



CARAGUATATUBA
4º 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 31.12.2024.

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

94,24%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,940000%)	0,23	0,05	1,01	2,92	21.443.782,47	2,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,23	0,05	1,01	2,93	10.950.584,57	1,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,080000%)	0,22	0,05	1,02	2,96	20.390.049,30	2,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	0,24	0,05	1,04	3,02	16.335.978,70	2,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,400000%)	0,22	0,05	1,04	3,03	20.806.042,87	2,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,703000%)	0,22	0,05	1,07	3,11	20.675.779,52	2,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,26	0,05	1,02	2,96	5.422.317,14	0,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,220000%)	0,22	0,05	1,03	2,99	10.097.476,87	1,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (7,301500%)	0,22	0,05	0,98	0,98	20.195.291,86	2,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,221000%)	0,22	0,05	1,03	2,99	20.611.909,66	2,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	0,26	0,04	1,04	3,02	16.333.036,04	2,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (7,030000%)	0,22	0,06	1,09	1,93	10.190.720,54	1,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,30	0,05	0,99	2,87	11.631.318,13	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,070000%)	0,23	0,06	1,02	2,95	41.742.098,98	5,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,35	0,05	0,98	2,83	17.860.092,85	2,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,36	0,05	1,00	2,89	20.918.534,42	2,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,40	0,05	0,98	2,85	991.190,12	0,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,41	0,05	0,99	2,88	11.674.301,93	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,186000%)	0,22	0,05	1,03	2,98	15.519.707,36	1,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,46	0,05	0,99	2,87	34.207.999,63	4,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,46	0,05	0,99	2,88	11.375.679,05	1,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,46	0,05	0,99	2,88	11.357.560,01	1,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,50	0,05	0,99	2,87	11.740.367,36	1,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,50	0,05	0,99	2,88	11.349.714,52	1,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,51	0,05	1,00	2,89	11.664.039,52	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,51	0,05	1,00	2,92	4.188.140,61	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,49	0,02	1,00	2,92	11.217.632,53	1,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,970000%)	0,50	0,03	1,01	2,93	21.492.590,82	2,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,296000%)	0,22	0,05	1,03	3,01	36.229.281,50	4,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,54	0,05	1,00	2,89	11.343.179,88	1,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,52	0,02	1,00	2,90	10.968.711,20	1,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,32	0,05	1,02	2,95	500.925.109,96	62,14

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	0,82	0,05	0,17	1,38	10.909.147,21	1,35	5.307.578.902,09	0,21
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,03	0,05	0,89	2,64	25.236.885,09	3,13	29.925.966.987,52	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,41	0,05	0,20	1,60	1.244.935,77	0,15	3.670.341.424,26	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	3,75	0,04	-2,29	-3,22	561.044,20	0,07	113.980.733,20	0,49
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,44	0,04	0,65	2,08	525.742,07	0,07	633.173.463,16	0,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	1,62	0,05	-0,38	0,23	58.057,88	0,01	201.290.639,17	0,03
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,04	0,04	0,87	2,61	12.092.843,94	1,50	7.022.509.346,32	0,17
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,89	0,05	0,67	2,24	50.628.656,16	6,28		

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	0,05	0,64	2,37	22.146.077,01	2,75	2.410.648.204,17	0,92
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,80	2,56	53.156.057,69	6,59	20.140.019.415,30	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,05	0,83	2,58	15.126.945,37	1,88	6.711.585.180,95	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	0,83	2,57	68.249.667,63	8,47	18.901.575.347,13	0,36
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,06	0,04	0,86	2,61	36.828.267,27	4,57	6.911.306.522,53	0,53
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,08	0,04	0,84	2,58	11.368.564,47	1,41	3.156.991.525,99	0,36
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,09	0,04	0,81	2,55	206.875.579,44	25,66		

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 *	5,62	0,45	0,45	-3,56	1.280.798,06	0,16	56.027.774,26	2,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	5,62	0,45	0,45	-3,56	1.280.798,06	0,16		
		Renda Fixa	0,25	0,05	0,94	2,78	759.710.143,62	94,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

4,46%

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	12,32	-0,00	-4,81	-8,05	1.608.523,25	0,20	516.608.485,34	0,31
BRADESCO	BEM	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	18,20	-0,00	-7,50	-13,67	4.236.548,99	0,53	307.314.907,12	1,38
BRADESCO	BEM	BRADESCO FIC FIA SELECTION	14,04	-0,00	-5,86	-10,86	4.913.128,69	0,61	224.524.891,97	2,19
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,69	-0,00	-4,11	-8,60	6.793.963,32	0,84	971.373.998,81	0,70
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	12,99	-0,00	-4,45	-10,14	7.422.968,46	0,92	637.925.240,48	1,16
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	13,08	-0,00	-5,05	-8,21	3.739.259,27	0,46	1.188.970.075,54	0,31
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	14,69	-0,01	-5,39	-11,63	7.233.974,37	0,90	100.926.721,87	7,17
Sub-total Artigo 8º I			12,94	-0,00	-5,22	-10,40	35.948.366,35	4,46		
Renda Variável			12,94	-0,00	-5,22	-10,40	35.948.366,35	4,46		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,30%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	12,31	0,04	-1,87	3,69	10.460.656,46	1,30	2.100.762.128,65	0,50
Sub-total Artigo 10º I			12,31	0,04	-1,87	3,69	10.460.656,46	1,30		
Investimentos Estruturados			9,45	0,04	-1,87	3,69	10.460.656,46	1,30		
Total			1,05	0,05	0,61	2,12	806.119.166,43	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	500.925.109,96	62,14	0,00	58,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	50.628.656,16	6,28	0,00	8,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	206.875.579,44	25,66	0,00	28,20	75,00	0,00	75,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.280.798,06	0,16	0,00	0,20	5,00	0,00	15,00
	Total Renda Fixa	759.710.143,62	94,24					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	35.948.366,35	4,46	0,00	4,00	30,00	0,00	45,00
	Total Renda Variável	35.948.366,35	4,46					45,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.460.656,46	1,30	0,00	1,30	15,00	0,00	15,00
	Total Investimentos Estruturados	10.460.656,46	1,30					20,00
Total		806.119.166,43	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Atribuição Desemp. (%)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,02 109,66	2,95 110,42	2,95 110,42	5,23 97,27	11,27 103,66	5.020.828,56	0,63	13.917.747,12
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,67 72,15	2,24 84,04	2,24 84,04	4,80 89,41	7,88 72,50	336.680,89	0,04	1.198.063,73
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,81 86,85	2,55 95,64	2,55 95,64	5,35 99,59	10,77 99,03	1.691.035,80	0,21	5.483.219,94
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,45 48,90	-3,56 -133,41	-3,56 -133,41	-1,01 -18,81	2,67 24,53	5.784,39	0,00	-42.895,48
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-5,22 -0,93	-10,40 -1,65	-10,40 -1,65	-4,99 -2,06	-12,66 -2,30	-1.978.172,12	-0,25	-4.173.288,18
Artigo 9º III % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-5,97 -111,10	31,19 286,83	0,00	0,00	0,00
Artigo 10º I % do CDI	-1,87 -201,75	3,69 138,01	3,69 138,01	-0,50 -9,35	12,26 112,71	-199.550,92	-0,02	371.804,32
CARAGUATATUBA (Total)						4.876.606,60	0,61	16.754.651,45

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%)	21.230.279,42	0,00	0,00	0,00	21.443.782,47	213.503,05	618.386,96
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.841.258,08	0,00	0,00	0,00	10.950.584,57	109.326,49	316.685,52
NTN-B 150525 (6,080000%)	20.184.776,72	0,00	0,00	0,00	20.390.049,30	205.272,58	594.764,33
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.367.696,00	0,00	0,00	0,00	5.422.317,14	54.621,14	158.277,01
NTN-B 150527 (6,220000%)	9.994.736,36	0,00	0,00	0,00	10.097.476,87	102.740,51	297.820,81
NTN-B 150527 (7,301500%)	0,00	20.000.135,18	0,00	0,00	20.195.291,86	195.156,68	195.156,68
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.687.578,96	0,00	0,00	0,00	17.860.092,85	172.513,89	498.945,20
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.712.212,86	0,00	0,00	0,00	20.918.534,42	206.321,56	597.295,81
NTN-B 150545 (5,710000%)	33.873.544,98	0,00	0,00	0,00	34.207.999,63	334.454,65	967.613,73
NTN-B 150545 (5,760000%)	11.264.017,01	0,00	0,00	0,00	11.375.679,05	111.662,04	323.119,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150545 (5,781000%)	11.245.884,30	0,00	0,00	0,00	11.357.560,01	111.675,71	323.184,60
NTN-B 150555 (5,815000%)	11.231.347,05	0,00	0,00	0,00	11.343.179,88	111.832,83	323.668,80
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.860.257,62	0,00	0,00	0,00	10.968.711,20	108.453,58	313.943,90
NTN-B 150826 (6,350000%)	16.168.084,13	0,00	0,00	0,00	16.335.978,70	167.894,57	479.190,03
NTN-B 150826 (6,400000%)	20.591.420,72	0,00	0,00	0,00	20.806.042,87	214.622,15	612.587,30
NTN-B 150826 (6,703000%)	20.457.689,52	0,00	0,00	0,00	20.675.779,52	218.090,00	622.967,03
NTN-B 150828 (6,221000%)	20.402.182,91	0,00	0,00	0,00	20.611.909,66	209.726,75	598.391,95
NTN-B 150828 (6,350000%)	16.165.187,68	0,00	0,00	0,00	16.333.036,04	167.848,36	479.097,86
NTN-B 150828 (7,030000%)	10.080.675,94	0,00	0,00	0,00	10.190.720,54	110.044,60	192.500,83
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.517.621,92	0,00	0,00	0,00	11.631.318,13	113.696,21	323.992,74
NTN-B 150832 (6,070000%)	41.322.370,35	0,00	0,00	0,00	41.742.098,98	419.728,63	1.197.185,78
NTN-B 150840 (5,650000%)	981.545,25	0,00	0,00	0,00	991.190,12	9.644,87	27.478,44
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.559.619,51	0,00	0,00	0,00	11.674.301,93	114.682,42	326.858,14
NTN-B 150840 (6,186000%)	15.362.211,56	0,00	0,00	0,00	15.519.707,36	157.495,80	449.321,99
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.625.547,42	0,00	0,00	0,00	11.740.367,36	114.819,94	327.176,85
NTN-B 150850 (5,780000%)	11.238.122,17	0,00	0,00	0,00	11.349.714,52	111.592,35	318.036,15
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.549.040,03	0,00	0,00	0,00	11.664.039,52	114.999,49	327.770,95
NTN-B 150850 (5,916000%)	4.146.518,78	0,00	0,00	0,00	4.188.140,61	41.621,83	118.663,13
NTN-B 150850 (5,920000%)	11.106.100,75	0,00	0,00	0,00	11.217.632,53	111.531,78	317.991,48
NTN-B 150850 (5,970000%)	21.278.080,44	0,00	0,00	0,00	21.492.590,82	214.510,38	611.687,33
NTN-B 150850 (6,296000%)	35.858.537,78	0,00	0,00	0,00	36.229.281,50	370.743,72	1.057.985,83
	475.904.146,22	20.000.135,18	0,00	0,00	500.925.109,96	5.020.828,56	13.917.747,12

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	10.890.690,23	0,00	0,00	0,00	10.909.147,21	18.456,98	148.295,39
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	25.014.865,56	0,00	0,00	0,00	25.236.885,09	222.019,53	649.881,85
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.242.487,96	0,00	0,00	0,00	1.244.935,77	2.447,81	100.030,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	574.212,80	0,00	0,00	0,00	561.044,20	-13.168,60	-18.674,08
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	521.953,98	400,00	0,00	0,00	525.742,07	3.388,09	10.685,31
SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	58.281,69	0,00	0,00	0,00	58.057,88	-223,81	130,60
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA	11.989.083,05	0,00	0,00	0,00	12.092.843,94	103.760,89	307.713,86
	50.291.575,27	400,00	0,00	0,00	50.628.656,16	336.680,89	1.198.063,73

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	22.005.114,35	0,00	0,00	0,00	22.146.077,01	140.962,66	511.713,53
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	51.253.872,16	1.485.171,83	0,00	0,00	53.156.057,69	417.013,70	1.292.310,29
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	34.986.162,10	0,00	-20.000.135,18	0,00	15.126.945,37	140.918,45	665.510,26
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	71.017.722,32	6.148.590,29	-9.501.954,85	0,00	68.249.667,63	585.309,87	1.793.493,99
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	36.510.985,96	4.606,38	0,00	0,00	36.828.267,27	312.674,93	934.306,51
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	11.274.408,28	0,00	0,00	0,00	11.368.564,47	94.156,19	285.885,36
	227.048.265,17	7.638.368,50	-29.502.090,03	0,00	206.875.579,44	1.691.035,80	5.483.219,94

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	1.275.013,67	0,00	0,00	0,00	1.280.798,06	5.784,39	-42.895,48
	1.275.013,67	0,00	0,00	0,00	1.280.798,06	5.784,39	-42.895,48

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.689.727,15	0,00	0,00	0,00	1.608.523,25	-81.203,90	-140.897,31
BRABESCO FIA MID SMALL CAPS	4.580.045,57	0,00	0,00	0,00	4.236.548,99	-343.496,58	-670.942,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FIC FIA SELECTION	5.218.997,25	0,00	0,00	0,00	4.913.128,69	-305.868,56	-598.335,78
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	7.085.246,50	0,00	0,00	0,00	6.793.963,32	-291.283,18	-639.071,83
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.768.385,69	0,00	0,00	0,00	7.422.968,46	-345.417,23	-837.370,77
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	3.937.955,34	0,00	0,00	0,00	3.739.259,27	-198.696,07	-334.490,12
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	7.646.180,97	0,00	0,00	0,00	7.233.974,37	-412.206,60	-952.180,00
	37.926.538,47	0,00	0,00	0,00	35.948.366,35	-1.978.172,12	-4.173.288,18

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	10.660.207,38	0,00	0,00	0,00	10.460.656,46	-199.550,92	371.804,32
	10.660.207,38	0,00	0,00	0,00	10.460.656,46	-199.550,92	371.804,32

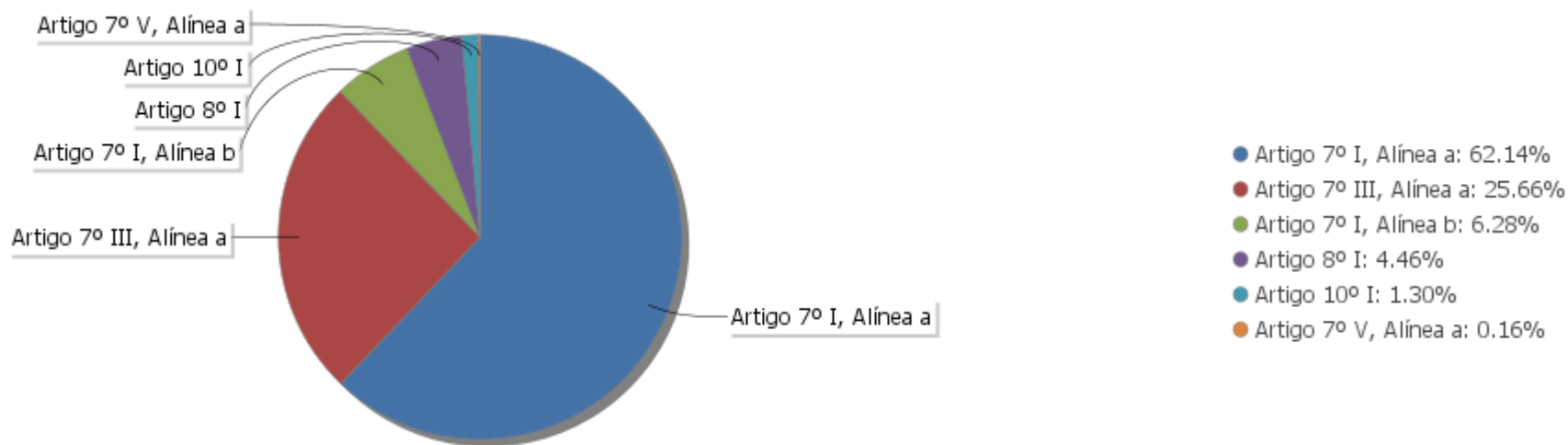
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

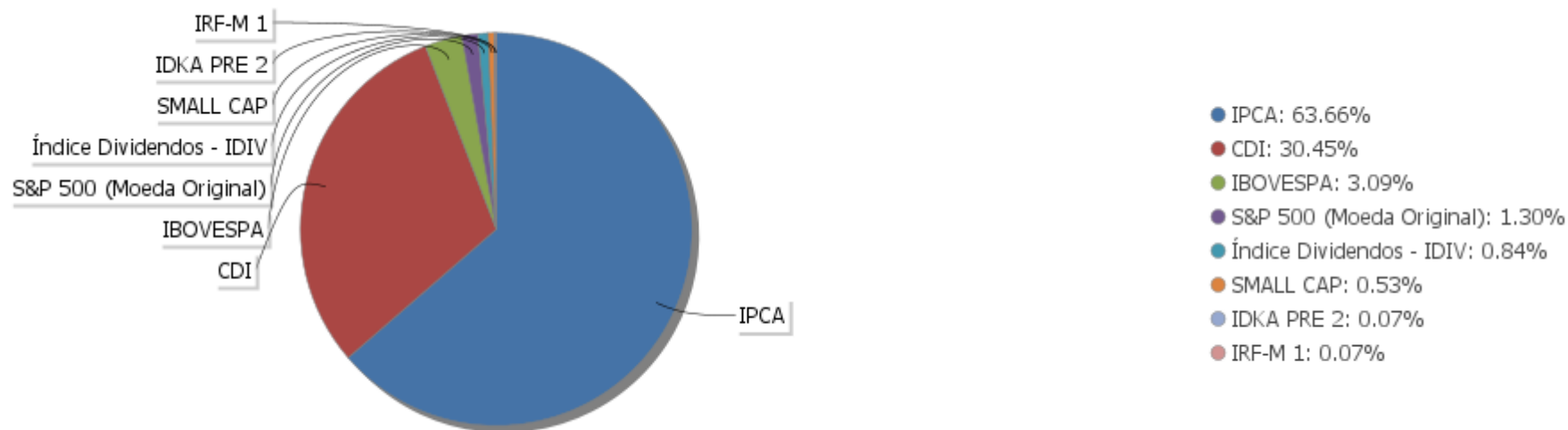
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	280.003.891,05	34,73		280.003.891,05	34,73	
de 31 dias a 365 dias	77.974.581,76	9,67		357.978.472,81	44,41	
acima de 365 dias	448.140.693,62	55,59		806.119.166,43	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

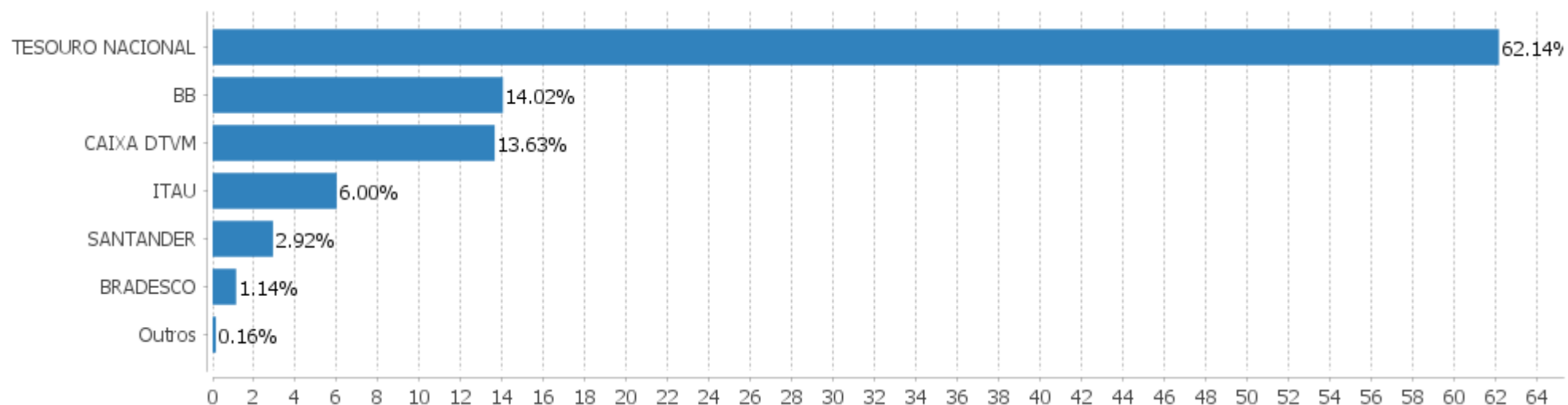


Alocação Por Estratégia



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	1,00	0,72	0,57	0,83	0,67	0,61	9,85
IPCA + 5,02%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41	0,85	1,01	0,76	0,93	10,12
p.p. indexador	-0,22	-0,08	0,36	-0,57	0,02	0,65	0,17	0,31	-0,28	-0,18	-0,09	-0,32	-0,26
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

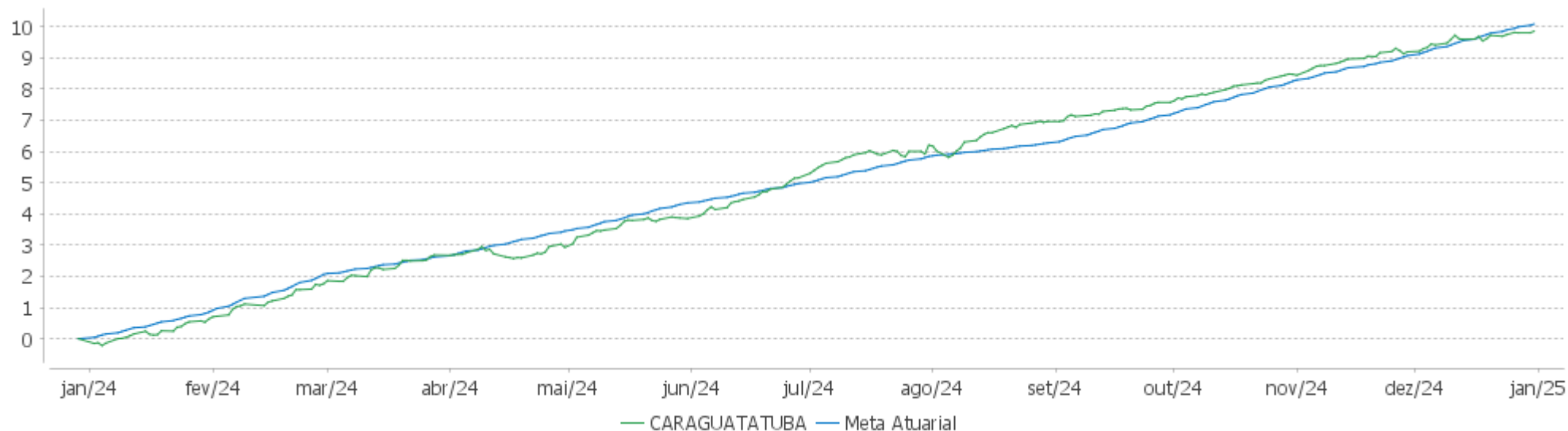
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	33	45,83
Meses abaixo - Meta Atuarial	39	54,17
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03

Relatório

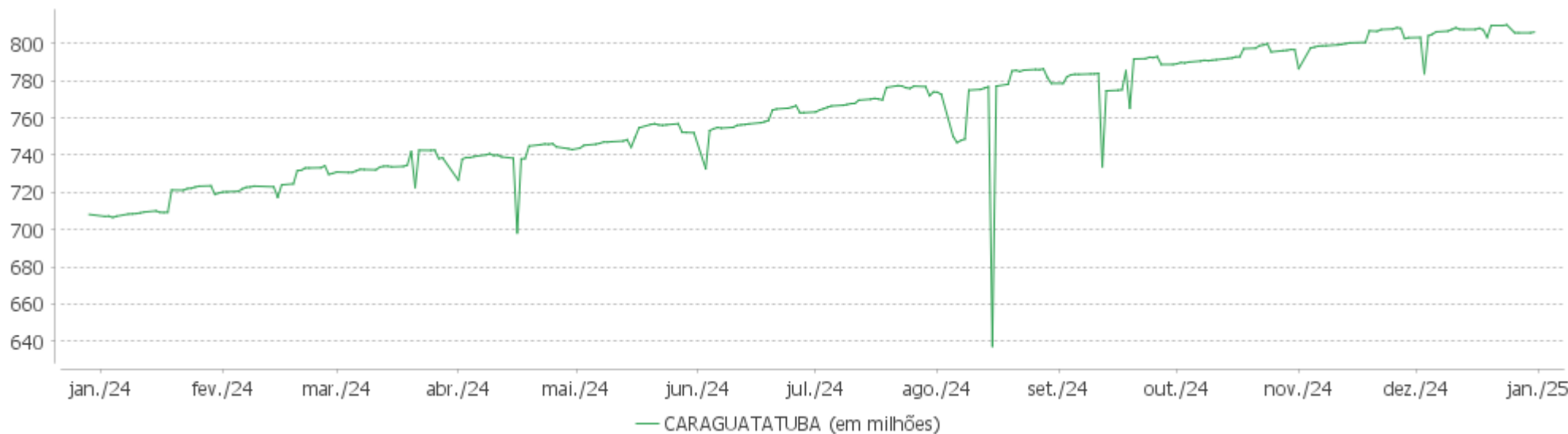
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,12	2,73	-0,61	0,83
06 meses	4,48	4,89	-0,41	1,02
12 meses	9,85	10,12	-0,26	1,05
24 meses	24,08	20,93	3,15	1,47
36 meses	28,79	34,28	-5,49	3,24
48 meses	26,90	55,83	-28,93	4,05
60 meses	33,40	72,42	-39,02	6,86
Desde 31/12/2018	53,86	90,68	-36,82	6,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

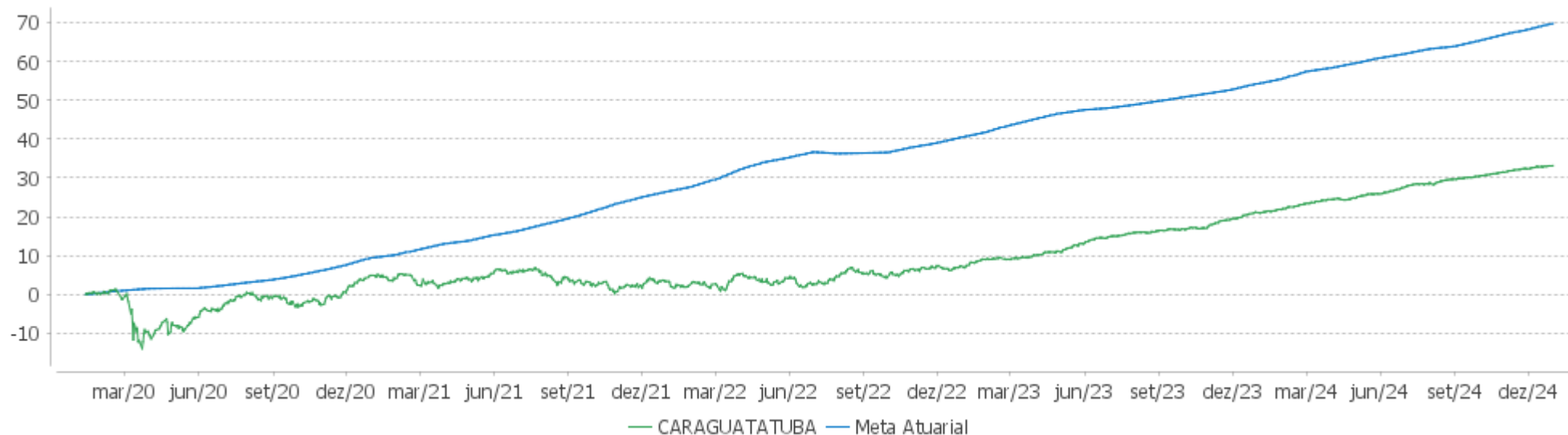


Patrimônio Líquido No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

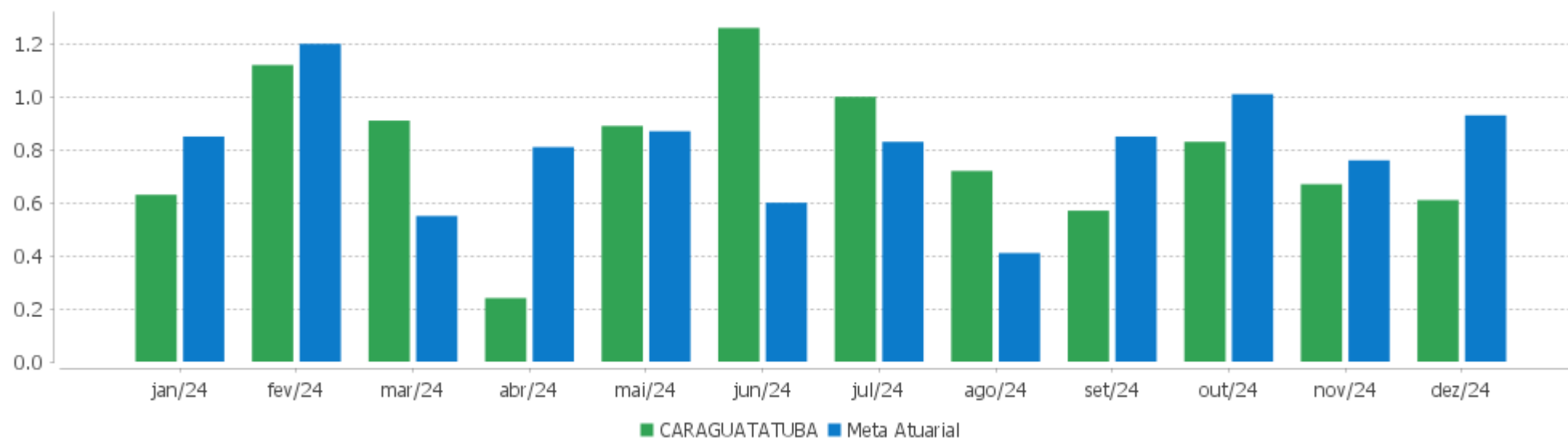


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150850 (5,970000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,49	2,93 1,45	2,93 1,45	5,19 2,90	11,20 6,37	23,55 13,87	
NTN-B 150525 (5,940000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,49	2,92 1,44	2,92 1,44	5,18 2,89	11,16 6,33	23,25 13,58	38,10 22,08
NTN-B 150840 (6,186000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,51	2,98 1,50	2,98 1,50	5,30 3,01	11,42 6,59		
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,46	2,83 1,35	2,83 1,35	4,98 2,69	10,76 5,93	22,50 12,83	36,77 20,75
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,46	2,85 1,37	2,85 1,37	5,03 2,74	10,86 6,03	22,75 13,08	37,16 21,14
NTN-B 150828 (7,030000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,57	3,19 1,72	3,19 1,72	5,74 3,45	12,32 7,49		
NTN-B 150850 (6,296000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,51	3,01 1,53	3,01 1,53	5,36 3,07	11,54 6,71		
NTN-B 150828 (6,221000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,51	2,99 1,51	2,99 1,51	5,32 3,03	11,46 6,63		
NTN-B 150826 (6,400000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,52	3,03 1,56	3,03 1,56	5,41 3,12	11,65 6,82		
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,47	2,87 1,39	2,87 1,39	5,06 2,77	10,92 6,09	22,80 13,12	37,29 21,27
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,47	2,88 1,40	2,88 1,40	5,09 2,80	10,99 6,15	23,03 13,36	37,63 21,61
NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,52	3,02 1,54	3,02 1,54	5,39 3,10	11,60 6,77	24,23 14,55	39,73 23,71
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,48	2,89 1,42	2,89 1,42	5,12 2,83	11,04 6,21	23,11 13,44	37,79 21,77
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,48	2,92 1,44	2,92 1,44	5,17 2,88	11,14 6,31	23,46 13,78	38,26 22,24
NTN-B 150527 (6,220000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,51	2,99 1,51	2,99 1,51	5,32 3,03	11,46 6,63		
NTN-B 150525 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,50	2,96 1,48	2,96 1,48	5,25 2,96	11,31 6,48	23,55 13,87	
NTN-B 150832 (6,070000%)	1,02	2,95	2,95	5,24	11,31	23,54	

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.	0,50	1,48	1,48	2,95	6,48	13,87	
NTN-B 150527 (7,301500%) Var. IPCA p.p.	1,11 0,59	3,25 1,77	3,25 1,77	5,87 3,58	12,60 7,77		
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,47	2,88 1,41	2,88 1,41	5,10 2,81	11,00 6,17	23,10 13,42	37,72 21,70
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,48	2,90 1,42	2,90 1,42	5,13 2,84	11,07 6,24	23,31 13,64	38,01 21,99
NTN-B 150826 (6,703000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,55	3,11 1,63	3,11 1,63	5,57 3,27	11,97 7,14		
NTN-B 150850 (5,713000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,47	2,87 1,39	2,87 1,39	5,06 2,77	10,93 6,09	22,97 13,29	37,49 21,47
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,48	2,92 1,44	2,92 1,44	5,17 2,88	11,14 6,31	23,45 13,77	38,28 22,26
NTN-B 150527 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,50	2,96 1,48	2,96 1,48	5,25 2,96	11,32 6,49	23,65 13,98	38,74 22,72
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,48	2,89 1,41	2,89 1,41	5,11 2,82	11,03 6,20	23,21 13,53	37,89 21,87
NTN-B 150828 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,52	3,02 1,54	3,02 1,54	5,39 3,10	11,60 6,77	24,25 14,57	39,75 23,73
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,47	2,88 1,40	2,88 1,40	5,09 2,80	10,97 6,14	23,05 13,37	37,64 21,62
NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,49	2,93 1,45	2,93 1,45	5,20 2,91	11,20 6,37	23,33 13,66	38,26 22,24
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,48	2,89 1,41	2,89 1,41	5,11 2,82	11,03 6,20	23,23 13,55	37,91 21,89
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,47	2,88 1,41	2,88 1,41	5,10 2,81	11,00 6,16	23,13 13,45	37,75 21,73
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,47	2,87 1,39	2,87 1,39	5,06 2,77	10,92 6,09	22,93 13,26	37,44 21,42
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,65 -0,05	2,08 -0,05	2,08 -0,05	4,60 -0,14	9,30 -0,16	23,57 -0,39	38,21 -0,65
SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI Var. IPCA p.p.	-0,38 -0,90	0,23 -1,25	0,23 -1,25	2,46 0,17	4,53 -0,30	18,52 8,84	29,51 13,49
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,20 -0,32	1,60 0,12	1,60 0,12	3,81 1,52	6,26 1,43	20,70 11,02	33,61 17,59
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,17	1,38	1,38	4,13	8,12	24,33	35,89

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.	-0,35	-0,10	-0,10	1,84	3,29	14,65	19,87
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,89	2,64	2,64	5,35	10,82	25,21	40,72
% do CDI	95,66	98,98	98,98	99,51	99,51	99,48	99,69
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	-2,29	-3,22	-3,22	-1,45	-0,39	16,03	
Var. IDKA PRE 2 p.p.	-0,15	-0,11	-0,11	-0,15	-0,40	-1,00	
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,87	2,61	2,61	5,29	10,71	24,99	40,37
% do CDI	93,28	97,78	97,78	98,41	98,54	98,63	98,82
FIDC ITALIA SENIOR	0,45	-2,95	-2,95	0,01	3,72	229,45	329,89
% do CDI	48,90	-110,31	-110,31	0,19	34,23	905,49	807,60
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,86	2,61	2,61	5,40	11,18	26,27	42,85
% do CDI	92,30	97,66	97,66	100,46	102,85	103,68	104,90
BB INSTITUCIONAL FI RF	0,64	2,37	2,37	5,21	10,96	25,10	41,00
% do CDI	69,04	88,58	88,58	96,92	100,81	99,07	100,37
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,80	2,56	2,56	5,36	10,88	25,27	41,04
% do CDI	85,86	95,76	95,76	99,72	100,04	99,72	100,46
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,83	2,58	2,58	5,35	10,86	25,70	41,74
% do CDI	88,96	96,54	96,54	99,60	99,92	101,44	102,18
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,83	2,57	2,57	5,38	11,03	25,82	41,76
% do CDI	89,31	96,30	96,30	100,08	101,42	101,88	102,23
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,84	2,58	2,58	5,40	11,18	26,01	42,23
% do CDI	90,01	96,60	96,60	100,45	102,77	102,63	103,37
BRADESCO FIC FIA SELECTION	-5,86	-10,86	-10,86	-5,01	-17,68	-7,38	-0,75
Var. IBOVESPA p.p.	-1,58	-2,11	-2,11	-2,09	-7,32	-17,00	-15,50
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	-4,45	-10,14	-10,14	-4,76	-13,15	4,74	9,75
Var. IBOVESPA p.p.	-0,16	-1,39	-1,39	-1,83	-2,79	-4,87	-5,00
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	-5,05	-8,21	-8,21	2,87	2,04	13,72	19,59
Var. IBOVESPA p.p.	-0,76	0,54	0,54	5,80	12,40	4,11	4,84
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-4,11	-8,60	-8,60	-2,38	-5,69	16,69	26,60
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,78	-2,01	-2,01	-3,19	-3,07	-6,82	-12,54
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-5,39	-11,63	-11,63	-6,46	-20,74	-15,69	-22,52
Var. IBOVESPA p.p.	-1,11	-2,88	-2,88	-3,54	-10,38	-25,30	-37,26
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-4,81	-8,05	-8,05	-1,84	-8,03	11,61	19,01
Var. IBOVESPA p.p.	-0,52	0,70	0,70	1,08	2,33	2,00	4,26
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	-7,50	-13,67	-13,67	-15,58	-26,41	-23,83	-30,12
Var. SMALL CAP p.p.							
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	-1,87	3,69	3,69	10,23	28,64	71,37	50,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 (Moeda Original) p.p.	0,63	1,62	1,62	2,52	5,33	18,19	27,45
CARAGUATATUBA	0,61	2,12	2,12	4,48	9,85	24,08	28,79
Var. IPCA + 4,99% p.p.	-0,32	-0,61	-0,61	-0,41	-0,26	3,17	-5,52
CDI	0,93	2,67	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85
IBOVESPA	-4,28	-8,75	-8,75	-2,92	-10,36	9,61	14,75
INPC + 6,00%	0,97	2,91	2,91	5,12	11,08	22,02	36,99
IPCA + 6,00%	1,01	2,97	2,97	5,39	11,15	23,17	38,09

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 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 FIA MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FIC FIA SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
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 INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
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 FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		1,72
FIDC ITALIA SENIOR	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	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	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
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
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA	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	0,70	2,13	2,13	4,74	9,46	23,96	38,86	42,92	48,41
IRF-M 1+	-2,96	-4,20	-4,20	-2,02	-1,81	16,38	25,01	18,77	28,81
IRF-M TOTAL	-1,66	-1,97	-1,97	0,34	1,86	18,67	29,15	26,57	35,05
IMA-B 5	-0,28	0,82	0,82	2,75	6,16	19,03	30,68	36,64	47,63
IMA-B 5+	-4,37	-6,17	-6,17	-3,78	-8,63	8,98	12,58	5,20	10,99
IMA-B TOTAL	-2,62	-3,23	-3,23	-1,36	-2,44	13,22	20,43	18,91	26,53
IMA-GERAL TOTAL	-0,59	0,10	0,10	2,61	5,10	20,65	32,31	33,58	40,70
IDKA 2	-0,24	0,79	0,79	2,55	5,84	18,67	29,76	36,21	47,96
IDKA 20	-8,35	-12,95	-12,95	-10,03	-20,91	0,55	-1,38	-15,68	-13,82
CDI	0,93	2,67	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85	47,04	51,11

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,28	-8,75	-8,75	-2,92	-10,36	9,61	14,75	1,06	4,01
IBRX 100	-4,38	-8,59	-8,59	-2,71	-9,71	9,50	13,89	1,17	4,71
IBRX 50	-4,02	-7,92	-7,92	-2,14	-8,13	10,30	16,61	4,32	8,10
SMALL CAP									
Índice Consumo - ICON	-7,28	-12,77	-12,77	-9,92	-22,56	-17,15	-38,16	-54,30	-53,93
Índice Dividendos - IDIV	-4,89	-6,59	-6,59	0,81	-2,62	23,51	39,14	30,22	28,91

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	-0,26	16,01	16,01	19,99	57,72	81,80	36,93	86,59	179,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,67	-5,74	-5,74	-6,90	-5,89	8,69	11,11	8,58	-2,54

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,22	12,27	12,27	16,86	48,02	64,93	23,68	55,12	128,67

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,52	1,48	1,48	2,29	4,83	9,68	16,02	27,69	33,46
INPC	0,48	1,43	1,43	2,04	4,77	8,65	15,10	26,79	33,70
IGPM	0,94	3,80	3,80	5,38	6,54	3,15	8,77	28,11	57,76
SELIC	0,93	2,67	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85	47,04	51,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,85	2,48	2,48	4,36	9,04	18,59	30,45	49,29	62,25
IPCA + 5,00%	0,93	2,72	2,72	4,88	10,09	20,87	34,23	55,09	70,17
IPCA + 5,50%	0,97	2,84	2,84	5,13	10,62	22,02	36,15	58,05	74,24
IPCA + 5,89%	1,00	2,94	2,94	5,33	11,03	22,92	37,66	60,40	77,48
IPCA + 6,00%	1,01	2,97	2,97	5,39	11,15	23,17	38,09	61,06	78,40
INPC + 4,00%	0,81	2,43	2,43	4,10	8,98	17,48	29,41	48,24	62,54
INPC + 6,00%	0,97	2,91	2,91	5,12	11,08	22,02	36,99	59,92	78,71

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%)	21.443.782,47	5,940000	21.531.613,57	4,747700	87.831,10
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.950.584,57	5,980000	10.996.756,43	4,747700	46.171,86
NTN-B 150525 (6,080000%)	20.390.049,30	6,080000	20.483.457,46	4,747700	93.408,16
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.422.317,14	6,090000	5.208.615,83	8,035900	-213.701,31
NTN-B 150527 (6,220000%)	10.097.476,87	6,220000	9.725.860,02	8,035900	-371.616,85
NTN-B 150527 (7,301500%)	20.195.291,86	7,301500	19.892.840,60	8,035900	-302.451,26
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.860.092,85	5,560000	15.347.246,75	7,652000	-2.512.846,10
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.918.534,42	5,821000	18.326.186,69	7,652000	-2.592.347,73
NTN-B 150545 (5,710000%)	34.207.999,63	5,710000	28.417.222,35	7,401600	-5.790.777,28
NTN-B 150545 (5,760000%)	11.375.679,05	5,760000	9.504.164,21	7,401600	-1.871.514,84
NTN-B 150545 (5,781000%)	11.357.560,01	5,781000	9.511.785,84	7,401600	-1.845.774,17
NTN-B 150555 (5,815000%)	11.343.179,88	5,815000	9.207.090,21	7,441800	-2.136.089,67
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.968.711,20	5,850000	8.948.256,35	7,441800	-2.020.454,85
NTN-B 150826 (6,350000%)	16.335.978,70	6,350000	15.953.101,19	8,009900	-382.877,51
NTN-B 150826 (6,400000%)	20.806.042,87	6,400000	20.332.469,31	8,009900	-473.573,56
NTN-B 150826 (6,703000%)	20.675.779,52	6,703000	20.293.251,09	8,009900	-382.528,43
NTN-B 150828 (6,221000%)	20.611.909,66	6,221000	19.470.350,24	8,118800	-1.141.559,42
NTN-B 150828 (6,350000%)	16.333.036,04	6,350000	15.490.363,01	8,118800	-842.673,03
NTN-B 150828 (7,030000%)	10.190.720,54	7,030000	9.863.629,74	8,118800	-327.090,80
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.631.318,13	5,708000	10.628.071,23	7,752600	-1.003.246,90
NTN-B 150832 (6,070000%)	41.742.098,98	6,070000	37.988.183,60	7,739100	-3.753.915,38
NTN-B 150840 (5,650000%)	991.190,12	5,650000	847.846,81	7,314700	-143.343,31
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.674.301,93	5,770000	10.102.512,71	7,314700	-1.571.789,22
NTN-B 150840 (6,186000%)	15.519.707,36	6,186000	13.975.540,63	7,314700	-1.544.166,73
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.740.367,36	5,713000	9.530.235,65	7,461500	-2.210.131,71
NTN-B 150850 (5,780000%)	11.349.714,52	5,780000	9.291.411,13	7,461500	-2.058.303,39
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.664.039,52	5,815000	9.590.889,49	7,461500	-2.073.150,03
NTN-B 150850 (5,916000%)	4.188.140,61	5,916000	3.487.596,18	7,461500	-700.544,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (5,920000%)	11.217.632,53	5,920000	9.348.274,11	7,461500	-1.869.358,42
NTN-B 150850 (5,970000%)	21.492.590,82	5,970000	18.021.774,17	7,461500	-3.470.816,65
NTN-B 150850 (6,296000%)	36.229.281,50	6,296000	31.615.817,54	7,461500	-4.613.463,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
235	02/10/2024	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	400,00	0,00	8,50520000	47,0300550000
236	07/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	242.070,96	0,00	72.935,73347100	3,3189624410
237	10/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	63.000,00	11.617,42388100	5,4228890000
238	16/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	64.005,39	0,00	11.785,10094600	5,4310430000
239	18/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	2.637,79024200	3,3303557880
240	18/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.222.858,75	0,00	592.958,17962100	5,4352210000
241	18/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	837.446,62	0,00	154.077,74955200	5,4352210000
242	18/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.515,95641200	3,3303557880
243	18/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	14.028,96656500	3,3303557880
244	22/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.123.098,15	0,00	206.471,03269600	5,4394950000
245	22/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.402,50	0,00	625,51762600	5,4394950000
246	23/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	393.636,11	0,00	72.336,34897000	5,4417470000
249	25/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	313.363,07	57.538,63694000	5,4461330000
247	25/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	38.262,79	0,00	7.025,68042300	5,4461330000
248	25/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.374.058,56	803.149,41946800	5,4461330000
250	29/10/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.303,19	0,00	0,48943438	4,705,8198210000
251	30/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	104.788,95	0,00	19.217,87649000	5,4526810000
252	01/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	5.942,68	1.089,01111800	5,4569500000
253	01/11/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	9.998.219,72	4.985.270,75173500	2,0055520000
254	04/11/2024	NTN-B 150828 (7,030000%)	9.998.219,71	0,00	2.342,00000000	4,269,0946669513
255	08/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	121.000,00	22.127,29214800	5,4683600000
256	08/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.530,89	0,00	279,95413600	5,4683600000
257	08/11/2024	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	400,00	0,00	8,42558000	47,4744800000
258	08/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	241.257,11	0,00	71.998,88154000	3,3508452470
259	13/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.073,83	743,98989300	5,4756510000
260	13/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	818,20	0,00	149,42515500	5,4756510000
261	13/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	62.303,31	0,00	11.378,24707900	5,4756510000
262	13/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	2.618,30446300	3,3551407490

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
263	18/11/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	5.329.918,12	0,00	2.505.672,22389100	2,1271410000
264	18/11/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	114.815,85	0,00	24,26626000	4.731,5020780000
265	18/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	13.913,05100900	3,3581024010
266	19/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	837.446,62	0,00	152.742,43867600	5,4827370000
267	19/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.751.633,87	0,00	866.653,62026300	5,4827370000
268	21/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	78.000,00	14.220,41733700	5,4850710000
269	21/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.492,98432700	3,3610439930
270	27/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	104.788,95	0,00	19.072,21195100	5,4943260000
271	28/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	245.445,81	44.654,55438600	5,4965460000
272	28/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.521.866,52	822.674,18834700	5,4965460000
273	28/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	38.262,79	0,00	6.961,24256900	5,4965460000
274	29/11/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.303,19	0,00	0,48516000	4.747,2863540000
275	03/12/2024	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	400,00	0,00	8,38555000	47,7011420000
276	03/12/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	20.000.135,18	9.362.294,07476800	2,1362430000
277	04/12/2024	NTN-B 150527 (7,301500%)	20.000.135,18	0,00	4.690,00000000	4.264,4211471215
278	06/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.455.268,33	0,00	430.988,33897400	3,3765840010
279	06/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.903,50	0,00	8.856,13981200	3,3765840010
280	06/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	62.451,85	0,00	11.332,86515100	5,5106850000
281	09/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.530,89	0,00	277,68698200	5,5130060000
282	09/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	64.000,00	11.608,91171400	5,5130060000
283	18/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	60.674,64	0,00	10.972,44764500	5,5297270000
284	18/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	131.950,63	0,00	23.862,05141700	5,5297270000
285	19/12/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.303,19	0,00	0,48231183	4.775,3131490000
286	19/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.295.436,35	776.561,60257900	5,5313530000
287	19/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	38.262,79	0,00	6.917,43774000	5,5313530000
288	19/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	347.997,59	62.913,64568900	5,5313530000
289	20/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.810.769,35	0,00	869.606,36088500	5,5321230000
290	20/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	837.446,62	0,00	151.378,88655000	5,5321230000
291	23/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	62.451,78	0,00	11.286,44450800	5,5333440000
292	23/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	104.788,95	0,00	18.937,72554100	5,5333440000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
293	26/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.561.928,39	823.781,24970900	5,5377910000
294	26/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	38.262,79	0,00	6.909,39582200	5,5377910000
295	26/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	232.592,52	42.000,95609000	5,5377910000
296	27/12/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.303,19	0,00	0,48139724	4.784,3855150000
Total			55.282.646,22	49.227.060,22		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.768.306,99

Value-At-Risk: 0,34%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,20	0,06		0,01	0,04	0,94	759.710.143,62	94,24
Artigo 8º	19,26	7,01		0,30	-0,32	-5,22	35.948.366,35	4,46
Artigo 10º	13,84	5,15		0,03	-0,20	-1,87	10.460.656,46	1,30
CARAGUATATUBA		0,34		0,34			806.119.166,43	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,06%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,940000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,37	1,01	21.443.782,47	2,66
NTN-B 150525 (5,980000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,38	1,01	10.950.584,57	1,36
NTN-B 150525 (6,080000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,43	1,02	20.390.049,30	2,53
NTN-B 150826 (6,350000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,53	1,04	16.335.978,70	2,03
NTN-B 150826 (6,400000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,55	1,04	20.806.042,87	2,58
NTN-B 150826 (6,703000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,66	1,07	20.675.779,52	2,56
NTN-B 150527 (6,090000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,43	1,02	5.422.317,14	0,67
NTN-B 150527 (6,220000%)	0,21	0,09	0,00	0,10	0,48	1,03	10.097.476,87	1,25
NTN-B 150527 (7,301500%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,89	1,11	20.195.291,86	2,51
NTN-B 150828 (6,221000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,48	1,03	20.611.909,66	2,56
NTN-B 150828 (6,350000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,53	1,04	16.333.036,04	2,03
NTN-B 150828 (7,030000%)	0,22	0,08	0,00	0,10	0,75	1,09	10.190.720,54	1,26
NTN-B 150830 (5,708000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,28	0,99	11.631.318,13	1,44
NTN-B 150832 (6,070000%)	0,22	0,09	0,00	0,10	0,39	1,02	41.742.098,98	5,18
NTN-B 150535 (5,560000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,23	0,98	17.860.092,85	2,22
NTN-B 150535 (5,821000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,33	1,00	20.918.534,42	2,59
NTN-B 150840 (5,650000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,26	0,98	991.190,12	0,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,770000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,31	0,99	11.674.301,93	1,45
NTN-B 150840 (6,186000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,47	1,03	15.519.707,36	1,93
NTN-B 150545 (5,710000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,28	0,99	34.207.999,63	4,24
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,30	0,99	11.375.679,05	1,41
NTN-B 150545 (5,781000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,31	0,99	11.357.560,01	1,41
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,29	0,99	11.740.367,36	1,46
NTN-B 150850 (5,780000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,31	0,99	11.349.714,52	1,41
NTN-B 150850 (5,815000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,32	1,00	11.664.039,52	1,45
NTN-B 150850 (5,916000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,36	1,00	4.188.140,61	0,52
NTN-B 150850 (5,920000%)	0,23	0,12	0,00	0,12	0,33	1,00	11.217.632,53	1,39
NTN-B 150850 (5,970000%)	0,22	0,09	0,00	0,10	0,37	1,01	21.492.590,82	2,67
NTN-B 150850 (6,296000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,51	1,03	36.229.281,50	4,49
NTN-B 150555 (5,815000%)	0,21	0,08	0,00	0,10	0,32	1,00	11.343.179,88	1,41
NTN-B 150555 (5,850000%)	0,24	0,13	0,00	0,13	0,30	1,00	10.968.711,20	1,36
Sub-total	0,21	0,08	0,00		0,43	1,02	500.925.109,96	62,14

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	1,62	0,45	0,00	0,47	-0,47	0,17	10.909.147,21	1,35
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,05	0,02	-0,00	0,02	-0,81	0,89	25.236.885,09	3,13
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,48	0,62	0,00	0,62	-0,29	0,20	1.244.935,77	0,15
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	7,90	2,38	0,00	0,22	-0,41	-2,29	561.044,20	0,07
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,45	0,22	-0,00	0,33	-0,62	0,65	525.742,07	0,07
SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	3,03	0,98	0,00	0,98	-0,43	-0,38	58.057,88	0,01
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RF REF DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,08	0,04	-0,00	0,04	-0,76	0,87	12.092.843,94	1,50
Sub-total	0,48	0,13	0,01		-0,54	0,67	50.628.656,16	6,28

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB INSTITUCIONAL FI RF	0,24	0,09	0,00	0,11	-1,22	0,64	22.146.077,01	2,75
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,12	0,04	0,00	0,05	-1,14	0,80	53.156.057,69	6,59
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,13	0,04	0,00	0,04	-0,78	0,83	15.126.945,37	1,88
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,13	0,03	0,00	0,04	-0,76	0,83	68.249.667,63	8,47
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,07	0,02	-0,00	0,03	-0,99	0,86	36.828.267,27	4,57
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,10	0,03	-0,00	0,04	-0,94	0,84	11.368.564,47	1,41
Sub-total	0,11	0,03	0,00		-1,13	0,81	206.875.579,44	25,66

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR	1,57	0,05	-0,00	0,05	-0,30	0,45	1.280.798,06	0,16
Sub-total	1,57	0,05	-0,00		-0,30	0,45	1.280.798,06	0,16

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,01%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS	18,08	6,55	0,01	1,76	-0,32	-4,81	1.608.523,25	0,20
BRABESCO FIA MID SMALL CAPS	25,38	9,84	0,05	15,73	-0,33	-7,50	4.236.548,99	0,53
BRABESCO FIC FIA SELECTION	18,34	7,03	0,04	2,29	-0,37	-5,86	4.913.128,69	0,61
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,77	6,07	0,05	1,97	-0,28	-4,11	6.793.963,32	0,84
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	18,86	6,79	0,06	1,31	-0,28	-4,45	7.422.968,46	0,92
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	19,37	7,17	0,03	2,84	-0,31	-5,05	3.739.259,27	0,46
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	19,68	7,60	0,07	2,36	-0,32	-5,39	7.233.974,37	0,90
Sub-total	19,26	7,01	0,30		-0,32	-5,22	35.948.366,35	4,46

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,15%

Artigo 10º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	13,84	5,15	0,03	1,16	-0,20	-1,87	10.460.656,46	1,30
Sub-total	13,84	5,15	0,03		-0,20	-1,87	10.460.656,46	1,30

(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 (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de dezembro de 2024, vale observar que:

- O fundo FIDC ITALIA SENIOR não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.