LDB
EMPRESAS

LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO

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.

INTRODUÇÃO

Este relatório apresenta a posição da carteira de investimentos do IPASLI por segmentos e ativos, com as informações de riscos, rentabilidades, instituição financeira e limites da Resolução CMN nº 4.963/2021 e da Política de Investimentos, e o acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos.

Tem por objetivo demonstrar o resultado da gestão dos investimentos do IPASLI pelo Conselho Deliberativo, Comitê de Investimentos, Diretoria Executiva e Conselho Fiscal.

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos do IPASLI analisou e atestou a conformidade deste relatório de investimentos quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos, conforme reunião realizada em 29.02.2024.

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL

O Conselho Fiscal, considerando os dados constantes neste relatório mensal de investimentos e as explicações dos gestores, aprovou o relatório de investimentos, conforme registro em reunião realizada no dia 29.02.2024.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **83,06%**

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 150824 (5,800000%)	0,29	0,06	1,01	2,06	1.518.321,70	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,200000%)	0,33	0,06	0,97	1,96	4.392.858,45	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,33	0,06	0,97	1,98	2.162.296,04	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,500000%)	0,33	0,06	0,99	2,01	5.609.761,59	1,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,800000%)	0,35	0,06	0,94	1,90	5.641.965,35	1,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,350000%)	0,41	0,06	0,98	1,99	1.943.021,67	0,41
TESOURO NACIONAL	NTN-F 010135	6,36	0,56	0,26	0,26	1.006.073,12	0,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (3,200000%)	0,35	0,05	0,82	1,65	1.165.083,54	0,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,410000%)	0,39	0,06	0,91	1,84	1.168.010,71	0,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	0,44	0,06	1,00	2,03	2.611.701,35	0,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,480000%)	2,82	0,06	0,99	2,01	3.984.772,31	0,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,750000%)	2,90	0,06	1,01	2,05	1.242.685,74	0,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,800000%)	0,50	0,06	1,01	2,06	16.289.981,04	3,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,910000%)	0,50	0,06	1,02	2,08	3.063.169,00	0,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,050500%)	0,51	0,06	1,03	2,10	1.357.777,34	0,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,132000%)	0,51	0,06	1,04	2,11	10.475.877,77	2,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,190000%)	0,52	0,06	1,04	2,12	2.223.198,95	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,440500%)	2,77	0,06	0,99	2,00	2.151.305,76	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,470000%)	2,78	0,06	0,99	2,01	1.583.791,56	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,550000%)	2,84	0,12	0,99	2,02	2.075.033,29	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,680000%)	3,96	0,06	1,00	1,00	2.033.672,23	0,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	4,00	0,08	0,08	0,08	3.046.302,22	0,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,800000%)	2,89	0,06	1,01	2,06	9.431.671,77	2,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,825000%)	0,56	0,06	1,01	2,06	1.929.357,25	0,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,847000%)	0,56	0,06	1,02	2,07	2.117.799,27	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,920000%)	0,56	0,06	1,02	2,08	5.337.421,36	1,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,150000%)	0,57	0,06	1,04	2,11	2.313.181,45	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,281000%)	0,58	0,06	1,05	2,13	2.057.588,70	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305500%)	0,58	0,06	1,05	2,14	4.208.128,65	0,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,380000%)	0,58	0,06	1,05	2,15	4.102.835,66	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,418000%)	0,59	0,06	1,06	2,16	1.873.873,80	0,40
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,48**	**0,07**	**1,01**	**2,05**	**110.118.518,64**	**23,47**

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	4,12	0,13	0,54	-0,11	22.520.428,71	4,80	234.189.159,32	9,62
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,27	0,05	0,75	1,64	1.277.622,69	0,27	172.732.636,30	0,74
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,12	0,04	0,77	1,63	8.272.298,27	1,76	6.585.276.803,86	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,96	0,13	0,53	0,05	16.911.891,53	3,60	5.326.196.241,75	0,32
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,76	0,10	0,58	1,24	13.744.257,31	2,93	5.237.322.277,24	0,26
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,29	0,05	0,74	1,61	3.925.342,05	0,84	8.089.813.404,09	0,05
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,05	0,01	0,73	1,84	1.520.814,11	0,32	213.006.900,19	0,71
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,72	0,10	0,44	1,16	18.427.231,75	3,93	5.893.692.124,08	0,31
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB IMA-B FI RF	3,88	0,13	0,54	0,02	1.287.583,01	0,27	195.815.836,57	0,66
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,69	0,10	0,44	1,17	33.737.242,35	7,19	5.113.275.189,23	0,66
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,74	0,10	0,58	1,24	26.142.698,69	5,57	7.766.523.482,49	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,94	0,13	0,54	0,07	22.048.928,12	4,70	5.024.622.442,53	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,28	0,05	0,74	1,66	666.524,98	0,14	8.662.829.991,66	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,09	0,05	0,79	1,74	1.539.434,92	0,33	13.568.473.477,14	0,01
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**2,23**	**0,11**	**0,54**	**0,80**	**172.022.298,49**	**36,66**		

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				
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,71	0,06	0,75	1,39	10.269.176,03	2,19	146.727.747,01	7,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4,27	0,13	0,57	-0,09	19.171.839,79	4,09	167.715.454,56	11,43
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,15	0,05	0,84	1,88	11.191.592,48	2,38	3.014.112.159,80	0,37
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,70	0,04	0,79	1,77	18.579.430,77	3,96	289.255.516,59	6,42
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,80	1,78	30.436.013,13	6,49	17.003.081.830,78	0,18
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,07	0,04	0,80	1,79	834.556,76	0,18	1.209.586.271,37	0,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	14.469.354,61	3,08	16.385.434.228,67	0,09
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	5,96	1,02	0,78	-0,35	2.662.416,82	0,57	140.121.724,94	1,90
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,91**	**0,09**	**0,76**	**1,37**	**107.614.380,39**	**22,93**		
		Renda Fixa	**1,26**	**0,09**	**0,73**	**1,30**	**389.755.197,52**	**83,06**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 11,85%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,74	-0,27	1,63	-1,49	795.470,07	0,17	789.752.289,29	0,10
BANESTES	BANESTES	BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	15,46	-1,28	0,69	-2,01	1.932.803,93	0,41	13.427.971,64	14,39
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	17,07	-1,05	2,42	-1,01	6.405.453,11	1,36	142.338.379,07	4,50
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	15,63	-0,69	0,53	-5,96	4.284.645,86	0,91	1.379.356.707,83	0,31
PLURAL	BEM	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	13,47	-0,69	0,96	-2,01	5.893.645,35	1,26	277.609.814,22	2,12
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	13,19	-0,41	0,79	-2,78	2.241.401,16	0,48	250.644.114,14	0,89
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13,26	-0,46	1,80	-1,33	21.094.229,08	4,50	981.220.828,10	2,15
MONGERAL	BEM	MAG BRASIL FIA	16,79	-0,78	0,47	-4,14	7.996.708,04	1,70	322.128.882,98	2,48
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	18,40	0,35	2,24	-4,06	4.968.959,53	1,06	896.519.554,15	0,55
		Sub-total Artigo 8º I	**13,96**	**-0,57**	**1,45**	**-2,48**	**55.613.316,13**	**11,85**		
		Renda Variável	**13,96**	**-0,57**	**1,45**	**-2,48**	**55.613.316,13**	**11,85**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 1,97%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	13,55	0,29	2,08	6,94	2.512.175,96	0,54	59.326.782,31	4,23
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	28,44	-0,81	10,80	6,09	1.285.093,81	0,27	131.192.634,72	0,98
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,50	1,52	8,42	12,80	813.059,51	0,17	763.217.450,44	0,11
SCHRODER	INTRAG	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	14,65	0,32	2,92	5,80	4.623.018,57	0,99	329.505.382,91	1,40
		Sub-total Artigo 9º II	**14,58**	**0,25**	**4,19**	**6,73**	**9.233.347,85**	**1,97**		
		Investimentos no Exterior	**14,58**	**0,25**	**4,19**	**6,73**	**9.233.347,85**	**1,97**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 3,13%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	8,32	-0,76	1,28	-1,09	2.548.730,30	0,54	198.806.431,16	1,28
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	4,52	-0,15	0,49	-0,19	3.707.217,87	0,79	534.662.069,19	0,69
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2,15	-0,23	-0,93	0,23	2.301.863,12	0,49	237.204.471,26	0,97
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,14	0,52	1,35	-3,56	5.133.067,11	1,09	134.701.203,42	3,81
		Sub-total Artigo 10º I	**5,71**	**-0,03**	**0,72**	**-1,58**	**13.690.878,40**	**2,92**		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PÁTRIA	XP	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	8,40	-0,80	-0,80	-2,23	976.791,94	0,21	163.335.990,28	0,60
		Sub-total Artigo 10º II	**8,40**	**-0,80**	**-0,80**	**-2,23**	**976.791,94**	**0,21**		
		Investimentos Estruturados	**5,50**	**-0,08**	**0,61**	**-1,62**	**14.667.670,34**	**3,13**		
		Total	**2,36**	**0,01**	**0,88**	**0,84**	**469.269.531,84**	**100,00**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	438.891,14
Sub-total Disponibilidades Financeiras	**438.891,14**
Total	**469.708.422,98**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos				
Artigo	**Tipo de Ativo**	**Valor(R$)**	**% Carteira**	**Mínimo**	**Objetivo**	**Máximo**	**ALM**	**Limite Legal**
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	110.118.518,64	23,47	0,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	172.022.298,49	36,66	0,00	15,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	107.614.380,39	22,93	0,00	26,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	**389.755.197,52**	**83,06**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	55.613.316,13	11,85	0,00	14,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**55.613.316,13**	**11,85**					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	9.233.347,85	1,97	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	**9.233.347,85**	**1,97**					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	13.690.878,40	2,92	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	976.791,94	0,21	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	**14.667.670,34**	**3,13**					15,00
Total		**469.269.531,84**	**100,00**					

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R$)	No Ano(R$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,01 125,77	2,05 115,39	3,05 113,29	5,21 91,71	10,73 84,17	1.069.508,54	2.137.765,65
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,54 67,31	0,80 45,24	2,69 99,87	4,27 75,11	11,86 93,09	923.772,51	1.371.586,52
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,76 94,97	1,37 76,90	2,73 101,68	5,28 92,79	13,09 102,70	813.436,87	1.449.362,73
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,45 0,45	-2,48 1,37	3,20 1,87	11,53 0,06	23,44 0,48	792.209,23	-1.413.166,95
Artigo 9º II % do CDI	4,19 521,84	6,73 378,97	11,55 429,60	12,38 217,84	18,78 147,38	370.910,83	582.399,24
Artigo 10º I % do CDI	0,72 89,33	-1,58 -88,71	1,39 51,74	6,84 120,32	14,70 115,36	97.383,96	-219.211,05
Artigo 10º II % do CDI	-0,80 -99,13	-2,23 -125,39	-1,24 -46,18			-7.828,17	-22.253,27
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO (Total)						**4.059.393,77**	**3.886.482,87**

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 (3,200000%)	1.155.576,23	0,00	0,00	0,00	1.165.083,54	9.507,31	18.874,98
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.157.461,35	0,00	0,00	0,00	1.168.010,71	10.549,36	21.098,77
NTN-B 150535 (5,640000%)	2.585.829,61	0,00	0,00	0,00	2.611.701,35	25.871,74	52.059,88
NTN-B 150545 (5,440500%)	2.130.297,94	0,00	0,00	0,00	2.151.305,76	21.007,82	42.235,17
NTN-B 150545 (5,470000%)	1.568.293,64	0,00	0,00	0,00	1.583.791,56	15.497,92	31.163,32
NTN-B 150545 (5,550000%)	2.054.617,06	0,00	0,00	0,00	2.075.033,29	20.416,23	41.063,71
NTN-B 150545 (5,680000%)	2.013.467,81	0,00	0,00	0,00	2.033.672,23	20.204,42	20.204,42
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,00	3.043.823,62	0,00	0,00	3.046.302,22	2.478,60	2.478,60
NTN-B 150545 (5,800000%)	9.337.171,88	0,00	0,00	0,00	9.431.671,77	94.499,89	190.277,84
NTN-B 150545 (5,825000%)	1.909.993,51	0,00	0,00	0,00	1.929.357,25	19.363,74	38.997,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150545 (5,847000%)	2.096.511,36	0,00	0,00	0,00	2.117.799,27	21.287,91	42.875,46
NTN-B 150545 (5,920000%)	5.283.496,66	0,00	0,00	0,00	5.337.421,36	53.924,70	108.645,99
NTN-B 150545 (6,150000%)	2.289.434,57	0,00	0,00	0,00	2.313.181,45	23.746,88	47.886,48
NTN-B 150545 (6,281000%)	2.036.277,21	0,00	0,00	0,00	2.057.588,70	21.311,49	42.999,22
NTN-B 150545 (6,305500%)	4.164.473,10	0,00	0,00	0,00	4.208.128,65	43.655,55	88.092,05
NTN-B 150545 (6,380000%)	4.060.056,79	0,00	0,00	0,00	4.102.835,66	42.778,87	86.344,81
NTN-B 150545 (6,418000%)	1.854.285,30	0,00	0,00	0,00	1.873.873,80	19.588,50	39.543,41
NTN-B 150824 (5,800000%)	1.547.513,99	0,00	0,00	44.584,11	1.518.321,70	15.391,82	31.267,59
NTN-B 150828 (5,200000%)	4.475.390,92	0,00	0,00	125.159,30	4.392.858,45	42.626,83	86.335,72
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.202.974,10	0,00	0,00	61.770,16	2.162.296,04	21.092,10	42.734,43
NTN-B 150828 (5,500000%)	5.715.760,05	0,00	0,00	161.648,53	5.609.761,59	55.650,07	112.884,76
NTN-B 150830 (4,800000%)	5.744.410,93	0,00	0,00	155.546,24	5.641.965,35	53.100,66	107.310,60
NTN-B 150832 (5,350000%)	1.978.634,07	0,00	0,00	54.671,58	1.943.021,67	19.059,18	38.628,14
NTN-B 150840 (5,480000%)	4.056.031,02	0,00	0,00	110.713,05	3.984.772,31	39.454,34	80.001,21
NTN-B 150840 (5,750000%)	1.265.630,11	0,00	0,00	35.492,91	1.242.685,74	12.548,54	25.480,07
NTN-B 150840 (5,800000%)	16.592.527,53	0,00	0,00	467.635,00	16.289.981,04	165.088,51	335.305,20
NTN-B 150840 (5,910000%)	3.120.800,17	0,00	0,00	88.919,15	3.063.169,00	31.287,98	63.583,66
NTN-B 150840 (6,050500%)	1.383.745,50	0,00	0,00	39.976,25	1.357.777,34	14.008,09	28.485,57
NTN-B 150840 (6,132000%)	10.678.147,46	0,00	0,00	310.967,94	10.475.877,77	108.698,25	221.126,45
NTN-B 150840 (6,190000%)	2.266.416,13	0,00	0,00	66.378,02	2.223.198,95	23.160,84	47.130,11
NTN-F 010135	0,00	1.003.422,72	0,00	0,00	1.006.073,12	2.650,40	2.650,40
	106.725.226,00	4.047.246,34	0,00	1.723.462,24	110.118.518,64	1.069.508,54	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22.398.481,43	0,00	0,00	0,00	22.520.428,71	121.947,28	-24.725,25
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.268.152,98	0,00	0,00	0,00	1.277.622,69	9.469,71	20.625,57
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	8.208.805,50	0,00	0,00	0,00	8.272.298,27	63.492,77	132.612,09
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	16.822.611,00	0,00	0,00	0,00	16.911.891,53	89.280,53	7.855,98

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	13.665.590,75	0,00	0,00	0,00	13.744.257,31	78.666,56	168.297,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.896.473,73	0,00	0,00	0,00	3.925.342,05	28.868,32	62.268,39
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1.553.644,32	0,00	-44.055,30	0,00	1.520.814,11	11.225,09	28.193,94
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	18.345.622,06	0,00	0,00	0,00	18.427.231,75	81.609,69	211.276,69
BNB IMA-B FI RF	1.280.728,96	0,00	0,00	0,00	1.287.583,01	6.854,05	301,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	33.589.773,88	0,00	0,00	0,00	33.737.242,35	147.468,47	390.718,47
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.992.796,04	0,00	0,00	0,00	26.142.698,69	149.902,65	321.326,98
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.930.864,44	0,00	0,00	0,00	22.048.928,12	118.063,68	15.552,43
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	661.614,44	0,00	0,00	0,00	666.524,98	4.910,54	10.889,15
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.527.421,75	0,00	0,00	0,00	1.539.434,92	12.013,17	26.393,68
	171.142.581,28	0,00	-44.055,30	0,00	172.022.298,49	923.772,51	

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	10.193.122,65	0,00	0,00	0,00	10.269.176,03	76.053,38	140.730,92
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	19.062.771,94	0,00	0,00	0,00	19.171.839,79	109.067,85	-16.847,76
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	11.097.965,50	0,00	0,00	0,00	11.191.592,48	93.626,98	205.997,94
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	18.432.896,32	0,00	0,00	0,00	18.579.430,77	146.534,45	323.095,94
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.193.523,15	0,00	0,00	0,00	30.436.013,13	242.489,98	531.587,05
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	827.903,66	0,00	0,00	0,00	834.556,76	6.653,10	14.703,18
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.350.998,63	0,00	0,00	0,00	14.469.354,61	118.355,98	259.345,73
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	2.641.761,67	0,00	0,00	0,00	2.662.416,82	20.655,15	-9.250,27
	106.800.943,52	0,00	0,00	0,00	107.614.380,39	813.436,87	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	782.691,97	0,00	0,00	0,00	795.470,07	12.778,10	-11.999,87
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	1.919.653,67	0,00	0,00	0,00	1.932.803,93	13.150,26	-39.575,81
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	6.254.076,53	0,00	0,00	0,00	6.405.453,11	151.376,58	-65.336,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	4.261.912,02	0,00	0,00	0,00	4.284.645,86	22.733,84	-271.667,51
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	5.837.481,55	0,00	0,00	0,00	5.893.645,35	56.163,80	-120.941,48
FIA CAIXA DIVIDENDOS	2.223.938,88	0,00	0,00	0,00	2.241.401,16	17.462,28	-64.091,78
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	20.721.875,20	0,00	0,00	0,00	21.094.229,08	372.353,88	-284.426,60
MAG BRASIL FIA	7.959.287,78	0,00	0,00	0,00	7.996.708,04	37.420,26	-345.030,46
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	4.860.189,30	0,00	0,00	0,00	4.968.959,53	108.770,23	-210.096,47
	54.821.106,90	0,00	0,00	0,00	55.613.316,13	792.209,23	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	2.460.951,47	0,00	0,00	0,00	2.512.175,96	51.224,49	163.027,33
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.159.793,79	0,00	0,00	0,00	1.285.093,81	125.300,02	73.782,10
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	749.921,98	0,00	0,00	0,00	813.059,51	63.137,53	92.264,79
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	4.491.769,78	0,00	0,00	0,00	4.623.018,57	131.248,79	253.325,02
	8.862.437,02	0,00	0,00	0,00	9.233.347,85	370.910,83	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	2.516.512,49	0,00	0,00	0,00	2.548.730,30	32.217,81	-28.058,90
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	3.689.016,73	0,00	0,00	0,00	3.707.217,87	18.201,14	-6.984,38
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.323.462,05	0,00	0,00	0,00	2.301.863,12	-21.598,93	5.229,42
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5.064.503,17	0,00	0,00	0,00	5.133.067,11	68.563,94	-189.397,19
	13.593.494,44	0,00	0,00	0,00	13.690.878,40	97.383,96	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA	984.620,11	0,00	0,00	0,00	976.791,94	-7.828,17	-22.253,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CLASSE C							
	984.620,11	0,00	0,00	0,00	976.791,94	-7.828,17	

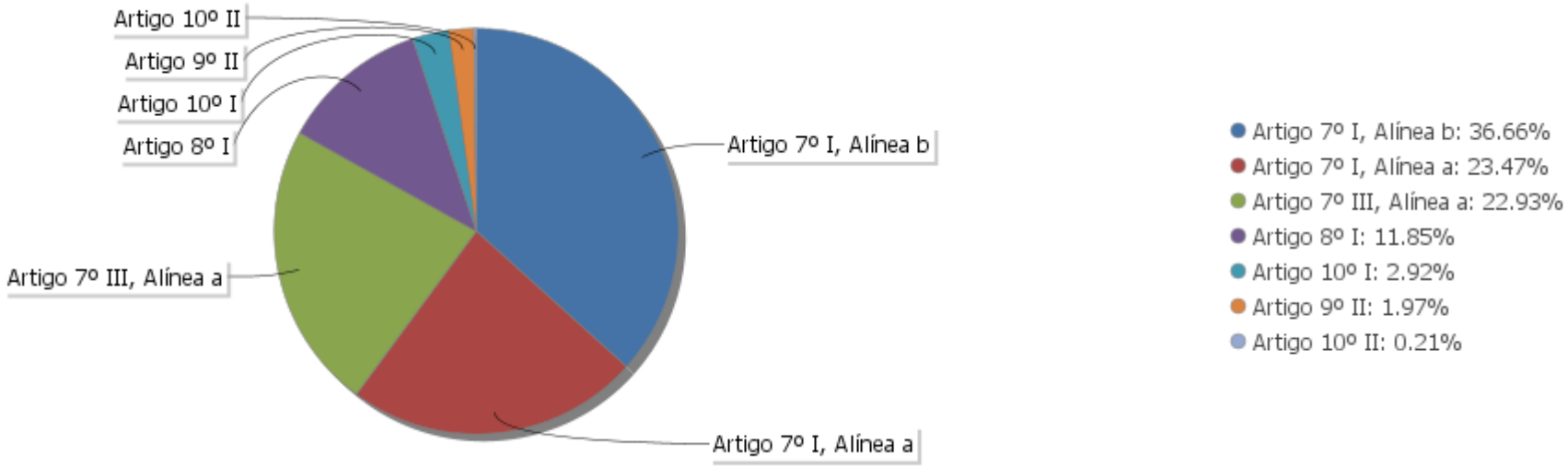
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

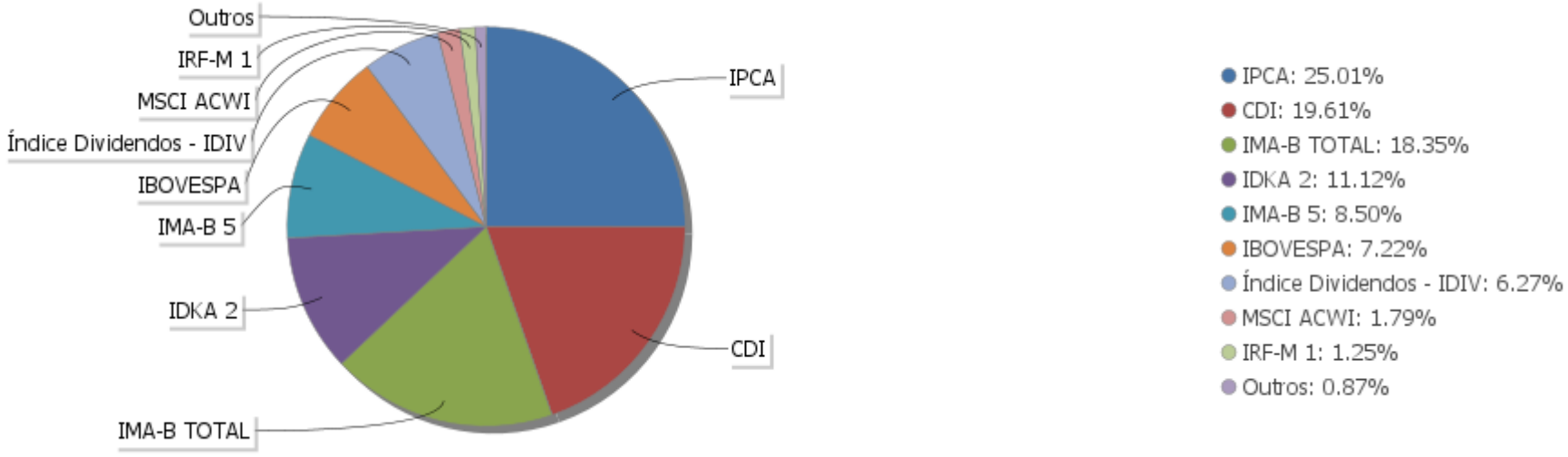
Período	Valor (R$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	314.087.418,38	66,93	68,23	314.087.418,38	66,93	68,23
de 31 dias a 365 dias	37.809.640,65	8,06	9,28	351.897.059,03	74,99	77,51
acima de 365 dias	117.372.472,81	25,01	22,48	469.269.531,84	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

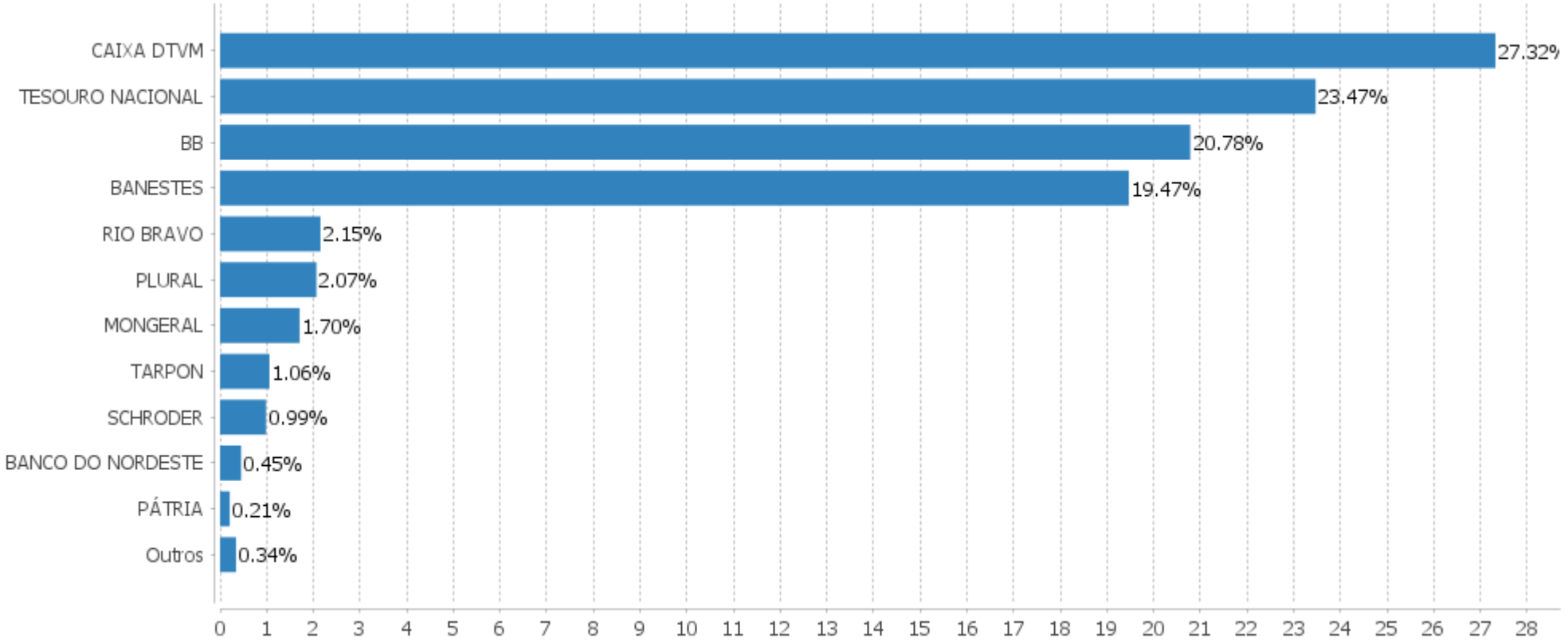


Alocação Por Estratégia



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	-0,04	0,88											0,84
INPC + 5,09%	1,01	1,19											2,21
p.p. indexador	-1,04	-0,31											-1,37
2023	1,22	0,03	1,05	1,20	1,64	2,00	1,13	-0,03	0,32	-0,29	2,67	2,11	13,81
INPC + 5,10%	0,90	1,13	1,10	0,89	0,80	0,31	0,33	0,66	0,51	0,54	0,50	0,95	8,93
p.p. indexador	0,32	-1,10	-0,05	0,32	0,85	1,69	0,80	-0,69	-0,18	-0,82	2,17	1,16	4,87
2022	0,23	0,39	2,25	-0,02	0,88	-0,66	0,71	1,00	0,55	1,72	-0,26	0,41	7,40
INPC + 4,93%	1,07	1,37	2,14	1,41	0,87	1,02	-0,20	0,13	0,08	0,85	0,76	1,11	11,13
p.p. indexador	-0,85	-0,97	0,11	-1,43	0,00	-1,68	0,91	0,88	0,47	0,86	-1,03	-0,70	-3,73
2021	-0,93	-1,16	0,23	0,72	1,07	0,17	-0,44	-0,62	-0,56	-1,41	1,62	0,55	-0,80
INPC + 5,45%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,05	1,49	1,35	1,65	1,59	1,27	1,22	16,14
p.p. indexador	-1,63	-2,36	-1,12	-0,08	-0,34	-0,87	-1,93	-1,97	-2,21	-3,00	0,35	-0,67	-16,94
2020	0,49	-0,30	-6,00	1,19	1,40	1,41	2,77	-1,09	-1,53	0,16	1,96	3,27	3,46
INPC + 6,00%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. indexador	-0,21	-0,89	-6,69	0,96	1,19	0,63	1,79	-1,94	-2,89	-1,22	0,55	1,29	-8,29
2019	2,03	0,57	0,45	0,98	2,17	2,28	1,23	-0,12	1,94	2,06	-1,14	1,47	14,79
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	1,15	-0,43	-0,77	-0,11	1,51	1,83	0,60	-0,75	1,50	1,49	-2,14	-0,25	4,02
2018	3,06	0,59	0,52	0,09	-2,34	-0,08	1,29	0,01	0,40	3,08	0,67	1,06	8,56
INPC + 6,00%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	2,32	-0,01	-0,04	-0,60	-3,25	-2,00	0,53	-0,53	-0,34	2,17	0,46	0,46	-1,03

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	31	41,89
Meses abaixo - Meta Atuarial	43	58,11

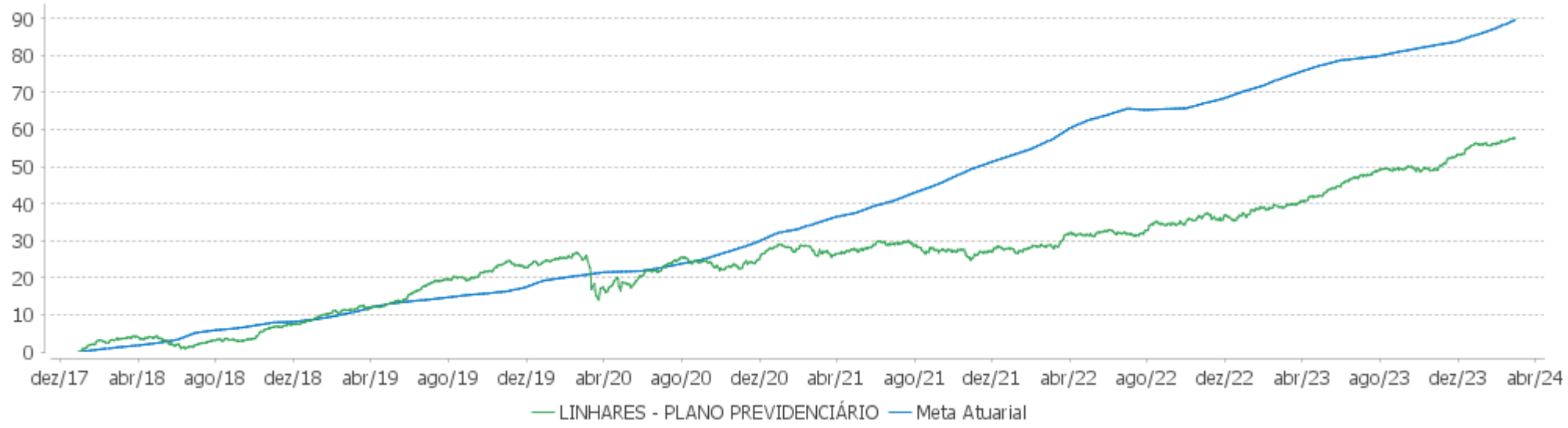
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,27	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-6,00	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,96	3,18	-0,21	2,04
06 meses	5,75	4,77	0,98	2,50
12 meses	13,35	9,11	4,24	2,36
24 meses	22,49	20,76	1,73	2,88
36 meses	24,86	41,02	-16,16	3,14
48 meses	26,25	58,53	-32,28	4,28
60 meses	41,50	74,59	-33,09	3,98
Desde 29/12/2017	57,63	94,95	-37,32	3,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

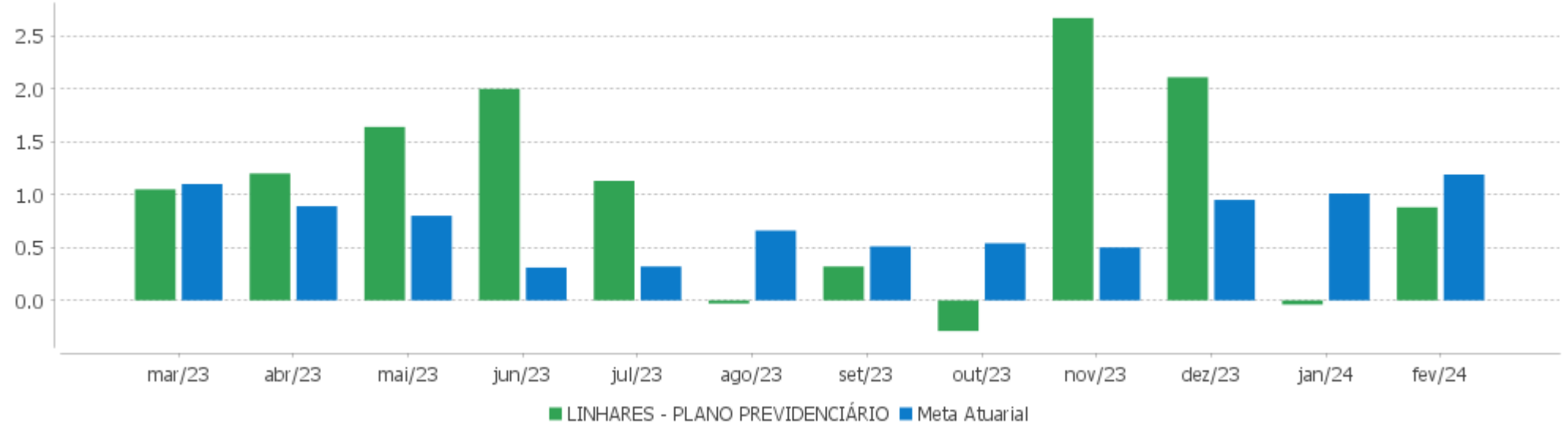


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150545 (5,800000%)	1,01	2,06	3,10	5,29	7,72	13,74	
Var. IPCA p.p.	0,18	0,81	1,28	2,67	3,23	3,40	
NTN-B 150545 (5,680000%)	1,00	2,04	2,87	2,13	4,48		
Var. IPCA p.p.	0,17	0,79	1,05	-0,49	-0,02		
NTN-B 150545 (5,920000%)	1,02	2,08	3,13	5,35	10,95	20,61	33,37
Var. IPCA p.p.	0,19	0,82	1,31	2,73	6,46	10,27	11,39
NTN-B 150840 (5,750000%)	1,01	2,05	3,06	5,23	7,64		
Var. IPCA p.p.	0,18	0,80	1,24	2,61	3,15		
NTN-B 150840 (5,480000%)	0,99	2,01	2,99	5,09	7,45		
Var. IPCA p.p.	0,16	0,76	1,17	2,47	2,95		
NTN-B 150828 (5,500000%)	0,99	2,01	2,89	4,99	10,36	22,98	39,47
Var. IPCA p.p.	0,16	0,76	1,07	2,38	5,86	12,64	17,49
NTN-F 010135	-0,46	0,27					
% do CDI	-56,82	17,17					
NTN-B 150545 (5,760000%)	1,07	2,11	2,95	2,20	4,56		
Var. IPCA p.p.	0,24	0,86	1,13	-0,42	0,06		
NTN-B 150840 (6,050500%)	1,03	2,10	3,14	5,38	11,06	17,34	
Var. IPCA p.p.	0,20	0,84	1,32	2,76	6,56	7,00	
NTN-B 150545 (5,470000%)	0,99	2,01	3,02	5,12	7,50		
Var. IPCA p.p.	0,16	0,75	1,20	2,50	3,00		
NTN-B 150545 (6,305500%)	1,05	2,14	3,23	5,54	11,37	21,33	34,29
Var. IPCA p.p.	0,22	0,88	1,41	2,92	6,87	10,99	12,31
NTN-B 150535 (4,410000%)	0,91	1,84	2,68	4,52	9,28	20,53	39,15
Var. IPCA p.p.	0,08	0,59	0,86	1,90	4,78	10,18	17,17
NTN-B 150840 (6,190000%)	1,04	2,12	3,17	5,45	11,21	17,55	
Var. IPCA p.p.	0,21	0,87	1,35	2,83	6,71	7,21	
NTN-B 150545 (6,150000%)	1,04	2,11	3,19	5,46	11,20	21,04	
Var. IPCA p.p.	0,21	0,86	1,37	2,85	6,70	10,70	
NTN-B 150830 (4,800000%)	0,94	1,90	2,74	4,68	9,66	21,39	36,94
Var. IPCA p.p.	0,11	0,65	0,92	2,06	5,16	11,05	14,97
NTN-B 150840 (6,132000%)	1,04	2,11	3,16	5,42	11,14	24,60	37,86
Var. IPCA p.p.	0,21	0,86	1,34	2,80	6,65	14,25	15,88
NTN-B 150535 (5,640000%)	1,00	2,03	3,00	5,14	10,59	23,40	36,25

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	1,18	2,52	6,09	13,05	14,28
NTN-B 150828 (5,270000%)	0,97	1,98	2,83	4,88	10,12	22,45	38,60
Var. IPCA p.p.	0,14	0,72	1,01	2,26	5,62	12,10	16,63
NTN-B 150545 (5,825000%)	1,01	2,06	3,11	5,30	10,85	20,43	33,14
Var. IPCA p.p.	0,18	0,81	1,29	2,68	6,36	10,09	11,16
NTN-B 150545 (6,418000%)	1,06	2,16	3,26	5,60	11,48	17,89	
Var. IPCA p.p.	0,23	0,90	1,44	2,98	6,99	7,55	
NTN-B 150545 (5,440500%)	0,99	2,00	3,01	5,10	7,48	13,37	
Var. IPCA p.p.	0,16	0,75	1,19	2,49	2,98	3,03	
NTN-B 150545 (6,281000%)	1,05	2,13	3,23	5,53	11,34	21,29	34,23
Var. IPCA p.p.	0,22	0,88	1,41	2,91	6,84	10,94	12,25
NTN-B 150840 (5,910000%)	1,02	2,08	3,10	5,31	10,91	17,13	
Var. IPCA p.p.	0,19	0,82	1,28	2,69	6,41	6,78	
NTN-B 150828 (5,200000%)	0,97	1,96	2,81	4,85	10,05	22,28	38,34
Var. IPCA p.p.	0,14	0,71	0,99	2,23	5,55	11,94	16,36
NTN-B 150545 (6,380000%)	1,05	2,15	3,25	5,58	11,44	17,84	
Var. IPCA p.p.	0,22	0,90	1,43	2,96	6,95	7,49	
NTN-B 150545 (5,847000%)	1,02	2,07	3,12	5,31	10,88	20,47	
Var. IPCA p.p.	0,19	0,81	1,29	2,69	6,38	10,13	
NTN-B 150824 (5,800000%)	1,01	2,06	2,90	5,08	10,61	23,61	36,47
Var. IPCA p.p.	0,18	0,81	1,08	2,46	6,11	13,26	14,49
NTN-B 150545 (5,550000%)	0,99	2,02	3,04	5,16	7,62	13,55	
Var. IPCA p.p.	0,16	0,77	1,22	2,54	3,12	3,21	
NTN-B 150832 (5,350000%)	0,98	1,99	2,91	4,98	10,27	22,70	35,24
Var. IPCA p.p.	0,15	0,73	1,09	2,36	5,77	12,36	13,26
NTN-B 150535 (3,200000%)	0,82	1,65	2,36	3,90	8,00	17,73	34,34
Var. IPCA p.p.	-0,01	0,39	0,54	1,28	3,50	7,39	12,37
NTN-B 150840 (5,800000%)	1,01	2,06	3,07	5,25	10,79	23,81	36,84
Var. IPCA p.p.	0,18	0,81	1,25	2,64	6,30	13,47	14,86
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,54	0,07	2,80	3,78	14,54	23,41	24,22
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,03	-0,05	-0,09	-0,16	-0,40	-0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,58	1,24	2,70	4,32	10,29	22,91	30,38
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,03	-0,06	-0,11	-0,15	-0,30	-0,62
BNB IMA-B FI RF	0,54	0,02	2,86	3,97	14,25	23,48	24,98
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,07	0,01	0,10	-0,45	-0,32	0,03
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
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,58	1,24	2,70	4,31	10,24	22,71	30,07
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,04	-0,05	-0,11	-0,20	-0,50	-0,93
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,79	1,74	2,66	5,58	12,63	27,10	34,47
% do CDI	98,07	98,20	98,83	98,15	99,15	98,92	99,65
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,73	1,84	2,78	5,17	10,16	23,04	31,64
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,18	1,75	-0,07	1,31	-4,54	-0,76	6,69
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,75	1,64	2,54	5,46	12,64	27,05	32,05
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	0,04	0,01	-0,06	-0,06	-0,09	-0,50
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,54	-0,11	2,76	3,77	14,48	23,10	19,52
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,21	-0,09	-0,10	-0,22	-0,70	-5,43
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,44	1,16	2,59	4,30	9,78	22,13	29,78
Var. IDKA 2 p.p.	0,02	-0,07	-0,11	-0,16	-0,33	-0,38	-0,94
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,44	1,17	2,59	4,43	9,98	22,02	29,71
Var. IDKA 2 p.p.	0,02	-0,06	-0,11	-0,03	-0,13	-0,48	-1,01
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,77	1,63	2,59	5,52	14,98	26,64	30,22
Var. IPCA p.p.	-0,06	0,38	0,77	2,90	10,49	16,29	8,24
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 VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,79	1,77	2,68	5,59	12,66	24,75	32,58
% do CDI	99,12	99,62	99,70	98,39	99,34	90,35	94,18
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
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	0,78	-0,35	2,19	2,92	10,40		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,23	-0,44	-0,66	-0,94	-4,30		
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
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
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,80	1,79	2,70	5,61	12,55	26,93	34,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	100,20	100,95	100,29	98,76	98,49	98,30	98,53
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
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	2,24	-4,06	5,39	15,20	49,41	60,84	96,95
Var. IBOVESPA p.p.	1,25	-0,21	4,06	3,73	26,46	46,81	79,70
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	0,53	-5,96	-1,05	7,60	17,03	4,59	15,06
Var. IBOVESPA p.p.	-0,46	-2,11	-2,38	-3,87	-5,93	-9,44	-2,19
FIA CAIXA DIVIDENDOS	0,79	-2,78	3,74	12,32	24,33	29,35	39,45
Var. IBOVESPA p.p.	-0,21	1,07	2,41	0,85	1,38	15,32	22,19
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	1,63	-1,49	3,67	6,16	16,93	2,55	-5,25
Var. IBOVESPA p.p.	0,64	2,36	2,35	-5,31	-6,03	-11,49	-22,51
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	0,96	-2,01	2,11	12,06	23,81	31,04	43,22
Var. IBOVESPA p.p.	-0,03	1,84	0,79	0,58	0,85	17,01	25,97
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
MAG BRASIL FIA	0,47	-4,14	1,19	9,81	15,95	2,23	3,32
Var. IBOVESPA p.p.	-0,52	-0,29	-0,14	-1,66	-7,00	-11,80	-13,93
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	0,69	-2,01	2,61	15,27	17,74	14,95	5,44
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,22	0,63	-1,47	2,20	-8,42	-17,57	-39,25
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	2,08	6,94	9,18	7,99	14,23	6,26	9,32
Var. MSCI ACWI p.p.	-2,71	-0,85	-1,52	-4,35	-1,58	0,58	4,93
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,92	5,80	10,11	11,66	16,02	9,69	5,69
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,87	-1,99	-0,58	-0,68	0,21	4,02	1,30
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	10,80	6,09	18,45	18,79	28,29	-18,82	-47,84
Var. MSCI ACWI p.p.	6,01	-1,70	7,76	6,46	12,48	-24,50	-52,23
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8,42	12,80	17,34	21,85	38,33	14,96	-16,08
Var. IPCA + 6,00% p.p.	7,15	10,58	14,07	16,30	27,61	-8,94	-61,29
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	1,28	-1,09	2,14	9,56	21,76		
Var. IBOVESPA p.p.	0,29	2,76	0,81	-1,91	-1,20		
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1,35	-3,56	0,77	6,54	12,44	16,25	
Var. IBOVESPA p.p.	0,36	0,29	-0,56	-4,93	-10,52	2,21	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	-0,93	0,23	1,23	4,82	12,82		
Var. S&P 500 p.p.	-6,73	-9,75	-11,42	-9,65	-10,01		
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	0,49	-0,19	1,85	6,71	14,52	23,51	29,17
% do CDI	61,52	-10,59	68,77	118,05	113,91	85,80	84,34
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	-0,80	-2,23	-1,24				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 7,00% p.p.	-2,14	-4,60	-4,74				
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO	0,88	0,84	2,96	5,75	13,35	22,49	24,86
Var. INPC + 5,09% p.p.	-0,31	-1,37	-0,21	0,98	4,24	1,58	-15,95
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

Cotização e Taxas

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO ÍNDICE SMALL CAP - SMLL, APURADO PELA B3.	2,00
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		
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 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
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
PÚBLICOS FI						
BNB IMA-B FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES			D+5 du	D+7 du	-	2,00
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	D+0	D+0	D+0	D+2		
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
FIA CAIXA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	D+1	D+1	D+1	D+5		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		
MAG BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C						0,08
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3 du		
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		1,20
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	D+1 du	D+1 du	D+30	D+32	O fundo cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o indice IBOV_FEC. A taxa de performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro	

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

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150535 (3,200000%)	1.165.083,54	3,200000	955.539,34	5,670000	-209.544,20
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.168.010,71	4,410000	1.057.286,58	5,670000	-110.724,13
NTN-B 150535 (5,640000%)	2.611.701,35	5,640000	2.605.614,22	5,670000	-6.087,13
NTN-B 150545 (5,440500%)	2.151.305,76	5,440500	2.076.654,11	5,743100	-74.651,65
NTN-B 150545 (5,470000%)	1.583.791,56	5,470000	1.534.145,69	5,743100	-49.645,87
NTN-B 150545 (5,550000%)	2.075.033,29	5,550000	2.027.739,34	5,743100	-47.293,95
NTN-B 150545 (5,680000%)	2.033.672,23	5,680000	2.018.845,75	5,743100	-14.826,48
NTN-B 150545 (5,760000%)	3.046.302,22	5,760000	3.050.502,61	5,743100	4.200,39
NTN-B 150545 (5,800000%)	9.431.671,77	5,800000	9.493.911,18	5,743100	62.239,41
NTN-B 150545 (5,825000%)	1.929.357,25	5,825000	1.947.697,00	5,743100	18.339,75
NTN-B 150545 (5,847000%)	2.117.799,27	5,847000	2.143.356,06	5,743100	25.556,79
NTN-B 150545 (5,920000%)	5.337.421,36	5,920000	5.447.326,08	5,743100	109.904,72
NTN-B 150545 (6,150000%)	2.313.181,45	6,150000	2.423.504,26	5,743100	110.322,81
NTN-B 150545 (6,281000%)	2.057.588,70	6,281000	2.187.824,03	5,743100	130.235,33
NTN-B 150545 (6,305500%)	4.208.128,65	6,305500	4.486.817,98	5,743100	278.689,33
NTN-B 150545 (6,380000%)	4.102.835,66	6,380000	4.411.222,43	5,743100	308.386,77
NTN-B 150545 (6,418000%)	1.873.873,80	6,418000	2.023.292,55	5,743100	149.418,75
NTN-B 150824 (5,800000%)	1.518.321,70	5,800000	1.508.451,48	7,296700	-9.870,22
NTN-B 150828 (5,200000%)	4.392.858,45	5,200000	4.335.754,69	5,547200	-57.103,76
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.162.296,04	5,270000	2.139.835,15	5,547200	-22.460,89
NTN-B 150828 (5,500000%)	5.609.761,59	5,500000	5.599.810,54	5,547200	-9.951,05
NTN-B 150830 (4,800000%)	5.641.965,35	4,800000	5.427.033,99	5,550000	-214.931,36
NTN-B 150832 (5,350000%)	1.943.021,67	5,350000	1.907.218,17	5,640000	-35.803,50
NTN-B 150840 (5,480000%)	3.984.772,31	5,480000	3.901.727,32	5,685800	-83.044,99
NTN-B 150840 (5,750000%)	1.242.685,74	5,750000	1.250.833,92	5,685800	8.148,18
NTN-B 150840 (5,800000%)	16.289.981,04	5,800000	16.480.299,32	5,685800	190.318,28
NTN-B 150840 (5,910000%)	3.063.169,00	5,910000	3.133.670,76	5,685800	70.501,76
NTN-B 150840 (6,050500%)	1.357.777,34	6,050500	1.408.835,17	5,685800	51.057,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150840 (6,132000%)	10.475.877,77	6,132000	10.959.069,88	5,685800	483.192,11
NTN-B 150840 (6,190000%)	2.223.198,95	6,190000	2.339.280,84	5,685800	116.081,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
5	15/02/2024	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,00	44.055,30	17.199,57341538	2,5614181780
8	27/02/2024	NTN-F 010135	1.003.422,72	0,00	1.040,00000000	964,8295400000
6	28/02/2024	NTN-B 150545 (5,760000%)	3.043.823,62	0,00	686,00000000	4.437,0606705500
	Total		**4.047.246,34**	**44.055,30**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 5.549.597,56** **Value-At-Risk: 1,18%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite(5)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,83	0,59	5,00	0,41	-0,08	0,73	389.755.197,52	83,06
Artigo 8º	12,24	6,30	20,00	0,70	0,05	1,45	55.613.316,13	11,85
Artigo 9º	15,03	7,10	20,00	-0,00	0,23	4,19	9.233.347,85	1,97
Artigo 10º	6,93	2,98	20,00	0,08	-0,03	0,62	14.667.670,34	3,13
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO		1,18		1,18			469.269.531,84	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,59%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,800000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,12	1,01	1.518.321,70	0,32
NTN-B 150828 (5,200000%)	0,41	0,10	-0,00	0,12	0,41	0,97	4.392.858,45	0,94
NTN-B 150828 (5,270000%)	0,41	0,10	-0,00	0,12	0,42	0,97	2.162.296,04	0,46
NTN-B 150828 (5,500000%)	0,42	0,10	-0,00	0,12	0,44	0,99	5.609.761,59	1,20
NTN-B 150830 (4,800000%)	0,53	0,11	-0,00	0,12	0,26	0,94	5.641.965,35	1,20
NTN-B 150832 (5,350000%)	0,71	0,11	0,00	0,13	0,25	0,98	1.943.021,67	0,41
NTN-F 010135	6,10	2,74	0,00	2,74	-0,21	-0,46	1.006.073,12	0,21
NTN-B 150535 (3,200000%)	0,53	0,11	-0,00	0,12	0,04	0,82	1.165.083,54	0,25
NTN-B 150535 (4,410000%)	0,66	0,11	0,00	0,13	0,16	0,91	1.168.010,71	0,25
NTN-B 150535 (5,640000%)	0,80	0,11	0,00	0,13	0,25	1,00	2.611.701,35	0,56
NTN-B 150840 (5,480000%)	0,94	0,11	0,00	0,13	0,20	0,99	3.984.772,31	0,85
NTN-B 150840 (5,750000%)	0,97	0,11	0,00	0,13	0,21	1,01	1.242.685,74	0,26
NTN-B 150840 (5,800000%)	0,98	0,11	0,00	0,13	0,21	1,01	16.289.981,04	3,47
NTN-B 150840 (5,910000%)	0,99	0,11	0,00	0,13	0,22	1,02	3.063.169,00	0,65
NTN-B 150840 (6,050500%)	1,01	0,11	0,00	0,13	0,23	1,03	1.357.777,34	0,29
NTN-B 150840 (6,132000%)	1,02	0,11	0,00	0,13	0,23	1,04	10.475.877,77	2,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,190000%)	1,03	0,11	0,00	0,13	0,23	1,04	2.223.198,95	0,47
NTN-B 150545 (5,440500%)	1,10	0,11	0,00	0,13	0,17	0,99	2.151.305,76	0,46
NTN-B 150545 (5,470000%)	1,10	0,11	0,00	0,13	0,17	0,99	1.583.791,56	0,34
NTN-B 150545 (5,550000%)	1,30	0,24	0,00	0,25	0,15	0,99	2.075.033,29	0,44
NTN-B 150545 (5,680000%)	0,19	0,20	-0,00	0,21	1,07	1,00	2.033.672,23	0,43
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,30	0,20	-0,00	0,22	0,89	1,07	3.046.302,22	0,65
NTN-B 150545 (5,800000%)	1,14	0,11	0,00	0,13	0,18	1,01	9.431.671,77	2,01
NTN-B 150545 (5,825000%)	1,15	0,11	0,00	0,13	0,18	1,01	1.929.357,25	0,41
NTN-B 150545 (5,847000%)	1,15	0,11	0,00	0,13	0,19	1,02	2.117.799,27	0,45
NTN-B 150545 (5,920000%)	1,16	0,11	0,00	0,14	0,19	1,02	5.337.421,36	1,14
NTN-B 150545 (6,150000%)	1,19	0,11	0,00	0,14	0,20	1,04	2.313.181,45	0,49
NTN-B 150545 (6,281000%)	1,20	0,11	0,00	0,14	0,20	1,05	2.057.588,70	0,44
NTN-B 150545 (6,305500%)	1,21	0,11	0,00	0,14	0,20	1,05	4.208.128,65	0,90
NTN-B 150545 (6,380000%)	1,22	0,11	0,00	0,14	0,21	1,05	4.102.835,66	0,87
NTN-B 150545 (6,418000%)	1,22	0,11	0,00	0,14	0,21	1,06	1.873.873,80	0,40
Sub-total	0,92	0,11	0,00		0,23	1,01	110.118.518,64	23,47

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	1,66	1,86	0,07	0,09	-0,16	0,54	22.520.428,71	4,80
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,19	0,10	0,00	0,03	-0,29	0,75	1.277.622,69	0,27
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,09	0,15	0,00	0,19	-0,31	0,77	8.272.298,27	1,76
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,66	1,81	0,05	0,01	-0,16	0,53	16.911.891,53	3,60
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,86	0,95	0,02	0,01	-0,26	0,58	13.744.257,31	2,93
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,19	0,10	0,00	0,02	-0,33	0,74	3.925.342,05	0,84
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,53	0,37	0,00	1,79	-0,13	0,73	1.520.814,11	0,32
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,01	0,74	0,02	0,10	-0,35	0,44	18.427.231,75	3,93
BNB IMA-B FI RF	1,65	1,75	0,00	0,09	-0,16	0,54	1.287.583,01	0,27
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,01	0,71	0,04	0,10	-0,36	0,44	33.737.242,35	7,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,85	0,94	0,04	0,01	-0,26	0,58	26.142.698,69	5,57
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,66	1,81	0,07	0,01	-0,16	0,54	22.048.928,12	4,70
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,19	0,09	0,00	0,04	-0,31	0,74	666.524,98	0,14
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,12	0,03	0,00	0,03	-0,13	0,79	1.539.434,92	0,33
Sub-total	1,04	1,07	0,33		-0,25	0,54	172.022.298,49	36,66

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,36	0,38	0,01	0,38	-0,15	0,75	10.269.176,03	2,19
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	1,79	1,91	0,06	0,13	-0,13	0,57	19.171.839,79	4,09
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,06	0,03	0,00	0,03	0,71	0,84	11.191.592,48	2,38
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,06	0,03	0,00	0,03	-0,12	0,79	18.579.430,77	3,96
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	0,00	0,01	0,07	0,80	30.436.013,13	6,49
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,05	0,02	0,00	0,02	0,03	0,80	834.556,76	0,18
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,01	0,52	0,82	14.469.354,61	3,08
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	4,99	2,17	0,00	2,25	-0,00	0,78	2.662.416,82	0,57
Sub-total	0,41	0,40	0,07		-0,10	0,76	107.614.380,39	22,93

Renda Variável **Value-At-Risk: 6,30%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	13,28	8,19	0,01	4,05	0,06	1,63	795.470,07	0,17
BANESTES DIVIDENDOS FIC FIA	15,59	8,09	0,03	4,02	-0,01	0,69	1.932.803,93	0,41
BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	12,94	6,98	0,08	4,28	0,13	2,42	6.405.453,11	1,36
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	14,37	6,53	0,05	1,34	-0,02	0,53	4.284.645,86	0,91
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	12,88	6,22	0,07	2,10	0,01	0,96	5.893.645,35	1,26
FIA CAIXA DIVIDENDOS	12,61	5,81	0,02	2,38	-0,00	0,79	2.241.401,16	0,48
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,87	6,25	0,26	1,78	0,08	1,80	21.094.229,08	4,50
MAG BRASIL FIA	13,72	8,41	0,10	5,82	-0,02	0,47	7.996.708,04	1,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	12,14	8,20	0,07	5,75	0,12	2,24	4.968.959,53	1,06
Sub-total	12,24	6,30	0,70		0,05	1,45	55.613.316,13	11,85

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 2,98%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	11,80	4,91	0,02	2,38	0,04	1,28	2.548.730,30	0,54
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	4,53	2,34	0,02	2,34	-0,07	0,49	3.707.217,87	0,79
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	4,80	1,30	0,00	6,82	-0,36	-0,93	2.301.863,12	0,49
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	11,25	4,53	0,04	3,77	0,05	1,35	5.133.067,11	1,09
Sub-total	7,22	3,19	0,08		-0,01	0,72	13.690.878,40	2,92

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	2,91	0,05	-0,00	0,11	-0,55	-0,80	976.791,94	0,21
Sub-total	2,91	0,05	-0,00		-0,55	-0,80	976.791,94	0,21

Investimentos no Exterior **Value-At-Risk: 7,10%**

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	15,87	7,11	-0,00	7,23	0,08	2,08	2.512.175,96	0,54
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	33,63	15,27	0,01	13,94	0,30	10,80	1.285.093,81	0,27
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,18	10,22	-0,00	10,21	0,40	8,42	813.059,51	0,17
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	12,36	6,20	-0,00	6,65	0,17	2,92	4.623.018,57	0,99
Sub-total	15,03	7,10	-0,00		0,23	4,19	9.233.347,85	1,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

(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 Politica de Investimentos (%)