,00	16,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	139.193.399,64	18,25	0,00	19,80	75,00	0,00	75,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.495.037,50	0,20	0,00	0,20	15,00	0,00	15,00
	Total Renda Fixa	668.891.170,98	87,68					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	50.199.946,70	6,58	0,00	6,00	45,00	0,00	45,00
	Total Renda Variável	50.199.946,70	6,58					45,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	26.508.545,28	3,47	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	26.508.545,28	3,47					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	17.238.910,92	2,26	0,00	8,00	15,00	0,00	15,00
	Total Investimentos Estruturados	17.238.910,92	2,26					20,00
Total		762.838.573,88	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	0,86 108,48	2,53 99,82	2,53 99,82	5,75 110,04	10,45 89,40	3.903.824,18	10.948.145,98
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,25 31,63	1,03 40,71	1,03 40,71	2,94 56,30	8,59 73,44	163.672,75	723.821,32
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,81 102,80	2,54 100,44	2,54 100,44	5,14 98,49	11,69 99,96	1.129.422,52	3.392.353,39
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,66 84,19	1,94 76,68	1,94 76,68	3,72 71,16	283,60 2.425,65	9.856,96	29.048,89
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,21 -0,27	-5,21 -1,94	-5,21 -1,94	-8,08 -0,42	0,21 -4,72	601.996,65	-2.761.707,50
Artigo 9º III % do CDI	12,73 1.615,12	21,34 843,39	21,34 843,39	39,52 756,84	52,18 446,26	2.993.979,38	4.624.596,56
Artigo 10º I % do CDI	3,90 494,77	6,72 265,66	6,72 265,66	12,82 245,58	20,07 171,63	647.149,69	911.105,25
CARAGUATATUBA (Total)						9.449.902,13	17.867.363,89

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%)	20.813.657,94	0,00	0,00	0,00	20.989.785,52	176.127,58	518.687,52
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.626.761,41	0,00	0,00	0,00	10.716.978,12	90.216,71	265.728,86
NTN-B 150525 (6,080000%)	19.775.584,59	0,00	0,00	0,00	19.945.043,46	169.458,87	499.518,12
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.258.837,76	0,00	0,00	0,00	5.303.937,86	45.100,10	132.945,11
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.354.947,74	0,00	0,00	0,00	17.496.829,52	141.881,78	416.614,74
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.308.378,10	0,00	0,00	0,00	20.478.399,67	170.021,57	500.262,46
NTN-B 150545 (5,710000%)	33.211.152,55	0,00	0,00	0,00	33.486.420,20	275.267,65	809.117,91
NTN-B 150545 (5,760000%)	11.042.865,91	0,00	0,00	0,00	11.134.808,86	91.942,95	270.363,43
NTN-B 150545 (5,781000%)	11.024.719,88	0,00	0,00	0,00	11.116.686,09	91.966,21	270.474,19
NTN-B 150555 (5,815000%)	11.008.340,71	0,00	0,00	0,00	11.100.445,76	92.105,05	270.957,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.644.242,53	0,00	0,00	0,00	10.733.599,70	89.357,17	262.956,84
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.722.925,49	0,00	0,00	0,00	5.771.149,87	48.224,38	140.024,92
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.818.700,56	0,00	0,00	0,00	10.910.026,89	91.326,33	265.231,20
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.411.807,01	0,00	0,00	0,00	5.458.199,65	46.392,64	134.868,11
NTN-B 150824 (6,440000%)	21.175.248,23	0,00	0,00	0,00	21.362.452,25	187.204,02	545.305,06
NTN-B 150824 (6,480000%)	22.051.907,98	0,00	0,00	0,00	22.247.414,46	195.506,48	569.570,17
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.444.445,24	0,00	0,00	0,00	5.493.549,04	49.103,80	143.212,43
NTN-B 150824 (6,990300%)	31.534.678,75	0,00	0,00	0,00	31.826.430,86	291.752,11	852.181,29
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.823.071,68	0,00	0,00	0,00	15.961.892,23	138.820,55	404.187,47
NTN-B 150828 (6,221000%)	0,00	19.996.621,75	0,00	0,00	20.152.917,66	156.295,91	156.295,91
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.822.431,43	0,00	0,00	0,00	15.961.247,54	138.816,11	404.175,96
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.299.511,89	0,00	0,00	0,00	11.393.146,92	93.635,03	271.596,04
NTN-B 150832 (6,070000%)	40.490.935,60	0,00	0,00	0,00	40.837.500,67	346.565,07	850.269,94
NTN-B 150840 (5,650000%)	962.629,53	0,00	0,00	0,00	970.564,45	7.934,92	23.006,66
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.334.098,66	0,00	0,00	0,00	11.428.558,62	94.459,96	274.074,16
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.397.015,66	0,00	0,00	0,00	11.491.497,20	94.481,54	274.070,76
NTN-B 150850 (5,780000%)	11.016.311,58	0,00	0,00	0,00	11.108.206,29	91.894,71	266.647,50
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.320.621,04	0,00	0,00	0,00	11.415.347,21	94.726,17	274.938,16
NTN-B 150850 (5,916000%)	4.064.023,86	0,00	0,00	0,00	4.098.342,22	34.318,36	99.663,15
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.885.067,10	0,00	0,00	0,00	10.977.033,89	91.966,79	267.097,84
NTN-B 150850 (5,970000%)	20.853.419,41	0,00	0,00	0,00	21.030.373,07	176.953,66	514.102,19
	438.498.339,82	19.996.621,75	0,00	0,00	462.398.785,75	3.903.824,18	

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	10.436.626,00	0,00	0,00	0,00	10.476.592,19	39.966,19	144.160,90
BB PREV RF IRF M	10.585.593,31	0,00	0,00	0,00	10.552.165,07	-33.428,24	-46.437,82
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	13.312.140,81	0,00	0,00	0,00	13.416.889,15	104.748,34	223.884,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	213.142,62	0,00	0,00	0,00	211.021,65	-2.120,97	-18.637,81
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5.666.712,83	0,00	0,00	0,00	5.624.418,97	-42.293,86	-102.825,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	10.886.773,37	0,00	0,00	0,00	10.905.330,23	18.556,86	37.770,17
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.589.378,59	0,00	0,00	0,00	2.574.973,79	-14.404,80	-14.547,21
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	496.455,10	400,00	0,00	0,00	500.280,37	3.425,27	9.857,35
SANTANDER RF ATIVO FIC	56.575,33	0,00	0,00	0,00	56.665,35	90,02	-546,34
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	11.396.477,38	0,00	0,00	0,00	11.485.611,32	89.133,94	358.327,14
	65.639.875,34	400,00	0,00	0,00	65.803.948,09	163.672,75	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB INSTITUCIONAL FI RF	20.879.075,36	0,00	0,00	0,00	21.050.044,80	170.969,44	355.949,37
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	17.811.196,20	310.005,53	0,00	0,00	18.263.377,61	142.175,88	605.535,19
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	17.899.890,00	0,00	0,00	0,00	18.042.170,35	142.280,35	434.754,82
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	58.364.789,89	5.837.895,67	-24.769.192,44	0,00	39.767.688,05	334.194,93	1.039.393,80
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	30.835.388,88	2.303,19	0,00	0,00	31.092.162,63	254.470,56	786.933,90
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	193.574,53	0,00	0,00	0,00	191.483,46	-2.091,07	-16.686,43
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	10.699.050,31	0,00	0,00	0,00	10.786.472,74	87.422,43	186.472,74
	156.682.965,17	6.150.204,39	-24.769.192,44	0,00	139.193.399,64	1.129.422,52	

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	1.485.180,54	0,00	0,00	0,00	1.495.037,50	9.856,96	29.048,89
	1.485.180,54	0,00	0,00	0,00	1.495.037,50	9.856,96	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.613.033,26	0,00	0,00	0,00	1.638.745,60	25.712,34	-36.655,24
BRADESCO F I A SELECTION	5.179.132,84	0,00	0,00	0,00	5.172.490,37	-6.642,47	-615.249,14
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.020.480,27	0,00	0,00	0,00	5.018.702,02	-1.778,25	-445.818,38
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.687.978,14	0,00	0,00	0,00	7.793.593,72	105.615,58	-448.424,12
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	15.833.690,52	0,00	0,00	0,00	16.114.962,42	281.271,90	-177.427,23
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6.608.575,58	0,00	0,00	0,00	6.727.507,69	118.932,11	-152.705,64
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	7.655.059,44	0,00	0,00	0,00	7.733.944,88	78.885,44	-885.427,75
	49.597.950,05	0,00	0,00	0,00	50.199.946,70	601.996,65	

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	23.514.565,90	0,00	0,00	0,00	26.508.545,28	2.993.979,38	4.624.596,56
	23.514.565,90	0,00	0,00	0,00	26.508.545,28	2.993.979,38	

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	16.591.761,23	0,00	0,00	0,00	17.238.910,92	647.149,69	835.937,22
	16.591.761,23	0,00	0,00	0,00	17.238.910,92	647.149,69	

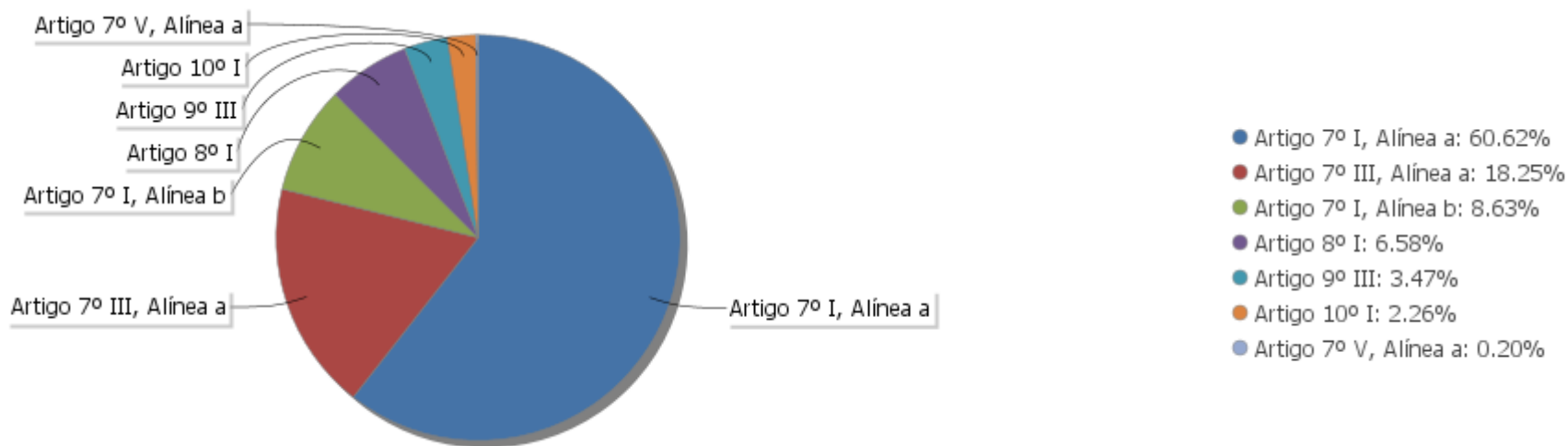
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

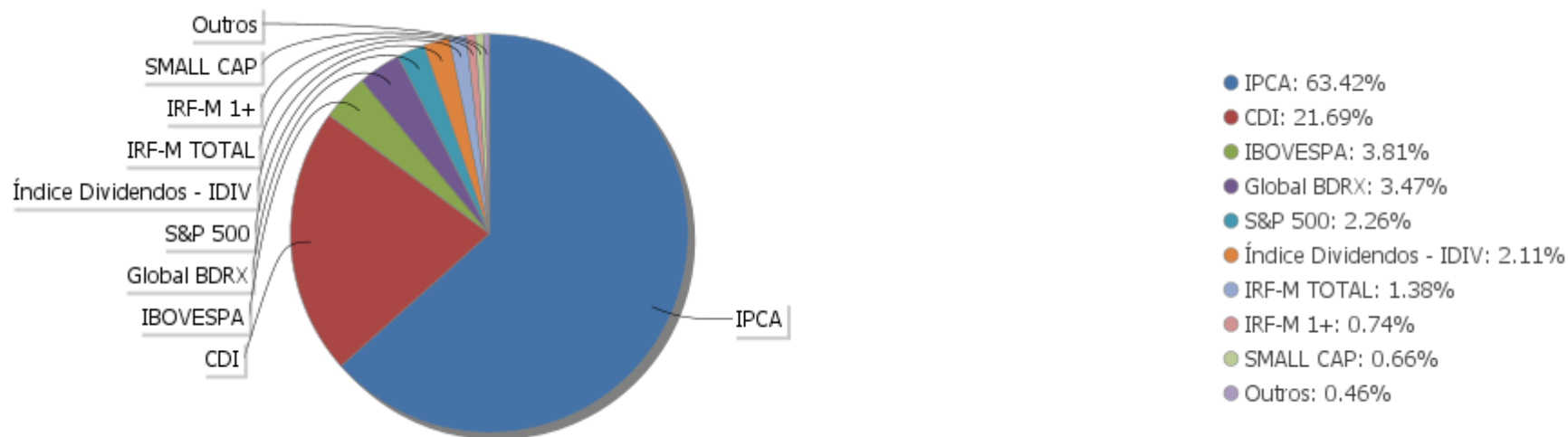
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	262.069.779,42	34,35		262.069.779,42	34,35	
de 31 dias a 365 dias	193.091.038,83	25,31		455.160.818,25	59,67	
acima de 365 dias	307.677.755,63	40,33		762.838.573,88	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

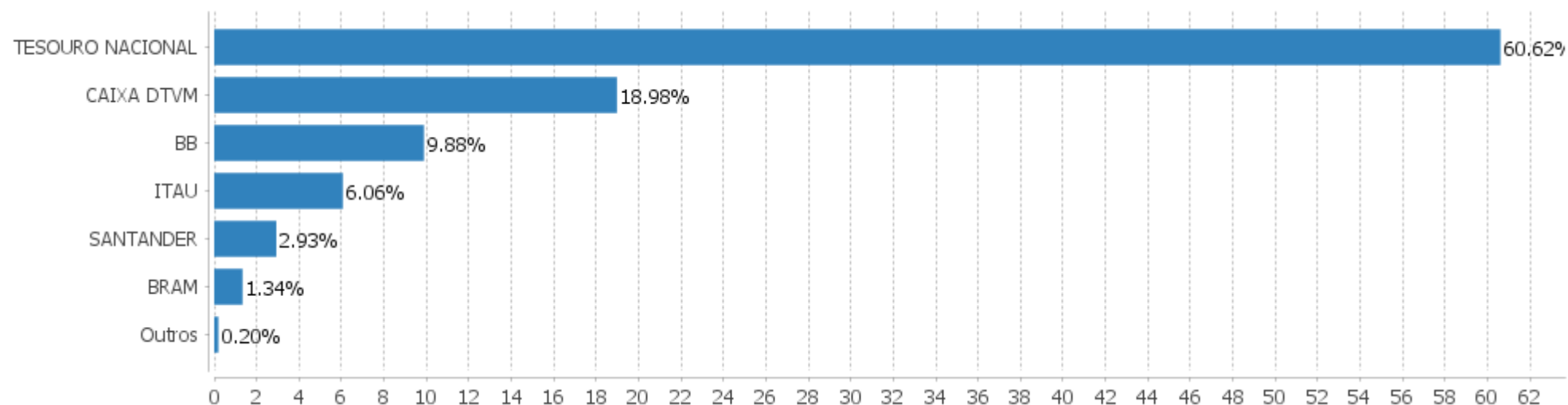


Alocação Por Estratégia



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	1,12	0,91	0,24	0,89	1,26							5,15
IPCA + 5,02%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60							4,98
p.p. indexador	-0,22	-0,08	0,36	-0,57	0,02	0,65							0,16
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

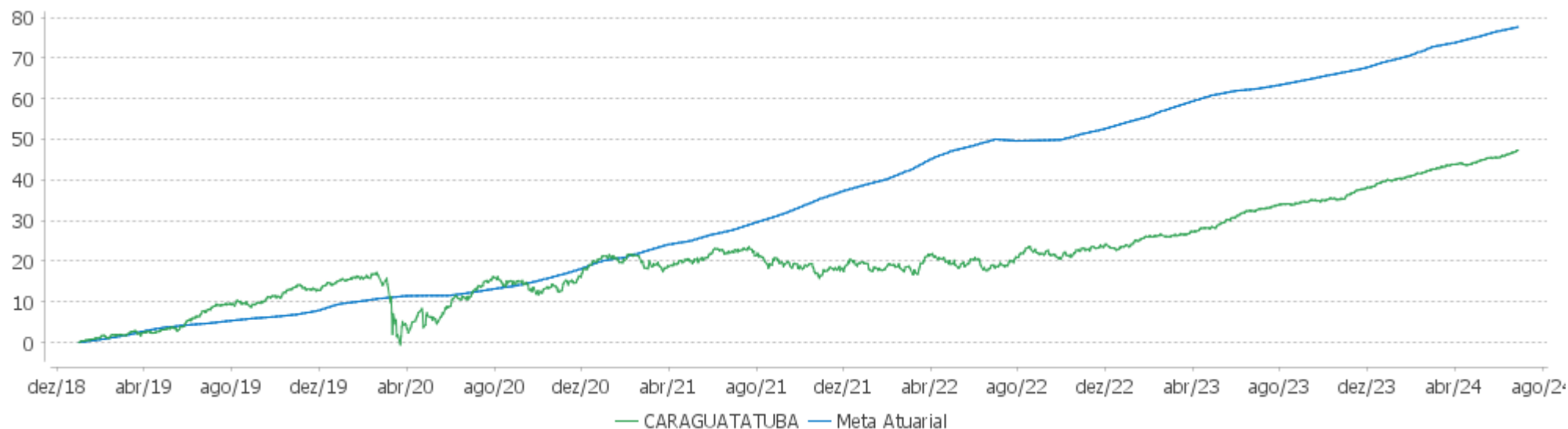
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	31	46,97
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	53,03
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03

Relatório

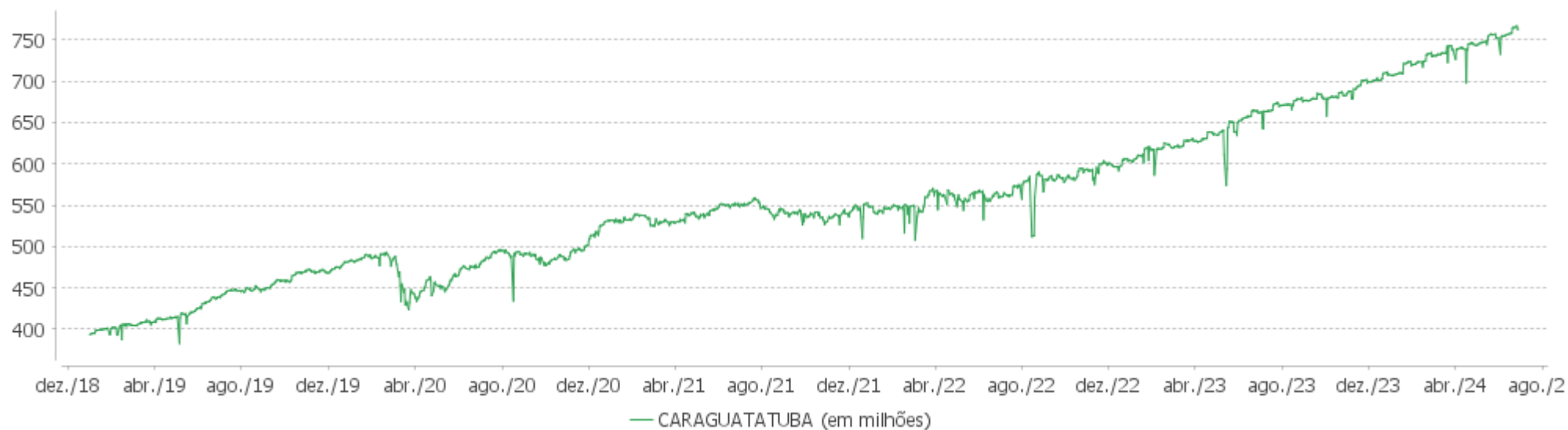
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,40	2,30	0,10	1,06
06 meses	5,15	4,98	0,16	1,08
12 meses	11,05	9,40	1,65	1,29
24 meses	24,43	18,49	5,94	2,58
36 meses	20,43	39,51	-19,07	4,11
48 meses	32,05	59,70	-27,65	4,63
60 meses	36,32	72,84	-36,53	6,93
Desde 31/12/2018	47,27	81,79	-34,52	6,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

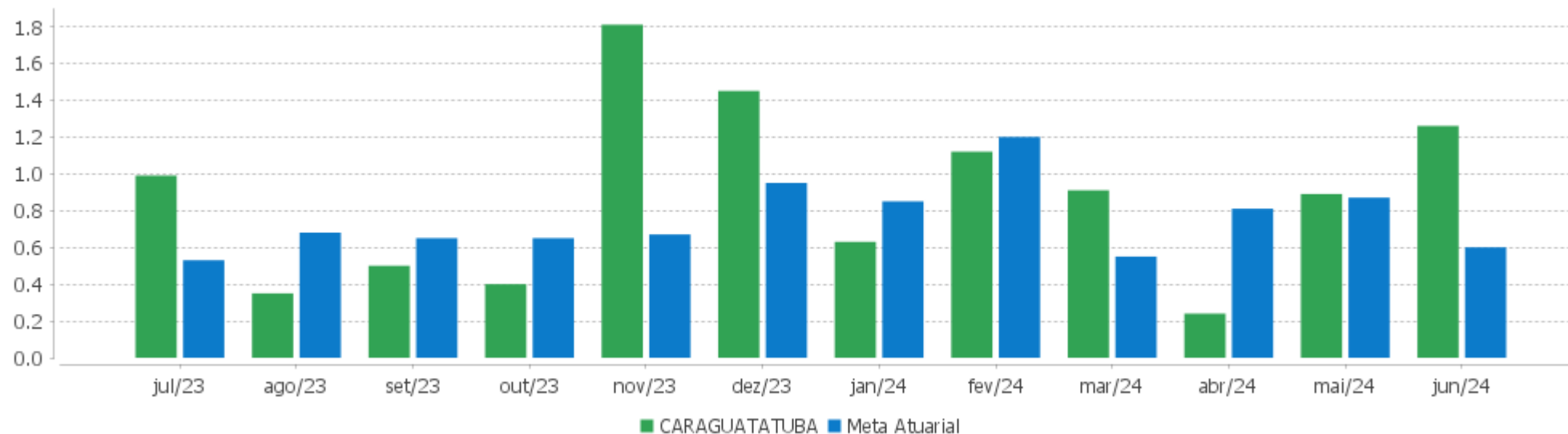


Patrimônio Líquido



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.	0,85 0,64	2,51 1,45	2,51 1,45	5,71 3,22	7,32 3,09	11,10 3,57	
NTN-B 150525 (5,940000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,64	2,50 1,44	2,50 1,44	5,69 3,21	10,24 6,01	14,05 6,53	
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	2,41 1,35	2,41 1,35	5,50 3,02	9,97 5,74	20,15 12,63	37,88 17,58
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	2,43 1,37	2,43 1,37	5,55 3,07	10,10 5,87	20,40 12,87	38,28 17,97
NTN-B 150828 (6,221000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	2,57 1,51	2,57 1,51	2,77 0,28	4,20 -0,02		
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	2,44 1,39	2,44 1,39	5,58 3,09	10,08 5,85	20,44 12,92	34,44 14,13
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	2,46 1,40	2,46 1,40	5,61 3,12	10,22 6,00	20,67 13,15	34,82 14,52
NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	2,60 1,54	2,60 1,54	5,89 3,41	10,69 6,46	18,30 10,77	
NTN-B 150824 (6,680000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,69	2,68 1,62	2,68 1,62	6,05 3,57	10,98 6,75	18,98 11,46	33,75 13,44
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	2,47 1,42	2,47 1,42	5,63 3,15	10,24 6,01	20,75 13,23	38,82 18,52
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	2,49 1,44	2,49 1,44	5,68 3,20	10,44 6,22	21,08 13,56	35,33 15,03
NTN-B 150525 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	2,53 1,48	2,53 1,48	5,76 3,27	7,19 2,96		
NTN-B 150832 (6,070000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	2,54 1,49	2,54 1,49	2,72 0,24	4,10 -0,13		
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	2,46 1,41	2,46 1,41	5,61 3,13	10,27 6,04	20,73 13,21	38,79 18,49
NTN-B 150824 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	2,53 1,48	2,53 1,48	5,76 3,28	10,37 6,14	17,71 10,19	31,70 11,40
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	2,49 1,43	2,49 1,43	5,67 3,18	10,17 5,94	20,75 13,23	34,88 14,58
NTN-B 150824 (5,910000%)	0,84	2,49	2,49	5,68	10,19	17,33	31,08

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.	0,63	1,44	1,44	3,19	5,96	9,80	10,77
NTN-B 150555 (5,850000%)	0,84	2,48	2,48	5,65	10,39	20,94	39,06
Var. IPCA p.p.	0,63	1,42	1,42	3,16	6,16	13,42	18,76
NTN-B 150824 (6,440000%)	0,88	2,62	2,62	5,94	10,73	18,46	
Var. IPCA p.p.	0,67	1,57	1,57	3,45	6,51	10,94	
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,83	2,44	2,44	5,58	10,22	20,61	34,78
Var. IPCA p.p.	0,62	1,39	1,39	3,10	6,00	13,08	14,48
NTN-B 150850 (5,916000%)	0,84	2,49	2,49	5,68	10,44	21,07	35,35
Var. IPCA p.p.	0,63	1,44	1,44	3,20	6,21	13,55	15,05
NTN-B 150527 (6,090000%)	0,86	2,53	2,53	5,77	10,44	21,27	35,66
Var. IPCA p.p.	0,65	1,48	1,48	3,28	6,21	13,75	15,36
NTN-B 150850 (5,815000%)	0,84	2,47	2,47	5,63	10,33	20,84	35,07
Var. IPCA p.p.	0,63	1,41	1,41	3,15	6,10	13,32	14,77
NTN-B 150824 (6,990300%)	0,93	2,75	2,75	6,21	11,30	16,17	
Var. IPCA p.p.	0,72	1,70	1,70	3,72	7,07	8,65	
NTN-B 150828 (6,350000%)	0,88	2,60	2,60	5,89	10,71	18,30	
Var. IPCA p.p.	0,67	1,54	1,54	3,41	6,49	10,78	
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,83	2,45	2,45	5,60	10,25	20,69	38,72
Var. IPCA p.p.	0,62	1,40	1,40	3,12	6,02	13,16	18,42
NTN-B 150525 (5,980000%)	0,85	2,51	2,51	5,71	10,28	20,98	35,23
Var. IPCA p.p.	0,64	1,45	1,45	3,23	6,05	13,46	14,93
NTN-B 150555 (5,815000%)	0,84	2,47	2,47	5,63	10,35	20,86	38,98
Var. IPCA p.p.	0,63	1,41	1,41	3,15	6,12	13,34	18,68
NTN-B 150824 (6,480000%)	0,89	2,63	2,63	5,95	10,77	18,55	33,05
Var. IPCA p.p.	0,68	1,57	1,57	3,47	6,54	11,03	12,75
NTN-B 150850 (5,780000%)	0,83	2,46	2,46	5,61	10,30	20,76	34,97
Var. IPCA p.p.	0,62	1,41	1,41	3,13	6,07	13,24	14,67
NTN-B 150545 (5,710000%)	0,83	2,44	2,44	5,58	10,19	20,57	38,55
Var. IPCA p.p.	0,62	1,39	1,39	3,09	5,97	13,05	18,24
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,75	-1,20	-1,20	0,08	6,33	25,74	24,05
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,03	-0,06	-0,06	-0,13	-0,28	-0,91	-1,30
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,69	2,01	2,01	4,49	10,86	25,93	34,78
Var. IRF-M 1 p.p.	0,05	0,01	0,01	-0,02	-0,09	-0,35	-0,58
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-1,00	-1,35	-1,35	-1,22	2,87	16,57	20,68
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,08	-0,08	-0,13	-0,19	-0,43	-0,75
SANTANDER RF ATIVO FIC	0,16	0,65	0,65	2,02	7,36	21,17	29,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	20,19	25,61	25,61	38,75	62,92	78,93	77,90
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,17 -0,04	0,55 -0,50	0,55 -0,50	2,36 -0,12	7,39 3,17	23,06 15,54	27,65 7,35
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,32 -0,02	-0,24 -0,07	-0,24 -0,07	1,37 -0,14	7,50 -0,39	25,10 -0,84	26,99 -1,17
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,38 0,17	1,40 0,34	1,40 0,34	3,84 1,35	9,79 5,56	25,12 17,60	31,72 11,41
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,79 99,81	2,51 99,36	2,51 99,36	5,20 99,52	11,62 99,35	26,72 99,62	37,80 100,03
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO Var. IDKA 2 p.p.	-0,56 -0,73	-0,56 -1,51	-0,56 -1,51	1,07 -2,14	7,32 -1,06		
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,78 99,21	2,49 98,56	2,49 98,56	5,16 98,74	11,52 98,55	26,51 98,87	37,47 99,15
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,66 84,19	1,94 76,68	1,94 76,68	3,71 71,08	283,60 2.425,65	234,85 875,74	362,16 958,25
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,83 104,68	2,62 103,39	2,62 103,39	5,49 105,16	12,54 107,24	27,99 104,38	40,33 106,72
BB INSTITUCIONAL FI RF % do CDI	0,82 103,87	2,54 100,38	2,54 100,38	5,47 104,77	12,24 104,67	26,97 100,58	38,51 101,89
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,08 -0,11	-2,13 -0,86	-2,13 -0,86	-2,42 -1,32	1,00 -2,07	13,67 -3,33	17,70 -3,73
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,79 100,10	2,53 99,91	2,53 99,91	5,24 100,37	11,71 100,14	26,83 100,06	38,23 101,15
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,79 100,83	2,47 97,59	2,47 97,59	5,23 100,25	12,03 102,93	27,30 101,78	39,04 103,30
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,82 103,84	2,57 101,69	2,57 101,69	5,36 102,72	12,19 104,28	27,40 102,16	39,10 103,45
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,82 103,65	2,62 103,49	2,62 103,49	5,48 105,02	12,39 106,00	27,67 103,19	39,60 104,77
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-0,13 -1,61	-10,63 -7,35	-10,63 -7,35	-13,33 -5,67	-7,64 -12,57	10,00 -15,74	-18,58 -16,29
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	1,37 -0,11	-5,44 -2,16	-5,44 -2,16	-8,82 -1,16	2,40 -2,53	17,87 -7,87	-7,48 -5,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	1,80 0,32	-2,22 1,06	-2,22 1,06	-0,81 6,85	12,30 7,37	27,30 1,56	-5,22 -2,94
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1,03	-10,27	-10,27	-15,26	-12,67	-9,58	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,45	-6,99	-6,99	-7,60	-17,60	-35,32	
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	1,78	-1,09	-1,09	-3,39	8,56	27,99	11,84
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,22	-1,51	-1,51	0,02	-3,53	-3,98	-14,72
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1,59	-2,19	-2,19	-6,31	5,99	21,37	-1,52
Var. IBOVESPA p.p.	0,11	1,09	1,09	1,36	1,06	-4,37	0,76
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-0,04	-8,16	-8,16	-12,82	-13,42	-5,00	-34,26
Var. SMALL CAP p.p.	0,36	3,07	3,07	2,03	-1,46	-10,47	2,03
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,73	21,34	21,34	39,52	52,18	72,57	50,01
Var. Global BDRX p.p.	-0,06	-0,40	-0,40	-1,55	-2,61	-4,56	-5,70
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,90	5,01	5,01	16,70	29,37	66,02	56,49
Var. S&P 500 p.p.	-5,83	-10,61	-10,61	-14,75	-12,16	12,93	15,29
CARAGUATATUBA	1,26	2,40	2,40	5,15	11,05	24,43	20,43
Var. IPCA + 4,99% p.p.	0,65	0,10	0,10	0,16	1,66	5,94	-18,80
CDI	0,79	2,53	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-3,28	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	2,57	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	2,54	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

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 INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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 REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
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
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
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	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
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 INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
SANTANDER RF ATIVO FIC	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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	0,63	2,00	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	-1,14	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	-0,17	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	1,24	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-3,58	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,27	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	0,77	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	0,95	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-7,87	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	2,53	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-3,28	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-3,03	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-2,15	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-11,23	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-7,46	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	0,42	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43

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	9,73	15,63	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	-1,78	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	13,94	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	1,05	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	1,08	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	2,03	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	2,53	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	2,05	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	2,29	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	2,42	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	2,51	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	2,54	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	2,08	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	2,57	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

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%)	20.989.785,52	5,940000	20.921.747,76	6,341000	-68.037,76
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.716.978,12	5,980000	10.685.282,06	6,341000	-31.696,06
NTN-B 150525 (6,080000%)	19.945.043,46	6,080000	19.903.279,84	6,341000	-41.763,62
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.303.937,86	6,090000	5.243.837,82	6,546600	-60.100,04
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.496.829,52	5,560000	16.274.886,96	6,510700	-1.221.942,56
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.478.399,67	5,821000	19.433.884,25	6,510700	-1.044.515,42
NTN-B 150545 (5,710000%)	33.486.420,20	5,710000	30.619.531,01	6,496800	-2.866.889,19
NTN-B 150545 (5,760000%)	11.134.808,86	5,760000	10.240.728,22	6,496800	-894.080,64
NTN-B 150545 (5,781000%)	11.116.686,09	5,781000	10.248.940,51	6,496800	-867.745,58
NTN-B 150555 (5,815000%)	11.100.445,76	5,815000	10.156.071,30	6,477700	-944.374,46
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.733.599,70	5,850000	9.870.559,26	6,477700	-863.040,44
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.771.149,87	5,892000	5.755.818,75	7,999900	-15.331,12
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.910.026,89	5,910000	10.881.342,51	7,999900	-28.684,38
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.458.199,65	6,090000	5.445.048,30	7,999900	-13.151,35
NTN-B 150824 (6,440000%)	21.362.452,25	6,440000	21.320.603,13	7,999900	-41.849,12
NTN-B 150824 (6,480000%)	22.247.414,46	6,480000	22.204.766,92	7,999900	-42.647,54
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.493.549,04	6,680000	5.484.441,74	7,999900	-9.107,30
NTN-B 150824 (6,990300%)	31.826.430,86	6,990300	31.786.126,03	7,999900	-40.304,83
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.961.892,23	6,350000	15.906.329,75	6,539400	-55.562,48
NTN-B 150828 (6,221000%)	20.152.917,66	6,221000	19.925.390,58	6,553700	-227.527,08
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.961.247,54	6,350000	15.852.387,31	6,553700	-108.860,23
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.393.146,92	5,708000	10.989.419,59	6,460000	-403.727,33
NTN-B 150832 (6,070000%)	40.837.500,67	6,070000	39.729.222,77	6,526000	-1.108.277,90
NTN-B 150840 (5,650000%)	970.564,45	5,650000	898.705,45	6,439600	-71.859,00
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.428.558,62	5,770000	10.708.518,50	6,439600	-720.040,12
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.491.497,20	5,713000	10.414.333,69	6,504300	-1.077.163,51
NTN-B 150850 (5,780000%)	11.108.206,29	5,780000	10.153.353,96	6,504300	-954.852,33
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.415.347,21	5,815000	10.480.614,25	6,504300	-934.732,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (5,916000%)	4.098.342,22	5,916000	3.811.132,45	6,504300	-287.209,77
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.977.033,89	5,920000	10.215.491,99	6,504300	-761.541,90
NTN-B 150850 (5,970000%)	21.030.373,07	5,970000	19.693.612,71	6,504300	-1.336.760,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
51	01/04/2024	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	0,00	7.000.000,00	507.572,51054000	13,7911330000
52	01/04/2024	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.000.000,00	0,00	2.173.916,82420300	2,2999960000
53	01/04/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	10.000.000,00	2.235.112,36356874	4,4740480000
54	01/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	68.777,41	0,00	13.402,96786168	5,1315060000
55	01/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	2.792,91639400	3,1453787940
56	02/04/2024	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	400,00	0,00	8,89182000	44,9851890000
57	02/04/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	7.000.000,00	0,00	1.580,01415000	4.430,3400700557
58	02/04/2024	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.206.693,51	0,00	593.622,67999266	7,0864770700
59	03/04/2024	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	793.306,49	0,00	112.175,43370322	7,0720162500
60	05/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	246.607,10	0,00	78.277,12150500	3,1504364910
61	08/04/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	76.325,01	0,00	17,19817000	4.437,9727610554
62	10/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	68.000,00	13.213,95432441	5,1460750000
63	15/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.653,29096200	3,1579763090
64	16/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	39.987.230,73	12.657.412,68822500	3,1591946723
65	17/04/2024	NTN-B 150832 (6,070000%)	39.987.230,73	0,00	9.326,00000000	4.287,7150686300
66	19/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.696.357,35	0,00	910.051,71165260	5,1605390000
67	19/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	837.446,62	0,00	162.278,90536240	5,1605390000
68	19/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	379.794,65356500	3,1629949730
69	22/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	14.765,34757100	3,1642634740
70	25/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	78.000,00	15.089,93309936	5,1690090000
71	26/04/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	10.694.095,43	2.943.024,70352700	3,6337090290
72	26/04/2024	BB INSTITUCIONAL FI RF	10.361.426,37	0,00	821.314,93749100	12,6156555750
73	26/04/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	13.193.004,33	3.630.726,65795400	3,6337090541
74	26/04/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	12.782.599,74	0,00	3.662.507,09476000	3,4901228610
75	26/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.000.000,00	1.603.653,76429100	3,1178800000
76	26/04/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	7.000.000,00	3.626.531,49729500	1,9302190000
77	26/04/2024	FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,00	16.000.000,00	5.556.097,65844600	2,8797190000
78	26/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	26.310.292,29	0,00	5.087.916,37925300	5,1711330000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
79	26/04/2024	SANTANDER RF ATIVO FIC	0,00	600.000,00	36.164,77830300	16,5907280000
80	26/04/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	10.000.000,00	0,00	38.427,15220520	260,2326591000
81	26/04/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	10.000.000,00	256.987,63778444	38,9123776000
82	29/04/2024	BB PREV RF IRF M	0,00	10.000.000,00	1.302.691,44377800	7,6764148930
83	29/04/2024	BB INSTITUCIONAL FI RF	332.669,06	0,00	26.370,52874800	12,6151835320
84	29/04/2024	BB INSTITUCIONAL FI RF	10.000.000,00	0,00	792.695,56202900	12,6151835320
85	29/04/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	410.404,59	0,00	117.543,50211442	3,4915123560
86	29/04/2024	FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,00	847.902,45	294.308,58516700	2,8809980000
87	29/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.254.725,51	822.446,19212300	5,1732569872
88	29/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	720.397,11	0,00	139.254,07340000	5,1732570000
89	29/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	38.160,72	0,00	7.376,53667699	5,1732570000
90	29/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.689.707,71	0,00	326.623,57775769	5,1732570000
91	29/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	231.168,64	44.685,31913261	5,1732570000
92	29/04/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	600.000,00	0,00	2.304,30544044	260,3821479000
93	30/04/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.303,19	0,00	0,51558000	4.467,1825904806
94	30/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	111.620,53	0,00	21.567,64667400	5,1753690000
95	30/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	127.505,34	0,00	24.636,95632100	5,1753690000
96	02/05/2024	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	400,00	0,00	8,84382860	45,2292800000
97	06/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	69.138,66	0,00	13.342,94543200	5,1816640000
98	08/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	244.684,12	0,00	76.981,14573700	3,1784941320
99	10/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	64.000,00	12.332,51148706	5,1895350000
100	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.933.560,72	0,00	949.121,43044900	5,1980290000
101	16/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.630,06343400	3,1858661240
102	17/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	837.446,62	0,00	161.039,71559800	5,2002490000
103	17/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.357.019,15	0,00	837.848,17803900	5,2002490000
104	20/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	398.725,36	0,00	76.644,49557500	5,2022700000
105	20/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	14.653,76623700	3,1883578080
106	20/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	376.773,45277428	3,1883578080
107	22/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	2.753,16287370	3,1907956060
108	24/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	205.000,00	39.342,20597100	5,2106890000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
109	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	231.048,64	44.306,02227900	5,2148360000
110	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.286.151,94	821.915,00213500	5,2148360000
111	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	38.202,09	0,00	7.325,65511100	5,2148360000
112	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.681,03	0,00	322,35529500	5,2148360000
113	29/05/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.303,19	0,00	0,51138018	4.503,8702830000
114	03/06/2024	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	400,00	0,00	8,77718035	45,5727220000
115	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	110.261,83	0,00	21.119,04365600	5,2209670000
116	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	19.996.621,80	3.830.060,94424100	5,2209670000
117	04/06/2024	NTN-B 150828 (6,221000%)	19.996.621,75	0,00	4.623,00000000	4.325,4643629678
118	07/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	246.120,27	0,00	76.797,39435500	3,2047997470
119	10/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	69.138,65	0,00	13.215,46794200	5,2316460000
120	10/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	64.000,00	12.233,24359400	5,2316460000
121	17/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.608,27272200	3,2124823170
122	19/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	14.532,05184200	3,2150621610
123	19/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.530,89	0,00	291,76387200	5,2470170000
124	20/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.670.921,77	0,00	889.855,66036500	5,2490780000
125	20/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	837.446,62	0,00	159.541,66045900	5,2490780000
126	21/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	2.730,22751500	3,2175999800
127	25/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	162.122,00	30.849,24960300	5,2552980000
128	26/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	108.552,76	0,00	20.647,40081400	5,2574540000
129	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.738,99	0,00	330,63745300	5,2595070000
130	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	38.304,16	0,00	7.282,84228900	5,2595070000
131	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.306.707,23	818.842,37982600	5,2595070000
132	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	239.741,41	45.582,48702300	5,2595070000
133	28/06/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.303,19	0,00	0,50700180	4.542,7649000000
Total			175.960.965,63	164.509.520,11		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.913.423,19

Value-At-Risk: 0,51%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,29	0,09		0,03	-0,01	0,79	668.891.170,98	87,68
Artigo 8º	12,44	6,14		0,33	0,03	1,21	50.199.946,70	6,58
Artigo 9º	17,32	6,46		0,07	0,69	12,73	26.508.545,28	3,47
Artigo 10º	6,22	4,79		0,08	0,50	3,90	17.238.910,92	2,26
CARAGUATATUBA		0,51		0,51			762.838.573,88	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,09%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,892000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,32	0,84	5.771.149,87	0,76
NTN-B 150824 (5,910000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,33	0,84	10.910.026,89	1,43
NTN-B 150824 (6,090000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,41	0,86	5.458.199,65	0,72
NTN-B 150824 (6,440000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,56	0,88	21.362.452,25	2,80
NTN-B 150824 (6,480000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,58	0,89	22.247.414,46	2,92
NTN-B 150824 (6,680000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,67	0,90	5.493.549,04	0,72
NTN-B 150824 (6,990300%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,81	0,93	31.826.430,86	4,17
NTN-B 150525 (5,940000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,34	0,85	20.989.785,52	2,75
NTN-B 150525 (5,980000%)	0,17	0,10	0,00	0,13	0,36	0,85	10.716.978,12	1,40
NTN-B 150525 (6,080000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,40	0,86	19.945.043,46	2,61
NTN-B 150826 (6,350000%)	0,17	0,11	0,00	0,13	0,51	0,88	15.961.892,23	2,09
NTN-B 150527 (6,090000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,40	0,86	5.303.937,86	0,70
NTN-B 150828 (6,221000%)	0,17	0,22	-0,00	0,26	0,47	0,87	20.152.917,66	2,64
NTN-B 150828 (6,350000%)	0,18	0,13	0,00	0,15	0,49	0,88	15.961.247,54	2,09
NTN-B 150830 (5,708000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,24	0,83	11.393.146,92	1,49
NTN-B 150832 (6,070000%)	0,18	0,22	-0,00	0,26	0,38	0,86	40.837.500,67	5,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,560000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,17	0,82	17.496.829,52	2,29
NTN-B 150535 (5,821000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,29	0,84	20.478.399,67	2,68
NTN-B 150840 (5,650000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,21	0,82	970.564,45	0,13
NTN-B 150840 (5,770000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,27	0,83	11.428.558,62	1,50
NTN-B 150545 (5,710000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,24	0,83	33.486.420,20	4,39
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,26	0,83	11.134.808,86	1,46
NTN-B 150545 (5,781000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,27	0,83	11.116.686,09	1,46
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,24	0,83	11.491.497,20	1,51
NTN-B 150850 (5,780000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,27	0,83	11.108.206,29	1,46
NTN-B 150850 (5,815000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,29	0,84	11.415.347,21	1,50
NTN-B 150850 (5,916000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,33	0,84	4.098.342,22	0,54
NTN-B 150850 (5,920000%)	0,22	0,13	0,00	0,15	0,26	0,84	10.977.033,89	1,44
NTN-B 150850 (5,970000%)	0,20	0,13	0,00	0,15	0,30	0,85	21.030.373,07	2,76
NTN-B 150555 (5,815000%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,28	0,84	11.100.445,76	1,46
NTN-B 150555 (5,850000%)	0,23	0,13	0,00	0,15	0,22	0,84	10.733.599,70	1,41
Sub-total	0,17	0,08	0,00		0,39	0,86	462.398.785,75	60,62

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	1,00	0,42	0,00	0,42	-0,41	0,38	10.476.592,19	1,37
BB PREV RF IRF M	3,60	1,36	0,01	0,01	-0,31	-0,32	10.552.165,07	1,38
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,01	0,01	0,00	0,00	-0,21	0,79	13.416.889,15	1,76
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,00	2,15	0,00	0,02	-0,45	-1,00	211.021,65	0,03
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,03	1,91	0,01	0,03	-0,31	-0,75	5.624.418,97	0,74
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,85	0,72	0,00	0,72	-0,33	0,17	10.905.330,23	1,43
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	4,09	1,24	0,00	0,78	-0,33	-0,56	2.574.973,79	0,34
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,48	0,23	0,00	0,32	-0,21	0,69	500.280,37	0,07
SANTANDER RF ATIVO FIC	1,71	0,76	0,00	0,76	-0,37	0,16	56.665,35	0,01
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	0,00	0,00	-0,56	0,78	11.485.611,32	1,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	1,64	0,61	0,02		-0,33	0,25	65.803.948,09	8,63

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB INSTITUCIONAL FI RF	0,07	0,05	0,00	0,05	0,46	0,82	21.050.044,80	2,76
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,04	0,02	0,00	0,02	0,02	0,79	18.263.377,61	2,39
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	0,00	0,05	0,09	0,79	18.042.170,35	2,37
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,81	0,82	39.767.688,05	5,21
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,04	0,03	-0,00	0,03	0,84	0,83	31.092.162,63	4,08
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,22	2,24	0,00	0,39	-0,44	-1,08	191.483,46	0,03
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,07	0,03	0,00	0,03	0,42	0,82	10.786.472,74	1,41
Sub-total	0,04	0,02	0,00		0,60	0,81	139.193.399,64	18,25

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR	2,35	0,13	-0,00	0,13	-0,05	0,66	1.495.037,50	0,20
Sub-total	2,35	0,13	-0,00		-0,05	0,66	1.495.037,50	0,20

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,14%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS	12,01	6,36	0,01	1,99	0,07	1,59	1.638.745,60	0,21
BRADESCO F I A SELECTION	15,33	7,72	0,04	3,26	-0,06	-0,13	5.172.490,37	0,68
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	17,77	8,77	0,04	3,20	-0,05	-0,04	5.018.702,02	0,66
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	12,62	6,45	0,05	1,40	0,05	1,37	7.793.593,72	1,02
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,96	5,55	0,09	1,83	0,09	1,78	16.114.962,42	2,11
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	10,88	5,37	0,04	3,73	0,09	1,80	6.727.507,69	0,88
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	15,01	7,51	0,06	3,57	0,02	1,03	7.733.944,88	1,01
Sub-total	12,44	6,14	0,33		0,03	1,21	50.199.946,70	6,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,46%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,32	6,46	0,07	0,94	0,69	12,73	26.508.545,28	3,47
Sub-total	17,32	6,46	0,07		0,69	12,73	26.508.545,28	3,47

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,79%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,22	4,79	0,08	4,84	0,50	3,90	17.238.910,92	2,26
Sub-total	6,22	4,79	0,08		0,50	3,90	17.238.910,92	2,26

(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 (%)