



LDB
EMPRESAS

SANTA FÉ DO SUL
JULHO 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 31.07.2024.

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

94,11%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,60	0,09	1,04	4,91	5.227.429,67	3,19	6.518.185.291,57	0,08
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,92	0,29	2,07	0,82	10.328.295,29	6,31	4.446.980.761,25	0,23
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,74	0,09	0,89	4,12	2.147.668,32	1,31	4.921.617.196,95	0,04
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,20	0,48	3,20	-2,18	1.811.146,02	1,11	1.220.483.112,09	0,15
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,57	0,22	1,32	2,70	1.244.215,16	0,76	3.693.985.248,16	0,03
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,75	0,09	0,76	3,90	8.769.763,14	5,36	5.421.914.339,44	0,16
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	1,90	0,09	0,27	0,27	10.026.872,10	6,13	974.935.160,23	1,03
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,84	0,04	0,98	6,82	2.896.261,34	1,77	3.539.594.658,05	0,08
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,84	0,04	0,98	6,76	29.419.658,39	17,98	3.733.119.507,19	0,79
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2025 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	5,10	0,02	0,25	0,25	12.029.445,67	7,35	260.206.904,44	4,62
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,84	0,04	0,98	6,76	11.801.208,32	7,21	4.077.447.814,11	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,73	0,09	0,89	4,13	10.171.290,18	6,22	7.242.310.243,82	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,13	0,48	3,20	-2,04	8.071.583,36	4,93	1.166.611.040,66	0,69
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,91	0,29	2,07	0,82	3.487.938,48	2,13	3.987.797.714,56	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	0,15	1,34	3,68	836.237,16	0,51	600.770.337,70	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,33	0,08	0,96	3,35	6.150.685,69	3,76	4.733.163.653,12	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2,93	0,22	1,01	2,09	3.624.242,11	2,21	240.978.946,09	1,50
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	3,93	0,29	2,07	0,81	2.337.257,08	1,43	464.449.639,14	0,50
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	0,06	0,04	0,91	6,19	3.789.270,02	2,32	2.971.802.970,11	0,13

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			1,54	0,12	1,27	4,06	134.170.467,50	82,00		

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	0,97	6,26	14.095.674,19	8,61	17.211.240.215,08	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,11	0,04	0,96	6,25	2.886.120,96	1,76	5.517.362.915,13	0,05
BRZ	INTRADER	FI RECUPERACAO BR RF LONGO PRAZO	10,92	0,45	1,39	-17,57	17.931,11	0,01	4.238.444,44	0,42
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,04	0,94	6,47	2.812.834,86	1,72	3.055.735.513,04	0,09
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,07	0,04	0,97	6,27	19.812.561,12	12,11		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GENIAL	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		
Renda Fixa			1,37	0,11	1,23	4,32	153.983.028,62	94,11		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

2,70%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	18,10	1,15	2,77	-8,27	656.669,37	0,40	378.699.800,75	0,17
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	11,50	1,75	1,46	17,93	2.409.511,82	1,47	1.442.743.838,13	0,17
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,80	0,39	1,90	-4,06	1.350.612,28	0,83	773.992.391,10	0,17
Sub-total Artigo 8º I			11,03	1,24	1,78	6,00	4.416.793,47	2,70		
Renda Variável			11,03	1,24	1,78	6,00	4.416.793,47	2,70		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,43%

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	14,92	4,01	0,51	40,23	709.384,77	0,43	2.714.087.550,41	0,03
Sub-total Artigo 9º III			14,92	4,01	0,51	40,23	709.384,77	0,43		
Investimentos no Exterior			14,92	4,01	0,51	40,23	709.384,77	0,43		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,76%

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	0,77	0,06	0,86	4,52	3.414.141,03	2,09	12.152.015.892,34	0,03
Sub-total Artigo 10º I			0,77	0,06	0,86	4,52	3.414.141,03	2,09		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ROMA	INDIGO	CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES	0,44	0,13	0,13	0,92	-327.233,42	-0,20	-77.905.652,15	
LAD CAPITAL	LAD CAPITAL	FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	0,17	-0,00	-0,00	-0,05	1.428.657,26	0,87	794.393.152,37	0,18
Sub-total Artigo 10º II			0,24	-0,04	-0,04	-0,33	1.101.423,84	0,67		
Investimentos Estruturados			0,59	0,03	0,64	3,29	4.515.564,87	2,76		
Total			1,47	0,16	1,22	4,46	163.624.771,73	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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	134.170.467,50	82,00	0,00	76,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	19.812.561,12	12,11	0,00	11,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	0,00	0,00	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	153.983.028,62	94,11					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	4.416.793,47	2,70	0,00	8,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	4.416.793,47	2,70					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	709.384,77	0,43	0,00	0,30	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	709.384,77	0,43					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.414.141,03	2,09	0,00	4,20	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.101.423,84	0,67	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	4.515.564,87	2,76					15,00
Total		163.624.771,73	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 b % do CDI	1,27 139,80	4,06 65,75	2,45 96,20	3,50 67,83	8,26 71,79	1.680.298,36	5.185.332,65
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,97 106,44	6,27 101,59	2,61 102,19	5,24 101,60	11,71 101,78	187.526,58	1.110.969,26
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,78 -1,24	6,00 10,87	5,85 4,48	7,30 7,38	14,97 10,29	77.399,93	250.008,86
Artigo 9º III % do CDI	0,51 56,00	40,23 651,34	20,99 822,91	34,11 661,13	49,78 432,51	3.585,42	203.495,05
Artigo 10º I % do CDI	0,86 94,89	4,52 73,16	1,97 77,34	3,60 69,75	9,67 84,04	29.137,87	147.593,75
Artigo 10º II % do CDI	-0,04 -4,53	-0,33 -5,37	-0,14 -5,34	-0,29 -5,53	-0,35 -3,06	-452,76	-3.667,19
SANTA FÉ DO SUL (Total)						1.977.495,40	6.893.732,38

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	15.097.305,43	0,00	-10.000.000,00	0,00	5.227.429,67	130.124,24	688.023,07
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	10.118.405,74	0,00	0,00	0,00	10.328.295,29	209.889,55	91.016,36
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2.128.648,17	0,00	0,00	0,00	2.147.668,32	19.020,15	62.288,98
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.755.038,45	0,00	0,00	0,00	1.811.146,02	56.107,57	-40.321,70
BB PREV RF IRF M	1.228.008,06	0,00	0,00	0,00	1.244.215,16	16.207,10	32.758,83
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	8.703.303,51	0,00	0,00	0,00	8.769.763,14	66.459,63	329.248,21
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	10.026.872,10	26.872,10	26.872,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	2.868.029,16	0,00	0,00	0,00	2.896.261,34	28.232,18	186.044,41
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	29.135.516,18	0,00	0,00	0,00	29.419.658,39	284.142,21	1.874.302,98
CAIXA BRASIL 2025 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,00	12.000.000,00	0,00	0,00	12.029.445,67	29.445,67	29.445,67
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.687.245,35	0,00	0,00	0,00	11.801.208,32	113.962,97	751.769,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.081.280,91	0,00	0,00	0,00	10.171.290,18	90.009,27	403.589,16
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.821.472,37	0,00	0,00	0,00	8.071.583,36	250.110,99	-168.436,26
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.417.110,56	0,00	0,00	0,00	3.487.938,48	70.827,92	28.516,99
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	825.203,21	0,00	0,00	0,00	836.237,16	11.033,95	29.643,87
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	17.991.572,89	0,00	-12.000.000,00	0,00	6.150.685,69	159.112,80	564.566,87
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	3.587.935,47	0,00	0,00	0,00	3.624.242,11	36.306,64	74.281,90
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	2.089.171,21	200.000,00	0,00	0,00	2.337.257,08	48.085,87	23.320,56
SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	3.754.922,47	0,00	0,00	0,00	3.789.270,02	34.347,55	198.400,85
	132.290.169,14	22.200.000,00	-22.000.000,00	0,00	134.170.467,50	1.680.298,36	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.425.054,65	538.900,38	0,00	0,00	14.095.674,19	131.719,16	717.563,80
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	2.858.641,99	0,00	0,00	0,00	2.886.120,96	27.478,97	169.663,98
FI RECUPERACAO BR RF LONGO PRAZO	17.684,91	0,00	0,00	0,00	17.931,11	246,20	-3.822,53
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	3.034.752,61	0,00	-250.000,00	0,00	2.812.834,86	28.082,25	227.564,01
	19.336.134,16	538.900,38	-250.000,00	0,00	19.812.561,12	187.526,58	

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
4UM SMALL CAPS FIA	638.989,41	0,00	0,00	0,00	656.669,37	17.679,96	-59.198,99
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	2.374.935,01	0,00	0,00	0,00	2.409.511,82	34.576,81	366.371,61
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	1.325.469,12	0,00	0,00	0,00	1.350.612,28	25.143,16	-57.163,76
	4.339.393,54	0,00	0,00	0,00	4.416.793,47	77.399,93	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	705.799,35	0,00	0,00	0,00	709.384,77	3.585,42	203.495,05
	705.799,35	0,00	0,00	0,00	709.384,77	3.585,42	

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	3.385.003,16	0,00	0,00	0,00	3.414.141,03	29.137,87	147.593,75
	3.385.003,16	0,00	0,00	0,00	3.414.141,03	29.137,87	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES	-326.814,99	0,00	0,00	0,00	-327.233,42	-418,43	-2.970,53
FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	1.428.691,59	0,00	0,00	0,00	1.428.657,26	-34,33	-696,66
	1.101.876,60	0,00	0,00	0,00	1.101.423,84	-452,76	

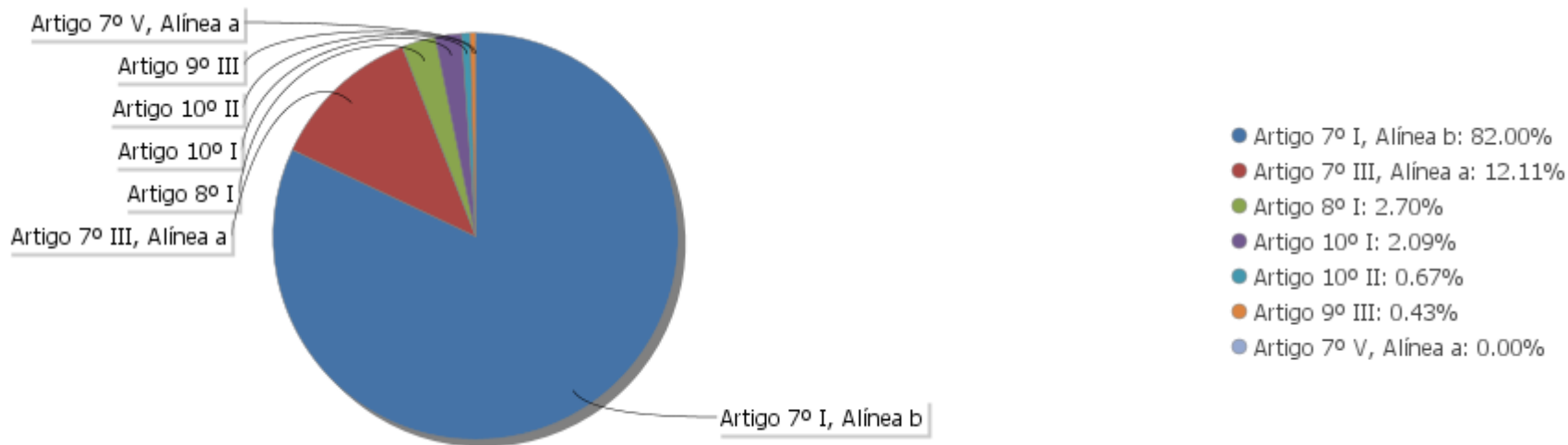
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

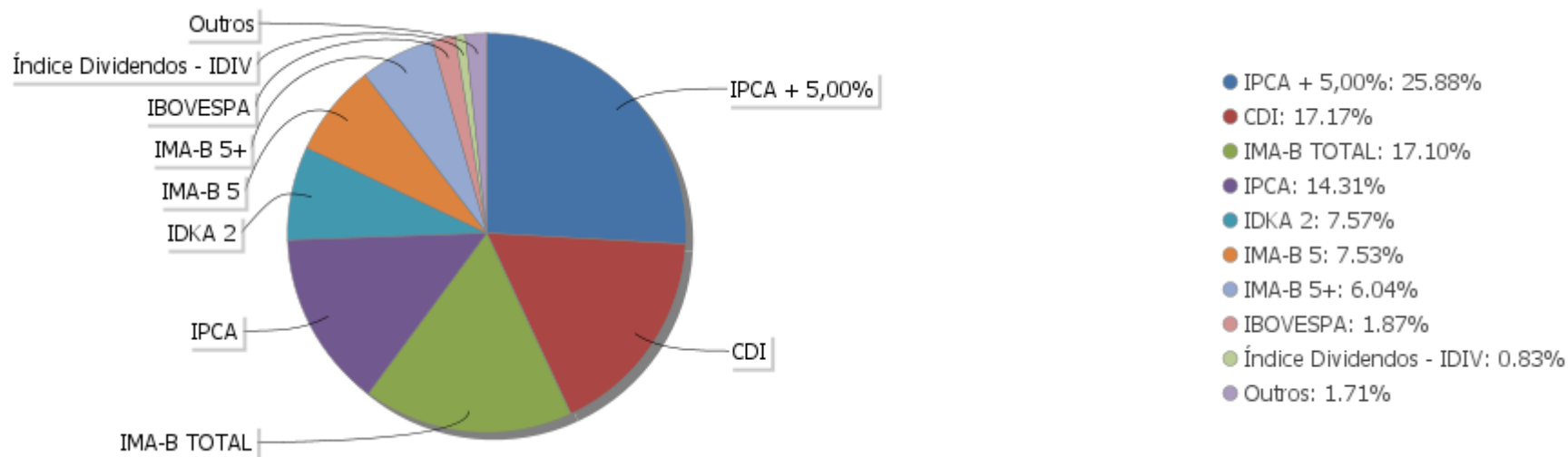
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	140.121.865,59	85,64	70,00	140.121.865,59	85,64	70,00
de 31 dias a 365 dias	13.458.102,93	8,22	30,00	153.579.968,52	93,86	100,00
acima de 365 dias	10.044.803,21	6,14	0,00	163.624.771,73	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

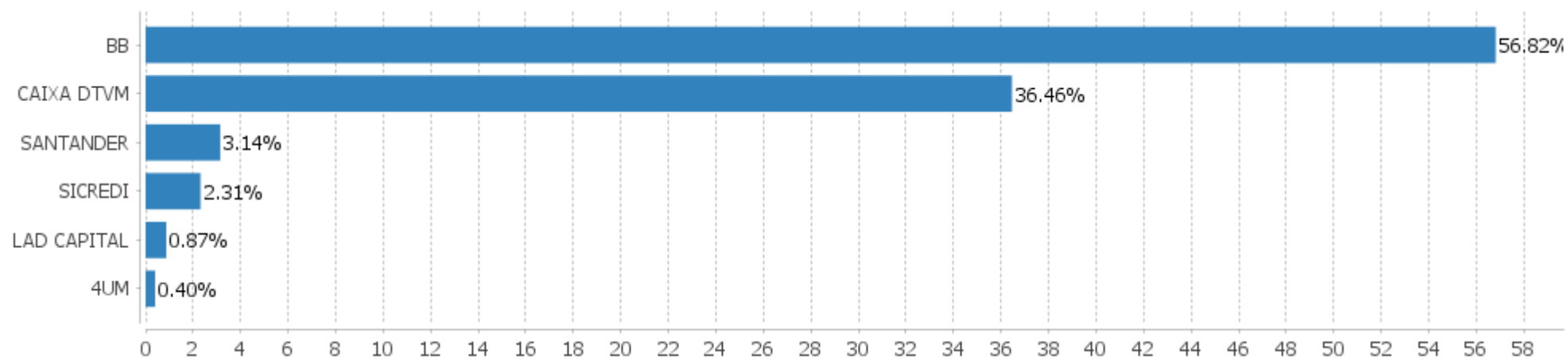


Alocação Por Estratégia



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	0,56	0,76	0,69	-0,21	0,95	0,40	1,22						4,46
IPCA + 4,86%	0,84	1,19	0,54	0,80	0,86	0,59	0,82						5,76
p.p. indexador	-0,28	-0,43	0,15	-1,01	0,09	-0,18	0,41						-1,30
2023	1,25	1,01	1,46	0,85	0,98	1,40	1,05	0,56	0,24	0,07	1,68	1,56	12,79
IPCA + 4,71%	0,93	1,17	1,13	0,94	0,63	0,30	0,50	0,65	0,63	0,63	0,65	0,93	9,49
p.p. indexador	0,32	-0,16	0,33	-0,09	0,34	1,10	0,55	-0,09	-0,39	-0,56	1,03	0,64	3,30
2022	-0,25	0,62	2,01	0,64	0,85	0,01	0,32	0,34	0,51	1,70	-0,21	-0,16	6,54
IPCA + 4,86%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,29	0,07	0,11	0,97	0,79	1,04	10,91
p.p. indexador	-1,19	-0,75	-0,03	-0,78	-0,04	-1,06	0,61	0,27	0,41	0,73	-1,00	-1,20	-4,36
2021	-0,55	-0,89	-0,09	0,64	0,60	0,17	-0,29	-1,60	0,06	-1,27	1,90	0,87	-0,50
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,00
p.p. indexador	-1,22	-2,13	-1,51	-0,09	-0,68	-0,80	-1,71	-2,94	-1,54	-2,95	0,53	-0,35	-16,50
2020	0,49	0,43	-3,19	0,91	1,36	1,24	2,14	-0,83	-0,79	0,06	1,22	2,75	5,80
IPCA + 6,00%	0,72	0,67	0,58	0,15	0,08	0,75	0,90	0,73	1,13	1,35	1,36	1,87	10,76
p.p. indexador	-0,23	-0,24	-3,77	0,75	1,28	0,49	1,24	-1,56	-1,92	-1,29	-0,13	0,89	-4,96
2019	0,87	0,45	0,52	0,69	1,00	1,11	0,78	0,30	1,02	1,04	-0,40	0,82	8,48
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	0,04	-0,44	-0,68	-0,37	0,36	0,66	0,05	-0,32	0,57	0,40	-1,37	-0,83	-2,11
2018	0,55	0,52	0,76	-0,10	-0,35	0,25	0,80	0,23	0,57	1,39	0,43	0,73	5,94
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	-0,25	-0,22	0,19	-0,81	-1,24	-1,50	-0,04	-0,21	-0,36	0,43	0,18	0,12	-3,98

Performance Sobre a Meta Atuarial

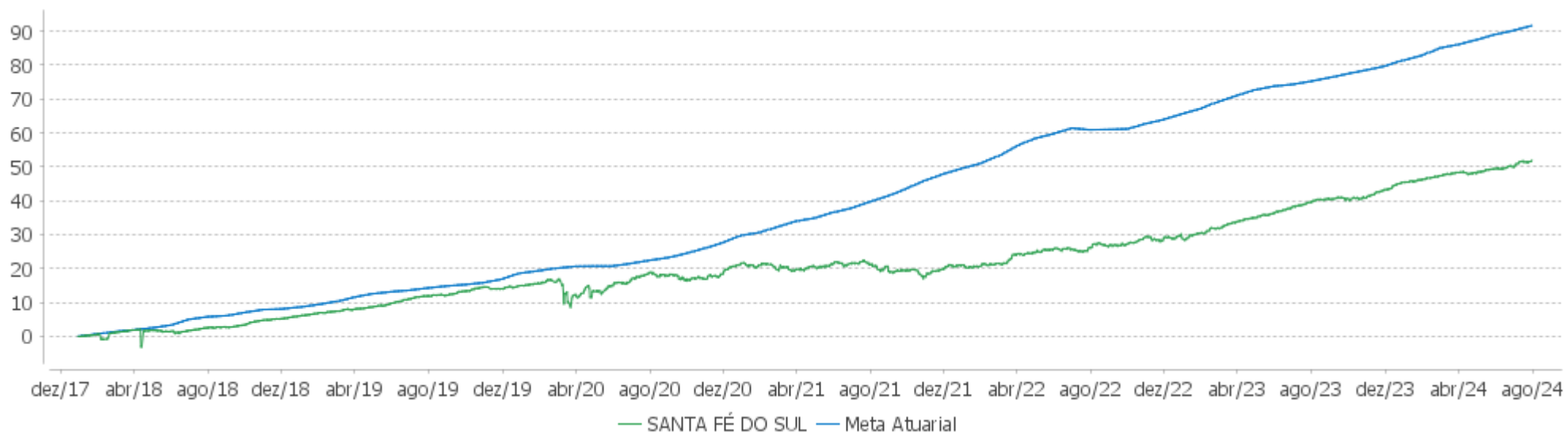
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	30	37,97
Meses abaixo - Meta Atuarial	49	62,03
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,75	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-3,19	2020-03

Relatório

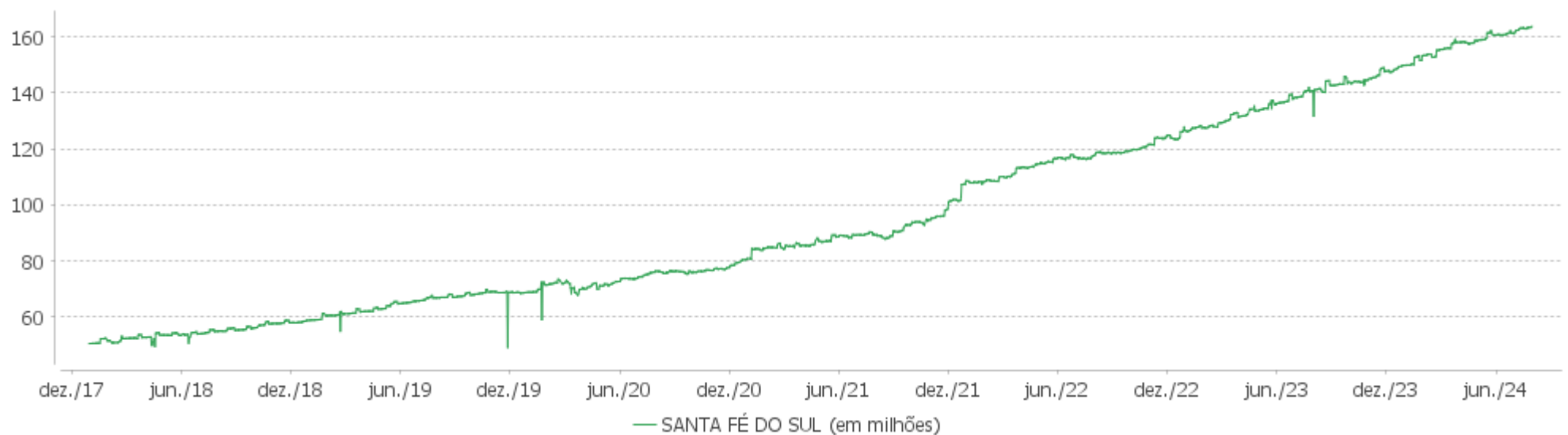
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,60	2,28	0,32	1,41
06 meses	3,88	4,88	-1,00	1,28
12 meses	8,80	9,49	-0,69	1,47
24 meses	20,39	19,28	1,12	1,90
36 meses	25,42	37,95	-12,53	2,39
48 meses	27,88	58,80	-30,92	2,62
60 meses	35,83	72,25	-36,43	3,88
Desde 29/12/2017	51,86	100,58	-48,73	4,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

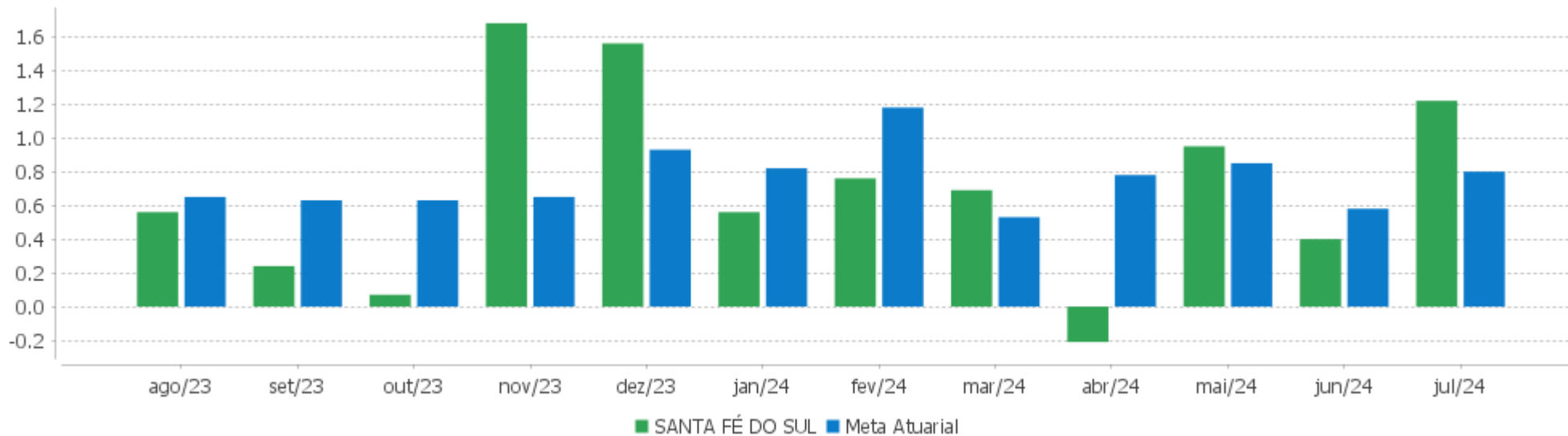


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,07 -0,02	0,82 -0,15	2,37 -0,08	1,30 -0,13	4,17 -0,21	20,10 -0,41	23,67 -0,76
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,89 -0,02	4,13 -0,13	2,31 -0,06	3,45 -0,12	7,93 -0,23	20,02 -0,35	31,84 -0,63
SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,91 100,84	6,19 100,24	2,55 100,07	5,17 100,27	11,51 100,00	26,60 99,80	38,53 99,95
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,70 -0,13	1,25 -0,68					
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,89 -0,02	4,12 -0,14	2,31 -0,06	3,44 -0,12	7,91 -0,25	19,88 -0,49	31,52 -0,94
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,98 0,15	6,76 0,91	3,05 0,74	5,59 0,64	11,26 1,56	22,27 2,51	
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,34 -0,02	3,68 -0,14	2,27 -0,09	3,21 -0,12	8,38 -0,26	24,35 -0,14	31,35 -0,54
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	3,20 -0,04	-2,04 -0,08	2,45 -0,07	-0,60 -0,09	1,00 -0,03	20,02 -0,58	15,55 -1,17
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,98 0,16	6,82 0,97	3,07 0,76	5,64 0,68	11,37 1,66		
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO Var. IDKA 2 p.p.	1,01 0,26	2,09 -1,89	1,00 -1,01	1,35 -1,80	7,38 -0,74		
CAIXA BRASIL 2025 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. IPCA p.p.	0,82 0,44	-0,15 -1,43	-0,31 -1,37				
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,76 0,01	3,90 -0,08	2,08 0,08	3,17 0,01	7,92 -0,20	19,47 -0,05	30,83 -0,78
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,98 -1,12	6,76 5,78	3,05 0,60	5,59 4,16	11,26 6,88	22,29 1,77	33,29 8,86
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,96 0,58	3,35 0,47	1,85 0,79	2,67 0,23	7,47 2,97	23,28 14,61	29,89 10,28
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,04 0,66	4,91 2,04	2,15 1,10	4,03 1,59	10,06 5,56	25,62 16,95	33,23 13,62
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,32 -0,02	2,70 -0,17	1,64 -0,06	2,03 -0,16	8,07 -0,30	25,34 -0,85	29,31 -1,19
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,07	0,82	2,39	1,31	4,13	19,89	23,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,15	-0,06	-0,12	-0,25	-0,62	-0,99
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	3,20 -0,04	-2,18 -0,21	2,42 -0,10	-0,67 -0,17	0,71 -0,31	19,75 -0,85	15,51 -1,21
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,07 -0,02	0,81 -0,16	2,38 -0,07	1,29 -0,14	4,10 -0,28	19,90 -0,61	23,50 -0,93
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,97 107,18	6,26 101,42	2,62 102,65	5,25 101,68	11,61 100,84	26,75 100,36	39,03 101,23
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,96 105,97	6,25 101,13	2,61 102,20	5,19 100,54	11,83 102,77	27,22 102,10	39,75 103,10
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,94 103,14	6,47 104,77	2,61 102,43	5,37 104,16	12,17 105,75	27,54 103,30	40,37 104,71
FI RECUPERACAO BR RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,39 -0,70	-17,57 -18,54	-6,88 -9,33	-14,63 -16,06	-18,09 -22,47	-61,27 -81,78	-65,02 -89,45
4UM SMALL CAPS FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,77 -0,26	-8,27 -3,40	1,25 -0,12	0,16 0,23	6,09 1,40	27,22 3,48	8,07 3,27
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,90 0,00	-4,06 -2,48	0,14 -2,75	-2,37 -4,37	1,06 -10,00	25,89 -5,97	9,64 -21,58
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,46 -1,57	17,93 22,80	10,77 9,39	15,99 16,07	25,13 20,45	45,13 21,40	43,85 39,05
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,51 0,22	40,23 -1,25	20,99 -0,40	34,11 -0,91	49,78 -2,21	60,78 -4,23	43,02 -4,42
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,86 94,89	4,52 73,16	1,97 77,34	3,60 69,75	9,67 84,04	23,79 89,25	34,90 90,52
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES % do CDI	0,13 14,11	0,92 14,83	0,39 15,10	0,79 15,24	1,57 13,65	54,98 206,26	-146,86 -380,94
FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-0,00 -0,26	-0,05 -0,79	-0,02 -0,67	-0,04 -0,81	0,08 0,71	-45,95 -172,37	-45,96 -119,22
SANTA FÉ DO SUL Var. IPCA + 4,71% p.p.	1,22 0,41	4,46 -1,30	2,60 0,32	3,88 -1,00	8,80 -0,75	20,39 0,95	25,42 -12,42
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
4UM SMALL CAPS FIA			D+17 du	D+20 du	-	2,00
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+3 du		1,00
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI			D+1 du	D+1 du		0,50
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 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 PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
CAIXA BRASIL 2025 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS 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 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 IMA GERAL 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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI RECUPERACAO BR RF LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+2 ou D+730 (isento de taxa de resgate)	D+3 ou D+731 (isento de taxa de resgate)		1,25
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 BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Não se aplica	Não se aplica				
FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	Não se aplica	Não se aplica				
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15

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	0,94	5,49	2,37	4,62	10,81	26,14	36,37	39,08	46,74
IRF-M 1+	1,55	1,77	1,44	1,17	7,38	27,10	28,37	24,09	39,00
IRF-M TOTAL	1,34	2,87	1,71	2,19	8,37	26,19	30,49	28,67	41,29
IMA-B 5	0,91	4,27	2,37	3,56	8,16	20,37	32,46	39,16	51,45
IMA-B 5+	3,24	-1,97	2,52	-0,51	1,03	20,60	16,72	17,12	26,27
IMA-B TOTAL	2,09	0,97	2,45	1,43	4,38	20,51	24,43	27,57	37,98
IMA-GERAL TOTAL	1,36	3,81	2,36	3,33	8,64	24,49	31,89	34,10	43,92
IDKA 2	0,75	3,98	2,01	3,15	8,12	19,52	31,61	39,35	51,45
IDKA 20	6,19	-6,65	2,88	-3,43	-3,72	23,96	4,78	3,52	8,64
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80	24,04	25,38
IBRX 100	2,90	-4,51	1,13	0,00	5,15	22,39	2,42	23,65	26,33
IBRX 50	3,15	-3,17	1,57	1,02	6,82	24,69	4,81	28,10	28,40
SMALL CAP	1,49	-13,59	-2,33	-7,53	-13,35	1,79	-31,36	-17,55	-11,07
Índice Consumo - ICON	2,01	-12,31	0,40	-4,34	-15,32	-14,69	-47,16	-45,60	-38,99
Índice Dividendos - IDIV	1,89	-1,58	2,90	2,00	11,06	31,85	31,21	49,86	55,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,01	35,40	20,06	30,27	43,70	45,91	38,90	83,71	178,66

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,52	1,61	-0,50	0,94	5,24	19,57	19,14	23,11	26,52

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,40	30,98	17,81	27,34	37,49	39,32	24,28	60,53	133,51

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,38	2,87	1,05	2,44	4,50	8,67	19,61	30,37	33,38
INPC	0,26	2,95	0,97	2,36	4,06	7,73	18,64	30,33	33,84
IGPM	0,61	1,71	2,33	1,64	3,82	-4,19	5,46	41,14	54,22
SELIC	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,74	5,25	2,07	4,46	8,66	17,50	34,49	52,40	62,17
IPCA + 5,00%	0,83	5,84	2,31	4,95	9,70	19,76	38,39	58,31	70,09
IPCA + 5,50%	0,87	6,14	2,44	5,20	10,22	20,90	40,36	61,34	74,17
IPCA + 5,89%	0,91	6,37	2,53	5,39	10,63	21,79	41,92	63,72	77,40
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36	64,40	78,32
INPC + 4,00%	0,62	5,33	1,98	4,37	8,21	16,49	33,39	52,35	62,74
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20	64,35	78,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
121	02/07/2024	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	200.000,00	0,00	5.866,39553500	34,0924847000
117	22/07/2024	CAIXA BRASIL 2025 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	12.000.000,00	0,00	12.047.014,31666177	0,9960974300
120	22/07/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	12.000.000,00	6.111.915,27931400	1,9633780000
113	23/07/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	10.000.000,00	0,00	9.902.615,40252900	1,0098342300
115	23/07/2024	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	10.000.000,00	7.091.790,87399900	1,4100810610
114	24/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	538.900,38	0,00	165.926,16448700	3,2478324420
118	26/07/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	250.000,00	936,44829100	266,9661556000
Total			22.738.900,38	22.250.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.226.959,85

Value-At-Risk: 0,75%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,44	0,72	5,00	0,67	0,22	1,23	153.983.028,62	94,11
Artigo 8º	12,19	4,90	20,00	0,08	0,07	1,78	4.416.793,47	2,70
Artigo 9º	21,18	7,37	20,00	-0,01	-0,02	0,51	709.384,77	0,43
Artigo 10º	0,51	0,36	20,00	0,01	-0,52	0,64	4.515.564,87	2,76
SANTA FÉ DO SUL		0,75		0,75			163.624.771,73	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,72%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,92	0,43	0,01	0,43	0,14	1,04	5.227.429,67	3,19
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,44	2,23	0,13	0,01	0,26	2,07	10.328.295,29	6,31
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,76	1,01	0,01	0,01	-0,01	0,89	2.147.668,32	1,31
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,16	3,16	0,03	0,04	0,32	3,20	1.811.146,02	1,11
BB PREV RF IRF M	2,96	1,42	0,01	0,02	0,14	1,32	1.244.215,16	0,76
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,98	1,12	0,05	0,19	-0,07	0,76	8.769.763,14	5,36
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,09	1,16	0,06	1,16	-0,10	0,70	10.026.872,10	6,13
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,54	0,31	0,00	0,32	0,14	0,98	2.896.261,34	1,77
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,54	0,31	0,01	0,32	0,13	0,98	29.419.658,39	17,98
CAIXA BRASIL 2025 X TP FIF RF - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,76	0,51	0,00	0,52	-0,12	0,82	12.029.445,67	7,35
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,54	0,31	0,00	2,26	0,13	0,98	11.801.208,32	7,21
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	1,01	0,06	0,01	-0,01	0,89	10.171.290,18	6,22
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,12	3,13	0,14	0,04	0,32	3,20	8.071.583,36	4,93
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,46	2,21	0,04	0,02	0,26	2,07	3.487.938,48	2,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,93	0,97	0,00	0,03	0,22	1,34	836.237,16	0,51
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,35	0,73	0,02	0,73	0,04	0,96	6.150.685,69	3,76
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	3,32	1,58	0,03	0,94	0,03	1,01	3.624.242,11	2,21
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	4,45	2,22	0,03	0,01	0,26	2,07	2.337.257,08	1,43
SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	0,01	0,01	-0,00	0,01	0,69	0,91	3.789.270,02	2,32
Sub-total	1,65	0,82	0,66		0,22	1,27	134.170.467,50	82,00

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	0,08	0,02	0,00	0,02	0,82	0,97	14.095.674,19	8,61
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,05	0,00	0,05	0,85	0,96	2.886.120,96	1,76
FI RECUPERACAO BR RF LONGO PRAZO	7,58	3,81	0,00	2,58	0,06	1,39	17.931,11	0,01
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,03	0,03	0,00	0,03	0,91	0,94	2.812.834,86	1,72
Sub-total	0,06	0,02	0,00		1,01	0,97	19.812.561,12	12,11

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	NaN	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00
Sub-total	0,00	NaN	0,00		0,00	0,00	0,00	0,00

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,36%

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	0,63	0,48	0,01	0,48	-0,07	0,86	3.414.141,03	2,09
Sub-total	0,63	0,48	0,01		-0,07	0,86	3.414.141,03	2,09

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES	0,42	-0,03	0,00	-0,03	-1,84	0,13	-327.233,42	-0,20
FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	0,01	0,00	0,00	0,00	-114,32	-0,00	1.428.657,26	0,87
Sub-total	0,14	0,01	0,00		-6,97	-0,04	1.101.423,84	0,67

Renda Variável

Value-At-Risk: 4,90%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
4UM SMALL CAPS FIA	19,35	7,87	0,02	4,79	0,10	2,77	656.669,37	0,40
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	13,55	5,18	0,03	6,57	0,04	1,46	2.409.511,82	1,47
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,01	6,65	0,04	3,49	0,07	1,90	1.350.612,28	0,83
Sub-total	12,19	4,90	0,08		0,07	1,78	4.416.793,47	2,70

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,37%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,18	7,37	-0,01	1,06	-0,02	0,51	709.384,77	0,43
Sub-total	21,18	7,37	-0,01		-0,02	0,51	709.384,77	0,43

(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 (%)