



LDB
EMPRESAS

COTIA
JUNHO 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

RENDA FIXA

63,45%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,030000%)	0,25	0,03	0,78	5,24	44.700.212,41	3,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,685000%)	0,33	0,04	0,83	5,57	44.641.102,99	3,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,080000%)	0,34	0,04	0,86	5,76	9.439.010,34	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,255000%)	0,34	0,04	0,87	5,85	43.434.772,45	3,62
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,30	0,04	0,83	5,56	142.215.098,19	11,87

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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,81	-0,51	-0,99	-1,23	108.421.262,74	9,05	4.649.802.742,18	2,33
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,72	-0,18	0,37	3,20	14.574.729,19	1,22	4.972.766.310,86	0,29
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,35	-0,02	0,61	4,40	47.910.801,35	4,00	8.181.670.586,25	0,59
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,70	-0,22	0,26	3,11	30.371.115,95	2,53	5.571.325.652,69	0,55
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	-0,24	0,20	2,96	63.013.631,28	5,26	4.585.046.250,25	1,37
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,72	-0,18	0,37	3,21	130.300.704,54	10,87	7.303.046.549,52	1,78
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,80	-0,51	-1,00	-1,22	29.660.670,50	2,48	4.133.113.700,82	0,72
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	-0,02	0,61	4,48	40.375.684,09	3,37	7.877.165.450,51	0,51
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	-0,14	0,17	2,36	41.577.438,31	3,47	4.858.229.912,84	0,86
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,70	-0,11	-0,20	1,91	6.394.835,17	0,53	2.052.875.038,41	0,31
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,08	-0,55	-1,23	-2,16	10.214.696,72	0,85	245.113.791,92	4,17
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,08	-0,25	-0,03	1,84	522.815.569,84	43,63		

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				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,04	0,71	4,71	3.309.379,17	0,28	5.048.562.747,13	0,07
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,04	0,79	5,24	17.182.367,64	1,43	17.821.452.916,03	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,04	0,82	5,36	55.029.381,73	4,59	16.508.104.382,05	0,33
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,79	0,01	0,90	5,11	19.786.017,86	1,65	2.177.822.970,57	0,91
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,16	0,03	0,82	5,23	95.307.146,40	7,95		
Renda Fixa			1,40	-0,16	0,24	2,97	760.337.814,43	63,45		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

16,21%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,41	-1,14	0,61	-5,58	4.065.558,47	0,34	732.971.794,55	0,55
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	11,03	0,10	3,95	16,24	45.560.190,19	3,80	1.472.785.019,27	3,09
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	12,79	-0,34	1,59	-6,31	19.552.059,99	1,63	567.596.143,42	3,44
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	13,80	-0,33	1,55	-6,94	21.920.916,50	1,83	649.126.137,40	3,38
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	13,49	-0,32	1,90	-11,11	6.156.820,19	0,51	1.108.199.259,35	0,56
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	13,73	-0,14	1,13	-7,60	7.335.281,74	0,61	715.959.885,20	1,02
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	13,56	-0,19	1,58	-7,39	11.578.387,00	0,97	378.771.354,66	3,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	14,09	-0,38	1,37	-8,82	15.528.557,15	1,30	748.046.356,69	2,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,92	-0,44	1,78	-3,39	17.830.907,50	1,49	1.013.802.736,53	1,76
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	14,18	-0,64	1,00	-9,38	9.282.599,11	0,77	547.635.436,93	1,70
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	12,89	-0,20	1,80	-0,81	3.899.410,64	0,33	1.114.262.445,89	0,35
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,70	-0,54	1,11	-10,19	4.952.821,28	0,41	324.809.945,67	1,52
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	17,33	-0,75	1,03	-15,26	5.285.395,01	0,44	114.389.853,59	4,62
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	14,62	-0,90	0,82	-10,10	7.469.052,44	0,62	115.388.111,59	6,47
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	15,44	-0,84	-0,17	-10,33	4.467.716,52	0,37	253.881.602,83	1,76
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	12,18	-0,43	1,40	-4,52	6.357.267,61	0,53	58.089.233,63	10,94
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	18,79	-1,64	-1,54	-13,58	3.035.170,27	0,25	71.178.581,48	4,26
Sub-total Artigo 8º I			11,64	-0,33	1,92	-2,94	194.278.111,61	16,21		
Renda Variável			11,64	-0,33	1,92	-2,94	194.278.111,61	16,21		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,97%

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	13,96	0,88	12,73	39,52	79.125.306,62	6,60	2.736.870.167,13	2,89
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	12,46	0,57	10,45	28,06	40.382.196,94	3,37	771.250.758,76	5,24
Sub-total Artigo 9º III			13,09	0,77	11,95	35,42	119.507.503,56	9,97		
Investimentos no Exterior			13,09	0,77	11,95	35,42	119.507.503,56	9,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,36%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,06	-0,28	3,90	16,70	85.481.998,39	7,13	1.972.213.735,46	4,33
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	11,05	-0,28	3,96	16,75	15.714.819,24	1,31	1.326.345.413,32	1,18
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	12,71	-0,28	3,84	16,39	22.923.125,63	1,91	808.853.410,21	2,83
Sub-total Artigo 10º I			11,17	-0,28	3,90	16,65	124.119.943,26	10,36		
Investimentos Estruturados			11,17	-0,28	3,90	16,65	124.119.943,26	10,36		
Total			3,71	-0,11	1,94	5,78	1.198.243.372,86	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	142.215.098,19	11,87	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	522.815.569,84	43,63	0,00	30,81	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	95.307.146,40	7,95	0,00	6,98	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	760.337.814,43	63,45					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	194.278.111,61	16,21	0,00	7,21	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	194.278.111,61	16,21					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	119.507.503,56	9,97	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	119.507.503,56	9,97					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	124.119.943,26	10,36	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	124.119.943,26	10,36					15,00
Total		1.198.243.372,86	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,83 104,83	5,56 106,53	2,43 96,24	5,56 106,53	10,06 86,07	1.165.683,63	7.549.805,23
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,03 -4,40	1,84 35,24	0,39 15,53	1,84 35,24	6,67 57,02	-185.179,45	9.128.600,66
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,82 104,42	5,23 100,11	2,63 103,89	5,23 100,11	11,57 98,95	799.170,06	4.893.168,54
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,92 0,44	-2,94 4,72	-2,15 1,12	-2,94 4,72	7,85 2,92	3.656.308,74	-5.888.059,77
Artigo 9º III % do CDI	11,95 1.515,79	35,42 678,46	19,52 771,40	35,42 678,46	47,80 408,82	12.756.190,87	31.260.556,64
Artigo 10º I % do CDI	3,90 494,36	16,65 318,87	5,00 197,49	16,65 318,87	29,30 250,57	4.655.729,00	18.236.365,70
COTIA (Total)						22.847.902,85	65.180.437,00

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%)	44.355.441,37	0,00	0,00	0,00	44.700.212,41	344.771,04	2.242.929,99
NTN-B 150830 (5,685000%)	44.274.991,49	0,00	0,00	0,00	44.641.102,99	366.111,50	2.371.438,21
NTN-B 150830 (6,080000%)	9.358.826,17	0,00	0,00	0,00	9.439.010,34	80.184,17	518.021,54
NTN-B 150830 (6,255000%)	43.060.155,53	0,00	0,00	0,00	43.434.772,45	374.616,92	2.417.415,49
	141.049.414,56	0,00	0,00	0,00	142.215.098,19	1.165.683,63	

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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	109.464.888,61	35.011,14	0,00	0,00	108.421.262,74	-1.078.637,01	-1.344.153,01
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	14.528.607,80	0,00	-8.158,26	0,00	14.574.729,19	54.279,65	445.933,49
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	45.563.536,25	2.068.794,67	0,00	0,00	47.910.801,35	278.470,43	608.173,24
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	30.293.605,57	0,00	0,00	0,00	30.371.115,95	77.510,38	917.029,08

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	62.890.893,76	0,00	0,00	0,00	63.013.631,28	122.737,52	2.082.612,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	129.817.314,90	0,00	0,00	0,00	130.300.704,54	483.389,64	4.468.501,59
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.958.789,28	0,00	0,00	0,00	29.660.670,50	-298.118,78	-367.260,72
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.131.516,31	0,00	0,00	0,00	40.375.684,09	244.167,78	1.491.636,85
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	41.506.688,77	0,00	0,00	0,00	41.577.438,31	70.749,54	931.498,68
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.407.706,97	0,00	0,00	0,00	6.394.835,17	-12.871,80	119.821,63
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	10.341.553,52	0,00	0,00	0,00	10.214.696,72	-126.856,80	-225.193,07
	520.905.101,74	2.103.805,81	-8.158,26	0,00	522.815.569,84	-185.179,45	

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	3.616.298,71	0,00	-332.083,64	0,00	3.309.379,17	25.164,10	194.882,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	25.024.640,34	10.476,06	-8.038.079,06	0,00	17.182.367,64	185.330,30	1.780.969,53
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	49.143.013,77	5.473.326,07	0,00	0,00	55.029.381,73	413.041,89	1.956.148,54
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	19.610.384,09	0,00	0,00	0,00	19.786.017,86	175.633,77	961.168,47
	97.394.336,91	5.483.802,13	-8.370.162,70	0,00	95.307.146,40	799.170,06	

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	4.040.809,61	0,00	0,00	0,00	4.065.558,47	24.748,86	-240.360,91
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	43.831.048,98	0,00	0,00	0,00	45.560.190,19	1.729.141,21	6.365.072,70
BB AÇÕES DIVIDENDOS	19.245.283,07	0,00	0,00	0,00	19.552.059,99	306.776,92	-1.315.725,29
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21.585.374,71	0,00	0,00	0,00	21.920.916,50	335.541,79	-1.635.944,95
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	6.042.269,54	0,00	0,00	0,00	6.156.820,19	114.550,65	-769.217,17
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7.253.151,47	0,00	0,00	0,00	7.335.281,74	82.130,27	-603.248,04
FIA BRASIL IBX-50	11.398.835,26	0,00	0,00	0,00	11.578.387,00	179.551,74	-923.557,57
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	15.318.120,50	0,00	0,00	0,00	15.528.557,15	210.436,65	-1.501.739,84
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17.519.685,35	0,00	0,00	0,00	17.830.907,50	311.222,15	-625.630,46
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9.190.795,38	0,00	0,00	0,00	9.282.599,11	91.803,73	-960.961,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	3.830.474,99	0,00	0,00	0,00	3.899.410,64	68.935,65	-31.936,72
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4.898.566,54	0,00	0,00	0,00	4.952.821,28	54.254,74	-561.855,57
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	5.231.484,53	0,00	0,00	0,00	5.285.395,01	53.910,48	-952.054,01
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	7.408.547,26	0,00	0,00	0,00	7.469.052,44	60.505,18	-838.762,78
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.475.324,30	0,00	0,00	0,00	4.467.716,52	-7.607,78	-514.535,39
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	6.269.533,60	0,00	0,00	0,00	6.357.267,61	87.734,01	-300.667,32
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	3.082.497,78	0,00	0,00	0,00	3.035.170,27	-47.327,51	-476.935,28
	190.621.802,87	0,00	0,00	0,00	194.278.111,61	3.656.308,74	

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	70.188.583,21	0,00	0,00	0,00	79.125.306,62	8.936.723,41	22.411.342,54
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	36.562.729,48	0,00	0,00	0,00	40.382.196,94	3.819.467,46	8.849.214,10
	106.751.312,69	0,00	0,00	0,00	119.507.503,56	12.756.190,87	

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	82.272.999,37	0,00	0,00	0,00	85.481.998,39	3.208.999,02	12.754.261,95
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	15.115.719,65	0,00	0,00	0,00	15.714.819,24	599.099,59	2.254.603,60
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	22.075.495,24	0,00	0,00	0,00	22.923.125,63	847.630,39	3.227.500,15
	119.464.214,26	0,00	0,00	0,00	124.119.943,26	4.655.729,00	

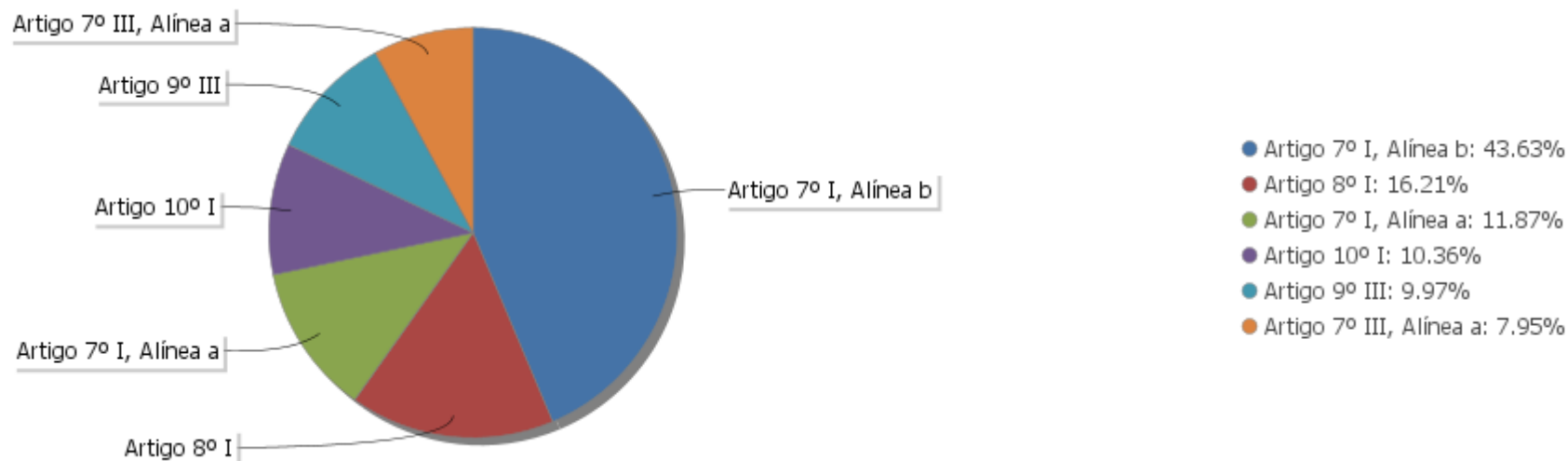
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

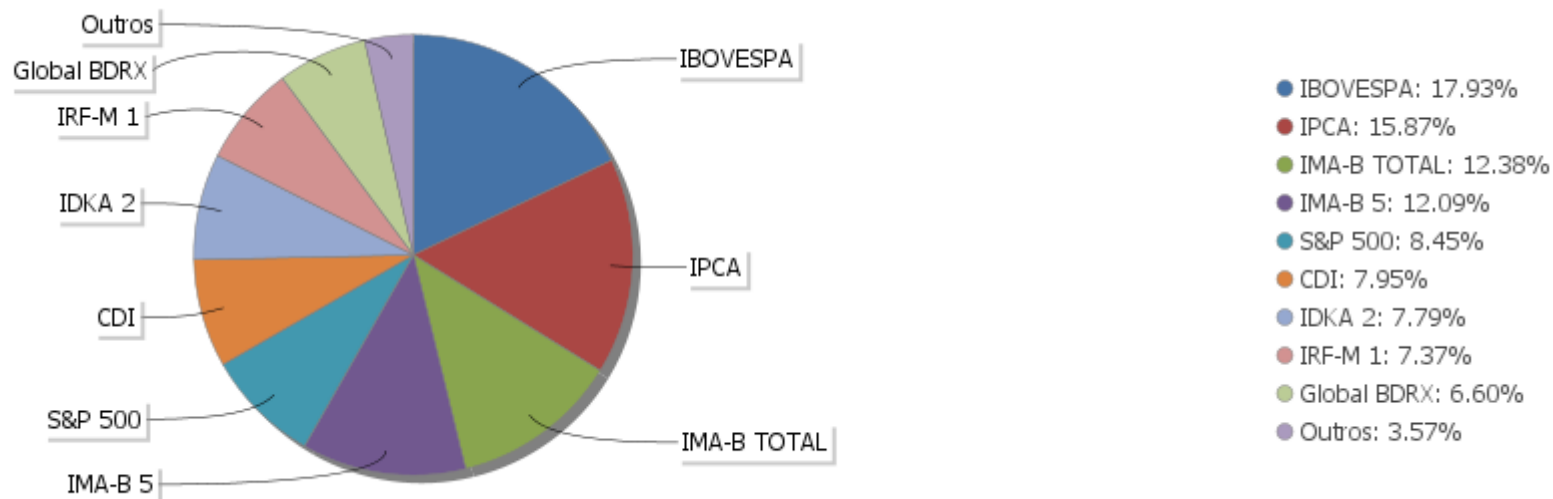
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	984.929.354,56	82,20		984.929.354,56	82,20	
de 31 dias a 365 dias	71.098.920,11	5,93		1.056.028.274,67	88,13	
acima de 365 dias	142.215.098,19	11,87		1.198.243.372,86	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

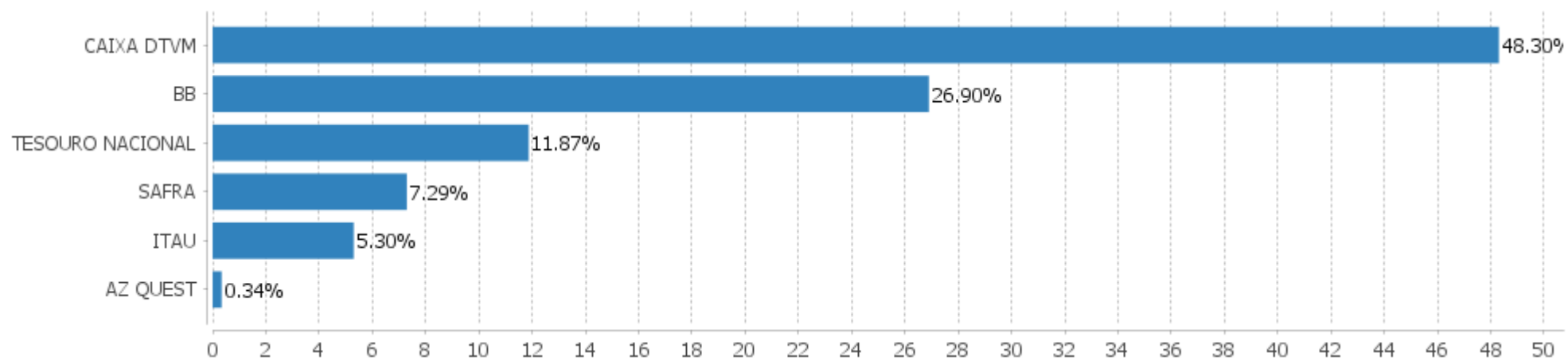


Alocação Por Estratégia



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	0,28	1,78	1,14	-1,00	1,54	1,94							5,78
IPCA + 5,04%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60							4,99
p.p. indexador	-0,57	0,58	0,58	-1,81	0,67	1,34							0,79
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	43	47,78
Meses abaixo - Meta Atuarial	47	52,22
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	2020-03

Relatório

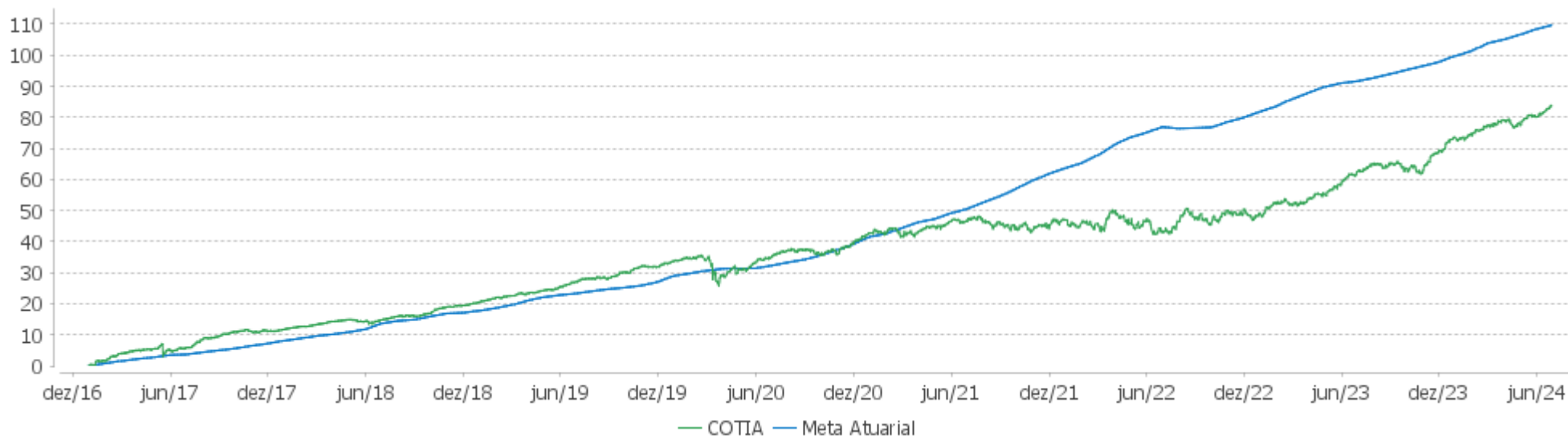
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,48	2,30	0,18	3,11
06 meses	5,78	4,99	0,79	3,15
12 meses	13,03	9,42	3,62	3,71
24 meses	28,42	18,45	9,96	4,55
36 meses	25,23	39,35	-14,12	5,24
48 meses	35,99	59,46	-23,47	4,95
60 meses	44,58	72,55	-27,97	5,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

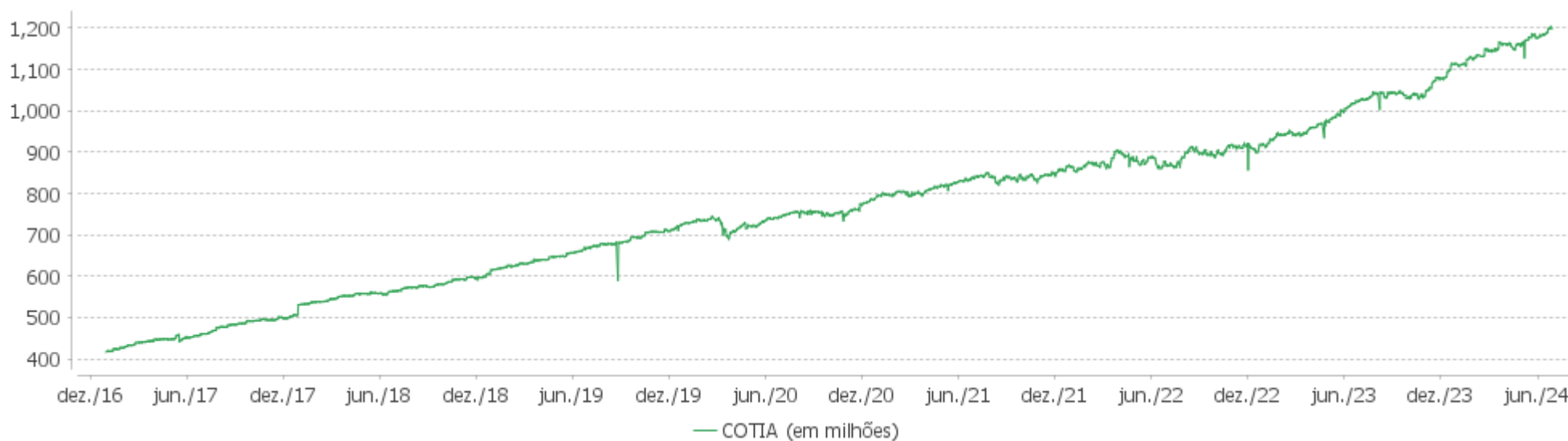
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	83,61	117,54	-33,93	4,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

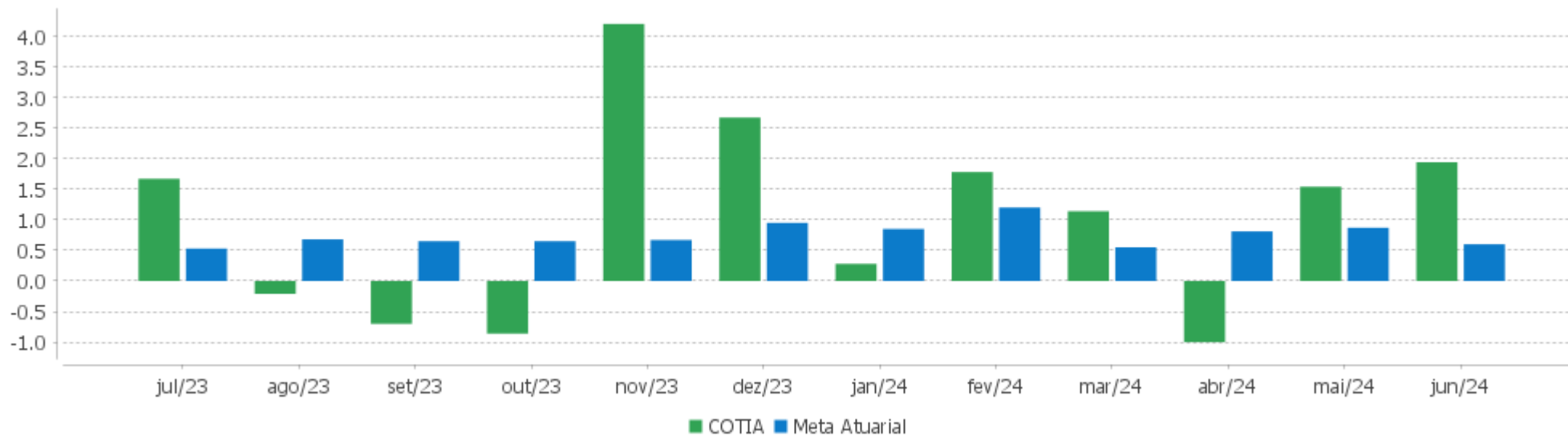


Patrimônio Líquido



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.	0,87 0,66	5,85 3,36	2,57 1,52	5,85 3,36	10,65 6,42	18,15 10,63	
NTN-B 150830 (5,685000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,57 3,08	2,44 1,38	5,57 3,08	10,05 5,83	17,00 9,48	30,58 10,28
NTN-B 150826 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,57	5,24 2,76	2,28 1,22	5,24 2,76	9,32 5,09	12,32 4,80	
NTN-B 150830 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	5,76 3,28	2,53 1,48	5,76 3,28	10,47 6,24	21,29 13,77	35,67 15,37
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,00 -0,03	-1,22 -0,13	-1,35 -0,08	-1,22 -0,13	2,87 -0,19	16,57 -0,43	20,68 -0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,02	3,21 -0,11	1,18 -0,06	3,21 -0,11	8,00 -0,23	18,98 -0,31	30,69 -0,61
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,26 0,08	3,11 -0,10	1,05 0,09	3,11 -0,10	8,11 -0,26	18,30 -0,13	29,95 -0,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,17 -0,04	2,36 -0,12	0,55 -0,50	2,36 -0,12	7,39 3,17	23,06 15,54	27,65 7,35
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,03	4,40 -0,11	1,93 -0,08	4,40 -0,11	10,66 -0,28	25,58 -0,70	34,27 -1,09
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,20 0,02	2,96 -0,25	0,86 -0,09	2,96 -0,25	8,08 -0,29	18,05 -0,38	29,46 -0,94
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,02	3,20 -0,12	1,18 -0,06	3,20 -0,12	7,97 -0,26	18,82 -0,48	30,38 -0,92
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,99 -0,02	-1,23 -0,13	-1,33 -0,06	-1,23 -0,13	2,76 -0,30	16,42 -0,59	20,47 -0,95
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,23 -0,26	-2,16 -1,06	-1,93 -0,66	-2,16 -1,06	1,61 -1,46	15,75 -1,25	16,21 -5,21
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,03	4,48 -0,02	1,97 -0,04	4,48 -0,02	10,79 -0,16	25,84 -0,44	34,58 -0,78
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,20 -0,41	1,91 -0,57	0,31 -0,74	1,91 -0,57	7,05 2,82	20,92 13,39	31,73 11,43
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,79 100,10	5,24 100,37	2,53 99,91	5,24 100,37	11,71 100,14	26,83 100,06	38,23 101,15
BB PREV RF FLUXO FIC	0,71	4,71	2,27	4,71	10,59	24,34	33,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	90,20	90,16	89,82	90,16	90,55	90,76	89,02
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,90	5,11	2,98	5,11	10,59	25,04	38,95
% do CDI	113,61	97,79	117,88	97,79	90,56	93,37	103,05
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82	5,36	2,57	5,36	12,19	27,40	39,10
% do CDI	103,84	102,72	101,69	102,72	104,28	102,16	103,45
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	0,82	-10,10	-7,39	-10,10	-3,02	12,38	-24,80
Var. IBOVESPA p.p.	-0,66	-2,44	-4,12	-2,44	-7,95	-13,36	-22,52
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	1,37	-8,82	-5,44	-8,82	2,40	17,87	-7,48
Var. IBOVESPA p.p.	-0,11	-1,16	-2,16	-1,16	-2,53	-7,87	-5,20
FIA BRASIL IBX-50	1,58	-7,39	-3,39	-7,39	3,54	20,07	-9,63
Var. IBOVESPA p.p.	0,09	0,27	-0,11	0,27	-1,39	-5,67	-7,35
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	1,90	-11,11	-3,95	-11,11	0,53	13,12	-7,05
Var. IBOVESPA p.p.	0,41	-3,45	-0,67	-3,45	-4,40	-12,62	-4,76
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	1,80	-0,81	-2,22	-0,81	12,30	27,30	-5,22
Var. IBOVESPA p.p.	0,32	6,85	1,06	6,85	7,37	1,56	-2,94
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	1,78	-3,39	-1,09	-3,39	8,56	27,99	11,84
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,22	0,02	-1,51	0,02	-3,53	-3,98	-14,72
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	1,13	-7,60	-3,48	-7,60	3,60	13,77	-5,18
Var. IBOVESPA p.p.	-0,35	0,06	-0,20	0,06	-1,33	-11,97	-2,90
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	-0,17	-10,33	-9,53	-10,33	-0,35	17,20	-31,12
Var. IBOVESPA p.p.	-1,65	-2,67	-6,26	-2,67	-5,28	-8,54	-28,84
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	0,61	-5,58	-6,85	-5,58	-0,67	12,90	-20,74
Var. IBOVESPA p.p.	-0,87	2,08	-3,57	2,08	-5,60	-12,84	-18,46
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	1,40	-4,52	0,48	-4,52	11,83	25,30	10,36
Var. IBOVESPA p.p.	-0,08	3,14	3,75	3,14	6,90	-0,44	12,64
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	3,95	16,24	5,15	16,24	27,39	56,34	45,17
Var. IBOVESPA p.p.	2,46	23,90	8,43	23,90	22,46	30,60	47,46
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	-1,54	-13,58	-11,29	-13,58	-4,54	24,19	-26,45
Var. SMALL CAP p.p.	-1,14	1,28	-0,07	1,28	7,42	18,73	9,84
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1,03	-15,26	-10,27	-15,26	-12,67	-9,58	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,45	-7,60	-6,99	-7,60	-17,60	-35,32	
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	1,11	-10,19	-6,16	-10,19	-0,28	18,70	-11,98
Var. IBOVESPA p.p.	-0,37	-2,53	-2,88	-2,53	-5,21	-7,03	-9,70
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	1,55	-6,94	-2,88	-6,94	5,04	22,95	-7,18
Var. IGCT p.p.	0,13	0,01	0,26	0,01	-0,75	-2,79	-2,93
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1,59	-6,31	-2,19	-6,31	5,99	21,37	-1,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,11	1,36	1,09	1,36	1,06	-4,37	0,76
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	1,00 -0,48	-9,38 -1,72	-6,70 -3,42	-9,38 -1,72	-1,76 -6,69	13,42 -12,32	-18,27 -15,99
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	12,73 -0,06	39,52 -1,55	21,34 -0,40	39,52 -1,55	52,18 -2,61	72,57 -4,56	50,01 -5,70
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	10,45 8,97	28,06 35,72	16,10 19,38	28,06 35,72	39,91 34,98	49,16 23,42	26,83 29,11
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	3,90 -5,83	16,70 -14,75	5,01 -10,61	16,70 -14,75	29,37 -12,16	66,02 12,93	56,49 15,29
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	3,84 2,36	16,39 24,05	4,89 8,16	16,39 24,05	28,95 24,02	64,85 39,11	55,29 57,57
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	3,96 -5,77	16,75 -14,70	5,07 -10,56	16,75 -14,70	29,39 -12,14	66,04 12,95	56,41 15,21
COTIA Var. IPCA + 5,04% p.p.	1,94 1,34	5,78 0,79	2,48 0,18	5,78 0,79	13,03 3,62	28,42 9,87	25,23 -14,09
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO ÍNDICE SMALL CAP - SMLL, APURADO PELA B3.	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 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
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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
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	0,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA B3. O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	0,50
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%	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração

(cem por cento) da
variação diária do
IBOVESPA no
mesmo período.

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	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

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

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

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	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 150826 (5,030000%)	44.700.212,41	5,030000	43.448.046,30	6,539400	-1.252.166,11
NTN-B 150830 (5,685000%)	44.641.102,99	5,685000	43.011.426,98	6,460000	-1.629.676,01
NTN-B 150830 (6,080000%)	9.439.010,34	6,080000	9.268.962,51	6,460000	-170.047,83
NTN-B 150830 (6,255000%)	43.434.772,45	6,255000	43.011.426,98	6,460000	-423.345,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
372	07/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.992,03	1.056,53517100	2,8319265470
377	10/06/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	35.011,14	0,00	4.463,08739100	7,8446010420
369	10/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	28.561,20	10.081,99993800	2,8328903170
380	11/06/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	51.858,16	0,00	14.142,91323586	3,6667240430
374	14/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.702.584,87	841.612,57811400	3,2111982880
381	17/06/2024	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	8.158,26	300,91340217	27,1116538550
368	17/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	78.546,64	27.677,67188700	2,8379063210
365	18/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.917,67	4.550,22945100	2,8389051890
364	20/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.649,63	6.212,64743900	2,8409192980
378	21/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.473.326,07	0,00	1.042.281,99694100	5,2512910000
379	21/06/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.013.098,55	0,00	547.225,03507099	3,6787398620
367	21/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.400,00	5.067,01222000	2,8419114410
366	25/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.178,35	414,33898300	2,8439274290
373	27/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	114.102,96	40.093,05103500	2,8459535270
371	27/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.469.841,89	1.387.049,50748600	3,2225539650
375	28/06/2024	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.837,96	0,00	1.042,05139400	3,6830812960
376	28/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	61.735,16	21.684,61966000	2,8469560900
363	28/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	865.652,30	268.526,34043900	3,2237146590
370	28/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.476,06	0,00	3.249,68587736	3,2237146590
Total			7.587.607,94	8.378.320,96		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 18.869.529,11

Value-At-Risk: 1,57%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,54	0,76		0,25	-0,36	0,23	760.337.814,43	63,45
Artigo 8º	8,70	5,02		0,64	0,13	1,92	194.278.111,61	16,21
Artigo 9º	15,92	6,04		0,26	0,70	11,95	119.507.503,56	9,97
Artigo 10º	6,21	4,68		0,42	0,50	3,90	124.119.943,26	10,36
COTIA		1,57		1,57			1.198.243.372,86	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,76%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,030000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	-0,06	0,78	44.700.212,41	3,73
NTN-B 150830 (5,685000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,23	0,83	44.641.102,99	3,73
NTN-B 150830 (6,080000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,40	0,86	9.439.010,34	0,79
NTN-B 150830 (6,255000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,48	0,87	43.434.772,45	3,62
Sub-total	0,17	0,08	0,00		0,22	0,83	142.215.098,19	11,87

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,99	2,16	0,10	0,01	-0,44	-0,99	108.421.262,74	9,05
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,72	0,91	0,01	0,01	-0,24	0,37	14.574.729,19	1,22
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,51	0,24	0,00	0,01	-0,36	0,61	47.910.801,35	4,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,95	0,99	0,01	0,16	-0,27	0,26	30.371.115,95	2,53
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,07	1,10	0,03	0,24	-0,29	0,20	63.013.631,28	5,26
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	0,91	0,05	0,01	-0,24	0,37	130.300.704,54	10,87
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,00	2,15	0,03	0,02	-0,45	-1,00	29.660.670,50	2,48
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,23	0,00	0,02	-0,35	0,61	40.375.684,09	3,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,85	0,72	0,01	0,72	-0,33	0,17	41.577.438,31	3,47
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,46	0,90	0,00	0,90	-0,29	-0,20	6.394.835,17	0,53
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,36	2,43	0,01	0,30	-0,46	-1,23	10.214.696,72	0,85
Sub-total	2,17	1,11	0,25		-0,38	-0,03	522.815.569,84	43,63

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,01	0,01	0,00	0,01	-5,87	0,71	3.309.379,17	0,28
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,04	0,02	0,00	0,02	0,02	0,79	17.182.367,64	1,43
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,81	0,82	55.029.381,73	4,59
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,38	0,27	-0,00	0,27	0,28	0,90	19.786.017,86	1,65
Sub-total	0,08	0,06	-0,00		0,44	0,82	95.307.146,40	7,95

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,02%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	12,41	6,09	0,01	3,25	-0,01	0,61	4.065.558,47	0,34
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	6,93	4,90	0,15	6,97	0,46	3,95	45.560.190,19	3,80
BB AÇÕES DIVIDENDOS	12,01	6,36	0,06	1,99	0,07	1,59	19.552.059,99	1,63
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	12,54	6,07	0,07	0,33	0,06	1,55	21.920.916,50	1,83
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	10,61	5,88	0,02	1,60	0,10	1,90	6.156.820,19	0,51
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	11,30	6,03	0,02	1,12	0,03	1,13	7.335.281,74	0,61
FIA BRASIL IBX-50	11,83	5,94	0,03	0,76	0,07	1,58	11.578.387,00	0,97
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	12,62	6,45	0,05	1,40	0,05	1,37	15.528.557,15	1,30
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,96	5,55	0,05	1,83	0,09	1,78	17.830.907,50	1,49
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	14,11	7,03	0,04	2,72	0,01	1,00	9.282.599,11	0,77
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	10,88	5,37	0,01	3,73	0,09	1,80	3.899.410,64	0,33
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,19	6,21	0,02	1,37	0,02	1,11	4.952.821,28	0,41
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	15,01	7,51	0,02	3,57	0,02	1,03	5.285.395,01	0,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	14,40	6,22	0,03	2,46	0,00	0,82	7.469.052,44	0,62
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	16,37	7,61	0,02	3,04	-0,06	-0,17	4.467.716,52	0,37
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	12,73	6,48	0,02	2,74	0,05	1,40	6.357.267,61	0,53
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	21,83	9,97	0,02	2,39	-0,11	-1,54	3.035.170,27	0,25
Sub-total	8,70	5,02	0,64		0,13	1,92	194.278.111,61	16,21

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,68%

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	0,30	4,84	0,50	3,90	85.481.998,39	7,13
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	6,20	4,86	0,06	4,84	0,51	3,96	15.714.819,24	1,31
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	6,18	5,02	0,07	7,25	0,49	3,84	22.923.125,63	1,91
Sub-total	6,21	4,68	0,42		0,50	3,90	124.119.943,26	10,36

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,04%

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	0,17	0,94	0,69	12,73	79.125.306,62	6,60
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,75	5,62	0,08	9,12	0,70	10,45	40.382.196,94	3,37
Sub-total	15,92	6,04	0,26		0,70	11,95	119.507.503,56	9,97

(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 (%)