



LDB
EMPRESAS

IPAJM - CONSOLIDADO
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

83,61%

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	4,23	0,20	0,61	0,28	121.662.891,70	1,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	0,44	0,06	1,00	2,03	133.023.837,81	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,645000%)	0,44	0,06	1,00	2,03	132.972.079,80	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,681000%)	0,44	0,06	1,00	2,04	132.600.259,26	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,706000%)	0,44	0,06	1,01	2,04	44.114.288,19	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,475000%)	0,54	0,06	0,99	2,01	45.880.065,71	0,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,511000%)	0,54	0,06	0,99	2,01	45.686.649,69	0,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,531000%)	0,55	0,06	0,99	2,02	91.159.501,50	1,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,576000%)	0,55	0,06	1,00	2,02	136.021.490,22	1,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,662500%)	0,55	0,06	1,00	2,04	134.657.133,39	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,700000%)	0,55	0,06	1,00	2,04	134.071.937,88	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,752000%)	0,56	0,06	1,01	2,05	88.844.344,66	1,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,761000%)	0,56	0,06	1,01	2,05	88.751.907,54	1,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,790000%)	0,56	0,06	1,01	2,06	88.454.975,46	1,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,945000%)	0,57	0,06	1,02	2,08	86.892.339,74	1,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,616100%)	0,49	0,06	1,00	2,03	88.404.570,58	1,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621700%)	0,49	0,06	1,00	2,03	88.353.996,56	1,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,642300%)	0,49	0,06	1,00	2,03	88.168.276,58	1,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,661100%)	0,49	0,06	1,00	2,04	131.998.952,76	1,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,726000%)	0,50	0,06	1,01	2,05	131.128.834,38	1,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,385000%)	0,58	0,05	0,98	1,99	46.137.418,12	0,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,797000%)	0,61	0,06	1,01	2,06	131.093.187,30	1,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,841000%)	0,61	0,06	1,02	2,07	130.345.486,77	1,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,887200%)	0,61	0,06	1,02	2,07	86.378.142,34	1,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,931000%)	0,61	0,06	1,02	2,08	128.836.004,52	1,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,961600%)	0,61	0,06	1,02	2,08	128.328.826,59	1,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,041000%)	0,62	0,06	1,03	2,10	127.027.010,73	1,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,071500%)	0,62	0,06	1,03	2,10	126.532.391,76	1,70
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,56	0,07	0,99	1,98	2.937.526.801,54	39,55

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				
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,05	0,03	0,58	1,30	77.279.825,09	1,04	1.512.234.815,89	5,11
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	4,12	0,13	0,54	-0,11	5.799.165,59	0,08	234.189.159,32	2,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,29	0,05	0,74	1,61	547.662.596,44	7,37	8.089.813.404,09	6,77
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,96	0,13	0,53	0,05	73.867.990,63	0,99	5.326.196.241,75	1,39
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,94	0,13	0,54	0,07	71.833.920,26	0,97	5.024.622.442,53	1,43
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,28	0,05	0,74	1,66	266.760.048,11	3,59	8.662.829.991,66	3,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,74	0,10	0,58	1,24	111.816.075,07	1,51	7.766.523.482,49	1,44
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,27	0,05	0,75	1,64	1.867.349,60	0,03	172.732.636,30	1,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,32	0,10	0,55	1,21	110.174.704,28	1,48	5.467.928.481,27	2,01
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,08	0,07	0,67	1,34	1.267.061.675,07	17,06		

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	0,82	1,84	1.081.077.824,02	14,55	16.385.434.228,67	6,60
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4,27	0,13	0,57	-0,09	385.896,42	0,01	167.715.454,56	0,23
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,80	1,78	685.427.795,96	9,23	17.003.081.830,78	4,03
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,04	0,73	1,61	143.794,05	0,00	4.488.445.035,86	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,04	0,04	0,73	1,61	17.032,41	0,00	1.070.041.866,60	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,15	0,05	0,84	1,88	229.719.066,85	3,09	3.014.112.159,80	7,62
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,71	0,06	0,75	1,39	9.278.376,53	0,12	146.727.747,01	6,32
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,06	0,04	0,82	1,82	2.006.049.786,24	27,01		
Renda Fixa			0,35	0,06	0,87	1,79	6.210.638.262,85	83,61		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

9,31%

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	139.359.227,16	1,88	1.379.356.707,83	10,10
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	14,23	-0,55	0,94	-3,27	45.936.286,68	0,62	582.421.532,73	7,89
CAIXA DTVM	CEF	FIA BRASIL IBX-50	15,68	-0,83	0,84	-3,37	55.748.050,96	0,75	388.007.211,51	14,37
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	16,03	-0,68	0,89	-3,71	76.340.498,47	1,03	755.342.037,32	10,11
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13,26	-0,46	1,80	-1,33	101.688.649,18	1,37	981.220.828,10	10,36
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,41	-0,25	0,38	-6,23	88.739.441,85	1,19	665.961.173,63	13,33
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	17,07	-1,05	2,42	-1,01	14.620.426,76	0,20	142.338.379,07	10,27
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	11,95	0,33	5,26	7,02	123.119.801,13	1,66	1.309.583.542,04	9,40
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	16,29	-0,52	0,50	-4,71	46.345.432,84	0,62	815.611.004,66	5,68
Sub-total Artigo 8º I			13,96	-0,42	1,64	-2,38	691.897.815,03	9,31		
Renda Variável			13,96	-0,42	1,64	-2,38	691.897.815,03	9,31		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,92%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,40	0,95	6,27	11,12	102.410.814,77	1,38	2.238.336.630,68	4,58
BB	BB	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	13,61	0,97	6,80	11,43	113.355.794,72	1,53	1.437.426.182,66	7,89
BB	BB	BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	16,25	0,93	8,64	12,77	75.407.799,40	1,02	528.506.099,23	14,27
Sub-total Artigo 9º III			13,78	0,95	7,08	11,66	291.174.408,89	3,92		
Investimentos no Exterior			13,78	0,95	7,08	11,66	291.174.408,89	3,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,88%

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	87.940.628,63	1,18	15.007.882.582,29	0,59
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,39	0,61	5,70	7,48	126.061.420,57	1,70	1.780.767.536,84	7,08
Sub-total Artigo 10º I			6,86	0,37	3,63	5,02	214.002.049,20	2,88		
Investimentos Estruturados			6,86	0,37	3,63	5,02	214.002.049,20	2,88		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,27%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA RIO BRAVO FI DE FII - CXRI11	25,41	25,86	21,85	29,19	20.400.000,00	0,27	144.943.419,55	14,07
Sub-total Artigo 11º			25,41	25,86	21,85	29,19	20.400.000,00	0,27		
Fundos Imobiliários			32,50	25,86	21,85	29,19	20.400.000,00	0,27		
Total			1,83	0,11	1,29	1,89	7.428.112.535,97	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	2.937.526.801,54	39,55	40,00	50,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	1.267.061.675,07	17,06	5,00	17,00	40,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	2.006.049.786,24	27,01	10,00	17,00	50,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	6.210.638.262,85	83,61					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	691.897.815,03	9,31	2,00	7,80	20,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	691.897.815,03	9,31					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	291.174.408,89	3,92	2,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	291.174.408,89	3,92					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	214.002.049,20	2,88	2,00	2,50	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	214.002.049,20	2,88					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	20.400.000,00	0,27	0,00	0,20	3,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	20.400.000,00	0,27					5,00
Total		7.428.112.535,97	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	0,99 123,67	1,98 111,20	3,06 113,88	5,17 90,90	10,89 85,47	29.030.327,08	57.512.723,05
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,67 83,63	1,34 75,61	2,54 94,30	4,61 81,01	11,13 87,38	8.896.421,83	17.354.814,55
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,82 102,12	1,82 102,31	2,75 102,46	5,81 102,18	12,91 101,29	16.033.275,00	34.916.209,02
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,64 0,65	-2,38 1,47	3,15 1,83	9,81 -1,66	21,19 -1,77	11.165.144,47	-16.899.339,79
Artigo 9º III % do CDI	7,08 883,18	11,66 656,64	15,06 560,14	17,39 305,82	35,83 281,16	19.260.043,04	30.416.903,65
Artigo 10º I % do CDI	3,63 452,00	5,02 282,62	8,53 317,37	11,54 203,02	25,53 200,38	7.486.329,88	10.230.689,42
Artigo 11º % do CDI	21,85 2.724,71	29,19 1.643,02	33,32 1.239,20	26,80 471,36	81,40 638,84	3.656.000,00	4.614.000,00
IPAJM - CONSOLIDADO (Total)						95.527.541,30	138.145.999,90

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 (5,640000%)	131.706.092,16	0,00	0,00	0,00	133.023.837,81	1.317.745,65	2.651.606,79
NTN-B 150535 (5,645000%)	131.654.382,18	0,00	0,00	0,00	132.972.079,80	1.317.697,62	2.651.531,73
NTN-B 150535 (5,681000%)	131.282.953,14	0,00	0,00	0,00	132.600.259,26	1.317.306,12	2.651.401,86
NTN-B 150535 (5,706000%)	43.675.221,47	0,00	0,00	0,00	44.114.288,19	439.066,72	883.722,48
NTN-B 150545 (5,475000%)	45.430.922,66	0,00	0,00	0,00	45.880.065,71	449.143,05	903.109,94
NTN-B 150545 (5,511000%)	45.238.250,41	0,00	0,00	0,00	45.686.649,69	448.399,28	901.748,74
NTN-B 150545 (5,531000%)	90.263.522,94	0,00	0,00	0,00	91.159.501,50	895.978,56	1.802.118,18
NTN-B 150545 (5,576000%)	134.680.173,12	0,00	0,00	0,00	136.021.490,22	1.341.317,10	2.698.188,24
NTN-B 150545 (5,662500%)	133.321.083,33	0,00	0,00	0,00	134.657.133,39	1.336.050,06	2.688.752,46
NTN-B 150545 (5,700000%)	132.738.147,84	0,00	0,00	0,00	134.071.937,88	1.333.790,04	2.684.613,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (5,752000%)	87.957.257,54	0,00	0,00	0,00	88.844.344,66	887.087,12	1.786.016,00
NTN-B 150545 (5,761000%)	87.865.104,46	0,00	0,00	0,00	88.751.907,54	886.803,08	1.785.320,28
NTN-B 150545 (5,790000%)	87.569.306,52	0,00	0,00	0,00	88.454.975,46	885.668,94	1.783.265,32
NTN-B 150545 (5,945000%)	86.012.877,96	0,00	0,00	0,00	86.892.339,74	879.461,78	1.772.037,82
NTN-B 150830	124.390.751,86	0,00	0,00	3.487.025,33	121.662.891,70	759.165,17	345.210,15
NTN-B 150840 (5,616100%)	90.011.195,02	0,00	0,00	2.490.732,38	88.404.570,58	884.107,94	1.793.909,10
NTN-B 150840 (5,621700%)	89.960.746,24	0,00	0,00	2.490.732,38	88.353.996,56	883.982,70	1.793.679,94
NTN-B 150840 (5,642300%)	89.775.599,28	0,00	0,00	2.490.732,38	88.168.276,58	883.409,68	1.792.780,84
NTN-B 150840 (5,661100%)	134.410.524,45	0,00	0,00	3.736.098,57	131.998.952,76	1.324.526,88	2.688.102,57
NTN-B 150840 (5,726000%)	133.543.057,92	0,00	0,00	3.736.098,57	131.128.834,38	1.321.875,03	2.683.798,92
NTN-B 150850 (5,385000%)	46.929.251,04	0,00	0,00	1.245.366,19	46.137.418,12	453.533,27	919.065,82
NTN-B 150850 (5,797000%)	133.501.185,42	0,00	0,00	3.736.098,57	131.093.187,30	1.328.100,45	2.697.325,92
NTN-B 150850 (5,841000%)	132.756.687,75	0,00	0,00	3.736.098,57	130.345.486,77	1.324.897,59	2.691.125,07
NTN-B 150850 (5,887200%)	87.988.031,28	0,00	0,00	2.490.732,38	86.378.142,34	880.843,44	1.789.722,36
NTN-B 150850 (5,931000%)	131.254.197,33	0,00	0,00	3.736.098,57	128.836.004,52	1.317.905,76	2.678.441,07
NTN-B 150850 (5,961600%)	130.749.331,29	0,00	0,00	3.736.098,57	128.328.826,59	1.315.593,87	2.674.168,29
NTN-B 150850 (6,041000%)	129.453.554,70	0,00	0,00	3.736.098,57	127.027.010,73	1.309.554,60	2.663.046,12
NTN-B 150850 (6,071500%)	128.961.174,75	0,00	0,00	3.736.098,57	126.532.391,76	1.307.315,58	2.658.913,32
	2.953.080.584,06	0,00	0,00	44.584.109,60	2.937.526.801,54	29.030.327,08	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	113.462.251,76	235.417.369,43	-272.434.365,57	0,00	77.279.825,09	834.569,47	1.505.008,18
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	5.767.763,32	0,00	0,00	0,00	5.799.165,59	31.402,27	-6.366,92
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.853.508,84	0,00	0,00	0,00	1.867.349,60	13.840,76	30.145,94
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	73.478.029,89	0,00	0,00	0,00	73.867.990,63	389.960,74	34.313,51
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	543.634.896,00	0,00	0,00	0,00	547.662.596,44	4.027.700,44	8.687.667,82
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	111.174.919,96	0,00	0,00	0,00	111.816.075,07	641.155,11	1.374.361,62
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	71.449.276,69	0,00	0,00	0,00	71.833.920,26	384.643,57	50.668,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	264.794.726,32	0,00	0,00	0,00	266.760.048,11	1.965.321,79	4.358.116,34
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	109.566.876,60	0,00	0,00	0,00	110.174.704,28	607.827,68	1.320.899,23
	1.295.182.249,38	235.417.369,43	-272.434.365,57	0,00	1.267.061.675,07	8.896.421,83	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	9.209.661,00	0,00	0,00	0,00	9.278.376,53	68.715,53	127.152,81
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	383.701,07	0,00	0,00	0,00	385.896,42	2.195,35	-339,12
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	227.797.275,60	0,00	0,00	0,00	229.719.066,85	1.921.791,25	4.260.507,99
BB PREV RF FLUXO FIC	244.094,87	111.754,82	-213.787,63	0,00	143.794,05	1.731,99	4.840,81
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	682.932.542,38	0,00	-2.987.036,30	0,00	685.427.795,96	5.482.289,88	12.046.952,93
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	16.865,97	116.000,00	-116.000,00	0,00	17.032,41	166,44	313,13
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	997.821.329,86	74.700.109,60	0,00	0,00	1.081.077.824,02	8.556.384,56	18.465.772,43
	1.918.405.470,75	74.927.864,42	-3.316.823,93	0,00	2.006.049.786,24	16.033.275,00	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	14.274.910,11	0,00	0,00	0,00	14.620.426,76	345.516,65	-149.131,40
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	116.968.098,27	0,00	0,00	0,00	123.119.801,13	6.151.702,86	8.076.037,51
BB AÇÕES DIVIDENDOS	45.507.479,83	0,00	0,00	0,00	45.936.286,68	428.806,85	-1.551.050,82
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	75.663.676,86	0,00	0,00	0,00	76.340.498,47	676.821,61	-2.937.454,06
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	46.116.477,16	0,00	0,00	0,00	46.345.432,84	228.955,68	-2.290.242,01
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	138.619.802,92	0,00	0,00	0,00	139.359.227,16	739.424,24	-8.836.056,80
FIA BRASIL IBX-50	55.286.302,96	0,00	0,00	0,00	55.748.050,96	461.748,00	-1.941.843,77
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	88.402.274,29	0,00	0,00	0,00	88.739.441,85	337.167,56	-5.898.467,24
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	99.893.648,16	0,00	0,00	0,00	101.688.649,18	1.795.001,02	-1.371.131,20
	680.732.670,56	0,00	0,00	0,00	691.897.815,03	11.165.144,47	

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	106.137.240,25	0,00	0,00	0,00	113.355.794,72	7.218.554,47	11.631.994,84
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	69.408.343,46	0,00	0,00	0,00	75.407.799,40	5.999.455,94	8.539.365,28
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	96.368.782,14	0,00	0,00	0,00	102.410.814,77	6.042.032,63	10.245.543,53
	271.914.365,85	0,00	0,00	0,00	291.174.408,89	19.260.043,04	

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	87.249.897,97	0,00	0,00	0,00	87.940.628,63	690.730,66	1.458.398,25
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	119.265.821,35	0,00	0,00	0,00	126.061.420,57	6.795.599,22	8.772.291,17
	206.515.719,32	0,00	0,00	0,00	214.002.049,20	7.486.329,88	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA RIO BRAVO FI DE FII - CXRI11	16.860.000,00	0,00	0,00	0,00	116.000,00	20.400.000,00	3.656.000,00	4.614.000,00
	16.860.000,00	0,00	0,00	0,00	116.000,00	20.400.000,00	3.656.000,00	

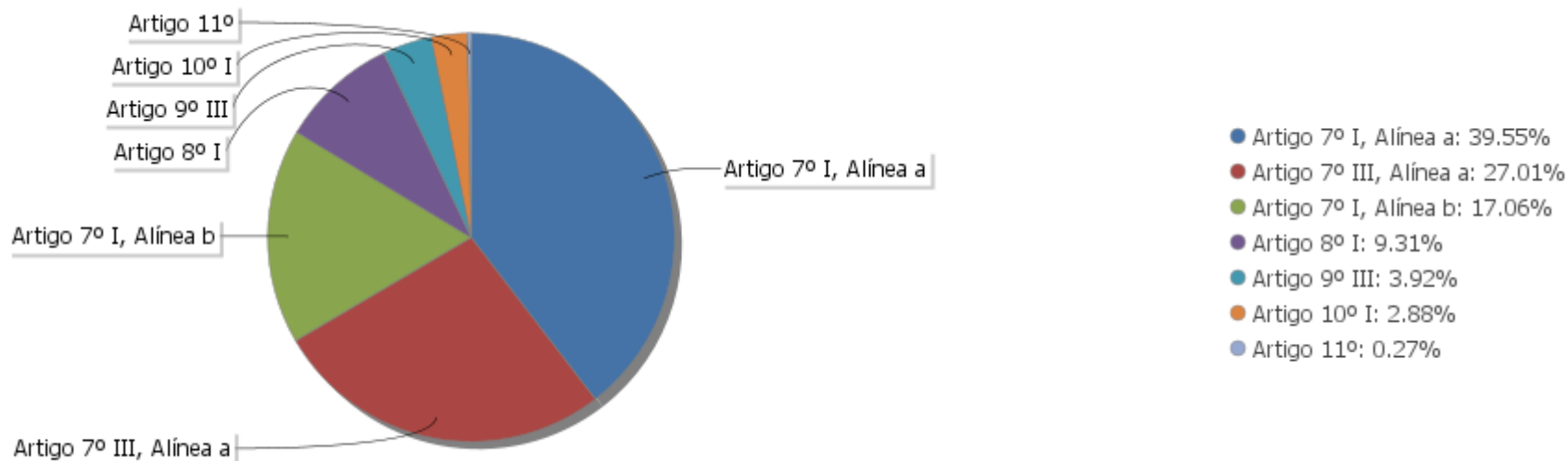
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

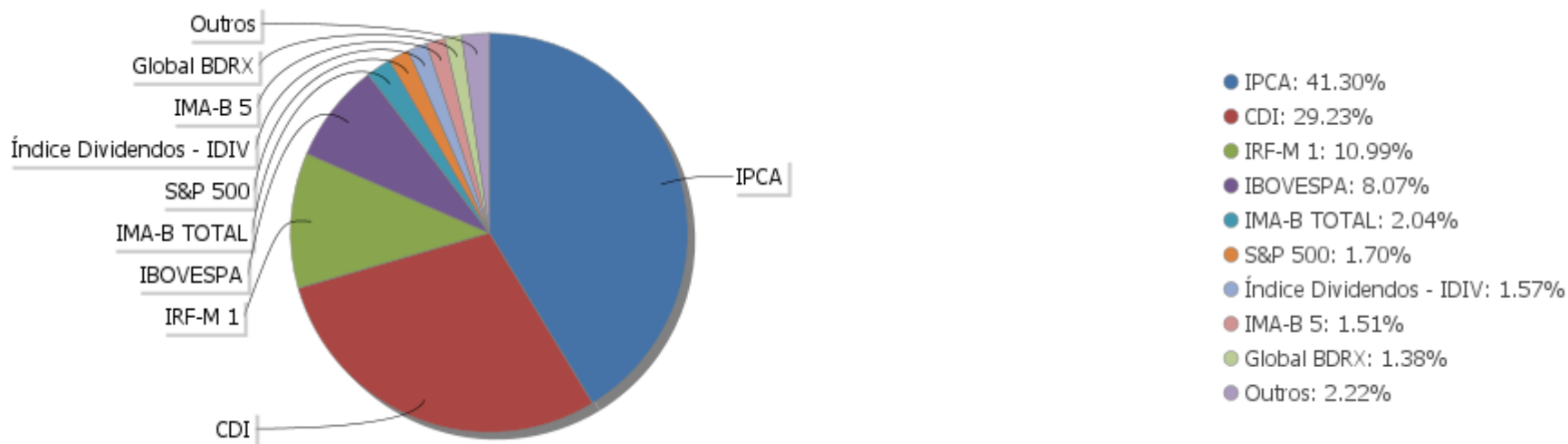
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	4.374.276.658,49	58,89		4.374.276.658,49	58,89	
de 31 dias a 365 dias	116.309.075,94	1,57		4.490.585.734,43	60,45	
acima de 365 dias	2.937.526.801,54	39,55		7.428.112.535,97	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

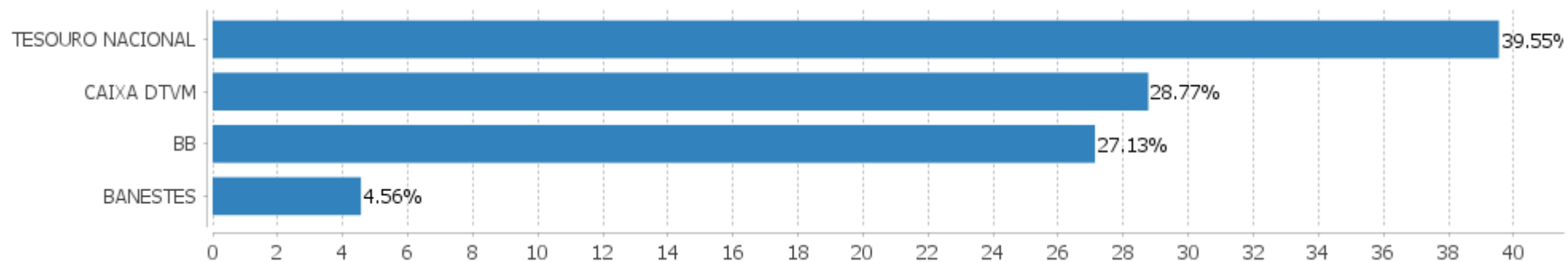


Alocação Por Estratégia



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	0,59	1,29											1,89
IPCA + 5,00%	0,85	1,20											2,06
p.p. indexador	-0,26	0,09											-0,17
2023	1,66	-0,12	1,08	0,97	1,62	1,77	1,14	0,32	0,35	0,18	2,25	1,64	13,61
IPCA + 5,00%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68	0,65	0,65	0,67	0,95	9,79
p.p. indexador	0,70	-1,31	-0,08	0,01	0,97	1,45	0,61	-0,36	-0,30	-0,47	1,58	0,69	3,82
2022	0,30	0,01	1,89	-1,01	0,89	-1,15	1,69	0,77	-0,29	1,71	0,52	0,11	5,52
IPCA + 5,00%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12	0,98	0,80	1,05	11,05
p.p. indexador	-0,65	-1,38	-0,16	-2,45	-0,01	-2,23	1,97	0,69	-0,40	0,73	-0,28	-0,94	-5,53
2021	-0,45	-0,70	1,06	0,83	1,07	0,14	-0,44	-0,37	-0,81	-0,58	0,54	1,28	1,55
IPCA + 5,00%	0,64	1,21	1,38	0,70	1,24	0,94	1,39	1,30	1,57	1,64	1,34	1,18	15,54
p.p. indexador	-1,09	-1,91	-0,32	0,13	-0,17	-0,80	-1,83	-1,67	-2,38	-2,22	-0,80	0,10	-13,99
2020	0,42	-0,92	-5,48	1,82	1,70	1,96	2,00	-0,26	-0,83	-0,22	2,51	2,29	4,80
IPCA + 5,00%	0,64	0,60	0,50	0,08	0,01	0,67	0,81	0,65	1,05	1,27	1,28	1,78	9,72
p.p. indexador	-0,22	-1,52	-5,98	1,74	1,70	1,29	1,19	-0,91	-1,88	-1,49	1,23	0,51	-4,92
2019	1,69	0,49	0,60	0,91	1,51	1,74	1,03	0,23	1,43	1,33	-0,10	1,02	12,53
IPCA + 5,50%	0,79	0,86	1,16	1,02	0,60	0,41	0,68	0,58	0,41	0,59	0,94	1,60	10,07
p.p. indexador	0,90	-0,37	-0,55	-0,11	0,91	1,32	0,35	-0,35	1,03	0,74	-1,04	-0,58	2,46
2018	1,29	0,58	1,11	0,44	-1,02	-0,00	1,12	0,18	0,62	1,87	0,53	0,84	7,80
IPCA + 5,75%	0,78	0,72	0,56	0,69	0,87	1,73	0,82	0,42	0,90	0,94	0,23	0,60	9,66
p.p. indexador	0,51	-0,14	0,56	-0,25	-1,89	-1,73	0,30	-0,24	-0,29	0,92	0,29	0,25	-1,86
2017	1,30	1,89	1,24	0,45	0,35	0,70	2,20	1,13	1,07	0,43	0,19	0,82	12,40
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,41	1,15	0,45	-0,11	-0,47	0,45	1,48	0,40	0,44	-0,48	-0,55	-0,09	3,35
2016	1,92	1,40	1,66	1,65	0,93	1,19	1,45	1,23	1,28	0,82	0,38	1,47	16,48
IPCA + 6,00%	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	0,86	1,01	0,98	0,57	0,72	0,64	0,81	12,64
p.p. indexador	0,18	0,05	0,72	0,57	-0,34	0,33	0,44	0,26	0,71	0,10	-0,26	0,66	3,84
2015	1,51	0,80	0,65	1,24	1,39	0,73	1,09	-0,17	0,72	1,96	0,91	1,67	13,20
IPCA + 6,00%	1,73	1,64	1,84	1,18	1,21	1,28	1,16	0,71	1,03	1,31	1,48	1,47	17,26
p.p. indexador	-0,22	-0,85	-1,19	0,06	0,19	-0,55	-0,07	-0,88	-0,31	0,64	-0,56	0,19	-4,06
2014	-1,15	2,71	0,90	1,75	2,50	0,76	1,06	2,33	-0,76	1,18	0,88	0,18	12,97
IPCA + 6,00%	1,06	1,16	1,36	1,14	0,95	0,87	0,54	0,74	1,08	0,96	0,98	1,29	12,82
p.p. indexador	-2,21	1,56	-0,46	0,61	1,55	-0,11	0,52	1,59	-1,84	0,22	-0,09	-1,12	0,15
2013	0,58	-0,48	-0,65	1,00	-1,62	-1,42	0,81	-0,81	0,75	0,72	-1,14	0,87	-1,43
IPCA + 6,00%	1,37	1,02	0,94	1,06	0,86	0,72	0,56	0,75	0,84	1,11	1,01	1,41	12,29
p.p. indexador	-0,80	-1,50	-1,58	-0,07	-2,48	-2,15	0,25	-1,56	-0,08	-0,38	-2,14	-0,54	-13,72
2012	1,48	1,67	1,59	3,31	1,29	-0,23	2,31	1,35	1,11	2,72	0,68	1,57	20,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
IPCA + 6,00%	1,07	0,89	0,72	1,11	0,87	0,54	0,94	0,95	1,01	1,10	1,07	1,26	12,16
p.p. indexador	0,41	0,78	0,87	2,20	0,42	-0,77	1,37	0,41	0,10	1,61	-0,38	0,31	8,35
2011	0,11	0,67	1,40	0,53	1,40	0,17	0,81	4,20	1,08	1,30	1,60	0,51	14,62
IPCA + 6,00%	1,32	1,27	1,28	1,21	0,98	0,64	0,65	0,91	1,02	0,90	0,99	1,01	12,87
p.p. indexador	-1,21	-0,60	0,12	-0,68	0,42	-0,47	0,17	3,30	0,06	0,40	0,61	-0,51	1,76

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

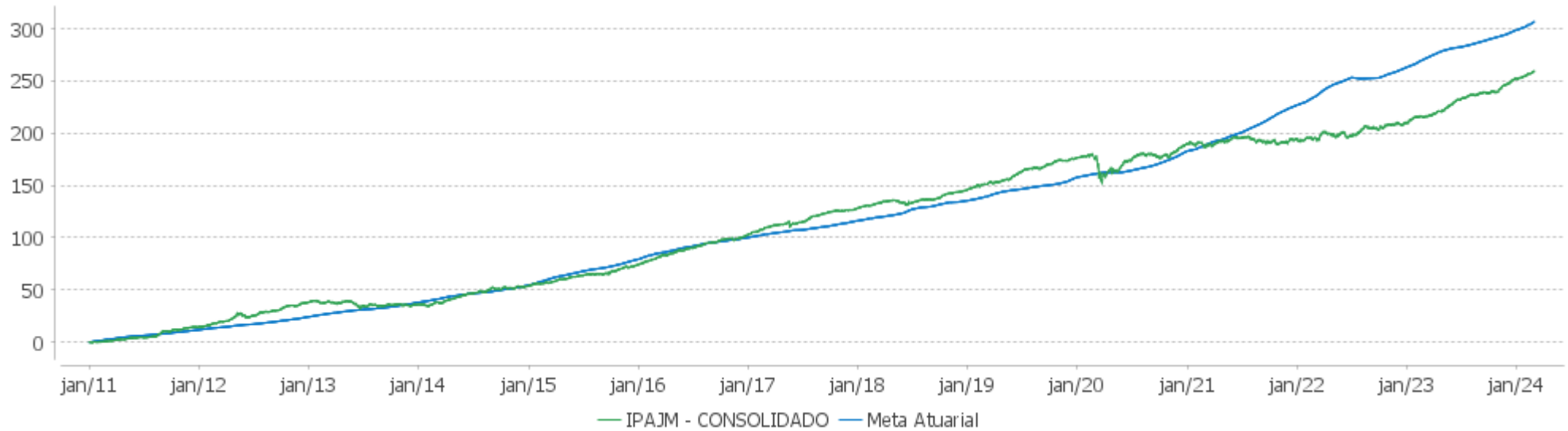
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	76	48,10
Meses abaixo - Meta Atuarial	82	51,90

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,20	2011-08
Menor rentabilidade da Carteira	-5,48	2020-03

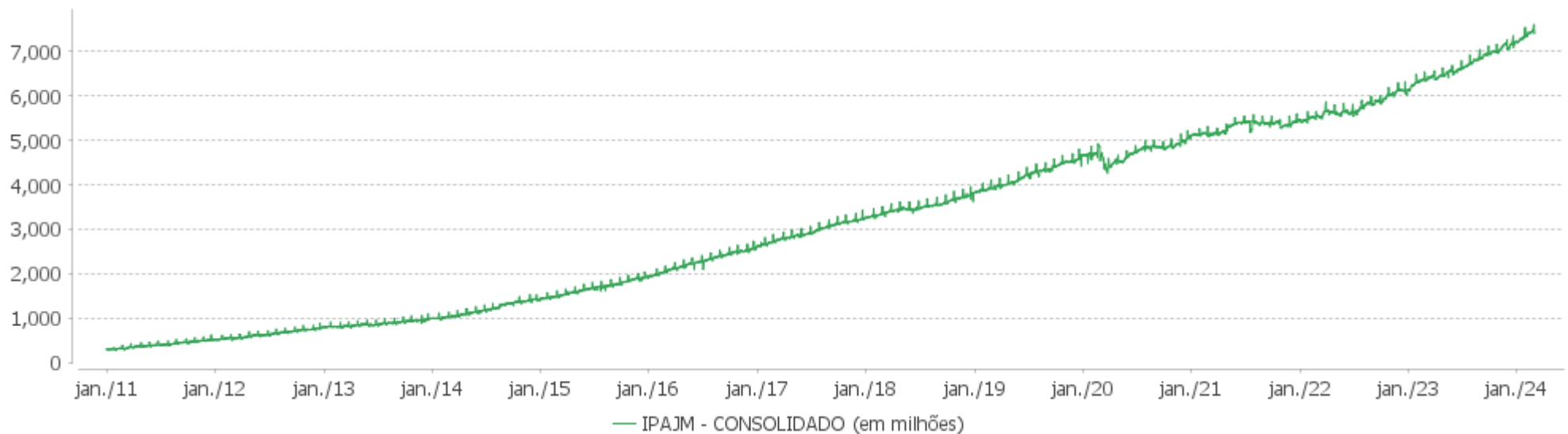
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,55	3,03	0,52	1,48
06 meses	6,44	5,07	1,37	1,82
12 meses	14,00	9,68	4,32	1,83
24 meses	21,78	21,58	0,19	2,80
36 meses	25,48	41,15	-15,67	3,08
48 meses	30,66	55,82	-25,16	4,74
60 meses	43,15	70,81	-27,66	4,36
Desde 31/12/2010	259,51	339,83	-80,33	3,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

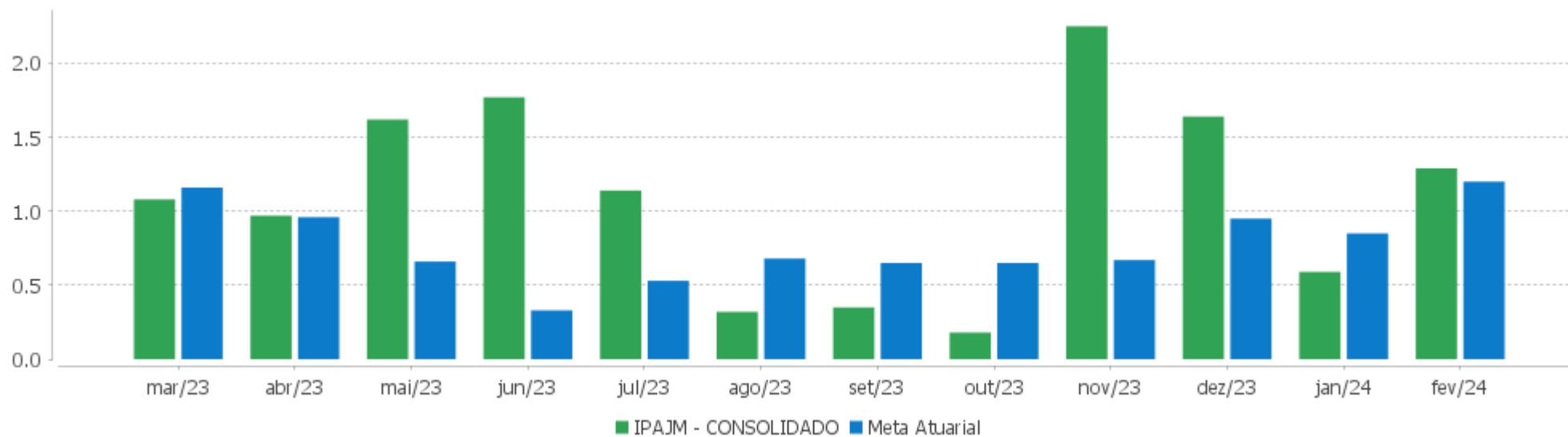


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150840 (5,661100%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,04 0,78	3,03 1,21	5,18 2,57	10,64 6,15	23,49 13,14	36,42 14,44
NTN-B 150545 (5,511000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,16	2,01 0,76	3,03 1,21	5,14 2,52	10,52 6,02	23,17 12,83	36,05 14,07
NTN-B 150840 (5,621700%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,03 0,78	3,02 1,20	5,16 2,55	10,60 6,11	23,39 13,05	36,30 14,32
NTN-B 150850 (5,797000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,06 0,81	3,13 1,31	5,31 2,69	10,85 6,35	23,87 13,53	36,95 14,97
NTN-B 150850 (6,071500%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,20	2,10 0,85	3,20 1,38	5,45 2,83	11,14 6,65	24,52 14,18	37,74 15,76
NTN-B 150850 (5,931000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,83	3,16 1,34	5,38 2,76	10,99 6,50	24,19 13,85	37,34 15,36
NTN-B 150535 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,03 0,78	3,00 1,18	5,14 2,52	10,59 6,09	23,40 13,05	36,25 14,28
NTN-B 150545 (5,576000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,02 0,77	3,04 1,22	5,17 2,56	10,59 6,09	23,32 12,98	36,25 14,27
NTN-B 150535 (5,681000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,04 0,79	3,01 1,19	5,16 2,54	10,63 6,13	23,49 13,15	36,39 14,41
NTN-B 150850 (5,887200%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,82	3,15 1,33	5,36 2,74	10,95 6,45	24,09 13,74	37,21 15,23
NTN-B 150840 (5,726000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,05 0,79	3,05 1,23	5,22 2,60	10,71 6,22	23,64 13,29	36,62 14,64
NTN-B 150545 (5,700000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,04 0,79	3,08 1,26	5,23 2,62	10,72 6,22	23,62 13,27	36,61 14,63
NTN-B 150545 (5,531000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,16	2,02 0,76	3,03 1,21	5,15 2,53	10,54 6,04	23,22 12,87	36,11 14,13
NTN-B 150850 (5,961600%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,83	3,17 1,35	5,39 2,78	11,03 6,53	24,26 13,92	37,42 15,44
NTN-B 150850 (5,841000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,81	3,14 1,32	5,33 2,71	10,90 6,40	23,98 13,63	37,08 15,10
NTN-B 150850 (5,385000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,99 0,74	3,02 1,20	5,10 2,48	10,41 5,91	22,90 12,55	39,44 17,46
NTN-B 150840 (5,642300%)	1,00	2,03	3,03	5,17	10,62	23,44	36,36

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.	0,17	0,78	1,21	2,56	6,13	13,10	14,38
NTN-B 150545 (5,475000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,16	2,01 0,75	3,02 1,20	5,12 2,50	10,48 5,98	23,09 12,74	35,95 13,97
NTN-B 150545 (5,662500%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,04 0,78	3,07 1,25	5,22 2,60	10,68 6,18	23,53 13,18	36,50 14,52
NTN-B 150545 (5,945000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,83	3,14 1,32	5,36 2,74	10,98 6,48	24,19 13,85	37,34 15,36
NTN-B 150535 (5,706000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,04 0,79	3,01 1,19	5,17 2,55	10,66 6,16	23,55 13,21	36,47 14,49
NTN-B 150545 (5,761000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,05 0,80	3,09 1,27	5,27 2,65	10,79 6,29	23,76 13,42	36,79 14,81
NTN-B 150545 (5,752000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,05 0,80	3,09 1,27	5,26 2,64	10,78 6,28	23,74 13,39	36,77 14,79
NTN-B 150830 Var. IPCA p.p.	0,61 -0,22	0,28 -0,97	2,62 0,80	3,28 0,67	14,28 9,78	24,34 13,99	24,56 2,58
NTN-B 150840 (5,616100%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,03 0,78	3,02 1,20	5,16 2,54	10,60 6,10	23,38 13,04	36,28 14,30
NTN-B 150535 (5,645000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,03 0,78	3,00 1,18	5,14 2,52	10,59 6,10	23,41 13,06	36,27 14,29
NTN-B 150545 (5,790000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,06 0,80	3,10 1,28	5,28 2,66	10,82 6,32	23,83 13,48	36,88 14,90
NTN-B 150850 (6,041000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,20	2,10 0,84	3,19 1,37	5,43 2,82	11,11 6,61	24,45 14,11	37,65 15,67
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA % do CDI	0,58 72,93	1,30 72,92	1,97 73,09	4,19 73,64	9,43 74,02	20,07 73,26	24,13 69,76
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
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,54 -0,01	-0,11 -0,21	2,76 -0,09	3,77 -0,10	14,48 -0,22	23,10 -0,70	19,52 -5,43
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,75 -0,02	1,64 0,04	2,54 0,01	5,46 -0,06	12,64 -0,06	27,05 -0,09	32,05 -0,50
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,02	1,24 -0,03	2,70 -0,06	4,32 -0,11	10,29 -0,15	22,91 -0,30	30,38 -0,62
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,55 -0,28	1,21 -0,04	2,44 0,62	4,59 1,98	12,70 8,20	25,41 15,07	27,74 5,76
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,74	1,61	2,51	5,40	12,42	26,44	31,50

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	0,01	-0,02	-0,11	-0,28	-0,70	-1,06
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,74	1,66	2,56	5,48	12,54	26,69	31,80
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	0,06	0,03	-0,03	-0,17	-0,45	-0,76
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,53	0,05	2,79	3,75	14,39	23,18	23,98
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,05	-0,06	-0,12	-0,31	-0,63	-0,97
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	0,57	-0,09	2,85	3,80	15,50	23,26	22,42
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,02	-0,19	-0,00	-0,06	0,80	-0,54	-2,52
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,84	1,88	2,84	5,92	12,61	25,52	33,97
% do CDI	105,19	105,56	105,54	104,09	98,94	93,14	98,20
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,75	1,39	2,70	5,30	11,93	23,47	28,39
% do CDI	93,03	78,22	100,39	93,20	93,61	85,66	82,08
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
BB PREV RF FLUXO FIC	0,73	1,61	2,45	5,17	11,62	24,88	30,51
% do CDI	90,72	90,86	91,05	90,89	91,22	90,81	88,21
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82	1,84	2,78	5,90	13,25	27,96	35,67
% do CDI	102,83	103,36	103,30	103,82	103,95	102,05	103,12
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,73	1,61	2,44	5,18	11,42	23,83	29,29
% do CDI	90,41	90,57	90,60	91,04	89,61	86,97	84,68
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	2,42	-1,01	3,74	12,25	16,78	6,38	-22,89
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,51	1,63	-0,34	-0,82	-9,38	-26,13	-67,59
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	0,38	-6,23	0,26	1,15	18,13	-6,20	-19,00
Var. SMALL CAP p.p.	-0,09	-0,12	-0,24	-0,55	-1,27	-1,46	-1,58
FIA BRASIL IBX-50	0,84	-3,37	2,28	10,90	17,48	6,90	10,38
Var. IBOVESPA p.p.	-0,16	0,48	0,96	-0,57	-5,48	-7,14	-6,88
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
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	5,26	7,02	12,45	14,41	31,01	28,35	50,73
Var. IBOVESPA p.p.	4,27	10,87	11,13	2,93	8,05	14,31	33,48
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	1,80	-1,33	4,50	11,77	25,83	22,59	28,73
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,89	1,31	0,42	-1,30	-0,32	-9,93	-15,96
BB AÇÕES DIVIDENDOS	0,94	-3,27	2,88	11,15	22,22	16,76	16,25
Var. IBOVESPA p.p.	-0,05	0,58	1,55	-0,33	-0,73	2,72	-1,01
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	0,89	-3,71	1,61	10,84	21,10	10,25	11,61
Var. IGCT p.p.	-0,15	-0,19	-0,36	-0,69	-2,16	-2,96	-4,08
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	0,50	-4,71	0,63	8,90	13,77	1,74	-8,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,50	-0,86	-0,70	-2,57	-9,18	-12,29	-25,99
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	6,27 -0,03	11,12 -0,26	13,99 -0,55	15,34 -0,54	32,07 -1,21	18,33 -2,16	18,18 -4,51
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI Var. IBOVESPA p.p.	8,64 7,65	12,77 16,62	16,92 15,60	22,59 11,12	55,95 32,99	34,34 20,31	4,02 -13,24
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	6,80 5,81	11,43 15,28	14,81 13,49	15,97 4,50	28,22 5,26	16,52 2,48	19,90 2,65
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
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
CAIXA RIO BRAVO FI DE FII - CXRI11 Var. IPCA p.p.	8,19 7,36	14,50 13,24	18,16 16,34	12,38 9,76	60,77 56,28	68,83 58,49	20,96 -1,02
IPAJM - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,29 0,09	1,89 -0,17	3,55 0,52	6,44 1,37	14,00 4,32	21,78 0,19	25,48 -15,67
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%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,50
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	D+1 du	D+0	D+30	D+34		0,00
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA			D+0	D+0		3,50
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,15
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI			D+1 du	D+1 du		0,50
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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
CAIXA RIO BRAVO FI DE FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica				
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 IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
LP						
FIA BRASIL IBX-50	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72

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	0,83	1,25	1,82	2,62	4,50	10,34	21,98	28,32	33,45
INPC	0,81	1,38	1,94	2,28	3,86	9,54	21,37	28,92	33,97
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%	1,13	1,90	2,79	4,58	8,64	19,29	37,17	49,99	62,22
IPCA + 5,00%	1,20	2,06	3,03	5,07	9,68	21,58	41,15	55,82	70,13
IPCA + 5,50%	1,24	2,14	3,15	5,31	10,20	22,74	43,17	58,79	74,20
IPCA + 5,89%	1,27	2,20	3,24	5,50	10,60	23,64	44,76	61,14	77,43
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21	61,81	78,34
INPC + 4,00%	1,11	2,03	2,91	4,24	7,98	18,43	36,48	50,70	62,84
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49	62,57	79,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (5,640000%)	133.023.837,81	5,640000	132.713.797,08	5,670000	-310.040,73
NTN-B 150535 (5,645000%)	132.972.079,80	5,645000	132.713.797,08	5,670000	-258.282,72
NTN-B 150535 (5,681000%)	132.600.259,26	5,681000	132.713.797,08	5,670000	113.537,82
NTN-B 150535 (5,706000%)	44.114.288,19	5,706000	44.237.932,36	5,670000	123.644,17
NTN-B 150545 (5,475000%)	45.880.065,71	5,475000	44.467.968,04	5,743100	-1.412.097,67
NTN-B 150545 (5,511000%)	45.686.649,69	5,511000	44.467.968,04	5,743100	-1.218.681,65
NTN-B 150545 (5,531000%)	91.159.501,50	5,531000	88.935.936,08	5,743100	-2.223.565,42
NTN-B 150545 (5,576000%)	136.021.490,22	5,576000	133.403.904,12	5,743100	-2.617.586,10
NTN-B 150545 (5,662500%)	134.657.133,39	5,662500	133.403.904,12	5,743100	-1.253.229,27
NTN-B 150545 (5,700000%)	134.071.937,88	5,700000	133.403.904,12	5,743100	-668.033,76
NTN-B 150545 (5,752000%)	88.844.344,66	5,752000	88.935.936,08	5,743100	91.591,42
NTN-B 150545 (5,761000%)	88.751.907,54	5,761000	88.935.936,08	5,743100	184.028,54
NTN-B 150545 (5,790000%)	88.454.975,46	5,790000	88.935.936,08	5,743100	480.960,62
NTN-B 150545 (5,945000%)	86.892.339,74	5,945000	88.935.936,08	5,743100	2.043.596,34
NTN-B 150840 (5,616100%)	88.404.570,58	5,616100	87.777.892,52	5,685800	-626.678,06
NTN-B 150840 (5,621700%)	88.353.996,56	5,621700	87.777.892,52	5,685800	-576.104,04
NTN-B 150840 (5,642300%)	88.168.276,58	5,642300	87.777.892,52	5,685800	-390.384,06
NTN-B 150840 (5,661100%)	131.998.952,76	5,661100	131.666.838,78	5,685800	-332.113,98
NTN-B 150840 (5,726000%)	131.128.834,38	5,726000	131.666.838,78	5,685800	538.004,40
NTN-B 150850 (5,385000%)	46.137.418,12	5,385000	43.995.126,33	5,745000	-2.142.291,79
NTN-B 150850 (5,797000%)	131.093.187,30	5,797000	131.985.378,99	5,745000	892.191,69
NTN-B 150850 (5,841000%)	130.345.486,77	5,841000	131.985.378,99	5,745000	1.639.892,22
NTN-B 150850 (5,887200%)	86.378.142,34	5,887200	87.990.252,66	5,745000	1.612.110,32
NTN-B 150850 (5,931000%)	128.836.004,52	5,931000	131.985.378,99	5,745000	3.149.374,47
NTN-B 150850 (5,961600%)	128.328.826,59	5,961600	131.985.378,99	5,745000	3.656.552,40
NTN-B 150850 (6,041000%)	127.027.010,73	6,041000	131.985.378,99	5,745000	4.958.368,26
NTN-B 150850 (6,071500%)	126.532.391,76	6,071500	131.985.378,99	5,745000	5.452.987,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
6470	01/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	168.490,55	0,00	17.040,95043332	9,8873915900
6469	01/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.709,70	0,00	987,50538629	2,7439850330
6516	01/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.378.540,20	0,00	139.424,05208207	9,8873915900
6515	01/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.353,58	0,00	1.222,15681196	2,7439850330
6444	01/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	253.924,79	25.681,67627313	9,8873915900
6445	01/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	963,68	0,00	97,46554399	9,8873915900
6473	02/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	20.289.574,39	2.051.461,69271887	9,8903013700
6474	02/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	2.382.552,33	0,00	240.897,84940497	9,8903013700
6471	02/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	27.180,40	9.901,64426922	2,7450390320
6518	02/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	399.888,91	40.432,42920918	9,8903013700
6519	02/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	5.879.343,33	0,00	594.455,42760038	9,8903013700
6517	02/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	955,96	0,00	348,25005723	2,7450390320
6446	02/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	272.182,83	27.520,17555558	9,8903013700
6447	02/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	25.693,38	0,00	2.597,83590396	9,8903013700
6472	02/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.596,83	0,00	1.310,30195129	2,7450390320
6476	05/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	216.793,39	21.912,93195024	9,8933995000
6475	05/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.785,86	0,00	1.014,49137046	2,7460657440
6521	05/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	200.340,12	20.249,87669810	9,8933995000
6522	05/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	12.653.082,13	0,00	1.278.941,79649776	9,8933995000
6520	05/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.877,16	0,00	683,58159454	2,7460657440
6448	05/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	135.395,09	13.685,39600569	9,8933995000
6477	05/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	4.773.252,07	0,00	482.468,34366691	9,8933995000
6479	06/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.653.232,67	0,00	167.052,32741430	9,8964958800
6524	06/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	6.966.047,42	0,00	703.890,29657233	9,8964958800
6523	06/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.892,06	0,00	688,74669352	2,7471057470
6449	06/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	7.414,51	749,20558649	9,8964958800
6450	06/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	13.687,63	0,00	1.383,07843160	9,8964958800
6478	06/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	19.904,14	2.011,23107020	9,8964958800

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
6481	07/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	28.021.790,86	0,00	2.830.623,10899225	9,8995132100
6480	07/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.172,85	0,00	1.154,54396870	2,7481413320
6526	07/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	5.034,64	508,57450192	9,8995132100
6527	07/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	95.864,72	0,00	9.683,78120887	9,8995132100
6525	07/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	846,36	0,00	307,97542693	2,7481413320
6451	07/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	97.164,04	9.815,03210702	9,8995132100
6482	08/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	472.933,59	47.758,61034387	9,9025827300
6483	08/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	58.893,01	0,00	5.947,23736279	9,9025827300
6530	08/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	69.185,97	6.986,65912585	9,9025827300
6531	08/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	110.716,01	0,00	11.180,51855953	9,9025827300
6528	08/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.002,33	6.911,97264933	2,7491905660
6529	08/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.374,28	0,00	863,62874563	2,7491905660
6452	08/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	94.477,23	9.540,66555928	9,9025827300
6453	08/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.212,59	122,45189291	9,9025827300
6485	09/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.789.684,55	0,00	180.674,51530455	9,9055727200
6484	09/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	508,37	0,00	184,84477274	2,7502535910
6533	09/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	42.316,14	0,00	4.271,95288916	9,9055727200
6532	09/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	8.171,56	0,00	2.971,20237448	2,7502535910
6564	09/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	20.579,27	2.077,54468941	9,9055727200
6486	14/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.076,56	0,00	391,28697875	2,7513310140
6534	14/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	14.623,77	0,00	5.315,16198000	2,7513310140
6535	14/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	116.000,00	0,00	47.807,23463585	2,4264110000
6488	15/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.315,61	334,51640089	9,9116515400
6487	15/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	703,10	0,00	255,45234909	2,7523724190
6538	15/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	30.000.000,00	3.026.740,78875053	9,9116515400
6536	15/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.594,47	4.212,53676282	2,7523724190
6539	15/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	116.000,00	47.789,11487556	2,4273310000
6540	15/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	116.000,00	0,00	22.909,95538286	5,0633010000
6541	15/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	74.584.109,60	0,00	14.730.332,95867656	5,0633010000
6537	15/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.827,44	0,00	663,95084742	2,7523724190

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
6455	15/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	14.312,04	1.443,96117461	9,9116515400
6490	16/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	6.196,58	624,98906233	9,9147015100
6491	16/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	11.131,88	0,00	1.122,76501605	9,9147015100
6489	16/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.395,88	0,00	506,96203037	2,7534211960
6543	16/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	8.153,51	0,00	822,36565486	9,9147015100
6542	16/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.999,58	0,00	1.089,40107106	2,7534211960
6456	16/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	22.742,95	2.293,86129043	9,9147015100
6457	16/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	9.367,32	0,00	944,79092392	9,9147015100
6493	19/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	6.799.890,23	685.626,46940254	9,9177767100
6494	19/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	370.086,64	0,00	37.315,48418779	9,9177767100
6492	19/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	151.266,78	48.685,38255733	3,1070266280
6545	19/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.378.766,03	239.848,71807020	9,9177767100
6546	19/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	929.353,20	0,00	93.705,79991612	9,9177767100
6458	19/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	130.191,71	13.127,10638754	9,9177767100
6459	19/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	7.111.107,53	0,00	717.006,21398644	9,9177767100
6544	19/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.331,72	0,00	5.929,22171989	2,7544458230
6496	20/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	149,13	15,03214290	9,9207412400
6497	20/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	2.924.232,68	0,00	294.759,49520885	9,9207412400
6495	20/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.127,35	0,00	1.134,94570686	2,7555062600
6547	20/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.051,76	0,00	5.825,33969638	2,7555062600
6460	20/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	28.417,49	2.864,45229369	9,9207412400
6461	20/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	25.212,82	0,00	2.541,42501957	9,9207412400
6499	21/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	17.749.188,20	0,00	1.788.566,39719689	9,9236954400
6498	21/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	6.982,74	0,00	2.533,19934407	2,7564905290
6549	21/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	875,08	0,00	88,18086017	9,9236954400
6548	21/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	9.249,32	0,00	3.355,46953733	2,7564905290
6462	21/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.247.111,70	327.207,91560286	9,9236954400
6501	22/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.316.506,99	334.097,76937941	9,9267558600
6502	22/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	993.457,63	0,00	100.078,78142779	9,9267558600
6500	22/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	31.752,14	11.514,39947834	2,7576027790

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
6550	22/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	67.524,15	6.802,23740286	9,9267558600
6551	22/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	874.455,64	0,00	88.090,77732269	9,9267558600
6463	22/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	4.688,04	472,26305010	9,9267558600
6504	23/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	20.561.584,82	2.070.693,73948192	9,9298048900
6505	23/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	9.895.274,56	0,00	996.522,55705097	9,9298048900
6503	23/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	556.041,58	178.658,20787681	3,1123203720
6553	23/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	202.295,93	20.372,59868054	9,9298048900
6554	23/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	4.993.317,73	0,00	502.861,61564248	9,9298048900
6552	23/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.893,84	1.411,50226220	2,7586494930
6464	23/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	11.083,60	1.116,19514409	9,9298048900
6507	26/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.608.353,18	363.277,29193267	9,9327793400
6508	26/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	120.950.908,57	0,00	12.176.945,08554340	9,9327793400
6506	26/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	34.352,67	12.447,99095948	2,7596959310
6557	26/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	11.814,67	1.189,46264641	9,9327793400
6558	26/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	466.429,42	0,00	46.958,60081394	9,9327793400
6555	26/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.343,40	3.385,66285330	2,7596959310
6556	26/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.155,73	0,00	1.143,50641480	2,7596959310
6465	26/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	19.742,85	1.987,64608819	9,9327793400
6510	27/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.886.146,78	391.124,71381063	9,9358251800
6509	27/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	285,94	0,00	103,57403297	2,7607305790
6559	27/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	60.577,26	6.096,85244080	9,9358251800
6560	27/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	20.166,52	0,00	2.029,67741830	9,9358251800
6466	27/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	719.359,97	72.400,62671876	9,9358251800
6467	27/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	9.414,83	0,00	947,56397475	9,9358251800
6511	27/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.849.747,85	0,00	186.169,52457290	9,9358251800
6513	28/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	168.344.314,20	16.937.931,34393228	9,9388945900
6514	28/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.166,11	0,00	117,32793717	9,9388945900
6512	28/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.279.727,94	731.556,25866245	3,1162715280
6563	28/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	5.176.713,97	520.854,09731667	9,9388945900
6561	28/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	76.668,38	27.760,41579593	2,7617878840

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
6562	28/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	918,84	0,00	332,69752732	2,7617878840
6468	28/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.253.200,19	126.090,50017101	9,9388945900
6565	29/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.360,00	337,96241866	9,9419338200
6566	29/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	15.886,74	0,00	1.597,95270092	9,9419338200
6567	29/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	121.460,14	0,00	12.216,95318024	9,9419338200
6568	29/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	780,52	0,00	282,50525162	2,7628512940
6569	29/02/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	72.824,15	0,00	7.324,94817593	9,9419338200
Total			310.345.233,85	275.751.189,50		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rendimentos Realizados

Artigo	Ativo	Quantidade	Valor Aplicação	Valor Resgate	Rendimento
Artigo 7º I, Alínea b	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	27.435.487,264481	271.563.286,88	272.434.365,56	871.078,68
Artigo 7º III, Alínea a	BB PREV RF FLUXO FIC	77.546,125031	211.118,49	213.787,64	2.669,15
Artigo 7º III, Alínea a	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	958.899,849097	2.597.217,37	2.987.036,30	389.818,93
Artigo 7º III, Alínea a	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	47.789,114876	115.677,81	116.000,00	322,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 60.910.912,29

Value-At-Risk: 0,82%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,58	0,13	5,00	0,06	0,12	0,87	6.210.638.262,85	83,61
Artigo 8º	11,67	6,17	20,00	0,54	0,07	1,64	691.897.815,03	9,31
Artigo 9º	17,89	6,03	20,00	0,13	0,35	7,08	291.174.408,89	3,92
Artigo 10º	6,43	3,88	20,00	0,09	0,44	3,63	214.002.049,20	2,88
Artigo 11º	84,77	8,69	10,00	-0,00	0,25	21,85	20.400.000,00	0,27
IPAJM - CONSOLIDADO		0,82		0,82			7.428.112.535,97	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,13%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830	1,92	2,04	0,02	2,05	-0,10	0,61	121.662.891,70	1,64
NTN-B 150535 (5,640000%)	0,80	0,11	-0,00	0,13	0,25	1,00	133.023.837,81	1,79
NTN-B 150535 (5,645000%)	0,80	0,11	-0,00	0,13	0,25	1,00	132.972.079,80	1,79
NTN-B 150535 (5,681000%)	0,80	0,11	-0,00	0,13	0,25	1,00	132.600.259,26	1,79
NTN-B 150535 (5,706000%)	0,80	0,11	-0,00	0,13	0,25	1,01	44.114.288,19	0,59
NTN-B 150545 (5,475000%)	1,10	0,11	-0,00	0,13	0,17	0,99	45.880.065,71	0,62
NTN-B 150545 (5,511000%)	1,11	0,11	-0,00	0,13	0,17	0,99	45.686.649,69	0,62
NTN-B 150545 (5,531000%)	1,11	0,11	-0,00	0,13	0,17	0,99	91.159.501,50	1,23
NTN-B 150545 (5,576000%)	1,12	0,11	-0,00	0,13	0,17	1,00	136.021.490,22	1,83
NTN-B 150545 (5,662500%)	1,13	0,11	-0,00	0,13	0,18	1,00	134.657.133,39	1,81
NTN-B 150545 (5,700000%)	1,13	0,11	-0,00	0,13	0,18	1,00	134.071.937,88	1,80
NTN-B 150545 (5,752000%)	1,14	0,11	-0,00	0,13	0,18	1,01	88.844.344,66	1,20
NTN-B 150545 (5,761000%)	1,14	0,11	-0,00	0,13	0,18	1,01	88.751.907,54	1,19
NTN-B 150545 (5,790000%)	1,14	0,11	-0,00	0,13	0,18	1,01	88.454.975,46	1,19
NTN-B 150545 (5,945000%)	1,16	0,11	-0,00	0,14	0,19	1,02	86.892.339,74	1,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,616100%)	0,96	0,11	-0,00	0,13	0,21	1,00	88.404.570,58	1,19
NTN-B 150840 (5,621700%)	0,96	0,11	-0,00	0,13	0,21	1,00	88.353.996,56	1,19
NTN-B 150840 (5,642300%)	0,96	0,11	-0,00	0,13	0,21	1,00	88.168.276,58	1,19
NTN-B 150840 (5,661100%)	0,96	0,11	-0,00	0,13	0,21	1,00	131.998.952,76	1,78
NTN-B 150840 (5,726000%)	0,97	0,11	-0,00	0,13	0,21	1,01	131.128.834,38	1,77
NTN-B 150850 (5,385000%)	1,20	0,11	-0,00	0,14	0,15	0,98	46.137.418,12	0,62
NTN-B 150850 (5,797000%)	1,27	0,11	-0,00	0,14	0,17	1,01	131.093.187,30	1,76
NTN-B 150850 (5,841000%)	1,27	0,11	-0,00	0,14	0,17	1,02	130.345.486,77	1,75
NTN-B 150850 (5,887200%)	1,28	0,11	-0,00	0,14	0,17	1,02	86.378.142,34	1,16
NTN-B 150850 (5,931000%)	1,29	0,11	-0,00	0,14	0,17	1,02	128.836.004,52	1,73
NTN-B 150850 (5,961600%)	1,29	0,11	-0,00	0,14	0,17	1,02	128.328.826,59	1,73
NTN-B 150850 (6,041000%)	1,30	0,11	-0,00	0,14	0,17	1,03	127.027.010,73	1,71
NTN-B 150850 (6,071500%)	1,30	0,11	-0,00	0,14	0,18	1,03	126.532.391,76	1,70
Sub-total	1,04	0,14	0,02		0,18	0,99	2.937.526.801,54	39,55

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,01	0,01	0,00	0,01	-17,85	0,58	77.279.825,09	1,04
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	1,66	1,86	0,00	0,09	-0,16	0,54	5.799.165,59	0,08
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,19	0,10	0,00	0,02	-0,33	0,74	547.662.596,44	7,37
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,66	1,81	0,01	0,01	-0,16	0,53	73.867.990,63	0,99
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,66	1,81	0,01	0,01	-0,16	0,54	71.833.920,26	0,97
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,19	0,09	0,00	0,04	-0,31	0,74	266.760.048,11	3,59
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,85	0,94	0,01	0,01	-0,26	0,58	111.816.075,07	1,51
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,19	0,10	0,00	0,03	-0,29	0,75	1.867.349,60	0,03
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,88	0,61	0,00	0,63	-0,28	0,55	110.174.704,28	1,48
Sub-total	0,40	0,39	0,04		-0,33	0,67	1.267.061.675,07	17,06

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,01	0,52	0,82	1.081.077.824,02	14,55
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	1,79	1,91	0,00	0,13	-0,13	0,57	385.896,42	0,01
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	0,00	0,01	0,07	0,80	685.427.795,96	9,23
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-4,76	0,73	143.794,05	0,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,01	0,01	0,00	0,00	-12,29	0,73	17.032,41	0,00
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,06	0,03	-0,00	0,03	0,71	0,84	229.719.066,85	3,09
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,36	0,38	0,00	0,38	-0,15	0,75	9.278.376,53	0,12
Sub-total	0,03	0,02	0,00		0,61	0,82	2.006.049.786,24	27,01

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,17%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	14,37	6,53	0,10	1,34	-0,02	0,53	139.359.227,16	1,88
BB AÇÕES DIVIDENDOS	13,66	6,57	0,03	1,76	0,01	0,94	45.936.286,68	0,62
FIA BRASIL IBX-50	13,94	6,56	0,04	0,97	0,00	0,84	55.748.050,96	0,75
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	14,45	6,75	0,06	0,25	0,01	0,89	76.340.498,47	1,03
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,87	6,25	0,07	1,78	0,08	1,80	101.688.649,18	1,37
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	17,97	9,96	0,10	0,13	-0,02	0,38	88.739.441,85	1,19
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	12,94	6,98	0,01	4,28	0,13	2,42	14.620.426,76	0,20
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	11,07	6,23	0,08	7,20	0,40	5,26	123.119.801,13	1,66
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	14,86	6,60	0,03	1,41	-0,02	0,50	46.345.432,84	0,62
Sub-total	11,67	6,17	0,54		0,07	1,64	691.897.815,03	9,31

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,03%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,21	5,75	0,04	0,48	0,30	6,27	102.410.814,77	1,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	17,72	5,76	0,04	8,92	0,34	6,80	113.355.794,72	1,53
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI	18,91	7,75	0,05	9,10	0,41	8,64	75.407.799,40	1,02
Sub-total	17,89	6,03	0,13		0,35	7,08	291.174.408,89	3,92

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,88%

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	0,11	0,32	0,00	0,32	-0,10	0,79	87.940.628,63	1,18
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,03	6,52	0,09	4,93	0,44	5,70	126.061.420,57	1,70
Sub-total	6,43	3,88	0,09		0,44	3,63	214.002.049,20	2,88

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 8,69%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA RIO BRAVO FI DE FII - CXRI11	41,09	8,69	-0,00	8,68	0,18	8,19	20.400.000,00	0,27
Sub-total	84,77	8,69	-0,00		0,25	21,85	20.400.000,00	0,27

(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 (%)