



LDB
EMPRESAS

TAMBAÚ
FEVEREIRO 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 29.02.2024.

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 81,19%

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 150830 (5,520000%)	2,88	0,06	0,99	2,01	2.802.573,70	2,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,650000%)	0,37	0,06	1,00	2,04	1.059.086,41	1,08
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,37	0,06	0,99	2,02	3.861.660,11	3,95

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 TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI	2,85	0,15	0,57	1,13	2.014.970,42	2,06	1.056.358.694,53	0,19
XP	XP	TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,06	0,04	0,80	1,77	909.925,39	0,93	10.065.375.688,38	0,01
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,31	0,16	0,44	1,10	3.653.932,69	3,74	4.190.498.364,43	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	4,22	0,20	0,60	0,25	521.463,63	0,53	997.345.488,00	0,05
SICREDI	SICREDI	SICREDI FC FI INSTITUCIONAL RF IMA B LP	4,08	0,13	0,54	0,87	2.121.106,61	2,17	629.097.664,44	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,94	0,13	0,54	0,07	1.555.790,23	1,59	5.024.622.442,53	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,28	0,05	0,74	1,66	688.668,77	0,70	8.662.829.991,66	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,28	0,05	0,75	1,62	6.300.251,62	6,45	797.998.578,98	0,79
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,72	0,10	0,44	1,16	4.521.670,46	4,63	5.893.692.124,08	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,08	0,16	0,50	-0,97	2.530.010,79	2,59	1.367.941.121,80	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,31	0,16	0,43	1,11	2.285.705,37	2,34	2.421.981.010,50	0,09
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,76	0,10	0,58	1,24	8.255.533,70	8,45	5.237.322.277,24	0,16
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,76	0,12	0,52	1,16	1.230.247,64	1,26	116.745.134,27	1,05
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,32	0,10	0,55	1,21	1.976.055,75	2,02	5.467.928.481,27	0,04
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,05	0,04	0,79	1,74	3.906.516,11	4,00	10.584.265.046,11	0,04
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,05	0,01	0,73	1,85	5.416.887,25	5,54	3.561.512.884,88	0,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,41	0,09	0,60	1,22	47.888.736,43	49,02		

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 REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,80	1,78	199.800,21	0,20	17.003.081.830,78	0,00
BRAM	BRDESCO	BRDESCO H FI RF NILO	4,36	0,14	0,46	-0,08	4.425.004,43	4,53	295.083.521,52	1,50
BRAM	BRDESCO	BRDESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,76	0,10	0,56	1,22	4.394.214,97	4,50	881.949.788,17	0,50
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,05	0,82	1,83	194.159,66	0,20	5.956.708.638,04	0,00
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,04	0,86	1,91	2.461.002,97	2,52	2.774.133.845,40	0,09
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,04	0,90	1,99	15.068.041,46	15,42	10.050.564.520,10	0,15
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,10	0,05	0,86	1,90	620.703,20	0,64	2.081.781.032,55	0,03
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,82	0,07	0,77	1,55	27.362.926,90	28,01		

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 ESPELHO SULAMÉRICA CRÉDITO ASG FIC DE FIF RF CREDITO PRIVADO IS RESPONSABILIDADE LIMITADA	1,80	0,06	0,56	0,56	210.783,88	0,22	362.514.776,33	0,06
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,80	0,06	0,56	0,56	210.783,88	0,22		
Renda Fixa			1,16	0,08	0,68	1,37	79.324.107,32	81,19		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

3,12%

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	15,63	-0,69	0,53	-5,96	208.343,90	0,21	1.379.356.707,83	0,02
BRAM	BRADERSCO	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	16,02	-0,78	0,89	-3,66	93.688,36	0,10	164.530.782,34	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,23	-0,56	2,29	-0,50	1.497.877,47	1,53	706.828.117,04	0,21
ALASKA	BTG PACTUAL	ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	18,36	-0,69	-0,87	-0,87	109.744,68	0,11	1.253.651.567,73	0,01
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	16,35	-0,54	0,60	-4,60	992.395,29	1,02	254.252.944,11	0,39
BRAM	BEM	BRADERSCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO	21,30	-0,42	2,27	-4,06	148.829,18	0,15	22.623.773,00	0,66
Sub-total Artigo 8º I			13,97	-0,57	1,44	-2,70	3.050.878,88	3,12		
Renda Variável			13,97	-0,57	1,44	-2,70	3.050.878,88	3,12		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,39%

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	14,40	0,95	6,27	11,12	797.251,19	0,82	2.238.336.630,68	0,04
BB	BB	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	13,61	0,97	6,80	11,43	3.063.315,82	3,14	1.437.426.182,66	0,21
BB	BB	BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I	14,18	0,45	4,41	5,18	3.363.433,23	3,44	379.642.015,57	0,89
Sub-total Artigo 9º III			11,44	0,72	5,62	8,40	7.224.000,24	7,39		
Investimentos no Exterior			11,44	0,72	5,62	8,40	7.224.000,24	7,39		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,29%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,53	0,04	0,79	1,69	2.527.308,38	2,59	15.007.882.582,29	0,02
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	12,58	0,61	5,64	7,33	1.317.856,15	1,35	179.131.370,23	0,74
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,39	0,61	5,70	7,48	2.258.729,08	2,31	1.780.767.536,84	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	8,21	-0,22	-0,36	-0,04	1.999.144,67	2,05	103.111.597,87	1,94
Sub-total Artigo 10º I			5,47	0,22	2,43	3,73	8.103.038,28	8,29		
Investimentos Estruturados			5,47	0,22	2,43	3,73	8.103.038,28	8,29		
Total			1,93	0,12	1,21	1,93	97.702.024,72	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	70.003,92
Sub-total Disponibilidades Financeiras	70.003,92
Total	97.772.028,64

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	3.861.660,11	3,95	0,00	22,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	47.888.736,43	49,02	0,00	35,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	27.362.926,90	28,01	0,00	8,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	210.783,88	0,22	0,00	5,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	79.324.107,32	81,19					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	3.050.878,88	3,12	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	3.050.878,88	3,12					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	7.224.000,24	7,39	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	7.224.000,24	7,39					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	8.103.038,28	8,29	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	8.103.038,28	8,29					15,00
Total		97.702.024,72	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	0,99 124,00	2,02 113,74	2,93 109,12	5,08 89,28	10,53 82,61	38.462,54	78.029,81
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,60 75,02	1,22 68,59	2,65 98,71	4,74 83,31	10,79 84,66	286.888,99	571.949,00
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,77 95,47	1,55 87,05	2,84 105,62	5,43 95,47	12,75 100,09	206.667,66	427.760,88
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,56 147,76	0,56 147,76				1.171,53	1.171,53
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,44 0,45	-2,70 1,15	2,75 1,43	9,25 -2,22	20,99 -1,97	43.692,12	-79.437,01
Artigo 9º III % do CDI	5,62 700,37	8,40 472,68	11,24 418,08	12,91 227,14	25,36 199,00	384.191,93	559.600,03
Artigo 10º I % do CDI	2,43 303,02	3,73 210,11	6,84 254,37	9,79 172,26	21,36 167,61	210.618,51	302.015,28
TAMBAÚ (Total)						1.171.693,28	1.861.089,52

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 150830 (5,520000%)	2.854.933,51	0,00	0,00	80.201,58	2.802.573,70	27.841,77	56.473,10
NTN-B 150830 (5,650000%)	1.078.977,11	0,00	0,00	30.511,47	1.059.086,41	10.620,77	21.556,71
	3.933.910,62	0,00	0,00	110.713,05	3.861.660,11	38.462,54	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IDKA2	4.501.645,08	0,00	0,00	0,00	4.521.670,46	20.025,38	51.843,04
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	8.208.282,37	0,00	0,00	0,00	8.255.533,70	47.251,33	101.088,27
BB PREV RF IRF M	3.638.002,73	0,00	0,00	0,00	3.653.932,69	15.929,96	39.718,62
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI	2.003.470,08	0,00	0,00	0,00	2.014.970,42	11.500,34	22.469,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	5.531.064,04	0,00	-154.335,06	0,00	5.416.887,25	40.158,27	100.728,71
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	6.253.557,91	0,00	0,00	0,00	6.300.251,62	46.693,71	100.449,85
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	3.876.086,93	0,00	0,00	0,00	3.906.516,11	30.429,18	66.740,46
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.223.865,49	0,00	0,00	0,00	1.230.247,64	6.382,15	14.064,85
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	532.514,52	0,00	0,00	14.212,07	521.463,63	3.161,18	1.295,72
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.517.490,38	0,00	0,00	0,00	2.530.010,79	12.520,41	-24.709,95
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.547.459,55	0,00	0,00	0,00	1.555.790,23	8.330,68	1.097,40
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	682.305,48	30.647,27	-29.499,80	0,00	688.668,77	5.215,82	12.391,54
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.261.017,83	14.838,29	0,00	0,00	2.285.705,37	9.849,25	24.857,83
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.952.019,06	13.153,62	0,00	0,00	1.976.055,75	10.883,07	23.030,73
SICREDI FC FI INSTITUCIONAL RF IMA B LP	2.106.915,34	2.814,94	0,00	0,00	2.121.106,61	11.376,33	15.119,74
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	902.743,46	0,00	0,00	0,00	909.925,39	7.181,93	15.837,17
	47.738.440,25	61.454,12	-183.834,86	14.212,07	47.888.736,43	286.888,99	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB INSTITUCIONAL FI RF	615.404,31	0,00	0,00	0,00	620.703,20	5.298,89	11.570,32
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	198.208,36	0,00	0,00	0,00	199.800,21	1.591,85	3.500,26
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	14.934.225,14	0,00	0,00	0,00	15.068.041,46	133.816,32	311.342,76
BRADESCO H FI RF NILO	4.404.732,58	0,00	0,00	0,00	4.425.004,43	20.271,85	-3.590,82
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	4.369.607,08	0,00	0,00	0,00	4.394.214,97	24.607,89	53.014,28
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	60.895,68	131.913,07	0,00	0,00	194.159,66	1.350,91	14.542,93
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	1.713.867,20	727.405,82	0,00	0,00	2.461.002,97	19.729,95	37.381,15
	26.296.940,35	859.318,89	0,00	0,00	27.362.926,90	206.667,66	

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 ESPELHO SULAMÉRICA CRÉDITO ASG FIC DE FIF RF CREDITO PRIVADO IS RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,00	209.612,35	0,00	0,00	210.783,88	1.171,53	1.171,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	0,00	209.612,35	0,00	0,00	210.783,88	1.171,53	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	0,00	110.713,05	0,00	0,00	109.744,68	-968,37	-968,37
BB AÇÕES AGRO FIC FI	986.507,52	0,00	0,00	0,00	992.395,29	5.887,77	-47.834,22
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	207.238,45	0,00	0,00	0,00	208.343,90	1.105,45	-13.210,02
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	92.863,88	0,00	0,00	0,00	93.688,36	824,48	-3.558,11
BRADESCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO	145.530,56	0,00	0,00	0,00	148.829,18	3.298,62	-6.303,98
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	1.464.333,30	0,00	0,00	0,00	1.497.877,47	33.544,17	-7.562,31
	2.896.473,71	110.713,05	0,00	0,00	3.050.878,88	43.692,12	

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 BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I	3.221.351,02	0,00	0,00	0,00	3.363.433,23	142.082,21	165.498,29
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	2.868.242,32	0,00	0,00	0,00	3.063.315,82	195.073,50	314.341,88
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	750.214,97	0,00	0,00	0,00	797.251,19	47.036,22	79.759,86
	6.839.808,31	0,00	0,00	0,00	7.224.000,24	384.191,93	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	3.401.478,99	0,00	-900.000,00	0,00	2.527.308,38	25.829,39	55.757,28
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	1.247.495,06	0,00	0,00	0,00	1.317.856,15	70.361,09	89.966,11
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.136.348,83	640,53	0,00	0,00	2.258.729,08	121.739,72	157.147,22
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	2.006.456,36	0,00	0,00	0,00	1.999.144,67	-7.311,69	-855,33
	8.791.779,24	640,53	-900.000,00	0,00	8.103.038,28	210.618,51	

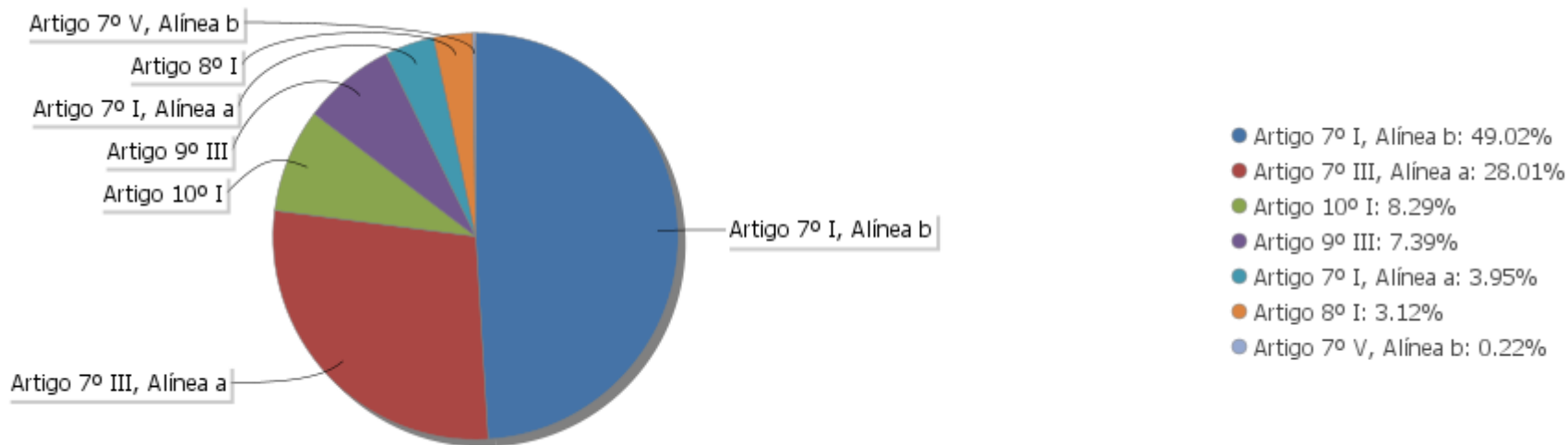
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

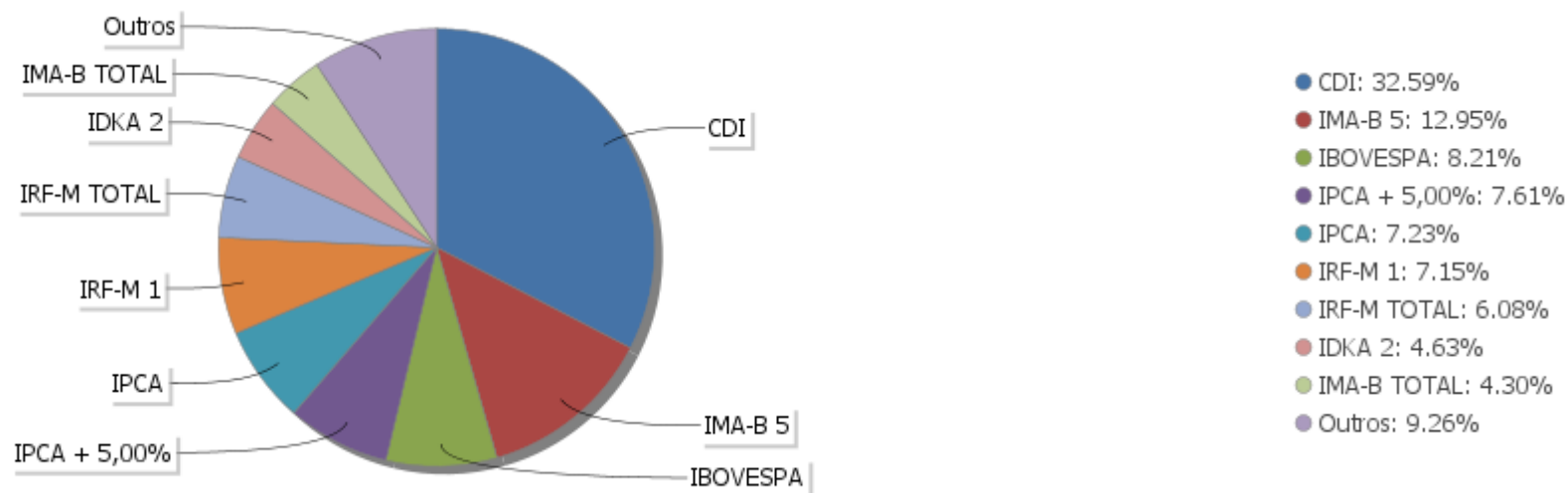
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	85.777.298,63	87,79		85.777.298,63	87,79	
de 31 dias a 365 dias	5.526.631,93	5,66		91.303.930,56	93,45	
acima de 365 dias	6.398.094,16	6,55		97.702.024,72	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

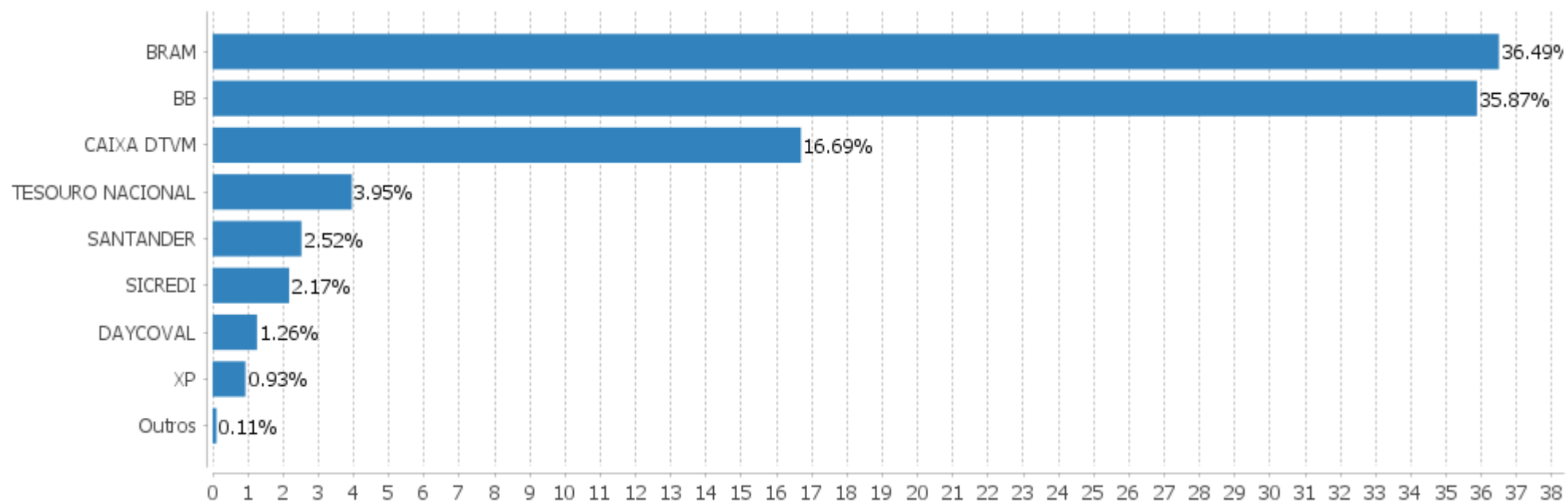


Alocação Por Estratégia



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	0,72	1,21											1,93
IPCA + 4,78%	0,83	1,02											1,86
p.p. indexador	-0,11	0,18											0,07
2023	1,89	0,52	1,47	0,91	1,04	1,82	1,25	0,55	0,00	-0,10	2,43	1,67	14,27
IPCA + 4,85%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52	0,66	0,64	0,64	0,66	0,94	9,63
p.p. indexador	0,95	-0,66	0,33	-0,04	0,39	1,50	0,73	-0,12	-0,64	-0,74	1,77	0,73	4,64
2022	-0,93	0,11	2,08	-0,64	0,80	-0,95	1,72	0,02	-0,77	2,44	0,95	-0,01	4,83
IPCA + 5,04%	0,95	1,39	2,06	1,44	0,90	1,08	-0,27	0,09	0,12	0,98	0,80	1,05	11,10
p.p. indexador	-1,88	-1,28	0,02	-2,07	-0,11	-2,04	1,99	-0,07	-0,88	1,46	0,15	-1,07	-6,26
2021	-0,04	-0,36	0,05	0,56	0,48	0,06	-0,08	0,00	0,24	-0,42	1,05	1,59	3,17
IPCA + 5,89%	0,71	1,27	1,46	0,77	1,31	1,01	1,47	1,38	1,64	1,71	1,41	1,26	16,52
p.p. indexador	-0,75	-1,63	-1,41	-0,21	-0,83	-0,95	-1,54	-1,37	-1,40	-2,13	-0,36	0,34	-13,35
2020	0,41	0,40	-0,54	0,38	0,84	0,58	0,70	0,02	-0,14	0,12	0,63	1,15	4,64
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	-0,30	-0,26	-1,11	0,24	0,76	-0,15	-0,19	-0,70	-1,26	-1,22	-0,72	-0,71	-6,01

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	15	30,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	70,00

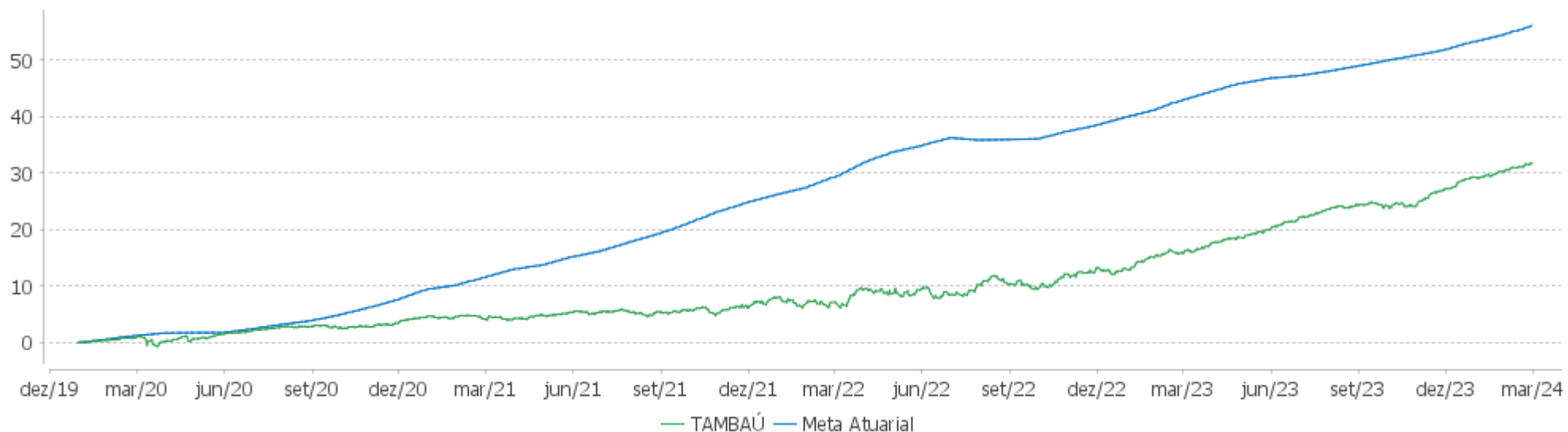
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,44	2022-10
Menor rentabilidade da Carteira	-0,95	2022-06

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,64	2,82	0,82	1,43
06 meses	6,05	4,82	1,23	2,06
12 meses	13,73	9,34	4,39	1,93
24 meses	23,13	21,22	1,91	3,19
36 meses	26,49	41,74	-15,25	3,01
48 meses	30,77	57,78	-27,01	2,82
Desde 31/12/2019	31,83	59,95	-28,12	2,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

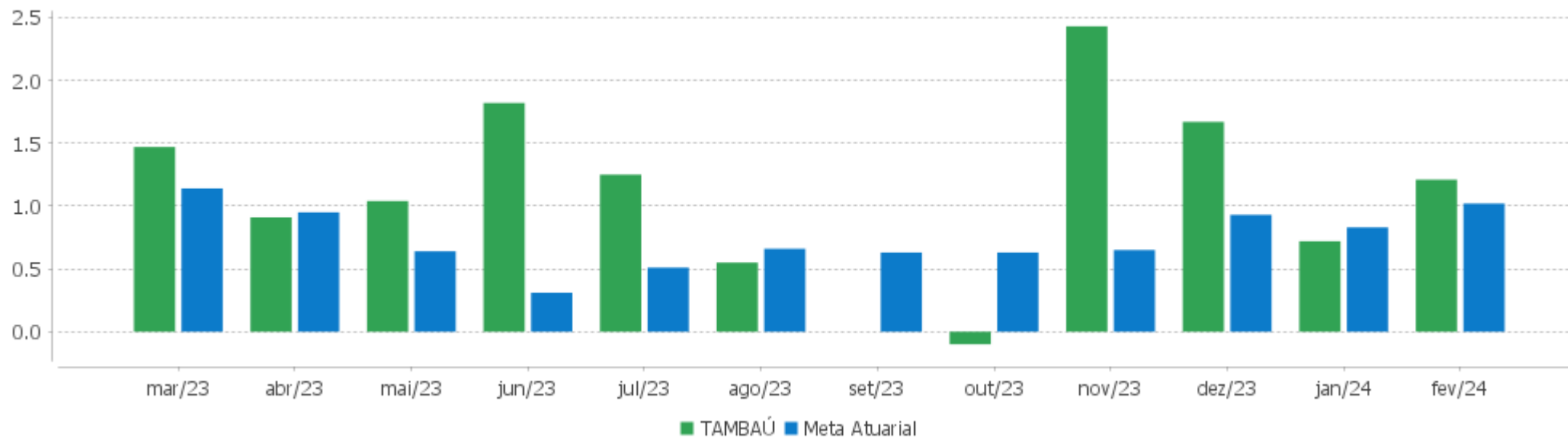


Patrimônio Líquido



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
BB ESPELHO SULAMÉRICA CRÉDITO ASG FIC DE FIF RF CREDITO PRIVADO IS RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	1,04 129,91	3,03 170,79	4,79 178,06				
NTN-B 150830 (5,520000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,32	2,01 0,92	2,92 1,27	5,04 2,58	7,33 3,00		
NTN-B 150830 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,33	2,04 0,94	2,96 1,30	5,10 2,65	10,55 6,22	19,91 9,74	32,34 10,56
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,54 -0,01	0,07 -0,03	2,80 -0,05	3,78 -0,09	14,54 -0,16	23,41 -0,40	24,22 -0,73
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,57 -0,47	1,13 -0,77	2,84 -0,03	3,96 -0,94	11,66 2,15		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,79 97,89	1,74 97,84	2,63 97,84	5,53 97,24	12,43 97,55	26,63 97,21	33,72 97,47
SICREDI FC FI INSTITUCIONAL RF IMA B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,54 -0,01	0,02 -0,07	2,82 -0,03	3,73 -0,14	14,59 -0,11	23,38 -0,43	23,89 -1,05
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,02	1,24 -0,04	2,70 -0,05	4,31 -0,11	10,24 -0,20	22,71 -0,50	30,07 -0,93
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,73 -0,31	1,85 -0,05	2,79 -0,08	5,19 0,29	10,20 0,69	22,19 0,80	
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,43 -0,03	1,11 -0,02	2,59 -0,04	5,64 -0,10	15,62 -0,23	27,21 -0,37	27,52 -0,68
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,50 -0,01	-0,97 -0,00	2,93 -0,02	3,41 0,04	17,93 -0,33	23,32 -0,69	17,56 -1,19
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA Var. IPCA p.p.	0,52 -0,15	1,16 0,06	2,57 0,91	4,04 1,58	10,01 5,69	22,07 11,90	28,47 6,69
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,44 0,02	1,16 -0,07	2,59 -0,11	4,30 -0,16	9,78 -0,33	22,13 -0,38	29,78 -0,94
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,75 -0,02	1,62 0,01	2,53 -0,00	5,44 -0,08	12,50 -0,20	26,62 -0,52	31,74 -0,82
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,55 -0,11	1,21 0,12	2,44 0,78	4,59 2,14	12,70 8,37	25,41 15,24	27,74 5,96
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,60 0,05	0,25 0,15	2,56 -0,29	3,19 -0,68	14,04 -0,66	20,05 -3,76	19,90 -5,05
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,74	1,66	2,56	5,48	12,54	26,69	31,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	0,06	0,03	-0,03	-0,17	-0,45	-0,76
BB PREV RF IRF M	0,44	1,10	2,57	5,62	15,44	26,85	27,01
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,03	-0,05	-0,12	-0,41	-0,73	-1,18
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,80	1,77	2,69	5,63	12,66	27,15	34,53
% do CDI	99,20	99,71	99,99	99,02	99,37	99,11	99,81
BB INSTITUCIONAL FI RF	0,86	1,90	2,92	6,02	13,16	27,49	35,37
% do CDI	107,36	106,93	108,50	105,82	103,27	100,35	102,24
BRADESCO H FI RF NILO	0,46	-0,08	2,65	3,28	14,59	22,15	21,12
% do CDI	57,38	-4,56	98,57	57,62	114,53	80,86	61,06
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,56	1,22	2,68	4,26	10,16	22,36	29,31
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,03	-0,05	-0,08	-0,16	-0,28	-0,85	-1,69
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,90	1,99	2,95	6,17	13,60	28,88	36,98
% do CDI	111,72	112,16	109,68	108,45	106,72	105,41	106,89
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,80	1,78	2,70	5,67	12,75	27,44	35,09
% do CDI	100,14	100,07	100,27	99,81	100,03	100,14	101,45
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,82	1,83	2,79	5,90	13,31	27,98	35,75
% do CDI	102,12	103,24	103,61	103,70	104,45	102,14	103,36
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,86	1,91	2,87	5,96	13,39	28,29	36,50
% do CDI	107,46	107,60	106,82	104,88	105,10	103,26	105,52
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	-1,81	-6,98	-2,17	7,74	28,59	28,22	44,74
Var. IBOVESPA p.p.	-2,80	-3,14	-3,49	-3,73	5,63	14,19	27,49
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	2,29	-0,50	6,12	13,69	30,84	29,10	42,83
Var. IBOVESPA p.p.	1,30	3,35	4,79	2,22	7,89	15,06	25,58
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	0,89	-3,66	1,72	10,04	17,89	9,25	7,56
Var. IBRX 100 p.p.	-0,07	-0,07	0,02	-1,72	-4,33	-2,92	-7,83
BB AÇÕES AGRO FIC FI	0,60	-4,60	-0,67	4,55	8,19	4,20	15,87
Var. IBOVESPA p.p.	-0,40	-0,75	-2,00	-6,92	-14,77	-9,83	-1,39
BRADESCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO	2,27	-4,06	1,87	3,41	4,47	-12,87	-16,11
Var. IBOVESPA p.p.	1,27	-0,21	0,54	-8,07	-18,49	-26,90	-33,37
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	0,53	-5,96	-1,05	7,60	17,03	4,59	15,06
Var. IBOVESPA p.p.	-0,46	-2,11	-2,38	-3,87	-5,93	-9,44	-2,19
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6,27	11,12	13,99	15,34	32,07	18,33	18,18
Var. Global BDRX p.p.	-0,03	-0,26	-0,55	-0,54	-1,21	-2,16	-4,51
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I	4,41	5,18	7,58	9,73	21,43	16,01	28,18
Var. MSCI World p.p.							
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	6,80	11,43	14,81	15,97	28,22	16,52	19,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	5,81	15,28	13,49	4,50	5,26	2,48	2,65
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	5,64 703,26	7,33 412,45	12,81 476,52	15,56 273,76	31,95 250,70	30,02 109,58	54,60 157,85
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	5,70 -0,11	7,48 -2,50	13,06 0,41	16,03 1,56	36,81 13,97	35,94 23,24	63,10 42,61
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,79 98,71	1,69 94,93	2,64 98,34	5,69 100,02	12,63 99,12	25,97 94,79	32,87 95,03
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,36 -1,36	-0,72 3,13	4,52 3,19	11,09 -0,38	16,70 -6,26	7,89 -6,15	
TAMBAÚ Var. IPCA + 4,78% p.p.	1,21 0,18	1,93 0,07	3,64 0,82	6,05 1,25	13,73 4,45	23,13 2,24	26,49 -13,55
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25
INPC + 6,00%							
IPCA + 6,00%	1,11	2,05	3,10	5,38	10,54	23,70	44,98

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro e Julho	2,00
BB AÇÕES AGRO FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+2	Será devida taxa de performance de 20% (vinte por cento), com base no resultado do FUNDO, sobre a rentabilidade que exceder 100% da variação do índice IBOVESPA, calculada e provisionada diariamente nos dias considerados úteis, após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I					Será devida taxa de performance de 10% (dez por cento), com base no resultado do FUNDO, sobre a rentabilidade que exceder 100% da variação do índice MSCI ACWI, calculada e	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	provisionada diariamente nos dias considerados úteis, após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.	1,00
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB ESPELHO SULAMÉRICA CRÉDITO ASG FIC DE FIF RF CREDITO PRIVADO IS RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+14	D+15	0,0050	
BB INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI			D+1 du	D+1 du		0,50
BB PREV RF IDKA2	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 M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	D+0	D+0	D+0	D+2 du	-	0,90
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du	-	1,50
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO					-	
BRADESCO H FI RF NILO	D+0	D+0	D+4 du	D+4 du		0,30
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	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
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	D+0	D+0	D+2 du	D+3 du		0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 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
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 CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2		
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	D+1 du	D+0	D+13 du	D+15 du		2,00
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
SICREDI FC FI INSTITUCIONAL RF IMA B LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES			D+0	D+0		0,20

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	0,76	1,61	2,53	5,52	12,71	27,14	32,56	36,64	45,55
IRF-M 1+	0,34	0,94	2,69	5,87	17,85	28,53	26,35	29,91	48,38
IRF-M TOTAL	0,46	1,13	2,63	5,74	15,85	27,58	28,20	32,06	47,72
IMA-B 5	0,59	1,28	2,76	4,42	10,44	23,21	31,00	39,16	56,09
IMA-B 5+	0,51	-0,96	2,94	3,37	18,26	24,00	18,75	19,88	46,30
IMA-B TOTAL	0,55	0,10	2,85	3,87	14,70	23,81	24,95	28,90	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,64	1,11	2,75	5,15	14,09	26,08	29,72	34,01	49,13
IDKA 2	0,42	1,23	2,70	4,46	10,12	22,51	30,72	39,80	55,45
IDKA 20	0,22	-3,13	3,25	3,06	28,07	25,16	9,21	7,12	36,25
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59	37,78	45,48

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25	23,85	34,98
IBRX 100	0,96	-3,59	1,70	11,76	22,23	12,17	15,38	23,37	37,13
IBRX 50	0,91	-3,27	1,87	12,03	21,50	12,09	17,44	26,99	35,38
SMALL CAP	0,47	-6,11	0,51	1,70	19,40	-4,74	-17,42	-15,61	14,52
Índice Consumo - ICON	0,09	-8,26	-2,77	-1,10	5,65	-26,51	-42,10	-41,50	-21,16
Índice Dividendos - IDIV	0,91	-2,64	4,09	13,07	26,16	32,52	44,70	39,59	69,79

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	5,80	9,98	12,65	14,47	22,83	12,70	20,50	91,09	143,96

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,79	1,47	5,77	4,58	19,64	22,58	16,40	13,37	38,01

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,79	7,79	10,70	12,33	15,81	5,67	4,39	64,46	101,55

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,67	1,09	1,66	2,45	4,33	10,17	21,78	28,11	33,24
INPC									
IGPM	-0,52	-0,45	0,29	1,76	-3,76	-1,97	13,83	46,78	56,79
SELIC	0,80	1,78	2,69	5,68	12,74	27,39	34,59	37,78	45,47

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	1,74	2,63	4,42	8,47	19,10	36,95	49,75	61,96
IPCA + 5,00%	1,04	1,90	2,87	4,90	9,50	21,39	40,92	55,57	69,86
IPCA + 5,50%	1,08	1,98	2,98	5,14	10,02	22,54	42,94	58,54	73,92
IPCA + 5,89%	1,10	2,04	3,08	5,33	10,42	23,44	44,53	60,88	77,14
IPCA + 6,00%	1,11	2,05	3,10	5,38	10,54	23,70	44,98	61,55	78,06
INPC + 4,00%									
INPC + 6,00%									

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150830 (5,520000%)	2.802.573,70	5,520000	2.798.246,51	5,550000	-4.327,19
NTN-B 150830 (5,650000%)	1.059.086,41	5,650000	1.064.550,30	5,550000	5.463,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
310	06/02/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	131.913,07	0,00	67.163,94117000	1,9640460000
304	06/02/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	727.405,82	0,00	2.862,45910692	254,1192006000
298	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.647,27	0,00	8.943,89069000	3,4266150000
311	09/02/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	13.153,62	0,00	6.860,60224200	1,9172690000
308	15/02/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	154.335,06	125.903,50793166	1,2258201740
305	16/02/2024	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	640,53	0,00	293,27383500	2,1840680000
313	16/02/2024	BB ESPELHO SULAMÉRICA CRÉDITO ASG FIC DE FIF RF CREDITO PRIVADO IS RESPONSABILIDADE LIMITADA	209.612,35	0,00	200.206,65362500	1,0469799390
312	19/02/2024	ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	110.713,05	0,00	31.831,90880529	3,4780525000
306	21/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.838,29	0,00	5.046,25816200	2,9404540000
303	23/02/2024	SICREDI FC FI INSTITUCIONAL RF IMA B LP	2.814,94	0,00	597,74608611	4,7092571000
307	26/02/2024	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,00	900.000,00	183.069,15526700	4,9161749760
299	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.499,80	8.566,79878700	3,4435030000
Total			1.241.738,94	1.083.834,86		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.046.592,71

Value-At-Risk: 1,07%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,65	0,61		0,36	0,46	0,68	79.324.107,32	81,19
Artigo 8º	15,37	7,77		0,18	0,04	1,44	3.050.878,88	3,12
Artigo 9º	13,14	5,67		0,28	0,37	5,62	7.224.000,24	7,39
Artigo 10º	4,49	3,49		0,25	0,36	2,43	8.103.038,28	8,29
TAMBAÚ		1,07		1,07			97.702.024,72	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,61%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830 (5,520000%)		0,11	-0,00	0,11			2.802.573,70	2,87
NTN-B 150830 (5,650000%)		0,11	-0,00	0,11			1.059.086,41	1,08
Sub-total	0,58	0,11	-0,00		0,33	0,99	3.861.660,11	3,95

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI		1,51	0,02	1,51			2.014.970,42	2,06
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES		0,02	0,00	0,01			909.925,39	0,93
BB PREV RF IRF M		1,16	0,03	0,03			3.653.932,69	3,74
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		2,03	0,01	0,55			521.463,63	0,53
SICREDI FC FI INSTITUCIONAL RF IMA B LP		1,86	0,03	0,05			2.121.106,61	2,17
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,81	0,02	0,01			1.555.790,23	1,59
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,09	0,00	0,04			688.668,77	0,70
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,10	0,00	0,02			6.300.251,62	6,45
BB PREV RF IDKA2		0,74	0,02	0,10			4.521.670,46	4,63
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,61	0,05	0,06			2.530.010,79	2,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,17	0,02	0,02			2.285.705,37	2,34
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,95	0,06	0,01			8.255.533,70	8,45
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA		0,92	0,01	0,92			1.230.247,64	1,26
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,61	0,01	0,62			1.976.055,75	2,02
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA		0,01	0,00	0,01			3.906.516,11	4,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,37	0,00	0,37			5.416.887,25	5,54
Sub-total	0,78	0,77	0,28		-0,26	0,60	47.888.736,43	49,02

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,01			199.800,21	0,20
BRADESCO H FI RF NILO		1,74	0,05	1,73			4.425.004,43	4,53
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		0,94	0,03	0,02			4.394.214,97	4,50
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			194.159,66	0,20
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,02	-0,00	0,02			2.461.002,97	2,52
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,06	0,00	0,06			15.068.041,46	15,42
BB INSTITUCIONAL FI RF		0,03	0,00	0,04			620.703,20	0,64
Sub-total	0,43	0,43	0,09		-0,08	0,77	27.362.926,90	28,01

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB ESPELHO SULAMÉRICA CRÉDITO ASG FIC DE FIF RF CREDITO PRIVADO IS RESPONSABILIDADE LIMITADA		0,33	-0,00	0,33			210.783,88	0,22
Sub-total	0,45	0,33	-0,00		0,40	0,56	210.783,88	0,22

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,49%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI		0,32	0,01	0,32			2.527.308,38	2,59
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,52	0,07	6,52			1.317.856,15	1,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,52	0,12	4,93			2.258.729,08	2,31
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO		3,92	0,05	4,81			1.999.144,67	2,05
Sub-total	4,49	3,49	0,25		0,36	2,43	8.103.038,28	8,29

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,67%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		5,75	0,02	0,48			797.251,19	0,82
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I		5,76	0,08	8,92			3.063.315,82	3,14
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC DE FIA - BDR ETF NÍVEL I		8,36	0,18	8,36			3.363.433,23	3,44
Sub-total	13,14	5,67	0,28		0,37	5,62	7.224.000,24	7,39

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,77%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		6,53	0,01	1,34			208.343,90	0,21
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA		6,79	0,00	0,50			93.688,36	0,10
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE		7,37	0,09	3,19			1.497.877,47	1,53
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA		9,73	0,01	4,28			109.744,68	0,11
BB AÇÕES AGRO FIC FI		9,40	0,06	5,16			992.395,29	1,02
BRADESCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO		8,99	0,01	4,63			148.829,18	0,15
Sub-total	15,37	7,77	0,18		0,04	1,44	3.050.878,88	3,12

(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 (%)