



LDB
EMPRESAS

SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO
MARÇO 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 28.03.2024.

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

72,36%

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 150535 (4,825000%)	0,40	0,03	0,93	2,85	5.730.677,57	1,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,875000%)	0,40	0,03	0,93	2,86	5.784.228,83	1,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,965000%)	0,40	0,03	0,94	2,89	5.691.575,93	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,41	0,03	0,97	2,97	5.696.639,52	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,100000%)	0,44	0,03	1,03	3,15	5.468.573,96	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,690000%)	0,55	0,03	0,99	3,06	5.680.075,46	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,750000%)	4,06	0,03	1,00	3,07	2.234.844,55	0,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,854000%)	0,56	0,03	1,01	3,10	5.560.797,69	1,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,895000%)	0,56	0,03	1,01	3,10	21.561.083,16	3,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,421000%)	0,58	0,04	1,05	3,23	5.433.285,14	0,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,351000%)	0,66	0,04	1,04	3,21	10.808.858,77	1,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,270000%)	0,27	0,03	0,96	2,96	6.940.073,81	1,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,408000%)	0,27	0,04	1,12	3,46	10.319.207,23	1,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,525000%)	0,29	0,03	0,98	3,02	11.326.414,59	2,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,563000%)	0,30	0,04	1,06	3,26	10.577.077,81	1,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,830000%)	0,45	0,03	0,93	2,85	11.699.322,79	2,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,873000%)	0,45	0,03	0,93	2,86	11.637.252,40	2,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,045000%)	0,46	0,03	0,95	2,90	5.713.056,71	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,47	0,03	0,97	2,98	5.713.805,35	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,49	0,03	0,99	3,06	1.475.405,35	0,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,760000%)	0,60	0,03	1,00	3,07	1.122.005,69	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,832500%)	0,60	0,03	1,01	3,09	5.834.406,59	1,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,042000%)	0,61	0,03	1,02	3,14	10.662.377,47	1,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,351000%)	0,63	0,04	1,04	3,21	10.485.688,04	1,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,352000%)	0,63	0,04	1,04	3,21	5.301.834,22	0,97
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,46	0,03	1,00	3,07	188.458.568,63	34,41

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,97	0,03	0,77	2,41	13.795.540,61	2,52	6.783.435.564,44	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,04	0,79	2,55	5.207.958,27	0,95	13.231.140.496,66	0,04
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,90	0,04	0,91	2,78	1.004.763,48	0,18	236.769.060,66	0,42
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,89	0,04	0,91	2,77	579.849,22	0,11	192.185.931,64	0,30
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,90	-0,00	0,06	0,11	15.788.346,37	2,88	5.324.825.927,52	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,88	-0,00	0,06	0,13	3.602.570,54	0,66	5.029.824.301,86	0,07
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	4,73	-0,00	-0,04	-0,29	5.579.006,40	1,02	168.544.602,31	3,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,69	0,08	0,75	1,99	9.951.169,61	1,82	1.269.573.693,69	0,78
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,00	-0,08	-0,56	-1,52	18.359.534,14	3,35	1.366.454.531,96	1,34
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,62	0,08	0,65	1,56	11.021.937,47	2,01	406.970.875,94	2,71
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,36	0,03	0,58	1,80	10.884.617,63	1,99	5.431.217.487,91	0,20
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,64	0,01	0,29	0,81	95.775.293,74	17,49		

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	0,87	2,72	23.361.858,96	4,27	16.216.695.874,70	0,14
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	3,95	0,00	0,04	0,09	25.383.309,06	4,64	541.976.373,60	4,68
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3,99	-0,01	0,10	0,20	39.402.522,56	7,20	1.280.284.121,42	3,08
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,04	0,75	1,69	4.871.337,75	0,89	4.354.660.093,34	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,04	0,75	2,37	119.605,74	0,02	1.092.831.104,05	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,70	0,08	0,74	1,97	8.516.605,18	1,56	850.459.230,83	1,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,04	0,85	2,70	1.189.721,90	0,22	6.030.179.613,18	0,02
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,45	0,01	0,34	1,03	102.844.961,15	18,78		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,46% a.a	4,36	1,44	1,44	3,82	6.075.578,11	1,11		
Sub-total Artigo 7º IV			4,36	1,44	1,44	3,82	6.075.578,11	1,11		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,28	0,06	0,77	2,39	3.088.566,86	0,56	311.881.894,95	0,99
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,28	0,06	0,77	2,39	3.088.566,86	0,56		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

1,31

0,05

0,66

2,00

396.242.968,49

72,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

12,20%

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	15,12	0,09	-1,58	-7,45	2.246.425,70	0,41	1.336.503.943,21	0,17
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	20,52	0,08	-0,11	-5,08	12.015.388,88	2,19	652.744.629,19	1,84
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	15,52	0,39	-0,44	-3,57	19.684.812,60	3,59	743.274.690,86	2,65
XP	SANTANDER	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	13,53	0,42	-1,57	-1,28	3.072.301,80	0,56	326.565.041,45	0,94
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	15,95	0,32	-0,65	-4,44	4.794.628,00	0,88	72.986.253,63	6,57
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	14,76	0,35	-1,18	-5,46	19.663.133,13	3,59	328.259.131,39	5,99
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,75	1,04	1,36	0,85	5.314.231,69	0,97	716.419.031,98	0,74
Sub-total Artigo 8º I			15,56	0,36	-0,59	-4,27	66.790.921,80	12,20		
Renda Variável			15,56	0,36	-0,59	-4,27	66.790.921,80	12,20		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,11%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,99	1,13	4,75	10,39	2.657.731,25	0,49	377.378.412,61	0,70
BB	BB	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,35	1,09	3,66	13,55	803.894,37	0,15	1.350.128.697,33	0,06
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,82	1,35	2,16	15,24	7.000.665,56	1,28	769.263.355,99	0,91
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	11,38	0,56	3,35	10,46	7.775.181,01	1,42	413.689.904,13	1,88
Sub-total Artigo 9º II			11,75	0,97	3,10	12,37	18.237.472,19	3,33		

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	14,00	0,35	3,48	14,98	7.029.275,51	1,28	2.280.222.056,45	0,31
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	15,39	0,43	1,57	16,41	11.007.861,45	2,01	1.559.186.452,18	0,71
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	13,27	-0,02	2,16	13,65	2.684.789,43	0,49	739.738.803,19	0,36
Sub-total Artigo 9º III			14,43	0,35	2,28	15,57	20.721.926,39	3,78		

Investimentos no Exterior

11,94 0,64 2,67 14,04 38.959.398,58 7,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,33%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	11,50	0,14	3,44	11,26	24.919.244,72	4,55	648.677.226,01	3,84
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,49	0,14	3,39	11,13	6.930.598,59	1,27	1.864.604.527,50	0,37
Sub-total Artigo 10º I			11,23	0,14	3,43	10,85	31.849.843,31	5,82		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PÁTRIA	XP	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	13,37	4,55	4,55	2,22	651.921,75	0,12	108.653.624,60	0,60
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	8,39	-2,38	-2,38	-6,87	291.396,42	0,05	122.656.310,27	0,24
KINEA	INTRAG	KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	51,52	8,45	8,45	7,01	1.254.418,48	0,23	136.982.498,03	0,92
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	29,68	0,11	0,11	2,98	11.579.346,84	2,11	369.381.113,95	3,13
Sub-total Artigo 10º II			28,04	0,96	0,95	3,07	13.777.083,49	2,52		

Investimentos Estruturados			11,69	0,39	2,67	8,42	45.626.926,80	8,33		
Total			3,29	0,16	0,79	2,36	547.620.215,67	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	2.116.716,16
Sub-total Disponibilidades Financeiras	2.116.716,16
Total	549.736.931,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 4	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	188.458.568,63	34,41	0,00	32,00	60,00	36,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	95.775.293,74	17,49	10,00	19,50	70,00	22,38	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	102.844.961,15	18,78	0,00	13,50	60,00	15,00	80,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	6.075.578,11	1,11	0,00	1,40	10,00	1,10	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.088.566,86	0,56	0,00	0,60	5,00	0,60	20,00
	Total Renda Fixa	396.242.968,49	72,36					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	66.790.921,80	12,20	0,00	13,00	30,00	4,92	50,00
	Total Renda Variável	66.790.921,80	12,20					50,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	18.237.472,19	3,33	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	20.721.926,39	3,78	0,00	4,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	38.959.398,58	7,11					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	31.849.843,31	5,82	0,00	7,50	15,00	7,50	15,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	13.777.083,49	2,52	0,00	3,50	8,00	2,50	15,00
	Total Investimentos Estruturados	45.626.926,80	8,33					20,00
Total		547.620.215,67	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	1,00 120,03	3,07 117,15	3,07 117,15	5,54 100,01	10,21 82,57	1.866.766,85	5.665.816,58
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,29 34,30	0,81 30,86	0,81 30,86	4,96 89,59	10,20 82,51	272.646,33	766.672,42
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,34 40,85	1,03 39,28	1,03 39,28	5,13 92,71	11,95 96,66	336.694,64	1.020.878,41
Artigo 7º IV % do CDI	1,44 173,18	3,82 145,43	3,82 145,43	6,72 121,28	13,03 105,42	86.448,38	223.392,54
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,77 92,39	2,39 91,01	2,39 91,01	5,11 92,36	10,16 82,18	23.601,92	72.057,11
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,59 0,12	-4,27 0,26	-4,27 0,26	8,18 -1,73	21,28 -4,46	-508.575,29	-3.357.106,17
Artigo 9º II % do CDI	3,10 372,25	12,37 471,32	12,37 471,32	24,61 444,38	29,37 237,60	548.811,78	2.007.777,83
Artigo 9º III % do CDI	2,28 274,02	15,57 593,22	15,57 593,22	27,04 488,27	34,73 280,96	462.705,65	2.774.674,71
Artigo 10º I % do CDI	3,43 411,21	10,85 413,35	10,85 413,35	25,24 455,75	35,89 290,28	1.055.431,29	3.164.358,15
Artigo 10º II % do CDI	0,95 113,91	3,07 116,81	3,07 116,81	3,61 65,28	5,15 41,63	129.490,85	408.961,94
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO (Total)						4.274.022,40	12.747.483,52

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 150535 (4,825000%)	5.677.945,31	0,00	0,00	0,00	5.730.677,57	52.732,26	158.892,15
NTN-B 150535 (4,875000%)	5.730.785,39	0,00	0,00	0,00	5.784.228,83	53.443,44	161.033,18
NTN-B 150535 (4,965000%)	5.638.607,67	0,00	0,00	0,00	5.691.575,93	52.968,26	159.599,44
NTN-B 150535 (5,320000%)	5.642.110,38	0,00	0,00	0,00	5.696.639,52	54.529,14	164.265,59
NTN-B 150535 (6,100000%)	5.413.055,02	0,00	0,00	0,00	5.468.573,96	55.518,94	167.168,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (5,690000%)	5.624.136,13	0,00	0,00	0,00	5.680.075,46	55.939,33	168.471,06
NTN-B 150545 (5,750000%)	2.212.735,90	0,00	0,00	0,00	2.234.844,55	22.108,65	66.581,99
NTN-B 150545 (5,854000%)	5.505.360,11	0,00	0,00	0,00	5.560.797,69	55.437,58	166.956,51
NTN-B 150545 (5,895000%)	21.345.473,08	0,00	0,00	0,00	21.561.083,16	215.610,08	649.300,02
NTN-B 150545 (6,421000%)	5.376.835,22	0,00	0,00	0,00	5.433.285,14	56.449,92	169.937,95
NTN-B 150555 (6,351000%)	10.697.114,36	0,00	0,00	0,00	10.808.858,77	111.744,41	336.408,26
NTN-B 150824 (5,270000%)	6.873.901,31	0,00	0,00	0,00	6.940.073,81	66.172,50	202.088,82
NTN-B 150824 (7,408000%)	10.204.517,56	0,00	0,00	0,00	10.319.207,23	114.689,67	349.921,55
NTN-B 150826 (5,525000%)	11.216.263,30	0,00	0,00	0,00	11.326.414,59	110.151,29	336.327,86
NTN-B 150826 (6,563000%)	10.466.084,08	0,00	0,00	0,00	10.577.077,81	110.993,73	338.837,22
NTN-B 150840 (4,830000%)	11.591.632,15	0,00	0,00	0,00	11.699.322,79	107.690,64	328.469,13
NTN-B 150840 (4,873000%)	11.529.744,43	0,00	0,00	0,00	11.637.252,40	107.507,97	327.884,46
NTN-B 150840 (5,045000%)	5.659.544,21	0,00	0,00	0,00	5.713.056,71	53.512,50	163.234,58
NTN-B 150840 (5,360000%)	5.658.942,99	0,00	0,00	0,00	5.713.805,35	54.862,36	167.401,04
NTN-B 150840 (5,690000%)	1.460.876,70	0,00	0,00	0,00	1.475.405,35	14.528,65	44.344,98
NTN-B 150850 (5,760000%)	1.110.898,51	0,00	0,00	0,00	1.122.005,69	11.107,18	33.899,39
NTN-B 150850 (5,832500%)	5.776.328,28	0,00	0,00	0,00	5.834.406,59	58.078,31	177.254,21
NTN-B 150850 (6,042000%)	10.554.595,23	0,00	0,00	0,00	10.662.377,47	107.782,24	329.066,33
NTN-B 150850 (6,351000%)	10.377.295,13	0,00	0,00	0,00	10.485.688,04	108.392,91	331.063,09
NTN-B 150850 (6,352000%)	5.247.019,33	0,00	0,00	0,00	5.301.834,22	54.814,89	167.409,29
	186.591.801,78	0,00	0,00	0,00	188.458.568,63	1.866.766,85	

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	13.690.584,86	0,00	0,00	0,00	13.795.540,61	104.955,75	324.427,65
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	15.778.940,10	0,00	0,00	0,00	15.788.346,37	9.406,27	16.735,97
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	574.618,58	0,00	0,00	0,00	579.849,22	5.230,64	15.890,46
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	995.656,47	0,00	0,00	0,00	1.004.763,48	9.107,01	27.580,04
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18.462.765,81	0,00	0,00	0,00	18.359.534,14	-103.231,67	-283.552,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.362.938,50	237.331,59	0,00	0,00	3.602.570,54	2.300,45	5.420,41
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.937.414,52	230.822,91	0,00	0,00	5.207.958,27	39.720,84	120.378,17
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	10.822.085,24	0,00	0,00	0,00	10.884.617,63	62.532,39	192.279,81
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	9.877.027,90	0,00	0,00	0,00	9.951.169,61	74.141,71	194.438,35
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	5.581.352,11	0,00	0,00	0,00	5.579.006,40	-2.345,71	-16.108,08
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	10.951.108,82	0,00	0,00	0,00	11.021.937,47	70.828,65	169.182,18
	95.034.492,91	468.154,50	0,00	0,00	95.775.293,74	272.646,33	

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	1.726,82	4.868.901,82	0,00	0,00	4.871.337,75	709,11	1.625,07
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	8.454.183,47	0,00	0,00	0,00	8.516.605,18	62.421,71	164.417,72
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	25.373.807,91	0,00	0,00	0,00	25.383.309,06	9.501,15	23.876,94
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	941.360,00	0,00	-826.585,61	0,00	119.605,74	4.831,35	15.075,03
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1.179.707,67	0,00	0,00	0,00	1.189.721,90	10.014,23	31.260,18
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	25.929.777,24	5.399.660,88	-8.178.222,03	0,00	23.361.858,96	210.642,87	705.464,07
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	38.831.739,73	532.208,61	0,00	0,00	39.402.522,56	38.574,22	79.159,40
	100.712.302,84	10.800.771,31	-9.004.807,64	0,00	102.844.961,15	336.694,64	

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,46% a.a	5.989.129,73	0,00	0,00	0,00	6.075.578,11	86.448,38	223.392,54
	5.989.129,73	0,00	0,00	0,00	6.075.578,11	86.448,38	

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.064.964,94	0,00	0,00	0,00	3.088.566,86	23.601,92	72.057,11
	3.064.964,94	0,00	0,00	0,00	3.088.566,86	23.601,92	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	24.556.336,59	0,00	-4.551.396,72	0,00	19.663.133,13	-341.806,74	-1.453.376,37
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	2.282.579,56	0,00	0,00	0,00	2.246.425,70	-36.153,86	-180.880,57
BRASESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	14.166.494,84	0,00	-2.116.716,16	0,00	12.015.388,88	-34.389,80	-775.973,00
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	4.826.202,03	0,00	0,00	0,00	4.794.628,00	-31.574,03	-222.736,63
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	19.771.558,24	0,00	0,00	0,00	19.684.812,60	-86.745,64	-729.117,06
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	5.243.089,15	0,00	0,00	0,00	5.314.231,69	71.142,54	44.671,86
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	3.121.349,56	0,00	0,00	0,00	3.072.301,80	-49.047,76	-39.694,40
	73.967.609,97	0,00	-6.668.112,88	0,00	66.790.921,80	-508.575,29	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	2.537.304,19	0,00	0,00	0,00	2.657.731,25	120.427,06	250.071,88
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	775.496,02	0,00	0,00	0,00	803.894,37	28.398,35	95.920,53
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	6.852.438,84	0,00	0,00	0,00	7.000.665,56	148.226,72	925.831,30
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	7.523.421,36	0,00	0,00	0,00	7.775.181,01	251.759,65	735.954,12
	17.688.660,41	0,00	0,00	0,00	18.237.472,19	548.811,78	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	2.628.047,73	0,00	0,00	0,00	2.684.789,43	56.741,70	307.185,05
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6.793.022,02	0,00	0,00	0,00	7.029.275,51	236.253,49	915.851,66
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	10.838.150,99	0,00	0,00	0,00	11.007.861,45	169.710,46	1.551.638,00
	20.259.220,74	0,00	0,00	0,00	20.721.926,39	462.705,65	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	24.091.350,07	0,00	0,00	0,00	24.919.244,72	827.894,65	2.521.240,68
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6.703.061,95	0,00	0,00	0,00	6.930.598,59	227.536,64	693.985,54
	30.794.412,02	0,00	0,00	0,00	31.849.843,31	1.055.431,29	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	298.509,31	0,00	0,00	0,00	291.396,42	-7.112,89	-21.481,74
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	11.567.180,55	0,00	0,00	0,00	11.579.346,84	12.166,29	334.991,48
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	1.156.652,77	0,00	0,00	0,00	1.254.418,48	97.765,71	82.132,42
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	586.075,17	39.174,84	0,00	0,00	651.921,75	26.671,74	13.319,78
	13.608.417,80	39.174,84	0,00	0,00	13.777.083,49	129.490,85	

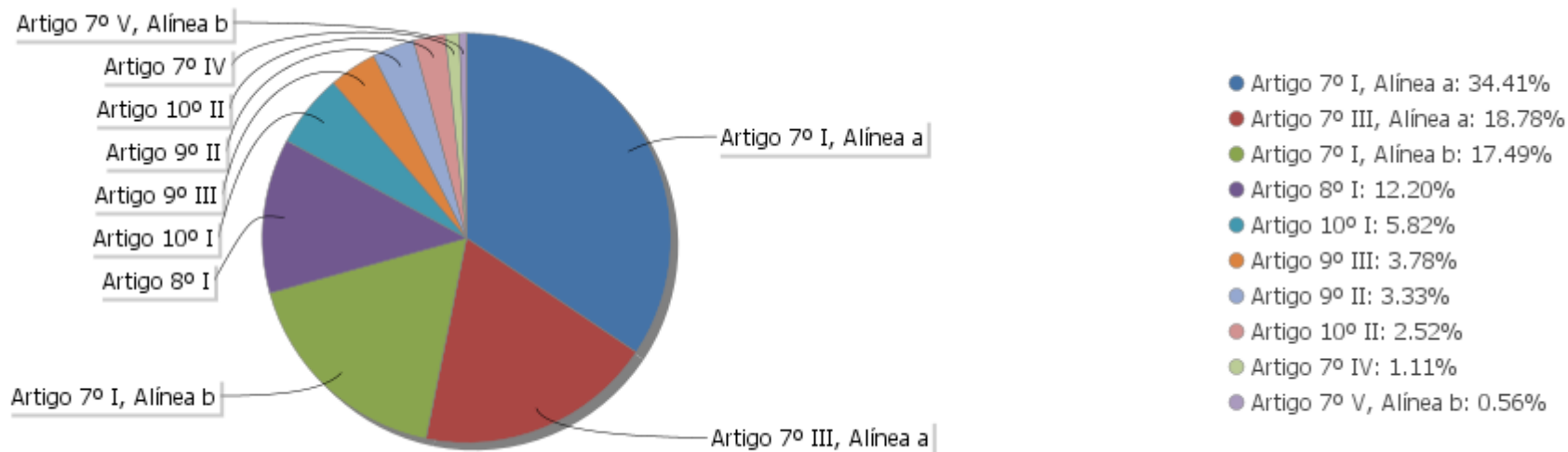
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

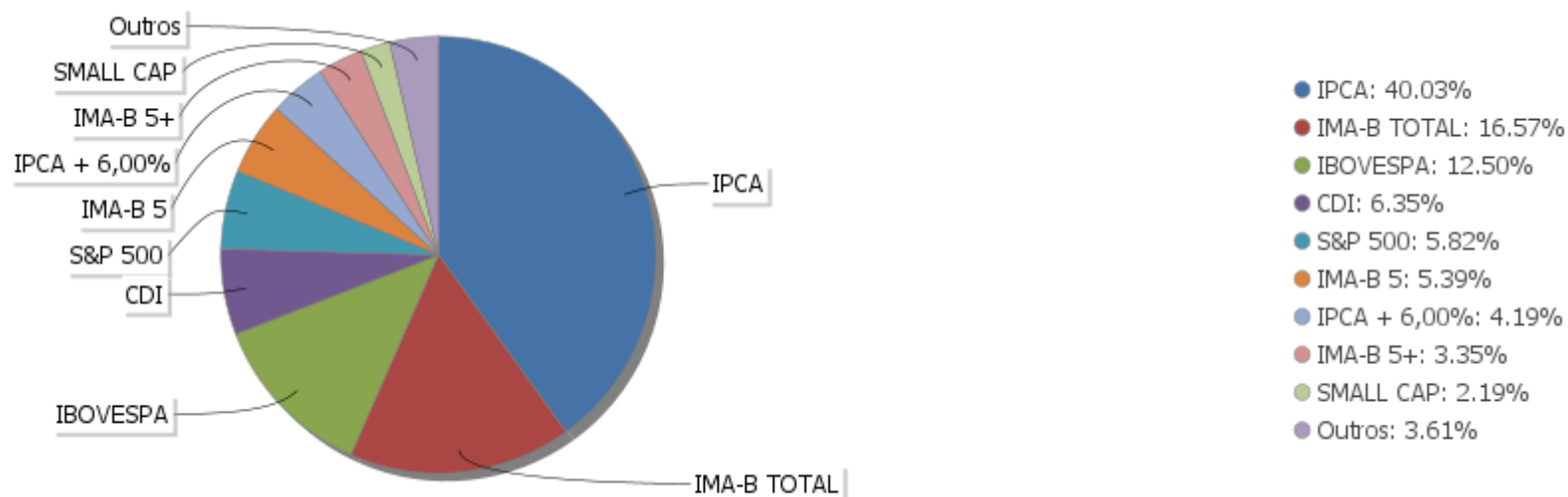
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	318.039.560,14	58,08	40,00	318.039.560,14	58,08	40,00
de 31 dias a 365 dias	38.528.706,34	7,04		356.568.266,48	65,11	40,00
acima de 365 dias	191.051.949,19	34,89		547.620.215,67	100,00	40,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

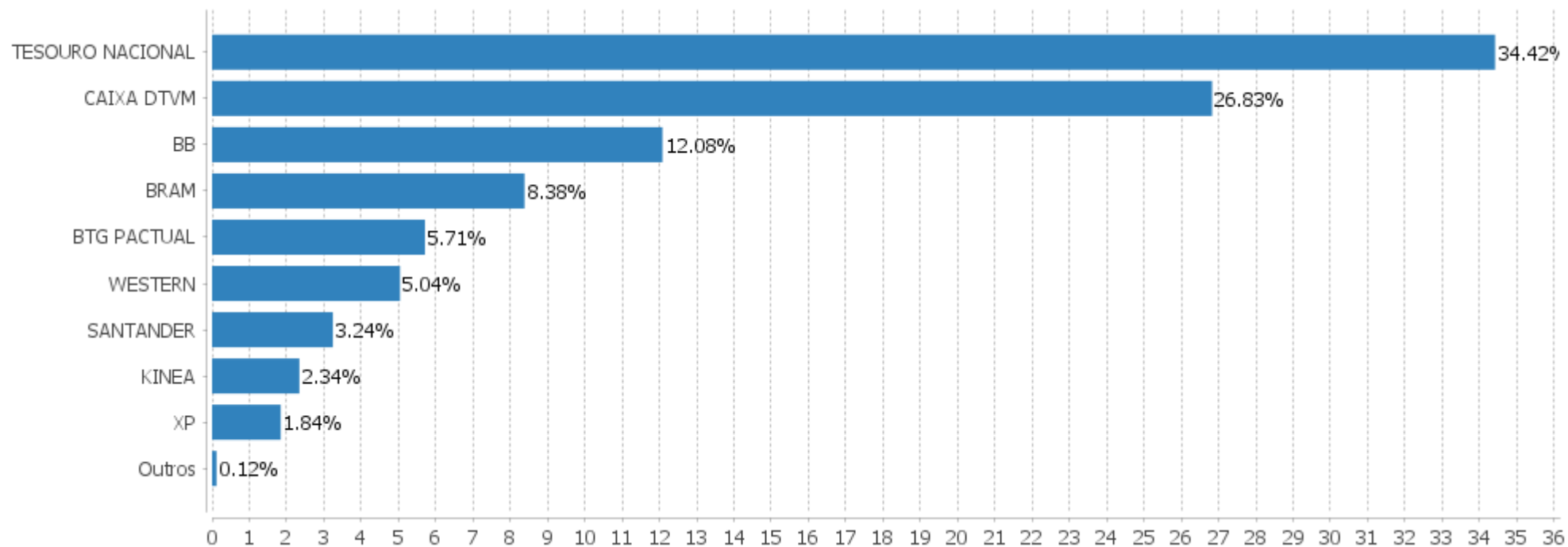


Alocação Por Estratégia



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	0,03	1,54	0,79										2,36
IPCA + 5,02%	0,85	1,20	0,55										2,63
p.p. indexador	-0,82	0,33	0,24										-0,26
2023	1,67	-0,32	1,15	1,15	1,97	2,35	1,30	-0,40	-0,40	-0,59	3,53	2,41	14,62
IPCA + 5,02%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68	0,65	0,65	0,67	0,95	9,81
p.p. indexador	0,71	-1,51	-0,01	0,19	1,31	2,02	0,77	-1,08	-1,05	-1,24	2,86	1,46	4,81
2022	-0,35	0,40	2,59	-1,93	0,83	-2,43	1,92	0,96	-0,55	2,18	-0,03	-0,51	3,01
IPCA + 4,85%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,29	0,07	0,10	0,97	0,79	1,04	10,90
p.p. indexador	-1,28	-0,97	0,54	-3,35	-0,05	-3,50	2,21	0,89	-0,65	1,21	-0,81	-1,55	-7,88
2021	-0,89	-0,49	1,07	1,57	1,51	0,27	-0,63	-0,67	-1,29	-0,88	1,10	1,33	1,95
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	-1,56	-1,73	-0,34	0,84	0,24	-0,71	-2,06	-2,01	-2,90	-2,55	-0,27	0,11	-14,04
2020	0,63	-1,53	-9,41	3,40	2,58	2,85	3,37	-0,44	-1,77	-0,52	3,92	3,93	6,38
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,08	-2,19	-9,98	3,25	2,51	2,11	2,48	-1,16	-2,89	-1,86	2,57	2,07	-4,27
2019	2,75	0,44	0,65	1,23	1,25	2,60	1,03	0,30	1,91	2,01	0,09	2,58	18,15
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	1,92	-0,46	-0,55	0,17	0,61	2,15	0,31	-0,32	1,46	1,37	-0,89	0,93	7,56
2018	2,74	0,16	0,62	0,32	-2,83	-0,62	1,78	0,19	0,78	1,99	0,94	0,34	6,48
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	1,93	-0,58	0,04	-0,39	-3,72	-2,37	0,94	-0,25	-0,14	1,03	0,68	-0,27	-3,44

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	35	46,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	40	53,33

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-9,41	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,36	2,63	-0,26	2,57
06 meses	7,89	4,97	2,92	3,24
12 meses	14,45	9,04	5,42	3,29
24 meses	17,75	19,69	-1,94	4,37
36 meses	23,61	40,24	-16,63	4,76
48 meses	46,00	57,31	-11,31	5,64
60 meses	49,09	72,29	-23,20	7,43
Desde 29/12/2017	64,90	94,97	-30,07	6,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

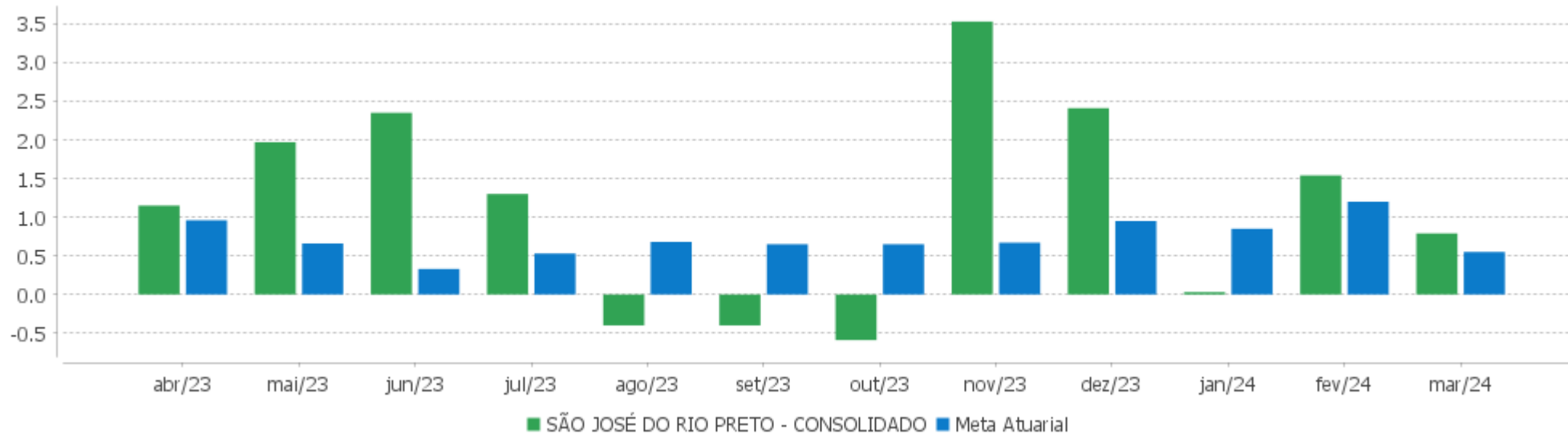


Patrimônio Líquido



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
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,46% a.a Var. IPCA p.p.	1,44 1,28	3,82 2,40	3,82 2,40	6,72 4,20	13,03 9,11		
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,77 0,15	2,39 -0,47	2,39 -0,47	5,11 -0,33	10,16 0,13	21,03 -1,03	31,72 -12,28
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,06 1,64	3,06 1,64	5,52 3,00	10,16 6,23	22,64 13,88	35,58 14,53
NTN-B 150545 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,07 1,66	3,07 1,66	2,64 0,13	4,20 0,28		
NTN-B 150824 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,80	2,96 1,54	2,96 1,54	5,14 2,63	9,55 5,63	21,47 12,72	37,51 16,47
NTN-B 150545 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,06 1,64	3,06 1,64	5,55 3,03	10,19 6,27	22,67 13,92	35,66 14,61
NTN-B 150850 (6,351000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,88	3,21 1,80	3,21 1,80	5,91 3,39	10,91 6,99	24,25 15,49	37,59 16,54
NTN-B 150826 (6,563000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,90	3,26 1,85	3,26 1,85	5,81 3,30	10,92 7,00	20,86 12,10	
NTN-B 150535 (4,875000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,77	2,86 1,45	2,86 1,45	5,07 2,56	9,27 5,35	20,71 11,95	36,46 15,41
NTN-B 150850 (5,832500%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,09 1,67	3,09 1,67	5,65 3,13	10,37 6,44	16,23 7,48	
NTN-B 150535 (4,825000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,77	2,85 1,44	2,85 1,44	5,04 2,53	9,22 5,30	20,60 11,84	36,28 15,23
NTN-B 150535 (6,100000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,87	3,15 1,74	3,15 1,74	5,69 3,17	10,55 6,63	16,51 7,75	
NTN-B 150850 (6,352000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,88	3,21 1,80	3,21 1,80	5,91 3,40	10,91 6,99	16,92 8,16	
NTN-B 150840 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,81	2,98 1,56	2,98 1,56	5,35 2,83	9,81 5,89	21,87 13,11	38,28 17,23
NTN-B 150840 (5,045000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,79	2,90 1,49	2,90 1,49	5,19 2,67	9,48 5,56	21,14 12,38	37,17 16,12
NTN-B 150545 (5,854000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,10 1,68	3,10 1,68	5,63 3,12	10,37 6,44	23,06 14,30	36,14 15,09
NTN-B 150535 (5,320000%)	0,97	2,97	2,97	5,30	9,74	21,74	38,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,81	1,55	1,55	2,78	5,81	12,98	17,00
NTN-B 150850 (6,042000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,86	3,14 1,72	3,14 1,72	5,75 3,24	10,59 6,66	19,97 11,21	
NTN-B 150545 (6,421000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,89	3,23 1,81	3,23 1,81	5,92 3,41	10,96 7,03	17,01 8,25	
NTN-B 150555 (6,351000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,88	3,21 1,80	3,21 1,80	5,93 3,41	10,93 7,00	20,54 11,78	33,46 12,41
NTN-B 150824 (7,408000%) Var. IPCA p.p.	1,12 0,96	3,46 2,04	3,46 2,04	6,17 3,66	11,73 7,81	19,10 10,35	
NTN-B 150545 (5,895000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,10 1,69	3,10 1,69	5,65 3,14	10,41 6,48	19,67 10,91	32,40 11,35
NTN-B 150840 (4,873000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,77	2,86 1,45	2,86 1,45	5,10 2,59	9,30 5,38	20,74 11,98	36,57 15,52
NTN-B 150840 (4,830000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,77	2,85 1,44	2,85 1,44	5,08 2,56	9,26 5,33	20,64 11,88	39,94 18,90
NTN-B 150850 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,07 1,66	3,07 1,66	5,61 3,10	10,29 6,37	22,87 14,11	35,92 14,87
NTN-B 150535 (4,965000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,78	2,89 1,47	2,89 1,47	5,12 2,60	9,37 5,44	20,92 12,16	36,78 15,73
NTN-B 150826 (5,525000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,82	3,02 1,60	3,02 1,60	5,31 2,79	9,85 5,93	22,11 13,35	38,56 17,52
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,65 -0,12	1,56 -0,50	1,56 -0,50	4,97 -0,11	9,42 -0,21	18,38 -2,63	25,22 -6,34
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06 -0,02	0,13 -0,05	0,13 -0,05	4,84 -0,10	11,64 -0,17	19,81 -0,40	24,88 -0,74
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,02	1,99 -0,06	1,99 -0,06	4,96 -0,13	9,37 -0,25	20,47 -0,54	30,69 -0,86
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04 -0,12	-0,29 -0,46	-0,29 -0,46	4,86 -0,08	11,64 -0,17	17,36 -2,85	18,98 -6,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,58 0,42	1,80 0,38	1,80 0,38	4,77 2,26	11,99 8,07	25,10 16,35	28,10 7,05
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06 -0,02	0,11 -0,07	0,11 -0,07	4,82 -0,12	11,56 -0,25	19,65 -0,56	24,65 -0,97
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,77 0,61	2,41 0,99	2,41 0,99	5,40 2,88	13,73 9,81	25,89 17,14	31,67 10,63
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,91	2,77	2,77	4,98	9,78	21,57	33,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. INPC + 6,00% p.p.	0,26	-0,25	-0,25	-0,31	0,30	0,47	-10,16
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,79 95,28	2,55 97,24	2,55 97,24	5,41 97,75	12,25 99,11	26,99 98,93	35,33 99,67
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,91 0,84	2,78 2,60	2,78 2,60	4,99 0,05	9,77 -2,04	20,11 -0,10	30,21 4,59
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,56 -0,01	-1,52 -0,01	-1,52 -0,01	4,78 -0,03	13,13 -0,25	18,45 -0,63	18,32 -1,18
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04 -0,04	0,09 -0,08	0,09 -0,08	4,78 -0,16	11,48 -0,33	19,47 -0,74	24,23 -1,39
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,74 -0,03	1,97 -0,09	1,97 -0,09	4,93 -0,16	9,33 -0,29	20,22 -0,78	30,15 -1,41
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,10 0,02	0,20 0,02	0,20 0,02	4,97 0,03	11,90 0,09	19,88 -0,33	24,98 -0,64
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 90,51	2,38 90,70	2,38 90,70	5,02 90,65	11,27 91,14	24,78 90,83	31,36 88,48
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,87 104,20	2,72 103,65	2,72 103,65	5,74 103,60	12,93 104,59	27,88 102,20	36,71 103,58
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,85 101,85	2,70 102,81	2,70 102,81	5,72 103,26	12,96 104,85	27,89 102,21	36,73 103,63
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,75 90,22	2,37 90,41	2,37 90,41	5,02 90,73	11,13 90,06	23,79 87,18	30,10 84,93
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	1,36 2,07	0,85 5,38	0,85 5,38	15,38 5,47	36,06 10,32	22,66 15,91	34,78 24,94
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,18 -0,47	-5,46 -0,92	-5,46 -0,92	6,70 -3,20	21,69 -4,05	4,77 -1,99	5,12 -4,71
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-0,44 0,27	-3,57 0,96	-3,57 0,96	10,25 0,35	25,42 -0,32	4,21 -2,55	6,17 -3,67
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,58 -0,88	-7,45 -2,92	-7,45 -2,92	5,40 -4,50	19,61 -6,13	-2,02 -8,78	4,15 -5,68
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-0,65 0,05	-4,44 0,09	-4,44 0,09	9,73 -0,17	25,09 -0,65	6,86 0,11	9,92 0,08
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-1,57 -0,86	-1,28 3,25	-1,28 3,25	11,56 1,66	27,07 1,33	23,55 16,79	30,73 20,90
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-0,11 -2,26	-5,08 -0,99	-5,08 -0,99	4,69 -2,24	9,20 -14,94	-19,36 -8,80	-18,39 0,94
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,48	14,98	14,98	23,77	32,44	27,69	18,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Global BDRX p.p.	-0,57	-0,90	-0,90	-1,11	-2,21	-2,86	-5,60
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,16 2,87	13,65 18,19	13,65 18,19	22,00 12,10	28,41 2,67	21,95 15,20	14,57 4,74
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	1,57 2,27	16,41 20,94	16,41 20,94	30,45 20,55	37,79 12,05	28,06 21,31	13,84 4,00
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	4,75 1,60	10,39 -0,79	10,39 -0,79	16,65 -2,31	9,69 -9,40	9,80 -6,26	-1,37 -3,37
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	3,66 0,52	13,55 2,37	13,55 2,37	22,89 3,92	25,66 6,58	28,77 12,70	21,74 19,73
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI Var. MSCI ACWI p.p.	3,35 0,20	10,46 -0,72	10,46 -0,72	23,57 4,61	30,44 11,35	28,35 12,29	45,62 43,61
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,16 1,54	15,24 12,38	15,24 12,38	29,37 23,92	37,99 27,96	27,89 5,83	-12,39 -56,39
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	3,39 0,03	11,13 -2,55	11,13 -2,55	25,56 3,31	36,04 10,29	34,42 12,11	62,08 46,10
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	3,44 0,07	11,26 -2,43	11,26 -2,43	25,85 3,60	36,73 10,98	41,02 18,71	71,15 55,17
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,11 -0,52	2,98 0,12	2,98 0,12	4,06 -1,39	5,24 -4,79	-4,93 -26,99	15,54 -28,46
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C Var. IPCA + 7,00% p.p.	4,55 3,85	2,22 -0,87	2,22 -0,87	3,43 -2,50			
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA + 8,00% p.p.	-2,38 -3,16	-6,87 -10,19	-6,87 -10,19	-13,67 -20,08			
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	8,45 7,83	7,01 4,15	7,01 4,15	5,00 -0,44	12,13 2,09		
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,02% p.p.	0,79 0,24	2,36 -0,26	2,36 -0,26	7,89 2,92	14,45 5,42	17,75 -2,09	23,61 -16,46
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,60
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,30
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30	D+30		0,20
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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA						
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2 du		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
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 MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		1,72
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	D+1 du	D+0	D+13 du	D+15 du		2,00
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Não se aplica	Não se aplica				
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA						
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C						
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	D+0	D+1	D+1	D+6		1,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		3,00

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	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

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	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (4,825000%)	5.730.677,57	4,825000	5.293.207,31	5,847100	-437.470,26
NTN-B 150535 (4,875000%)	5.784.228,83	4,875000	5.363.724,64	5,847100	-420.504,19
NTN-B 150535 (4,965000%)	5.691.575,93	4,965000	5.315.243,97	5,847100	-376.331,96
NTN-B 150535 (5,320000%)	5.696.639,52	5,320000	5.469.500,64	5,847100	-227.138,88
NTN-B 150535 (6,100000%)	5.468.573,96	6,100000	5.575.276,64	5,847100	106.702,68
NTN-B 150545 (5,690000%)	5.680.075,46	5,690000	5.550.530,97	5,891100	-129.544,49
NTN-B 150545 (5,750000%)	2.234.844,55	5,750000	2.199.017,04	5,891100	-35.827,51
NTN-B 150545 (5,854000%)	5.560.797,69	5,854000	5.537.283,88	5,891100	-23.513,81
NTN-B 150545 (5,895000%)	21.561.083,16	5,895000	21.570.679,23	5,891100	9.596,07
NTN-B 150545 (6,421000%)	5.433.285,14	6,421000	5.766.900,12	5,891100	333.614,98
NTN-B 150555 (6,351000%)	10.808.858,77	6,351000	11.515.443,33	5,874700	706.584,56
NTN-B 150824 (5,270000%)	6.940.073,81	5,270000	6.877.012,80	7,796100	-63.061,01
NTN-B 150824 (7,408000%)	10.319.207,23	7,408000	10.304.886,83	7,796100	-14.320,40
NTN-B 150826 (5,525000%)	11.326.414,59	5,525000	11.289.187,53	5,680000	-37.227,06
NTN-B 150826 (6,563000%)	10.577.077,81	6,563000	10.776.238,57	5,680000	199.160,76
NTN-B 150840 (4,830000%)	11.699.322,79	4,830000	10.529.520,00	5,857500	-1.169.802,79
NTN-B 150840 (4,873000%)	11.637.252,40	4,873000	10.520.807,11	5,857500	-1.116.445,29
NTN-B 150840 (5,045000%)	5.713.056,71	5,045000	5.258.225,34	5,857500	-454.831,37
NTN-B 150840 (5,360000%)	5.713.805,35	5,360000	5.432.483,01	5,857500	-281.322,34
NTN-B 150840 (5,690000%)	1.475.405,35	5,690000	1.450.695,14	5,857500	-24.710,21
NTN-B 150850 (5,760000%)	1.122.005,69	5,760000	1.104.182,82	5,883900	-17.822,87
NTN-B 150850 (5,832500%)	5.834.406,59	5,832500	5.795.868,72	5,883900	-38.537,87
NTN-B 150850 (6,042000%)	10.662.377,47	6,042000	10.880.346,93	5,883900	217.969,46
NTN-B 150850 (6,351000%)	10.485.688,04	6,351000	11.124.751,03	5,883900	639.062,99
NTN-B 150850 (6,352000%)	5.301.834,22	6,352000	5.625.658,72	5,883900	323.824,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
62	01/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.458.107,68	286.590,44080400	5,0877750000
63	01/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	16.474,20	6.758,69047100	2,4374840000
64	04/03/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	237.331,59	0,00	53.051,25727900	4,4736280000
65	04/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	239.424,04	98.188,71208500	2,4384070000
66	05/03/2024	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	39.174,84	0,00	39,17484000	1.000,0000000000
67	05/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	37.614,85	7.386,80310000	5,0921690000
68	06/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	44,33	18,16609200	2,4402600000
69	07/03/2024	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	532.208,61	0,00	111.361,14513000	4,7791230000
70	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	18.661,35	7.638,59912000	2,4430330000
71	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	60.665,11	0,00	11.886,71500100	5,1036060000
72	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.280,00	523,74060300	2,4439580000
73	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.104,26	1.269,69669900	2,4448830000
74	14/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	15.421,03	6.305,08340300	2,4458090000
75	15/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	15.933,39	6.512,09758500	2,4467370000
76	19/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	199.541,19	0,00	71.865,74980000	2,7765825940
77	20/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	10.780,01	0,00	3.881,00453100	2,7776339640
78	20/03/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	230.822,91	0,00	42.027,14414500	5,4922340000
79	20/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.106,78	860,07908600	2,4495190000
80	21/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	22.948,98	0,00	8.258,90017500	2,7786968620
81	21/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	42.499,50	8.302,37478200	5,1189570000
82	22/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	84.234,92	0,00	30.303,31816600	2,7797259540
83	25/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	204.954,29	83.579,11466900	2,4522190000
84	26/03/2024	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	0,00	2.116.716,16	227.907,20078600	9,2876230000
85	26/03/2024	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,00	4.551.396,72	2.118.408,20356400	2,1484984400
86	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	6.640.000,00	1.294.923,76309400	5,1277150000
87	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	182.925,19	74.541,91553200	2,4539910000
88	28/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.551.396,72	0,00	1.635.020,54002700	2,7836939100
89	28/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.338.995,77	0,00	1.040.813,15858600	5,1296390000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
90	28/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	126.256,75	51.430,92438400	2,4548800000
Total			11.308.100,65	15.672.920,52		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.315.302,17

Value-At-Risk: 1,34%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,03	0,45	5,00	0,22	-0,17	0,66	396.242.968,49	72,36
Artigo 8º	11,44	6,49	15,00	0,69	-0,12	-0,59	66.790.921,80	12,20
Artigo 9º	11,64	5,49	15,00	0,19	0,16	2,67	38.959.398,58	7,11
Artigo 10º	7,80	3,54	15,00	0,24	0,24	2,68	45.626.926,80	8,33
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	2,68	1,34		1,34	-0,02	0,79	547.620.215,67	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,45%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (4,825000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,37	0,93	5.730.677,57	1,05
NTN-B 150535 (4,875000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,39	0,93	5.784.228,83	1,06
NTN-B 150535 (4,965000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,41	0,94	5.691.575,93	1,04
NTN-B 150535 (5,320000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,52	0,97	5.696.639,52	1,04
NTN-B 150535 (6,100000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,75	1,03	5.468.573,96	1,00
NTN-B 150545 (5,690000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,63	0,99	5.680.075,46	1,04
NTN-B 150545 (5,750000%)	0,26	0,28	-0,00	0,29	0,65	1,00	2.234.844,55	0,41
NTN-B 150545 (5,854000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,68	1,01	5.560.797,69	1,02
NTN-B 150545 (5,895000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,69	1,01	21.561.083,16	3,94
NTN-B 150545 (6,421000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,85	1,05	5.433.285,14	0,99
NTN-B 150555 (6,351000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,83	1,04	10.808.858,77	1,97
NTN-B 150824 (5,270000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,51	0,96	6.940.073,81	1,27
NTN-B 150824 (7,408000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	1,14	1,12	10.319.207,23	1,88
NTN-B 150826 (5,525000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,58	0,98	11.326.414,59	2,07
NTN-B 150826 (6,563000%)	0,26	0,16	-0,00	0,17	0,89	1,06	10.577.077,81	1,93
NTN-B 150840 (4,830000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,37	0,93	11.699.322,79	2,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (4,873000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,39	0,93	11.637.252,40	2,13
NTN-B 150840 (5,045000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,44	0,95	5.713.056,71	1,04
NTN-B 150840 (5,360000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,53	0,97	5.713.805,35	1,04
NTN-B 150840 (5,690000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,63	0,99	1.475.405,35	0,27
NTN-B 150850 (5,760000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,65	1,00	1.122.005,69	0,20
NTN-B 150850 (5,832500%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,67	1,01	5.834.406,59	1,07
NTN-B 150850 (6,042000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,74	1,02	10.662.377,47	1,95
NTN-B 150850 (6,351000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,83	1,04	10.485.688,04	1,91
NTN-B 150850 (6,352000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,83	1,04	5.301.834,22	0,97
Sub-total	0,26	0,14	-0,00		0,65	1,00	188.458.568,63	34,41

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,17	0,08	0,00	0,13	-0,40	0,77	13.795.540,61	2,52
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,15	0,05	0,00	0,04	-0,26	0,79	5.207.958,27	0,95
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,42	0,33	-0,00	1,29	0,19	0,91	1.004.763,48	0,18
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,42	0,33	-0,00	0,35	0,18	0,91	579.849,22	0,11
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,29	1,22	0,02	0,01	-0,34	0,06	15.788.346,37	2,88
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,28	1,22	0,01	0,01	-0,34	0,06	3.602.570,54	0,66
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	2,85	1,63	0,01	0,46	-0,31	-0,04	5.579.006,40	1,02
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,93	0,54	0,01	0,00	-0,09	0,75	9.951.169,61	1,82
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,53	2,22	0,05	0,03	-0,39	-0,56	18.359.534,14	3,35
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	1,59	0,87	0,01	0,38	-0,12	0,65	11.021.937,47	2,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,17	0,40	0,00	0,41	-0,22	0,58	10.884.617,63	1,99
Sub-total	1,69	0,95	0,11		-0,32	0,29	95.775.293,74	17,49

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03	0,02	0,00	0,01	1,21	0,87	23.361.858,96	4,27
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	2,28	1,23	0,04	0,09	-0,35	0,04	25.383.309,06	4,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	2,31	1,26	0,06	0,07	-0,32	0,10	39.402.522,56	7,20
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-3,99	0,75	4.871.337,75	0,89
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,01	0,01	0,00	0,00	-6,51	0,75	119.605,74	0,02
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,93	0,54	0,01	0,01	-0,10	0,74	8.516.605,18	1,56
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,11	0,05	0,00	0,04	0,14	0,85	1.189.721,90	0,22
Sub-total	1,57	0,83	0,11		-0,31	0,34	102.844.961,15	18,78

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,46% a.a	5,09	0,25	0,00	0,27	0,12	1,44	6.075.578,11	1,11
Sub-total	5,09	0,25	0,00		0,12	1,44	6.075.578,11	1,11

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,59	0,52	0,00	0,53	-0,04	0,77	3.088.566,86	0,56
Sub-total	1,59	0,52	0,00		-0,04	0,77	3.088.566,86	0,56

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,49%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	11,17	6,22	0,02	1,36	-0,22	-1,58	2.246.425,70	0,41
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	16,46	8,63	0,16	2,70	-0,06	-0,11	12.015.388,88	2,19
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	10,98	6,17	0,19	1,24	-0,12	-0,44	19.684.812,60	3,59
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	9,10	7,21	0,03	3,45	-0,26	-1,57	3.072.301,80	0,56
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	10,92	5,45	0,04	1,33	-0,14	-0,65	4.794.628,00	0,88
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	11,70	6,37	0,20	1,44	-0,17	-1,18	19.663.133,13	3,59
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	11,54	6,88	0,06	3,25	0,05	1,36	5.314.231,69	0,97
Sub-total	11,44	6,49	0,69		-0,12	-0,59	66.790.921,80	12,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,54%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9,64	5,05	0,18	4,20	0,27	3,44	24.919.244,72	4,55
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9,64	5,09	0,05	4,20	0,27	3,39	6.930.598,59	1,27
Sub-total	9,64	5,06	0,24		0,27	3,43	31.849.843,31	5,82

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	27,54	0,12	-0,00	0,16	0,13	4,55	651.921,75	0,12
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	8,56	0,57	-0,00	0,58	-0,38	-2,38	291.396,42	0,05
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	28,80	0,26	0,00	0,28	0,26	8,45	1.254.418,48	0,23
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,37	0,20	0,00	0,21	-1,95	0,11	11.579.346,84	2,11
Sub-total	3,55	0,16	0,00		0,03	0,95	13.777.083,49	2,52

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,49%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	12,13	5,88	0,00	5,71	0,32	4,75	2.657.731,25	0,49
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,69	6,02	0,00	5,67	0,21	3,66	803.894,37	0,15
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,55	10,03	0,04	10,02	0,07	2,16	7.000.665,56	1,28
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	9,58	4,70	0,05	4,15	0,26	3,35	7.775.181,01	1,42
Sub-total	10,82	6,01	0,09		0,21	3,10	18.237.472,19	3,33

Artigo 9º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,38	5,51	0,03	0,56	0,21	3,48	7.029.275,51	1,28
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	12,61	6,40	0,06	8,48	0,06	1,57	11.007.861,45	2,01
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	12,20	5,55	0,01	7,44	0,11	2,16	2.684.789,43	0,49
Sub-total	12,36	5,89	0,10		0,12	2,28	20.721.926,39	3,78

(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 (%)