



LDB
EMPRESAS

COTIA
ABRIL 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 30.04.2024.

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

64,35%

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%)	0,29	0,03	0,67	3,58	43.995.389,63	3,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,685000%)	0,36	0,04	0,72	3,80	43.892.890,72	3,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,080000%)	0,37	0,04	0,75	3,92	9.275.165,38	0,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,255000%)	0,37	0,04	0,77	3,98	42.669.381,84	3,69
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,33	0,04	0,72	3,79	139.832.827,57	12,09

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	3,91	-0,62	-1,63	-1,53	107.935.751,46	9,33	5.056.024.851,42	2,13
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,75	-0,17	-0,22	1,77	14.380.970,21	1,24	5.149.829.191,06	0,28
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,32	-0,05	0,56	3,01	3.614.378,59	0,31	8.334.507.355,54	0,04
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,69	-0,19	-0,26	1,78	29.978.948,07	2,59	5.742.524.332,62	0,52
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,69	-0,21	-0,36	1,71	76.242.903,39	6,59	4.827.216.534,64	1,58
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,74	-0,17	-0,22	1,78	148.430.180,42	12,84	7.735.992.731,60	1,92
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,89	-0,62	-1,64	-1,51	29.574.318,60	2,56	4.738.343.434,12	0,62
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,31	-0,05	0,58	3,07	39.828.752,38	3,44	8.588.764.215,21	0,46
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,48	-0,06	-0,32	1,47	41.217.006,57	3,56	5.183.551.580,62	0,80
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,64	-0,41	-0,23	1,36	6.360.204,04	0,55	2.247.094.886,70	0,28
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,14	-0,77	-2,02	-2,24	10.205.812,26	0,88	284.861.608,97	3,58
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,06	-0,30	-0,62	0,81	507.769.225,99	43,92		

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	0,80	3,20	3.843.564,17	0,33	4.150.521.759,60	0,09
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,04	0,88	3,55	30.112.147,29	2,60	16.797.040.223,44	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,04	0,89	3,64	43.047.449,67	3,72	15.720.644.238,34	0,27
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,82	0,08	1,19	3,27	19.441.005,52	1,68	2.243.451.902,02	0,87
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,16	0,05	0,94	3,50	96.444.166,65	8,34		
Renda Fixa			1,38	-0,19	-0,16	1,72	744.046.220,21	64,35		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

16,66%

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	16,98	-1,43	-3,99	-2,69	4.190.175,51	0,36	762.804.286,12	0,55
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	11,58	-1,34	-3,69	6,47	41.730.575,59	3,61	1.348.712.805,01	3,09
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	13,36	-0,84	-2,16	-6,28	19.557.693,97	1,69	563.931.238,10	3,47
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	14,78	-1,17	-1,50	-5,62	22.232.320,33	1,92	712.088.894,91	3,12
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	14,58	-1,35	-2,92	-10,15	6.222.720,24	0,54	1.197.610.494,30	0,52
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	14,70	-1,02	-2,32	-6,48	7.423.778,72	0,64	770.829.305,32	0,96
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	14,50	-1,14	-1,42	-5,50	11.814.158,84	1,02	404.818.553,65	2,92
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	14,94	-1,41	-3,03	-6,49	15.924.511,71	1,38	739.292.621,28	2,15
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,50	-0,81	-1,34	-3,64	17.785.060,90	1,54	1.011.981.812,09	1,76
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	14,74	-1,53	-5,02	-7,75	9.449.399,35	0,82	593.207.929,74	1,59
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	13,61	-0,97	-1,02	0,40	3.947.205,27	0,34	1.225.011.016,40	0,32
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	14,36	-1,37	-3,48	-7,63	5.094.158,83	0,44	340.410.247,50	1,50
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	17,78	-1,77	-6,55	-11,75	5.504.712,62	0,48	136.119.947,17	4,04
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	14,98	-1,54	-4,78	-7,56	7.679.891,39	0,66	118.689.573,90	6,47
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	16,26	-1,73	-4,93	-5,77	4.694.871,97	0,41	281.311.736,36	1,67
SAFRA	SAFRA	SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	12,52	-1,06	-0,85	-5,78	6.273.388,10	0,54	58.376.166,66	10,75
SAFRA	SAFRA	SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	19,21	-2,25	-8,58	-10,94	3.127.951,40	0,27	73.464.468,98	4,26
Sub-total Artigo 8º I			12,37	-1,24	-2,97	-3,75	192.652.574,74	16,66		
Renda Variável			12,37	-1,24	-2,97	-3,75	192.652.574,74	16,66		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,67%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,13	0,14	0,80	15,90	65.733.090,64	5,69	2.311.782.090,34	2,84
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	12,68	-0,23	-0,70	9,53	34.539.077,52	2,99	697.836.710,76	4,95
Sub-total Artigo 9º III			13,26	0,01	0,28	13,63	100.272.168,16	8,67		
Investimentos no Exterior			13,26	0,01	0,28	13,63	100.272.168,16	8,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,32%

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	11,65	-1,42	-3,80	6,90	83.869.296,88	7,25	1.805.438.252,39	4,65
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	11,63	-1,43	-3,81	6,89	14.387.197,45	1,24	1.382.697.410,45	1,04
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	11,57	-1,42	-3,81	6,73	21.022.076,58	1,82	679.242.023,12	3,09
Sub-total Artigo 10º I			11,63	-1,42	-3,81	6,87	119.278.570,91	10,32		
Investimentos Estruturados			11,63	-1,42	-3,81	6,87	119.278.570,91	10,32		
Total			3,87	-0,48	-1,00	2,19	1.156.249.534,02	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	139.832.827,57	12,09	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	507.769.225,99	43,92	0,00	30,81	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	96.444.166,65	8,34	0,00	6,98	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	744.046.220,21	64,35					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	192.652.574,74	16,66	0,00	7,21	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	192.652.574,74	16,66					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	100.272.168,16	8,67	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	100.272.168,16	8,67					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	119.278.570,91	10,32	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	119.278.570,91	10,32					15,00
Total		1.156.249.534,02	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	0,72 81,02	3,79 107,31	2,74 107,71	5,43 100,20	9,90 80,29	998.220,02	5.167.534,61
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,62 -70,11	0,81 22,91	0,47 18,59	4,58 84,48	7,94 64,41	-3.136.649,83	3.992.749,44
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,94 106,23	3,50 98,96	2,52 98,85	5,50 101,50	12,29 99,72	934.726,30	3.255.692,16
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,97 -1,27	-3,75 2,40	-0,72 0,72	12,74 1,44	18,68 -1,90	-5.902.124,90	-7.513.596,64
Artigo 9º III % do CDI	0,28 31,60	13,63 385,43	9,35 367,63	23,94 441,53	29,72 241,06	280.368,44	12.025.221,24
Artigo 10º I % do CDI	-3,81 -428,88	6,87 194,30	5,11 200,87	22,91 422,55	28,23 229,00	-4.719.330,76	7.666.993,35
COTIA (Total)						-11.544.790,73	24.594.594,16

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%)	43.704.732,64	0,00	0,00	0,00	43.995.389,63	290.656,99	1.538.107,21
NTN-B 150830 (5,685000%)	43.579.300,48	0,00	0,00	0,00	43.892.890,72	313.590,24	1.623.225,94
NTN-B 150830 (6,080000%)	9.205.909,12	0,00	0,00	0,00	9.275.165,38	69.256,26	354.176,58
NTN-B 150830 (6,255000%)	42.344.665,31	0,00	0,00	0,00	42.669.381,84	324.716,53	1.652.024,88
	138.834.607,55	0,00	0,00	0,00	139.832.827,57	998.220,02	

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	109.693.580,65	33.354,35	0,00	0,00	107.935.751,46	-1.791.183,54	-1.675.139,56
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	14.413.251,24	0,00	0,00	0,00	14.380.970,21	-32.281,03	244.016,25
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.594.130,66	0,00	0,00	0,00	3.614.378,59	20.247,93	105.451,43
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	30.056.876,35	0,00	0,00	0,00	29.978.948,07	-77.928,28	524.861,20

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	76.519.968,40	0,00	0,00	0,00	76.242.903,39	-277.065,01	1.282.310,22
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	148.758.295,16	0,00	0,00	0,00	148.430.180,42	-328.114,74	2.597.977,47
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.066.142,10	0,00	0,00	0,00	29.574.318,60	-491.823,50	-453.612,62
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.927.157,68	8.702.514,01	0,00	0,00	39.828.752,38	199.080,69	944.705,14
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	41.349.579,16	0,00	0,00	0,00	41.217.006,57	-132.572,59	571.066,94
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.375.035,71	0,00	0,00	0,00	6.360.204,04	-14.831,67	85.190,50
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	10.415.990,35	0,00	0,00	0,00	10.205.812,26	-210.178,09	-234.077,53
	502.170.007,46	8.735.868,36	0,00	0,00	507.769.225,99	-3.136.649,83	

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	4.149.250,26	0,00	-338.139,64	0,00	3.843.564,17	32.453,55	141.551,32
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.999.497,59	2.007.100,76	-5.188.337,15	0,00	30.112.147,29	293.886,09	1.332.864,29
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	42.667.078,75	0,00	0,00	0,00	43.047.449,67	380.370,92	1.165.120,42
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	19.212.989,78	0,00	0,00	0,00	19.441.005,52	228.015,74	616.156,13
	99.028.816,38	2.007.100,76	-5.526.476,79	0,00	96.444.166,65	934.726,30	

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	4.364.485,26	0,00	0,00	0,00	4.190.175,51	-174.309,75	-115.743,87
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	43.327.803,09	0,00	0,00	0,00	41.730.575,59	-1.597.227,50	2.535.458,10
BB AÇÕES DIVIDENDOS	19.989.397,79	0,00	0,00	0,00	19.557.693,97	-431.703,82	-1.310.091,31
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	22.571.597,01	0,00	0,00	0,00	22.232.320,33	-339.276,68	-1.324.541,12
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	6.409.915,60	0,00	0,00	0,00	6.222.720,24	-187.195,36	-703.317,12
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7.599.824,86	0,00	0,00	0,00	7.423.778,72	-176.046,14	-514.751,06
FIA BRASIL IBX-50	11.984.691,45	0,00	0,00	0,00	11.814.158,84	-170.532,61	-687.785,73
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	16.422.031,97	0,00	0,00	0,00	15.924.511,71	-497.520,26	-1.105.785,28
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18.027.227,45	0,00	0,00	0,00	17.785.060,90	-242.166,55	-671.477,06
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9.948.873,39	0,00	0,00	0,00	9.449.399,35	-499.474,04	-794.160,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	3.987.922,17	0,00	0,00	0,00	3.947.205,27	-40.716,90	15.857,91
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	5.277.825,85	0,00	0,00	0,00	5.094.158,83	-183.667,02	-420.518,02
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	5.890.498,28	0,00	0,00	0,00	5.504.712,62	-385.785,66	-732.736,40
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	8.065.417,86	0,00	0,00	0,00	7.679.891,39	-385.526,47	-627.923,83
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	4.938.532,68	0,00	0,00	0,00	4.694.871,97	-243.660,71	-287.379,94
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	6.327.119,44	0,00	0,00	0,00	6.273.388,10	-53.731,34	-384.546,83
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	3.421.535,49	0,00	0,00	0,00	3.127.951,40	-293.584,09	-384.154,15
	198.554.699,64	0,00	0,00	0,00	192.652.574,74	-5.902.124,90	

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	65.210.279,67	0,00	0,00	0,00	65.733.090,64	522.810,97	9.019.126,56
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	34.781.520,05	0,00	0,00	0,00	34.539.077,52	-242.442,53	3.006.094,68
	99.991.799,72	0,00	0,00	0,00	100.272.168,16	280.368,44	

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	87.185.979,29	0,00	0,00	0,00	83.869.296,88	-3.316.682,41	5.413.560,44
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	14.956.669,60	0,00	0,00	0,00	14.387.197,45	-569.472,15	926.981,81
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	21.855.252,78	0,00	0,00	0,00	21.022.076,58	-833.176,20	1.326.451,10
	123.997.901,67	0,00	0,00	0,00	119.278.570,91	-4.719.330,76	

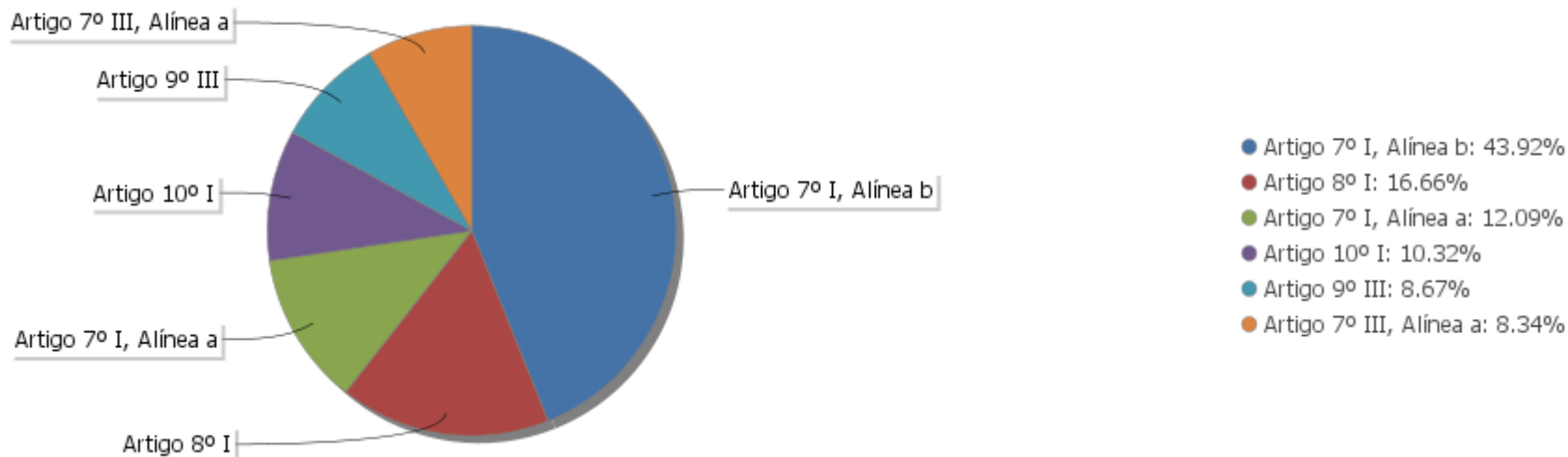
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

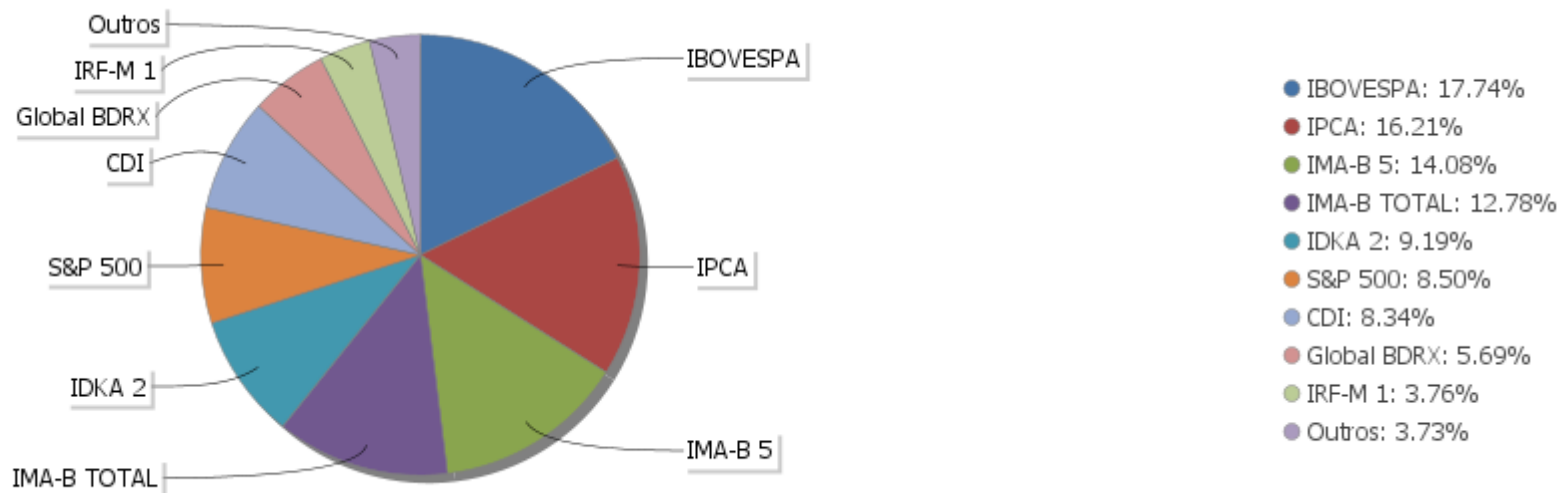
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	944.007.274,52	81,64		944.007.274,52	81,64	
de 31 dias a 365 dias	72.409.431,93	6,26		1.016.416.706,45	87,91	
acima de 365 dias	139.832.827,57	12,09		1.156.249.534,02	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

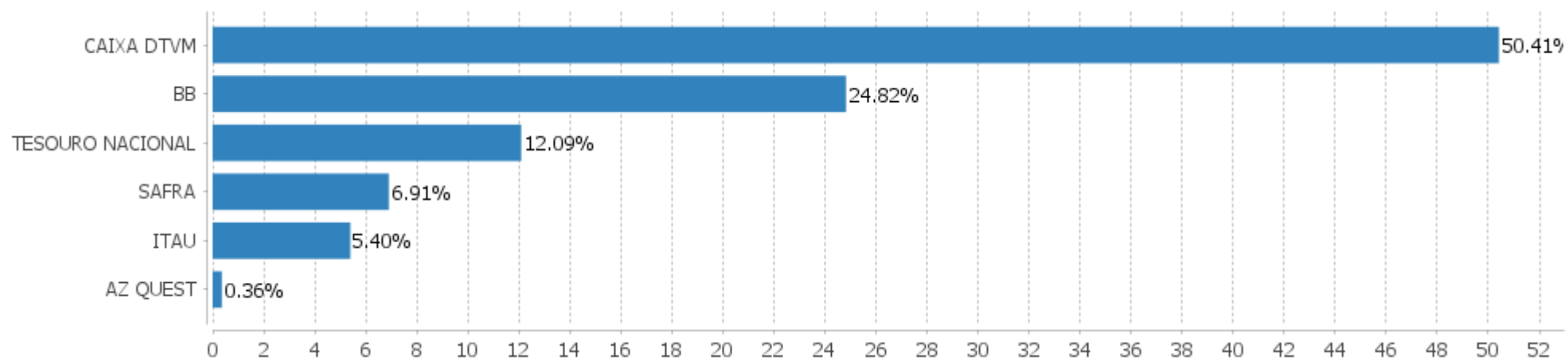


Alocação Por Estratégia



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									2,19
IPCA + 5,04%	0,85	1,20	0,55	0,81									3,46
p.p. indexador	-0,57	0,58	0,58	-1,81									-1,27
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	41	46,59
Meses abaixo - Meta Atuarial	47	53,41
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-3,56	2020-03

Relatório

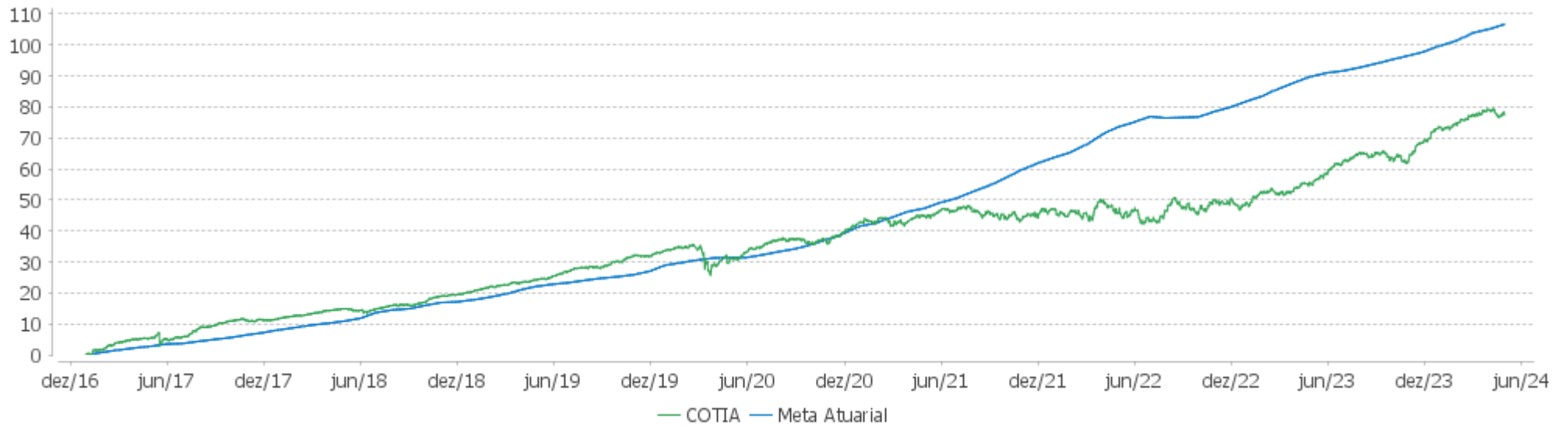
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,91	2,59	-0,68	3,57
06 meses	9,32	5,15	4,17	3,79
12 meses	13,98	8,89	5,09	3,87
24 meses	21,83	19,02	2,81	5,05
36 meses	22,53	40,42	-17,89	5,26
48 meses	35,40	58,40	-23,00	4,97
60 meses	42,75	71,89	-29,15	5,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

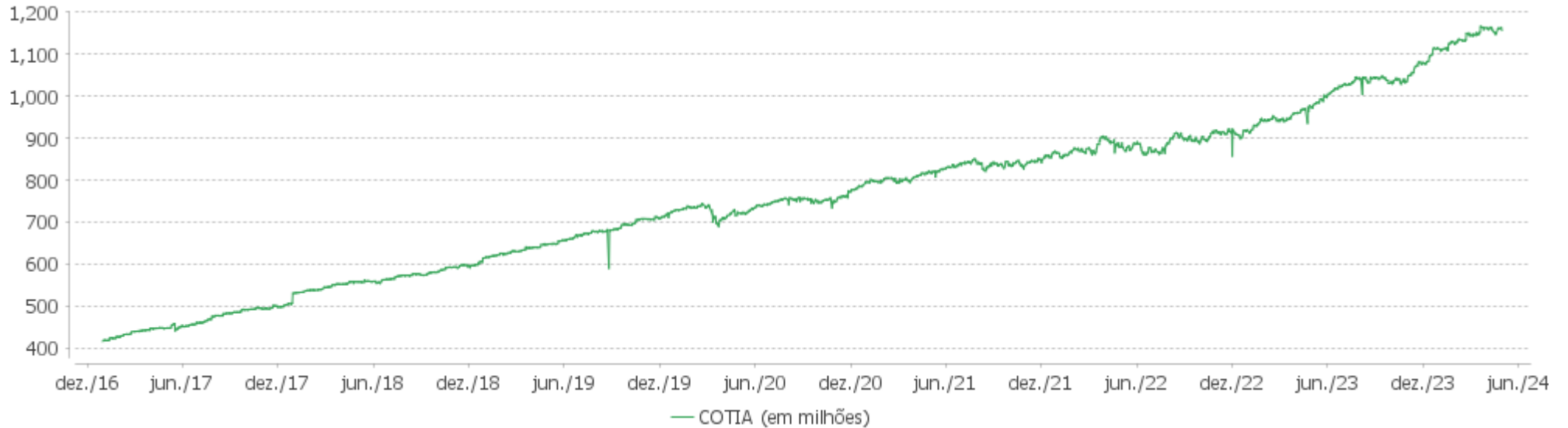
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	77,38	114,37	-36,99	4,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

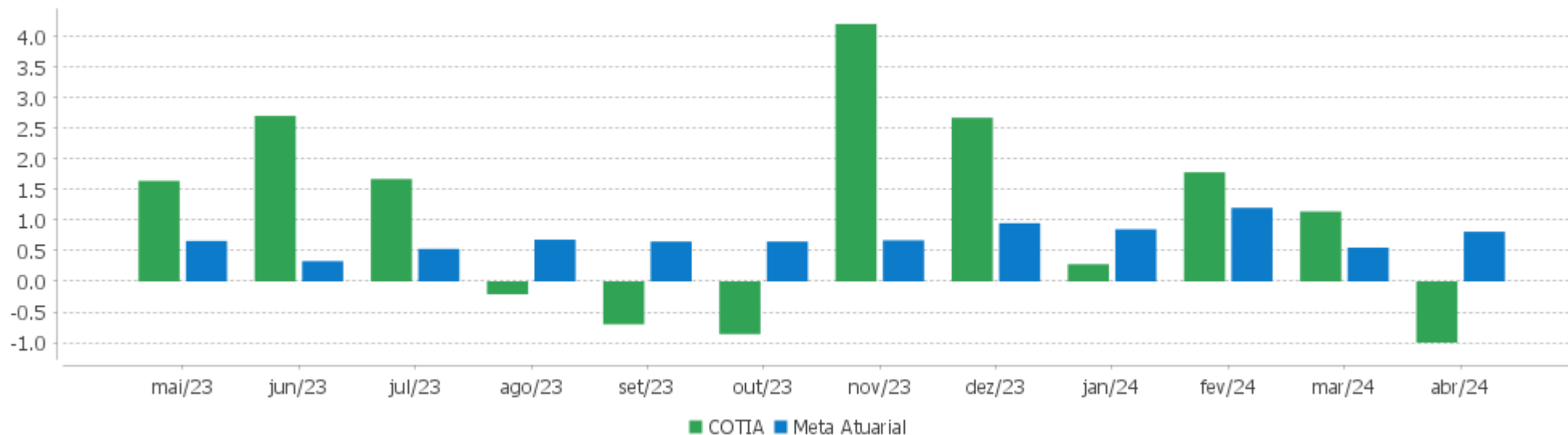


Patrimônio Líquido



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.	0,77 0,39	3,98 2,18	2,88 1,50	5,74 3,08	10,44 6,75	19,02 10,99	
NTN-B 150830 (5,685000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,34	3,80 2,00	2,74 1,37	5,45 2,80	9,84 6,15	17,86 9,83	
NTN-B 150826 (5,030000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,29	3,58 1,78	2,59 1,21	5,07 2,42	9,10 5,41	13,14 5,11	
NTN-B 150830 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	3,92 2,12	2,83 1,46	5,65 2,99	10,25 6,56	22,18 14,16	36,38 15,25
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,64 -0,02	-1,51 -0,07	-1,05 -0,05	3,81 -0,11	7,65 -0,18	16,91 -0,38	22,07 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,22 -0,02	1,78 -0,07	1,11 -0,05	5,09 -0,11	8,28 -0,15	18,63 -0,28	29,55 -0,60
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	-0,26 0,03	1,78 -0,16	1,06 -0,06	5,06 -0,25	8,22 -0,17	17,99 -0,53	29,01 -0,50
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,56 -0,02	3,01 -0,05	2,12 -0,08	4,92 -0,11	11,69 -0,28	26,19 -0,68	32,95 -1,06
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,32 -0,70	1,47 -0,33	0,81 -0,56	4,17 1,51	10,67 6,98	23,58 15,55	26,84 5,71
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,36 -0,07	1,71 -0,23	0,97 -0,15	4,92 -0,40	8,27 -0,12	17,88 -0,64	28,61 -0,90
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,22 -0,02	1,77 -0,08	1,10 -0,06	5,09 -0,11	8,23 -0,19	18,45 -0,46	29,22 -0,93
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,63 -0,02	-1,53 -0,09	-1,05 -0,05	3,81 -0,11	7,58 -0,24	16,76 -0,54	21,83 -0,97
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,58 0,01	3,07 0,02	2,14 -0,06	5,00 -0,03	11,80 -0,17	26,43 -0,44	33,23 -0,78
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,02 -0,40	-2,24 -0,80	-1,65 -0,65	3,24 -0,69	6,62 -1,21	16,25 -1,05	18,10 -4,70
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,23 -0,61	1,36 -0,44	0,88 -0,50	5,67 3,01	11,40 7,71	22,40 14,38	31,75 10,62
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,88 99,61	3,55 100,49	2,56 100,68	5,44 100,38	12,40 100,56	27,42 100,27	36,85 101,33
BB PREV RF FLUXO FIC	0,80	3,20	2,30	4,91	11,23	24,87	32,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	90,06	90,48	90,35	90,59	91,09	90,93	88,73
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1,19	3,27	2,35	5,71	11,71	25,39	37,67
% do CDI	133,73	92,58	92,30	105,32	95,02	92,82	103,60
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,89	3,64	2,61	5,61	12,90	28,00	37,57
% do CDI	100,46	102,85	102,47	103,38	104,64	102,37	103,32
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	-4,78	-7,56	-3,73	8,85	13,28	4,51	-18,16
Var. IBOVESPA p.p.	-3,08	-1,40	-2,29	-2,45	-7,30	-12,22	-24,07
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	-3,03	-6,49	-2,46	11,29	18,02	11,01	0,43
Var. IBOVESPA p.p.	-1,33	-0,34	-1,03	-0,01	-2,56	-5,72	-5,49
FIA BRASIL IBX-50	-1,42	-5,50	-1,39	11,15	17,99	8,11	-1,40
Var. IBOVESPA p.p.	0,28	0,66	0,04	-0,15	-2,59	-8,62	-7,31
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	-2,92	-10,15	-3,95	5,39	14,12	3,41	-1,39
Var. IBOVESPA p.p.	-1,22	-4,00	-2,52	-5,91	-6,46	-13,32	-7,30
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	-1,02	0,40	2,75	22,02	20,43	18,88	3,08
Var. IBOVESPA p.p.	0,68	6,56	4,18	10,72	-0,15	2,14	-2,83
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-1,34	-3,64	-0,58	11,94	19,73	19,73	16,11
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,78	0,71	0,28	-1,25	-2,03	-5,10	-13,42
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-2,32	-6,48	-2,01	11,16	16,50	5,68	0,64
Var. IBOVESPA p.p.	-0,61	-0,33	-0,58	-0,13	-4,08	-11,05	-5,27
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	-4,93	-5,77	-2,03	12,07	19,93	5,87	-21,51
Var. IBOVESPA p.p.	-3,23	0,39	-0,60	0,77	-0,65	-10,86	-27,42
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	-0,85	-5,78	-2,30	10,90	18,11	17,59	12,40
Var. IBOVESPA p.p.	0,85	0,38	-0,87	-0,40	-2,47	0,86	6,49
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	-3,69	6,47	4,72	21,53	24,37	33,47	36,97
Var. IBOVESPA p.p.	-1,98	12,63	6,15	10,24	3,79	16,74	31,06
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	-3,99	-2,69	0,39	13,11	16,64	2,45	-13,11
Var. IBOVESPA p.p.	-2,29	3,47	1,82	1,82	-3,95	-14,28	-19,03
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	-8,58	-10,94	-5,74	9,26	16,75	3,75	-15,84
Var. SMALL CAP p.p.	-0,82	0,59	-0,41	2,75	4,39	13,73	12,87
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-6,55	-11,75	-5,87	3,76	2,97	-16,87	
Var. IBOVESPA p.p.	-4,85	-5,59	-4,44	-7,54	-17,61	-33,60	
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-3,48	-7,63	-3,30	8,50	16,06	13,08	-4,29
Var. IBOVESPA p.p.	-1,78	-1,47	-1,87	-2,79	-4,52	-3,65	-10,20
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-2,16	-6,28	-2,20	10,23	17,05	12,20	3,67
Var. IBOVESPA p.p.	-0,46	-0,12	-0,77	-1,07	-3,53	-4,53	-2,24
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-1,50	-5,62	-1,11	11,70	20,72	13,22	0,21

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.	0,07	-0,18	-0,14	-0,51	-1,43	-2,89	-3,50
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-5,02 -3,32	-7,75 -1,60	-3,76 -2,33	7,56 -3,74	15,59 -4,99	4,95 -11,78	-11,18 -17,09
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,80 0,23	15,90 -0,64	10,85 -0,38	26,54 -1,06	34,38 -1,69	38,14 -2,99	18,46 -4,88
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-0,70 1,01	9,53 15,69	6,62 8,05	19,28 7,99	21,64 1,06	23,83 7,09	4,55 -1,36
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-3,80 -3,01	6,90 -5,88	5,13 -3,37	22,97 0,18	28,34 3,44	41,61 13,48	47,95 32,68
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-3,81 -2,11	6,73 12,89	5,03 6,46	22,70 11,41	27,83 7,25	40,86 24,13	46,85 40,94
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	-3,81 -3,01	6,89 -5,89	5,13 -3,37	22,91 0,12	28,16 3,25	41,50 13,37	47,61 32,34
COTIA Var. IPCA + 5,04% p.p.	-1,00 -1,81	2,19 -1,27	1,91 -0,68	9,32 4,17	13,98 5,09	21,83 2,68	22,53 -17,77
CDI	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36
IBOVESPA	-1,70	-6,16	-1,43	11,30	20,58	16,73	5,91
INPC + 6,00%	0,88	3,93	2,82	5,58	9,40	20,38	43,48
IPCA + 6,00%	0,89	3,77	2,82	5,62	9,88	21,32	44,17

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
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
ITAU 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	0,58	3,05	2,20	5,03	11,97	26,87	34,02	37,14	46,19
IRF-M 1+	-1,02	0,33	-0,26	5,27	12,67	27,40	26,02	27,83	45,63
IRF-M TOTAL	-0,52	1,14	0,47	5,18	12,20	26,69	28,23	30,71	46,00
IMA-B 5	-0,20	1,85	1,16	5,20	8,42	18,91	30,15	41,76	54,05
IMA-B 5+	-2,91	-4,38	-2,95	2,77	6,84	15,52	15,49	27,38	38,18
IMA-B TOTAL	-1,61	-1,44	-1,00	3,93	7,83	17,30	22,80	34,66	46,69
IMA-GERAL TOTAL	-0,22	1,41	0,94	4,96	10,96	23,84	29,96	35,96	47,48
IDKA 2	-0,29	1,94	1,12	5,32	8,39	18,52	29,51	41,70	53,91
IDKA 20	-4,90	-9,27	-6,13	1,23	7,00	14,11	3,87	18,01	24,63
CDI	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36	39,29	46,54

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,70	-6,16	-1,43	11,30	20,58	16,73	5,91	56,42	30,69
IBRX 100	-1,34	-5,57	-1,11	11,93	21,16	15,35	3,64	56,75	33,05
IBRX 50	-0,62	-4,66	-0,53	12,46	22,10	17,11	6,05	62,71	32,79
SMALL CAP	-7,76	-11,53	-5,32	6,51	12,36	-9,98	-28,71	11,14	6,04
Índice Consumo - ICON	-5,98	-12,66	-4,71	7,68	6,01	-22,89	-46,53	-30,89	-30,19
Índice Dividendos - IDIV	-0,56	-4,35	-0,87	13,19	21,76	24,83	29,53	77,48	64,74

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	-0,79	12,78	8,50	22,79	24,91	28,13	15,27	64,77	124,09

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,77	2,12	1,45	7,16	18,32	20,22	18,20	29,89	34,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,00	11,18	8,09	21,53	19,47	21,69	3,18	47,40	88,97

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,38	1,80	1,38	2,66	3,69	8,03	21,13	29,32	32,42
INPC	0,37	1,95	1,38	2,62	3,23	7,19	20,55	29,70	32,89
IGPM	0,31	-0,60	-0,68	0,73	-3,04	-5,14	8,77	43,59	53,19
SELIC	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36	39,29	46,54

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,72	3,12	2,34	4,64	7,82	16,81	36,19	51,17	61,01
IPCA + 5,00%	0,81	3,45	2,58	5,13	8,85	19,05	40,14	57,04	68,88
IPCA + 5,50%	0,85	3,61	2,70	5,38	9,37	20,19	42,15	60,03	72,92
IPCA + 5,89%	0,88	3,74	2,79	5,57	9,77	21,07	43,72	62,40	76,13
IPCA + 6,00%	0,89	3,77	2,82	5,62	9,88	21,32	44,17	63,07	77,05
INPC + 4,00%	0,71	3,28	2,34	4,60	7,35	15,90	35,54	51,62	61,59
INPC + 6,00%	0,88	3,93	2,82	5,58	9,40	20,38	43,48	63,56	77,68

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%)	43.995.389,63	5,030000	42.905.875,18	6,260000	-1.089.514,45
NTN-B 150830 (5,685000%)	43.892.890,72	5,685000	42.714.302,37	6,233700	-1.178.588,35
NTN-B 150830 (6,080000%)	9.275.165,38	6,080000	9.204.932,16	6,233700	-70.233,22
NTN-B 150830 (6,255000%)	42.669.381,84	6,255000	42.714.302,37	6,233700	44.920,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
328	05/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.936,72	8.224,73404100	2,7887491420
335	05/04/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	33.354,35	0,00	4.225,42709500	7,8937227510
326	10/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.428,85	4.451,96835200	2,7917651290
327	11/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.649,63	6.319,75854100	2,7927696740
325	16/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.527,00	2.692,22839500	2,7958252030
333	19/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.996.624,70	0,00	631.244,98048300	3,1629949730
320	22/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.702.514,01	0,00	2.496.612,33274302	3,4857290000
324	22/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	131.927,90	47.119,37252400	2,7998653830
323	23/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.400,00	5.141,22864200	2,8008869090
321	25/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	349,90	124,83399700	2,8029223400
322	26/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	108.784,94	38.797,23853600	2,8039351280
331	26/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.374.783,38	1.380.285,92232400	3,1694762000
332	29/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.724,00	3.466,75577200	2,8049279040
329	30/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	813.553,77	256.477,67705000	3,1720256490
330	30/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.476,06	0,00	3.302,64038100	3,1720256490
334	30/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.410,70	4.423,00589600	2,8059424500
Total			10.742.969,12	5.526.476,79		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 19.322.417,35

Value-At-Risk: 1,67%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,60	0,48		0,16	-0,66	-0,17	744.046.220,21	64,35
Artigo 8º	11,43	5,25		0,73	-0,34	-2,97	192.652.574,74	16,66
Artigo 9º	15,85	5,65		0,25	-0,04	0,28	100.272.168,16	8,67
Artigo 10º	12,84	5,80		0,53	-0,37	-3,81	119.278.570,91	10,32
COTIA		1,67		1,67			1.156.249.534,02	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,48%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,030000%)	0,21	0,13	0,00	0,15	-1,04	0,67	43.995.389,63	3,81
NTN-B 150830 (5,685000%)	0,21	0,16	-0,00	0,17	-0,78	0,72	43.892.890,72	3,80
NTN-B 150830 (6,080000%)	0,21	0,16	-0,00	0,17	-0,63	0,75	9.275.165,38	0,80
NTN-B 150830 (6,255000%)	0,21	0,15	-0,00	0,17	-0,56	0,77	42.669.381,84	3,69
Sub-total	0,21	0,15	-0,00		-0,79	0,72	139.832.827,57	12,09

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	3,47	1,24	0,06	0,02	-0,73	-1,63	107.935.751,46	9,33
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,93	0,53	0,00	0,01	-0,57	-0,22	14.380.970,21	1,24
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,69	0,13	0,00	0,07	-0,47	0,56	3.614.378,59	0,31
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,19	0,62	0,01	0,11	-0,52	-0,26	29.978.948,07	2,59
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,46	0,62	0,02	0,11	-0,51	-0,36	76.242.903,39	6,59
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,94	0,53	0,03	0,01	-0,57	-0,22	148.430.180,42	12,84
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,47	1,23	0,02	0,01	-0,73	-1,64	29.574.318,60	2,56
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,68	0,15	0,00	0,06	-0,45	0,58	39.828.752,38	3,44

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	1,88	0,65	0,01	0,65	-0,64	-0,32	41.217.006,57	3,56
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,30	0,62	0,00	0,62	-0,49	-0,23	6.360.204,04	0,55
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3,97	1,24	0,01	0,08	-0,73	-2,02	10.205.812,26	0,88
Sub-total	2,26	0,69	0,15		-0,67	-0,62	507.769.225,99	43,92

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	0,02	0,00	0,01	-12,72	0,80	3.843.564,17	0,33
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,03	0,02	0,00	0,01	-0,13	0,88	30.112.147,29	2,60
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,12	0,89	43.047.449,67	3,72
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,56	0,31	0,00	0,31	0,54	1,19	19.441.005,52	1,68
Sub-total	0,10	0,07	0,00		0,53	0,94	96.444.166,65	8,34

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,25%

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	14,08	6,63	0,02	3,43	-0,35	-3,99	4.190.175,51	0,36
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	13,84	5,35	0,17	6,76	-0,33	-3,69	41.730.575,59	3,61
BB AÇÕES DIVIDENDOS	12,83	6,26	0,07	1,71	-0,24	-2,16	19.557.693,97	1,69
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	13,05	6,21	0,08	0,18	-0,18	-1,50	22.232.320,33	1,92
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	12,88	6,04	0,02	1,48	-0,30	-2,92	6.222.720,24	0,54
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	12,33	6,12	0,03	0,89	-0,26	-2,32	7.423.778,72	0,64
FIA BRASIL IBX-50	12,40	5,96	0,04	0,69	-0,19	-1,42	11.814.158,84	1,02
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	12,86	6,13	0,06	1,20	-0,30	-3,03	15.924.511,71	1,38
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,37	5,33	0,05	1,85	-0,20	-1,34	17.785.060,90	1,54
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	13,62	6,64	0,04	2,65	-0,43	-5,02	9.449.399,35	0,82
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	11,57	5,66	0,02	3,82	-0,16	-1,02	3.947.205,27	0,34
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,06	6,00	0,02	1,29	-0,33	-3,48	5.094.158,83	0,44
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	16,04	7,76	0,02	3,51	-0,46	-6,55	5.504.712,62	0,48

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	6,11	0,03	2,29	-0,39	-4,78	7.679.891,39	0,66
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	16,36	7,63	0,02	2,88	-0,36	-4,93	4.694.871,97	0,41
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	13,61	6,45	0,02	2,47	-0,13	-0,85	6.273.388,10	0,54
SAFRA SMALL CAP PB FIC FIA	21,44	9,15	0,02	1,98	-0,44	-8,58	3.127.951,40	0,27
Sub-total	11,43	5,25	0,73		-0,34	-2,97	192.652.574,74	16,66

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,80%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,85	5,80	0,38	4,39	-0,36	-3,80	83.869.296,88	7,25
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	12,85	5,79	0,06	4,39	-0,37	-3,81	14.387.197,45	1,24
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	12,78	5,77	0,09	6,76	-0,37	-3,81	21.022.076,58	1,82
Sub-total	12,84	5,80	0,53		-0,37	-3,81	119.278.570,91	10,32

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,65%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,51	5,88	0,16	0,72	-0,00	0,80	65.733.090,64	5,69
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	14,47	5,82	0,09	8,89	-0,11	-0,70	34.539.077,52	2,99
Sub-total	15,85	5,65	0,25		-0,04	0,28	100.272.168,16	8,67

(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 (%)