



**LDB**  
EMPRESAS

**COTIA**  
DEZEMBRO 2023



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.12.2023.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Posição de Ativos e Enquadramento

## RENDA FIXA

64,11%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,030000%)	2,86	0,13	0,80	3,33	43.701.482,62	3,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,685000%)	0,35	0,19	0,91	10,69	43.515.030,97	3,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,080000%)	0,35	0,20	0,94	11,10	9.189.365,21	0,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,255000%)	0,35	0,20	0,96	11,29	42.262.723,15	3,79
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,34</b>	<b>0,18</b>	<b>0,89</b>	<b>10,85</b>	<b>138.668.601,95</b>	<b>12,44</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,36	0,04	0,89	12,88	3.508.927,16	0,31	7.852.193.725,16	0,04
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,52	0,09	2,74	15,95	10.439.889,79	0,94	350.978.358,32	2,97
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,45	0,09	2,74	15,77	109.150.581,21	9,79	5.283.374.941,87	2,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,45	0,10	2,73	15,86	30.027.931,22	2,69	5.157.397.073,53	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,04	0,89	13,02	30.181.533,23	2,71	8.470.280.308,74	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	0,10	1,44	11,96	145.832.202,95	13,08	7.603.591.100,02	1,92
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,99	0,09	1,41	11,72	29.454.086,87	2,64	5.798.399.930,42	0,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,98	0,09	1,40	11,90	74.960.593,17	6,73	5.218.373.540,00	1,44
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,97	0,10	1,44	11,93	12.230.377,36	1,10	5.230.672.087,91	0,23
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,31	0,05	1,61	15,84	6.275.013,54	0,56	2.287.059.745,87	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,08	1,21	13,59	32.174.139,39	2,89	5.290.529.627,75	0,61
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,23</b>	<b>0,09</b>	<b>1,76</b>	<b>12,65</b>	<b>484.235.275,89</b>	<b>43,44</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,04	0,92	13,32	24.633.502,28	2,21	13.988.008.512,08	0,18
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	0,90	12,98	43.317.852,48	3,89	16.475.113.370,57	0,26
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,04	0,04	0,82	11,93	4.904.417,29	0,44	4.049.178.389,19	0,12
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,83	0,05	1,13	12,69	18.824.849,39	1,69	2.357.597.914,23	0,80
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,20</b>	<b>0,04</b>	<b>0,95</b>	<b>13,00</b>	<b>91.680.621,44</b>	<b>8,23</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,49</b>	<b>0,10</b>	<b>1,48</b>	<b>12,41</b>	<b>714.584.499,28</b>	<b>64,11</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL

17,96%

## Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	16,78	-0,00	5,22	18,94	6.926.037,36	0,62	1.502.801.211,89	0,46
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	15,36	-0,00	6,35	21,36	20.867.785,28	1,87	613.943.691,61	3,40
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	14,16	-0,01	5,87	23,08	6.657.934,93	0,60	65.191.265,69	10,21
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	16,80	-0,00	5,84	17,91	12.501.944,57	1,12	570.194.267,19	2,19
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	16,46	-0,01	5,36	19,09	5.514.676,85	0,49	364.763.050,39	1,51
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	17,15	-0,00	5,52	20,23	23.556.861,45	2,11	783.566.811,58	3,01
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,46	-0,01	5,24	15,29	4.305.919,38	0,39	812.542.946,28	0,53
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	17,35	-0,01	5,87	20,61	17.030.296,99	1,53	716.164.953,12	2,38
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	14,51	-0,01	5,91	23,73	18.456.537,96	1,66	1.019.487.668,90	1,81
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,75	-0,01	7,35	11,45	3.931.347,36	0,35	1.403.792.198,31	0,28
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,86	0,00	6,04	16,67	7.938.529,78	0,71	882.454.615,78	0,90
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	12,67	-0,05	5,08	27,53	39.195.117,49	3,52	1.203.790.958,87	3,26
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	16,57	-0,02	5,40	17,14	10.243.560,28	0,92	662.205.543,66	1,55
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	19,60	-0,01	5,35	6,38	6.237.449,02	0,56	161.464.884,10	3,86
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	16,97	-0,01	5,51	15,90	8.307.815,22	0,75	166.220.845,31	5,00
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	18,40	-0,01	6,38	21,63	4.982.251,91	0,45	325.192.008,51	1,53
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	20,76	-0,01	8,11	29,21	3.512.105,55	0,32	73.529.642,38	4,78
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>13,97</b>	<b>-0,02</b>	<b>5,71</b>	<b>20,81</b>	<b>200.166.171,38</b>	<b>17,96</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>13,97</b>	<b>-0,02</b>	<b>5,71</b>	<b>20,81</b>	<b>200.166.171,38</b>	<b>17,96</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,92%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,18	-0,00	2,59	24,92	56.713.964,08	5,09	1.995.875.754,00	2,84
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,81	0,01	2,51	17,35	31.532.982,84	2,83	658.947.271,35	4,79
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>14,32</b>	<b>0,00</b>	<b>2,56</b>	<b>22,05</b>	<b>88.246.946,92</b>	<b>7,92</b>		
Investimentos no Exterior			14,32	0,00	2,56	22,05	88.246.946,92	7,92		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,01%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,12	0,04	5,16	32,77	19.695.625,48	1,77	569.663.099,27	3,46
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,23	0,04	5,19	33,22	78.455.736,44	7,04	1.635.814.462,49	4,80
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	13,19	0,04	5,17	33,07	13.460.215,64	1,21	1.210.908.559,23	1,11
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>13,20</b>	<b>0,04</b>	<b>5,18</b>	<b>33,12</b>	<b>111.611.577,56</b>	<b>10,01</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>13,20</b>	<b>0,04</b>	<b>5,18</b>	<b>33,12</b>	<b>111.611.577,56</b>	<b>10,01</b>		
<b>Total</b>			<b>4,08</b>	<b>0,07</b>	<b>2,67</b>	<b>16,37</b>	<b>1.114.609.195,14</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	138.668.601,95	12,44	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	484.235.275,89	43,44	0,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	91.680.621,44	8,23	0,00	11,50	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>714.584.499,28</b>	<b>64,11</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	200.166.171,38	17,96	0,00	3,50	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>200.166.171,38</b>	<b>17,96</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	88.246.946,92	7,92	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>88.246.946,92</b>	<b>7,92</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	111.611.577,56	10,01	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>111.611.577,56</b>	<b>10,01</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>1.114.609.195,14</b>	<b>100,00</b>					



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,89 99,50	10,85 83,15	2,29 80,85	4,26 69,32	10,85 83,15	1.225.754,59	11.040.232,67
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,76 196,46	12,65 96,94	3,44 121,11	4,74 77,07	12,65 96,94	8.231.164,24	50.391.060,78
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,95 105,79	13,00 99,67	2,88 101,53	6,03 98,01	13,00 99,67	889.753,01	15.321.998,07
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,71 0,32	20,81 -1,47	12,96 -2,16	11,12 -2,52	20,81 -1,47	10.804.248,26	34.481.955,53
Artigo 9º III % do CDI	2,56 285,53	22,05 169,00	7,29 257,02	9,14 148,58	22,05 169,00	2.202.092,43	15.240.610,81
Artigo 10º I % do CDI	5,18 578,30	33,12 253,85	12,98 457,49	10,84 176,31	33,12 253,85	5.500.196,31	27.768.944,57
<b>COTIA (Total)</b>						<b>28.853.208,84</b>	<b>154.244.802,43</b>

## RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150826 (5,030000%)	43.353.866,00	0,00	0,00	0,00	43.701.482,62	347.616,62	1.408.943,38
NTN-B 150830 (5,685000%)	43.123.950,58	0,00	0,00	0,00	43.515.030,97	391.080,39	4.300.778,74
NTN-B 150830 (6,080000%)	9.103.552,88	0,00	0,00	0,00	9.189.365,21	85.812,33	940.376,35
NTN-B 150830 (6,255000%)	41.861.477,90	0,00	0,00	0,00	42.262.723,15	401.245,25	4.390.134,20
	137.442.847,36	0,00	0,00	0,00	138.668.601,95	1.225.754,59	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IDKA2	29.043.245,98	0,00	0,00	0,00	29.454.086,87	410.840,89	3.090.945,38
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	106.023.551,48	218.041,87	0,00	0,00	109.150.581,21	2.908.987,86	7.600.853,39
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	12.056.222,16	0,00	0,00	0,00	12.230.377,36	174.155,20	1.303.849,64
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.478.120,51	0,00	0,00	0,00	3.508.927,16	30.806,65	400.470,67

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	73.924.299,02	0,00	0,00	0,00	74.960.593,17	1.036.294,15	8.347.368,94
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	143.764.110,48	0,00	0,00	0,00	145.832.202,95	2.068.092,47	19.462.142,86
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18.245.712,43	11.206.658,16	0,00	0,00	30.027.931,22	575.560,63	1.857.269,18
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.916.385,70	0,00	0,00	0,00	30.181.533,23	265.147,53	3.477.018,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	31.790.298,57	0,00	0,00	0,00	32.174.139,39	383.840,82	2.556.729,71
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.175.556,84	0,00	0,00	0,00	6.275.013,54	99.456,70	858.032,67
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	10.161.908,45	0,00	0,00	0,00	10.439.889,79	277.981,34	1.436.379,40
	464.579.411,62	11.424.700,03	0,00	0,00	484.235.275,89	8.231.164,24	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	5.229.046,69	6.520,85	-373.100,97	0,00	4.904.417,29	41.950,72	330.431,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	45.809.354,41	1.959.202,87	-4.862.728,49	0,00	43.317.852,48	412.023,69	9.032.286,33
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.407.899,12	0,00	0,00	0,00	24.633.502,28	225.603,16	3.753.413,57
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	18.614.673,95	0,00	0,00	0,00	18.824.849,39	210.175,44	1.918.786,56
	94.060.974,17	1.965.723,72	-5.235.829,46	0,00	91.680.621,44	889.753,01	

## Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4.091.576,97	0,00	0,00	0,00	4.305.919,38	214.342,41	571.086,54
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	37.301.199,41	0,00	0,00	0,00	39.195.117,49	1.893.918,08	8.460.550,87
BB AÇÕES DIVIDENDOS	19.621.273,20	0,00	0,00	0,00	20.867.785,28	1.246.512,08	3.672.489,01
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	22.324.593,53	0,00	0,00	0,00	23.556.861,45	1.232.267,92	3.963.205,60
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	6.582.443,88	0,00	0,00	0,00	6.926.037,36	343.593,48	1.102.749,88
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7.486.520,51	0,00	0,00	0,00	7.938.529,78	452.009,27	1.134.459,24
FIA BRASIL IBX-50	11.811.634,12	0,00	0,00	0,00	12.501.944,57	690.310,45	1.898.821,84
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	16.086.644,42	0,00	0,00	0,00	17.030.296,99	943.652,57	2.909.982,52
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17.426.463,12	0,00	0,00	0,00	18.456.537,96	1.030.074,84	3.540.062,94
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9.718.441,53	0,00	0,00	0,00	10.243.560,28	525.118,75	1.499.180,27

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	3.662.024,37	0,00	0,00	0,00	3.931.347,36	269.322,99	403.827,38
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	5.233.918,00	0,00	0,00	0,00	5.514.676,85	280.758,85	883.804,54
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	5.920.567,49	0,00	0,00	0,00	6.237.449,02	316.881,53	373.807,99
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	7.874.221,17	0,00	0,00	0,00	8.307.815,22	433.594,05	1.139.600,26
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.683.291,09	0,00	0,00	0,00	4.982.251,91	298.960,82	886.016,67
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	6.288.614,53	0,00	0,00	0,00	6.657.934,93	369.320,40	1.248.440,40
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	3.248.495,78	0,00	0,00	0,00	3.512.105,55	263.609,77	793.869,58
	189.361.923,12	0,00	0,00	0,00	200.166.171,38	10.804.248,26	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	55.282.975,64	0,00	0,00	0,00	56.713.964,08	1.430.988,44	10.686.521,94
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	30.761.878,85	0,00	0,00	0,00	31.532.982,84	771.103,99	4.554.088,87
	86.044.854,49	0,00	0,00	0,00	88.246.946,92	2.202.092,43	

## Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	74.584.408,42	0,00	0,00	0,00	78.455.736,44	3.871.328,02	19.562.997,09
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	12.798.372,01	0,00	0,00	0,00	13.460.215,64	661.843,63	3.345.066,68
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	18.728.600,82	0,00	0,00	0,00	19.695.625,48	967.024,66	4.860.880,80
	106.111.381,25	0,00	0,00	0,00	111.611.577,56	5.500.196,31	

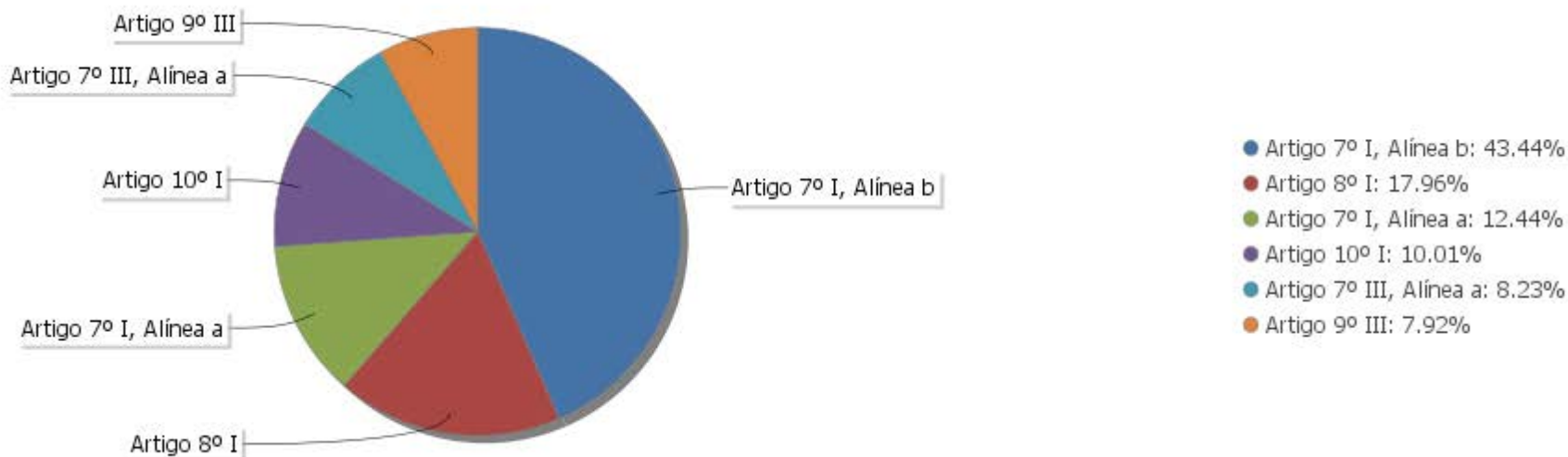
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

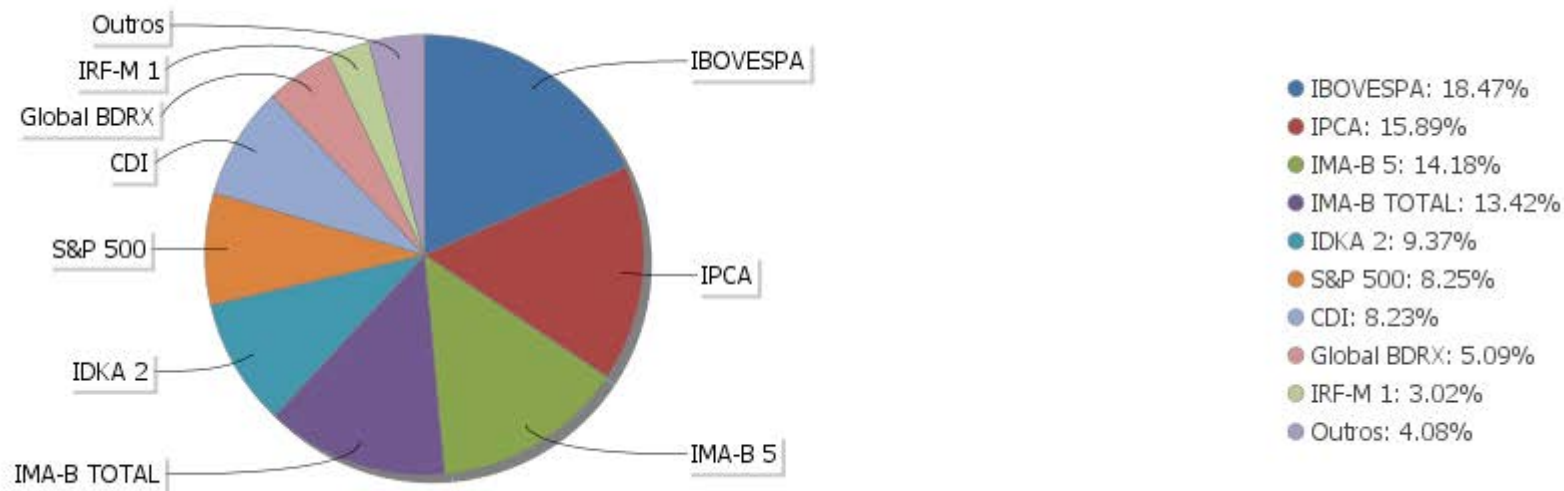
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	898.812.804,67	80,64	898.812.804,67	80,64	
de 31 dias a 365 dias	77.127.788,52	6,92	975.940.593,19	87,56	
acima de 365 dias	138.668.601,95	12,44	1.114.609.195,14	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

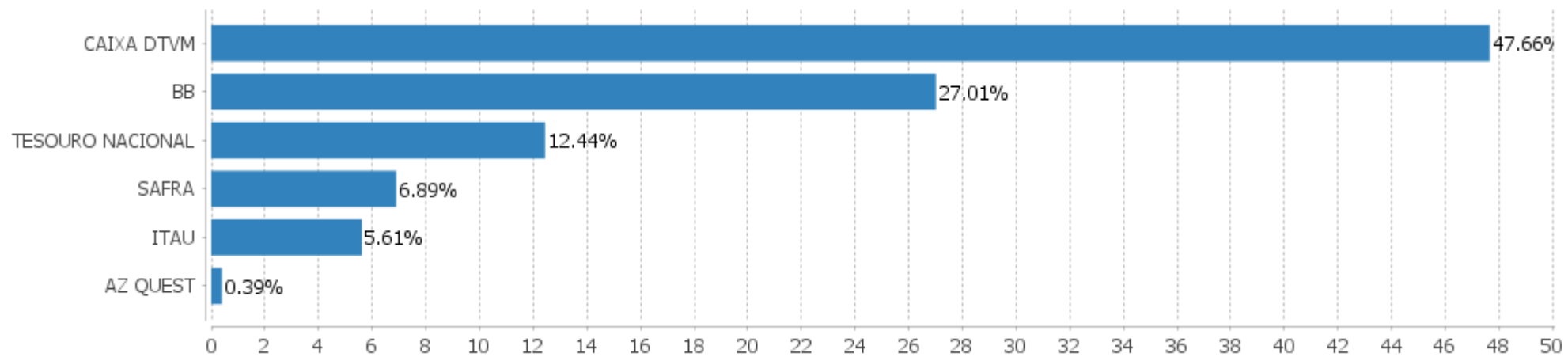


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	2,34	-0,48	1,26	1,17	1,64	2,70	1,67	-0,21	-0,70	-0,86	4,20	2,67	16,37
IPCA + 5,04%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68	0,65	0,65	0,67	0,95	9,83
p.p. indexador	1,38	-1,68	0,10	0,21	0,98	2,37	1,14	-0,89	-1,35	-1,51	3,52	1,72	6,54
2022	-0,60	-0,41	2,55	-2,43	0,69	-2,47	2,48	0,48	-1,13	3,05	0,20	-0,77	1,47
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,07	0,11	0,97	0,79	1,04	10,93
p.p. indexador	-1,54	-1,78	0,50	-3,85	-0,20	-3,54	2,77	0,41	-1,24	2,08	-0,59	-1,81	-9,46
2021	-0,21	-0,66	1,09	1,18	1,16	0,12	-0,23	-0,29	-1,34	-0,40	0,93	1,63	2,96
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
p.p. indexador	-0,88	-1,90	-0,32	0,45	-0,11	-0,86	-1,66	-1,63	-2,95	-2,08	-0,45	0,41	-13,03
2020	0,49	-0,32	-3,56	1,40	1,62	1,41	1,59	-0,08	-0,74	-0,16	2,49	2,57	6,75
IPCA + 5,85%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,85	10,61
p.p. indexador	-0,21	-0,98	-4,13	1,26	1,55	0,68	0,71	-0,80	-1,86	-1,50	1,14	0,72	-3,85
2019	1,23	0,48	0,57	0,84	0,95	1,23	0,79	0,30	1,39	1,36	-0,05	1,42	11,03
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	0,40	-0,41	-0,62	-0,22	0,31	0,78	0,07	-0,32	0,94	0,72	-1,02	-0,23	0,44
2018	0,86	0,51	0,95	0,49	-0,51	0,40	1,00	0,18	0,69	1,76	0,42	0,86	7,85
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	0,06	-0,23	0,37	-0,22	-1,40	-1,35	0,15	-0,27	-0,23	0,80	0,16	0,24	-2,07
2017	1,58	2,23	1,12	0,32	-0,10	0,50	2,52	1,12	1,18	0,19	-0,06	0,55	11,68
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,68	1,48	0,33	-0,23	-0,92	0,24	1,79	0,39	0,55	-0,72	-0,80	-0,35	2,64

## Performance Sobre a Meta Atuarial

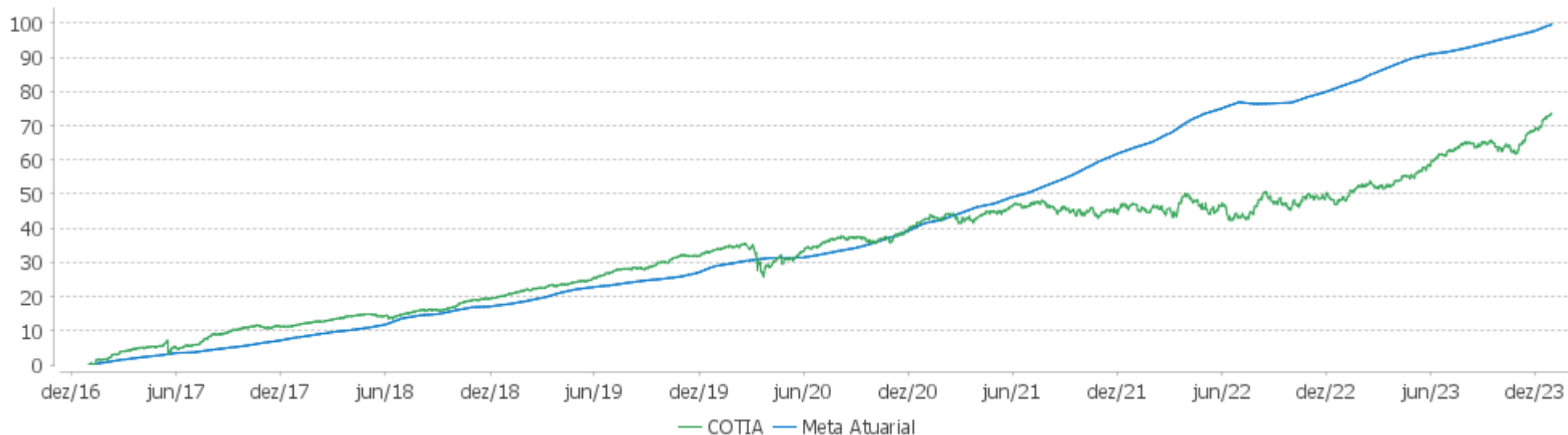
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	39	46,43
Meses abaixo - Meta Atuarial	45	53,57
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	2020-03

## Relatório

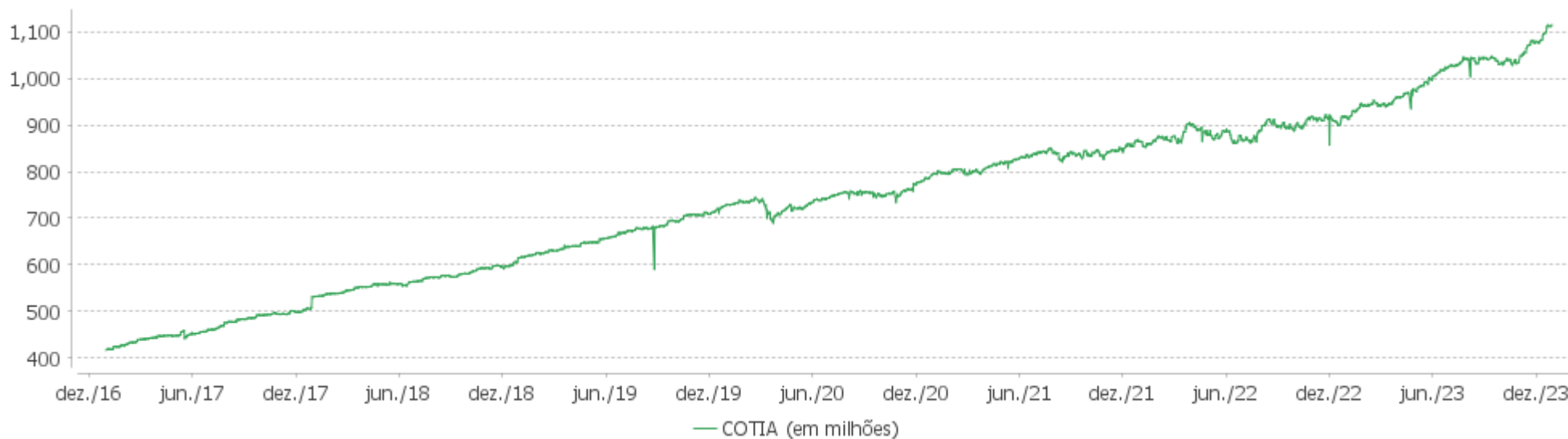
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	6,05	2,29	3,76	4,61
06 meses	6,86	4,21	2,64	4,20
12 meses	16,37	9,83	6,54	4,08
24 meses	18,08	21,83	-3,75	5,63
36 meses	21,57	41,31	-19,74	5,37
48 meses	29,78	56,30	-26,52	5,59
60 meses	44,10	72,85	-28,75	5,05
Desde 30/12/2016	73,57	107,19	-33,62	4,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



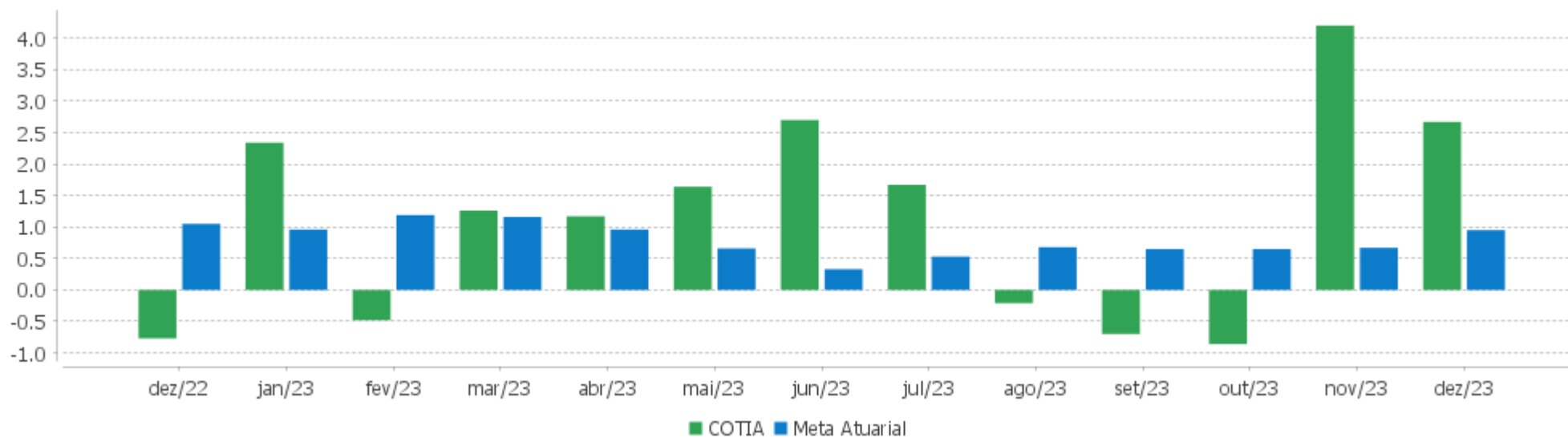
Patrimônio Líquido





EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150830 (6,255000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,40	11,29 6,67	2,45 1,37	4,54 2,84	11,29 6,67	17,88 7,21	
NTN-B 150830 (5,685000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,35	10,69 6,07	2,31 1,23	4,25 2,55	10,69 6,07	16,86 6,19	
NTN-B 150826 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,24	6,88 2,26	2,10 1,02	3,87 2,17	6,88 2,26		
NTN-B 150830 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,38	11,10 6,48	2,41 1,33	4,45 2,75	11,10 6,48	21,06 10,38	33,68 11,88
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,73 -0,02	15,86 -0,20	4,71 -0,05	4,15 -0,06	15,86 -0,20	23,03 -0,41	21,15 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 -0,02	11,96 -0,16	2,92 -0,05	4,64 -0,11	11,96 -0,16	22,79 -0,30	28,09 -0,63
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,41 -0,04	11,72 -0,40	2,88 -0,01	4,84 -0,16	11,72 -0,40	22,14 -0,46	27,81 -0,89
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,21 0,65	13,59 8,97	2,92 1,84	4,92 3,22	13,59 8,97	25,74 15,07	25,60 3,79
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,89 -0,03	12,88 -0,36	2,80 -0,09	6,00 -0,16	12,88 -0,36	26,12 -0,73	29,46 -1,12
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,40 -0,05	11,90 -0,23	2,86 -0,04	4,97 -0,03	11,90 -0,23	22,02 -0,59	27,70 -0,99
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 -0,02	11,93 -0,19	2,92 -0,05	4,62 -0,13	11,93 -0,19	22,58 -0,51	27,81 -0,90
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,74 -0,01	15,77 -0,28	4,71 -0,04	4,04 -0,17	15,77 -0,28	22,83 -0,62	20,97 -0,92
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,89 -0,03	13,02 -0,23	2,83 -0,07	6,04 -0,12	13,02 -0,23	26,29 -0,57	29,70 -0,87
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,74 -0,02	15,95 -0,10	4,77 0,01	3,85 -0,36	15,95 -0,10	22,54 -0,91	16,20 -5,69
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	1,61 1,05	15,84 11,22	4,04 2,95	5,04 3,34	15,84 11,22	24,91 14,24	30,57 8,76
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,90 100,65	12,98 99,47	2,83 99,76	6,15 99,95	12,98 99,47	27,20 100,61	33,08 101,42
BB PREV RF FLUXO FIC	0,82	11,93	2,58	5,62	11,93	24,53	28,60

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	91,56	91,44	90,82	91,31	91,44	90,75	87,69
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,92	13,32	2,94	6,48	13,32	27,68	33,54
% do CDI	103,12	102,09	103,46	105,39	102,09	102,38	102,84
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1,13	12,69	3,08	5,22	12,69	26,00	33,56
% do CDI	125,97	97,24	108,48	84,81	97,24	96,16	102,88
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	5,51	15,90	11,62	7,87	15,90	12,02	-11,48
Var. IBOVESPA p.p.	0,12	-6,38	-3,50	-5,77	-6,38	-16,00	-24,22
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	5,87	20,61	14,33	12,30	20,61	26,38	7,15
Var. IBOVESPA p.p.	0,48	-1,67	-0,78	-1,33	-1,67	-1,64	-5,60
FIA BRASIL IBX-50	5,84	17,91	13,70	11,79	17,91	20,64	7,02
Var. IBOVESPA p.p.	0,46	-4,37	-1,41	-1,84	-4,37	-7,37	-5,72
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	5,22	18,94	13,89	13,09	18,94	18,04	10,64
Var. IBOVESPA p.p.	-0,16	-3,34	-1,22	-0,54	-3,34	-9,97	-2,10
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	7,35	11,45	16,32	13,22	11,45	17,20	7,23
Var. IBOVESPA p.p.	1,97	-10,83	1,20	-0,41	-10,83	-10,81	-5,51
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	5,91	23,73	12,66	12,37	23,73	34,24	20,15
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,99	-3,11	-1,95	-3,68	-3,11	-8,64	-13,58
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	6,04	16,67	14,36	12,12	16,67	12,62	7,26
Var. IBOVESPA p.p.	0,65	-5,61	-0,75	-1,51	-5,61	-15,39	-5,48
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	6,38	21,63	12,86	11,13	21,63	12,31	-13,34
Var. IBOVESPA p.p.	1,00	-0,65	-2,25	-2,50	-0,65	-15,70	-26,08
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	5,08	27,53	12,14	9,59	27,53	10,54	44,03
Var. IBOVESPA p.p.	-0,31	5,25	-2,98	-4,04	5,25	-17,48	31,28
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	5,24	15,29	8,91	5,20	15,29	5,27	-4,90
Var. IBOVESPA p.p.	-0,14	-6,99	-6,21	-8,43	-6,99	-22,74	-17,65
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	5,87	23,08	15,17	17,12	23,08	34,10	16,79
Var. IBOVESPA p.p.	0,49	0,80	0,06	3,49	0,80	6,09	4,04
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	5,35	6,38	8,99	3,06	6,38	-2,24	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,03	-15,91	-6,13	-10,57	-15,91	-30,25	
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	5,36	19,09	13,13	11,03	19,09	24,69	3,94
Var. IBOVESPA p.p.	-0,02	-3,20	-1,99	-2,60	-3,20	-3,32	-8,80
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	8,11	29,21	13,44	10,46	29,21	14,07	-0,83
Var. SMALL CAP p.p.	1,07	12,09	1,96	7,06	12,09	14,59	15,80
BB AÇÕES DIVIDENDOS	6,35	21,36	13,60	13,12	21,36	29,41	9,46
Var. IBOVESPA p.p.	0,97	-0,92	-1,51	-0,51	-0,92	1,39	-3,29
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	5,52	20,23	14,07	12,88	20,23	23,14	8,94

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IGCT p.p.	-0,16	-2,01	-0,43	-0,82	-2,01	-3,41	-3,93
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	5,40 0,02	17,14 -5,14	10,44 -4,68	8,41 -5,22	17,14 -5,14	15,05 -12,97	-2,75 -15,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,59 -0,25	24,92 -1,41	7,65 -0,12	9,07 -0,65	24,92 -1,41	-10,73 -1,62	16,51 -4,97
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	2,51 -2,88	17,40 -4,88	6,67 -8,45	9,25 -4,38	17,40 -4,88	-18,28 -46,29	9,44 -3,31
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	5,19 2,76	33,22 17,95	12,99 5,45	10,86 3,19	33,22 17,95	17,27 30,45	55,76 37,46
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	5,16 -0,22	32,77 10,49	12,96 -2,15	10,79 -2,84	32,77 10,49	16,94 -11,07	54,49 41,75
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	5,17 2,74	33,07 17,80	12,98 5,44	10,83 3,16	33,07 17,80	17,21 30,39	55,58 37,28
COTIA Var. IPCA + 5,04% p.p.	2,67 1,72	16,37 6,54	6,05 3,76	6,86 2,64	16,37 6,54	18,08 -3,93	21,57 -19,46
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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 TÍTULOS PÚBLICOS RF	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 BRASIL IBX-50	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI 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
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	1,90
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	D+1 du	D+0	D+22 du	D+24 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 10% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA B3.	0,80
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE	0,50

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	Método Passivo.	0,00
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,30
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du		1,00
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		3,50
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Além da taxa de administração, será devida, pelo FUNDO à GESTORA, uma taxa de performance no valor equivalente a 20% (vinte por cento) aplicável sobre a valorização diária da cota do FUNDO que exceder a 100% (cem por cento) da variação diária do IBOVSPA no mesmo período.	2,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

## Renda Fixa

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

## Renda Variável

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



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Investimentos Estruturados

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

## Investimentos Imobiliários

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

## Investimentos no Exterior

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

## Indicadores Econômicos

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

## Meta Atuarial

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150826 (5,030000%)	43.701.482,62	5,030000	43.530.679,03	5,200000	-170.803,59
NTN-B 150830 (5,685000%)	43.515.030,97	5,685000	44.573.109,60	5,220000	1.058.078,63
NTN-B 150830 (6,080000%)	9.189.365,21	6,080000	9.605.505,12	5,220000	416.139,91
NTN-B 150830 (6,255000%)	42.262.723,15	6,255000	44.573.109,60	5,220000	2.310.386,45

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
246	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	28.368,17	10.501,38017212	2,7013753940
240	07/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.380,48	21.486,41632538	3,0428750430
247	11/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	26.475,75	9.788,31396248	2,7048325280
236	14/12/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	645.610,74	0,00	146.182,39346592	4,4164740000
248	14/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	96.014,21	35.453,31992940	2,7081867140
256	15/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	6.520,85	0,00	2.406,85574033	2,7092816120
237	19/12/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	150.118,32	0,00	33.800,30756553	4,4413300000
249	19/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.461,66	2.751,95632533	2,7114020420
238	20/12/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	149.639,62	0,00	33.655,40858454	4,4462280000
239	20/12/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.261.289,48	0,00	2.307.863,98718194	4,4462280000
243	20/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.947.140,67	0,00	637.324,59153440	3,0551789400
250	20/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.475,46	6.442,67499537	2,7124540680
251	21/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.400,00	5.306,71358243	2,7135438490
252	22/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.977,13	1.465,09774162	2,7145833940
241	26/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.038.662,33	1.320.173,04691720	3,0591916260
253	26/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	108.787,99	40.058,46214720	2,7157305640
242	27/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	758.685,68	247.892,99369892	3,0605370030
254	27/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	58.787,03	21.638,25368951	2,7168102770
257	27/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.062,20	0,00	3.941,20377835	3,0605370030
245	28/12/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	218.041,87	0,00	27.580,88066676	7,9055441570
255	28/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.353,57	4.177,35888659	2,7178823530
<b>Total</b>			<b>13.390.423,75</b>	<b>5.235.829,46</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 25.319.990,75

Value-At-Risk: 2,27%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
COTIA		2,27		2,27			1.114.609.195,14	100,00

## Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,93%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,030000%)		0,07	0,00	0,08			43.701.482,62	3,92
NTN-B 150830 (5,685000%)		0,08	0,00	0,08			43.515.030,97	3,90
NTN-B 150830 (6,080000%)		0,08	0,00	0,08			9.189.365,21	0,82
NTN-B 150830 (6,255000%)		0,08	0,00	0,08			42.262.723,15	3,79
<b>Sub-total</b>	0,49	0,07	0,00		-0,01	0,89	138.668.601,95	12,44

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,09	0,00	0,01			3.508.927,16	0,31
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		2,29	0,01	0,22			10.439.889,79	0,94
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,21	0,14	0,02			109.150.581,21	9,79
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,20	0,04	0,03			30.027.931,22	2,69
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,09	0,00	0,02			30.181.533,23	2,71
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,24	0,11	0,01			145.832.202,95	13,08
BB PREV RF IDKA2		1,15	0,02	0,16			29.454.086,87	2,64
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,98	0,04	0,31			74.960.593,17	6,73
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,26	0,01	0,02			12.230.377,36	1,10
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,84	0,01	1,84			6.275.013,54	0,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,72	0,01	0,71			32.174.139,39	2,89
<b>Sub-total</b>	1,44	1,35	0,40		0,60	1,76	484.235.275,89	43,44

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	-0,00	0,02			24.633.502,28	2,21
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	-0,00	0,01			43.317.852,48	3,89
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			4.904.417,29	0,44
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,59	0,01	0,60			18.824.849,39	1,69
<b>Sub-total</b>	0,11	0,12	0,00		0,46	0,95	91.680.621,44	8,23

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,48%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		6,78	0,04	0,88			6.926.037,36	0,62
BB AÇÕES DIVIDENDOS		6,59	0,11	1,72			20.867.785,28	1,87
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES		6,53	0,03	2,22			6.657.934,93	0,60
FIA BRASIL IBX-50		6,91	0,07	0,96			12.501.944,57	1,12
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		6,96	0,03	1,08			5.514.676,85	0,49
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		7,18	0,13	0,21			23.556.861,45	2,11
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		9,17	0,03	4,07			4.305.919,38	0,39
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		7,37	0,10	1,22			17.030.296,99	1,53
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,32	0,09	1,41			18.456.537,96	1,66
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC		7,33	0,02	2,89			3.931.347,36	0,35
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,78	0,05	1,15			7.938.529,78	0,71
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		6,38	0,19	6,14			39.195.117,49	3,52
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		7,55	0,06	2,50			10.243.560,28	0,92
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,44	0,04	3,64			6.237.449,02	0,56
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI		8,00	0,05	2,62			8.307.815,22	0,75
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		7,15	0,03	2,04			4.982.251,91	0,45
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA		8,63	0,02	2,89			3.512.105,55	0,32
<b>Sub-total</b>	11,50	6,48	1,08		0,42	5,71	200.166.171,38	17,96

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,36%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		6,34	0,10	5,73			19.695.625,48	1,77
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,36	0,40	5,46			78.455.736,44	7,04
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		6,35	0,07	5,47			13.460.215,64	1,21
<b>Sub-total</b>	<b>8,87</b>	<b>6,36</b>	<b>0,57</b>		<b>0,48</b>	<b>5,18</b>	<b>111.611.577,56</b>	<b>10,01</b>

## Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,98%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,24	0,15	0,59			56.713.964,08	5,09
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		6,00	0,07	9,02			31.532.982,84	2,83
<b>Sub-total</b>	<b>8,87</b>	<b>5,98</b>	<b>0,22</b>		<b>0,19</b>	<b>2,56</b>	<b>88.246.946,92</b>	<b>7,92</b>

(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 (%)