LDB EMPRESAS

LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO

JUNHO 2024



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 28.06.2024.

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 28.06.2024.

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 28.06.2024.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **84,51%**

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%)	0,22	0,04	0,84	5,62	1.571.340,16	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,200000%)	0,27	0,03	0,79	5,33	4.537.749,66	0,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,27	0,03	0,80	5,36	2.234.103,60	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,500000%)	0,27	0,04	0,81	5,48	5.800.225,23	1,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,800000%)	0,30	0,03	0,76	5,13	5.820.748,36	1,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,350000%)	0,37	0,04	0,80	5,40	2.008.051,87	0,41
TESOURO NACIONAL	NTN-F 010135	8,34	-0,70	-1,47	-5,22	9.229.009,93	1,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (3,200000%)	0,31	0,03	0,64	4,34	1.168.388,95	0,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,410000%)	0,35	0,03	0,73	4,94	1.173.030,00	0,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	0,40	0,04	0,82	5,54	2.626.248,83	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,480000%)	2,82	0,04	0,81	5,47	4.119.807,83	0,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,750000%)	2,90	0,04	0,83	5,60	1.285.880,61	0,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,800000%)	0,47	0,04	0,84	5,62	16.858.823,65	3,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,910000%)	0,47	0,04	0,84	5,68	3.171.220,02	0,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,050500%)	0,48	0,04	0,85	5,75	1.406.286,01	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%)	0,48	0,04	0,86	5,79	10.852.892,32	2,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,190000%)	0,48	0,04	0,87	5,81	2.303.622,93	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,440500%)	0,51	0,04	0,81	5,45	2.164.239,72	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,470000%)	0,51	0,04	0,81	5,46	1.593.311,12	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,550000%)	0,67	0,09	0,82	5,50	2.087.491,16	0,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,680000%)	2,83	0,04	0,83	4,49	2.045.851,85	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	2,86	0,09	0,83	3,56	3.064.516,16	0,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,800000%)	0,53	0,04	0,84	5,62	9.487.999,14	1,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,825000%)	0,53	0,04	0,84	5,64	1.940.873,39	0,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,847000%)	0,53	0,04	0,84	5,65	2.130.432,49	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,920000%)	0,54	0,04	0,84	5,68	5.369.193,70	1,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,150000%)	0,55	0,04	0,86	5,79	2.326.840,18	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,160000%)	4,21	0,09	0,86	0,93	6.933.889,18	1,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,281000%)	0,55	0,04	0,87	5,86	2.069.671,43	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305500%)	0,55	0,04	0,87	5,87	4.232.814,86	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,330000%)	4,29	0,04	0,18	0,18	2.326.035,27	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,380000%)	0,56	0,04	0,88	5,91	4.126.819,77	0,85
TESOURO	NTN-B 150545 (6,418000%)	0,56	0,04	0,88	5,93	1.884.806,64	0,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,120000%)	4,19	0,04	0,86	1,21	1.432.997,35	0,29
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,55**	**-0,01**	**0,67**	**5,17**	**131.385.213,37**	**26,97**

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 PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	3,95	-0,51	-0,99	-1,36	22.239.625,85	4,57	215.337.951,65	10,33
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,35	-0,02	0,62	4,51	1.313.690,34	0,27	190.535.352,32	0,69
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,61	-0,08	0,38	3,84	8.452.018,15	1,73	6.543.333.888,45	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,81	-0,51	-0,99	-1,23	14.655.965,78	3,01	4.649.802.742,18	0,32
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,72	-0,18	0,37	3,20	14.010.558,35	2,88	4.972.766.310,86	0,28
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,35	-0,02	0,61	4,40	4.033.064,16	0,83	8.181.670.586,25	0,05
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,87	0,05	1,16	5,70	1.578.472,37	0,32	221.082.579,45	0,71
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,70	-0,22	0,26	3,11	18.783.094,03	3,86	5.571.325.652,69	0,34
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB IMA-B FI RF	3,72	-0,47	-0,86	-0,98	1.274.608,91	0,26	218.215.436,00	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	-0,24	0,20	2,96	34.332.028,96	7,05	4.585.046.250,25	0,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,72	-0,18	0,37	3,21	26.650.334,76	5,47	7.303.046.549,52	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,80	-0,51	-1,00	-1,22	21.763.893,49	4,47	4.133.113.700,82	0,53
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	-0,02	0,61	4,48	685.039,68	0,14	7.877.165.450,51	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,03	0,78	5,00	1.588.679,72	0,33	11.312.134.510,29	0,01
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**2,18**	**-0,30**	**-0,14**	**1,64**	**171.361.074,55**	**35,18**		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,81	-0,10	0,34	3,71	10.504.618,95	2,16	147.615.964,09	7,12
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4,16	-0,53	-1,15	-1,56	18.888.491,75	3,88	147.917.571,71	12,77
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,09	0,04	0,84	5,51	12.003.551,65	2,46	3.191.210.876,46	0,38
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,63	0,03	0,79	5,83	19.319.880,73	3,97	308.335.783,81	6,27
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,04	0,79	5,24	29.582.096,32	6,07	17.821.452.916,03	0,17
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,08	0,04	0,81	5,25	862.918,23	0,18	1.266.912.543,72	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,04	0,82	5,36	15.221.310,06	3,12	16.508.104.382,05	0,09
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	5,98	-0,25	-0,74	-4,09	2.562.419,52	0,53	134.858.916,32	1,90
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,89**	**-0,08**	**0,38**	**3,76**	**108.945.287,21**	**22,36**		
		Renda Fixa	**1,25**	**-0,15**	**0,25**	**3,23**	**411.691.575,13**	**84,51**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 8,60%

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	16,41	-1,14	0,61	-5,58	762.396,13	0,16	732.971.794,55	0,10
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	13,49	-0,32	1,90	-11,11	4.050.281,67	0,83	1.108.199.259,35	0,37
PLURAL	BEM	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	12,81	-0,42	2,00	-8,72	7.287.103,36	1,50	354.039.229,75	2,06
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	11,83	-0,22	1,90	-3,86	2.216.546,27	0,46	244.733.368,12	0,91
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,92	-0,44	1,78	-3,39	20.653.972,73	4,24	1.013.802.736,53	2,04
MOS	BEM	QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	18,52	-1,41	-1,16	-7,36	1.896.294,89	0,39	90.850.669,59	2,09
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	16,09	0,02	0,20	-3,03	5.022.299,63	1,03	852.260.138,16	0,59
		Sub-total Artigo 8º I	**12,40**	**-0,42**	**1,48**	**-5,99**	**41.888.894,68**	**8,60**		
		Renda Variável	**12,40**	**-0,42**	**1,48**	**-5,99**	**41.888.894,68**	**8,60**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 2,15%

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	12,32	1,05	8,98	17,51	2.760.404,93	0,57	65.189.037,13	4,23
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	27,26	2,00	12,97	13,30	1.372.389,60	0,28	139.972.616,43	0,98
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,09	1,17	11,56	27,09	916.042,40	0,19	820.358.590,52	0,11
SCHRODER	INTRAG	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	13,46	1,35	9,06	24,34	5.433.244,48	1,12	378.257.978,60	1,44
		Sub-total Artigo 9º II	**13,50**	**1,34**	**9,75**	**21,17**	**10.482.081,41**	**2,15**		
		Investimentos no Exterior	**13,50**	**1,34**	**9,75**	**21,17**	**10.482.081,41**	**2,15**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 4,74%

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	9,88	-0,33	1,24	-5,37	2.438.514,05	0,50	190.209.410,51	1,28
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	4,88	-0,54	-0,27	-1,91	3.643.199,00	0,75	478.386.448,77	0,76
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5,47	-0,47	1,25	1,58	8.126.607,58	1,67	480.672.277,99	1,69
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	4,13	0,02	0,58	-0,23	2.291.315,48	0,47	236.117.556,91	0,97
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,63	-0,40	0,81	-6,33	4.985.520,88	1,02	130.829.324,10	3,81
		Sub-total Artigo 10º I	**6,14**	**-0,40**	**0,81**	**-2,96**	**21.485.156,99**	**4,41**		

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	11,03	9,05	9,05	9,75	1.601.943,08	0,33	160.194.308,40	1,00
		Sub-total Artigo 10º II	**11,03**	**9,05**	**9,05**	**9,75**	**1.601.943,08**	**0,33**		
		Investimentos Estruturados	**5,83**	**0,20**	**1,33**	**-2,15**	**23.087.100,07**	**4,74**		
		Total	**2,30**	**-0,12**	**0,60**	**2,32**	**487.149.651,29**	**100,00**		

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	131.385.213,37	26,97	0,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	171.361.074,55	35,18	0,00	15,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	108.945.287,21	22,36	0,00	26,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	**411.691.575,13**	**84,51**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	41.888.894,68	8,60	0,00	14,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**41.888.894,68**	**8,60**					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	10.482.081,41	2,15	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	**10.482.081,41**	**2,15**					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	21.485.156,99	4,41	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.601.943,08	0,33	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	**23.087.100,07**	**4,74**					15,00
Total		**487.149.651,29**	**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	0,67 84,62	5,17 98,95	2,07 81,64	5,17 98,95	9,74 83,30	856.461,77	5.698.650,80
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,14 -17,30	1,64 31,35	0,27 10,85	1,64 31,35	6,42 54,92	-233.955,42	2.776.362,58
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,38 48,07	3,76 72,08	1,71 67,50	3,76 72,08	9,73 83,21	410.551,89	3.970.217,86
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,48 0,00	-5,99 1,67	-3,52 -0,24	-5,99 1,67	6,09 1,16	612.470,08	-3.105.613,17
Artigo 9º II % do CDI	9,75 1.237,08	21,17 405,40	10,92 431,46	21,17 405,40	31,79 271,87	931.407,25	1.831.132,80
Artigo 10º I % do CDI	0,81 103,28	-2,96 -56,74	-0,92 -36,21	-2,96 -56,74	6,05 51,78	173.509,59	-424.932,46
Artigo 10º II % do CDI	9,05 1.148,56	9,75 186,82	7,37 291,41	9,75 186,82		127.009,42	132.456,10
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO (Total)						**2.877.454,58**	**10.878.274,51**

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%)	1.160.996,71	0,00	0,00	0,00	1.168.388,95	7.392,24	49.450,16
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.164.530,15	0,00	0,00	0,00	1.173.030,00	8.499,85	56.291,55
NTN-B 150535 (5,640000%)	2.604.797,63	0,00	0,00	0,00	2.626.248,83	21.451,20	140.967,98
NTN-B 150545 (5,440500%)	2.146.885,02	0,00	0,00	0,00	2.164.239,72	17.354,70	114.127,38
NTN-B 150545 (5,470000%)	1.580.498,18	0,00	0,00	0,00	1.593.311,12	12.812,94	84.238,78
NTN-B 150545 (5,550000%)	2.070.589,56	0,00	0,00	0,00	2.087.491,16	16.901,60	111.091,09
NTN-B 150545 (5,680000%)	2.029.081,11	0,00	0,00	0,00	2.045.851,85	16.770,74	89.701,05
NTN-B 150545 (5,760000%)	3.039.225,37	0,00	0,00	0,00	3.064.516,16	25.290,79	107.299,31
NTN-B 150545 (5,800000%)	9.409.368,57	0,00	0,00	0,00	9.487.999,14	78.630,57	516.146,68
NTN-B 150545 (5,825000%)	1.924.752,45	0,00	0,00	0,00	1.940.873,39	16.120,94	105.810,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150545 (5,847000%)	2.112.702,58	0,00	0,00	0,00	2.130.432,49	17.729,91	116.360,66
NTN-B 150545 (5,920000%)	5.324.217,99	0,00	0,00	0,00	5.369.193,70	44.975,71	295.073,27
NTN-B 150545 (6,150000%)	2.306.951,66	0,00	0,00	0,00	2.326.840,18	19.888,52	130.350,88
NTN-B 150545 (6,160000%)	6.874.596,70	0,00	0,00	0,00	6.933.889,18	59.292,48	63.753,39
NTN-B 150545 (6,281000%)	2.051.780,88	0,00	0,00	0,00	2.069.671,43	17.890,55	117.196,42
NTN-B 150545 (6,305500%)	4.196.148,00	0,00	0,00	0,00	4.232.814,86	36.666,86	240.163,43
NTN-B 150545 (6,330000%)	0,00	2.321.752,74	0,00	0,00	2.326.035,27	4.282,53	4.282,53
NTN-B 150545 (6,380000%)	4.090.844,41	0,00	0,00	0,00	4.126.819,77	35.975,36	235.567,86
NTN-B 150545 (6,418000%)	1.868.323,09	0,00	0,00	0,00	1.884.806,64	16.483,55	107.919,51
NTN-B 150824 (5,800000%)	1.558.319,46	0,00	0,00	0,00	1.571.340,16	13.020,70	84.286,05
NTN-B 150828 (5,200000%)	4.502.173,33	0,00	0,00	0,00	4.537.749,66	35.576,33	231.226,93
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.216.472,96	0,00	0,00	0,00	2.234.103,60	17.630,64	114.541,99
NTN-B 150828 (5,500000%)	5.753.453,72	0,00	0,00	0,00	5.800.225,23	46.771,51	303.348,40
NTN-B 150830 (4,800000%)	5.776.864,67	0,00	0,00	0,00	5.820.748,36	43.883,69	286.093,61
NTN-B 150832 (5,350000%)	1.992.085,28	0,00	0,00	0,00	2.008.051,87	15.966,59	103.658,34
NTN-B 150840 (5,480000%)	4.086.649,48	0,00	0,00	0,00	4.119.807,83	33.158,35	215.036,73
NTN-B 150840 (5,750000%)	1.275.272,22	0,00	0,00	0,00	1.285.880,61	10.608,39	68.674,94
NTN-B 150840 (5,800000%)	16.719.115,87	0,00	0,00	0,00	16.858.823,65	139.707,78	904.147,81
NTN-B 150840 (5,910000%)	3.144.680,32	0,00	0,00	0,00	3.171.220,02	26.539,70	171.634,68
NTN-B 150840 (6,050500%)	1.394.369,84	0,00	0,00	0,00	1.406.286,01	11.916,17	76.994,24
NTN-B 150840 (6,132000%)	10.760.273,71	0,00	0,00	0,00	10.852.892,32	92.618,61	598.141,00
NTN-B 150840 (6,190000%)	2.283.866,31	0,00	0,00	0,00	2.303.622,93	19.756,62	127.554,09
NTN-B 150850 (6,120000%)	1.420.781,78	0,00	0,00	0,00	1.432.997,35	12.215,57	17.097,56
NTN-F 010135	9.366.329,85	0,00	0,00	0,00	9.229.009,93	-137.319,92	-289.578,30
	128.206.998,86	2.321.752,74	0,00	0,00	131.385.213,37	856.461,77	

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	22.462.798,20	0,00	0,00	0,00	22.239.625,85	-223.172,35	-305.528,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.305.639,67	0,00	0,00	0,00	1.313.690,34	8.050,67	56.693,22
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	8.419.775,32	0,00	0,00	0,00	8.452.018,15	32.242,83	312.331,97
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	14.801.801,45	0,00	0,00	0,00	14.655.965,78	-145.835,67	-182.069,77
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	13.958.374,17	0,00	0,00	0,00	14.010.558,35	52.184,18	434.598,24
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.008.793,02	0,00	0,00	0,00	4.033.064,16	24.271,14	169.990,50
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1.560.428,25	0,00	0,00	0,00	1.578.472,37	18.044,12	85.852,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	18.735.157,53	0,00	0,00	0,00	18.783.094,03	47.936,50	567.138,97
BNB IMA-B FI RF	1.285.640,66	0,00	0,00	0,00	1.274.608,91	-11.031,75	-12.672,90
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	34.265.157,27	0,00	0,00	0,00	34.332.028,96	66.871,69	985.505,08
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.551.467,31	0,00	0,00	0,00	26.650.334,76	98.867,45	828.963,05
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.982.641,92	0,00	0,00	0,00	21.763.893,49	-218.748,43	-269.482,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	680.896,97	0,00	0,00	0,00	685.039,68	4.142,71	29.403,85
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.576.458,23	0,00	0,00	0,00	1.588.679,72	12.221,49	75.638,48
	171.595.029,97	0,00	0,00	0,00	171.361.074,55	-233.955,42	

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	10.468.751,70	0,00	0,00	0,00	10.504.618,95	35.867,25	376.173,84
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	19.107.788,92	0,00	0,00	0,00	18.888.491,75	-219.297,17	-300.195,80
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	11.903.382,57	0,00	0,00	0,00	12.003.551,65	100.169,08	612.184,04
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	19.168.137,65	0,00	0,00	0,00	19.319.880,73	151.743,08	1.063.545,90
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.193.869,22	157.610,31	0,00	0,00	29.582.096,32	230.616,79	1.520.059,93
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	855.948,17	0,00	0,00	0,00	862.918,23	6.970,06	43.064,65
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	15.097.722,74	0,00	0,00	0,00	15.221.310,06	123.587,32	764.632,87
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	2.581.524,04	0,00	0,00	0,00	2.562.419,52	-19.104,52	-109.247,57
	108.377.125,01	157.610,31	0,00	0,00	108.945.287,21	410.551,89	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	757.755,08	0,00	0,00	0,00	762.396,13	4.641,05	-45.073,81
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	3.974.924,20	0,00	0,00	0,00	4.050.281,67	75.357,47	-506.031,70
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	7.144.389,87	0,00	0,00	0,00	7.287.103,36	142.713,49	-527.483,47
FIA CAIXA DIVIDENDOS	2.175.191,13	0,00	0,00	0,00	2.216.546,27	41.355,14	-88.946,67
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	20.293.476,57	0,00	0,00	0,00	20.653.972,73	360.496,16	-724.682,95
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	1.918.645,95	0,00	0,00	0,00	1.896.294,89	-22.351,06	-150.666,02
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	5.012.041,80	0,00	0,00	0,00	5.022.299,63	10.257,83	-156.756,37
	41.276.424,60	0,00	0,00	0,00	41.888.894,68	612.470,08	

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	2.533.003,79	0,00	0,00	0,00	2.760.404,93	227.401,14	411.256,30
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.214.827,42	0,00	0,00	0,00	1.372.389,60	157.562,18	161.077,89
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	821.105,52	0,00	0,00	0,00	916.042,40	94.936,88	195.247,68
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	4.981.737,43	0,00	0,00	0,00	5.433.244,48	451.507,05	1.063.550,93
	9.550.674,16	0,00	0,00	0,00	10.482.081,41	931.407,25	

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	2.408.688,47	0,00	0,00	0,00	2.438.514,05	29.825,58	-138.275,15
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	3.653.011,79	0,00	0,00	0,00	3.643.199,00	-9.812,79	-71.003,25
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	8.026.171,83	0,00	0,00	0,00	8.126.607,58	100.435,75	126.607,58
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.278.159,82	0,00	0,00	0,00	2.291.315,48	13.155,66	-5.318,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.945.615,49	0,00	0,00	0,00	4.985.520,88	39.905,39	-336.943,42
	21.311.647,40	0,00	0,00	0,00	21.485.156,99	173.509,59	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	1.069.783,29	405.150,37	0,00	0,00	1.601.943,08	127.009,42	132.456,10
	1.069.783,29	405.150,37	0,00	0,00	1.601.943,08	127.009,42	

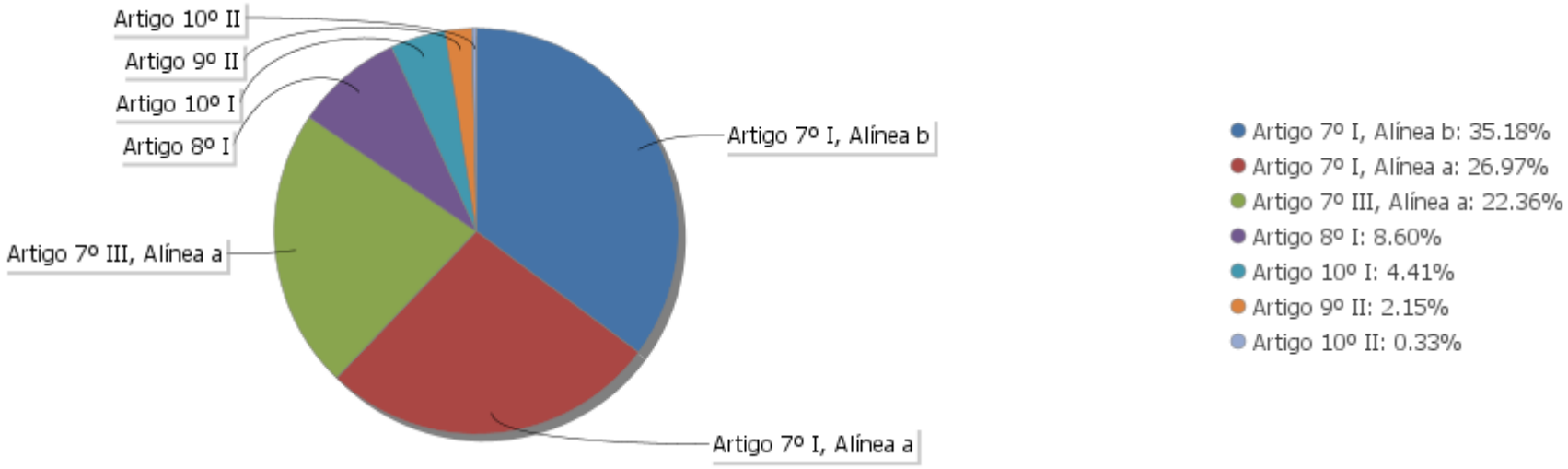
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

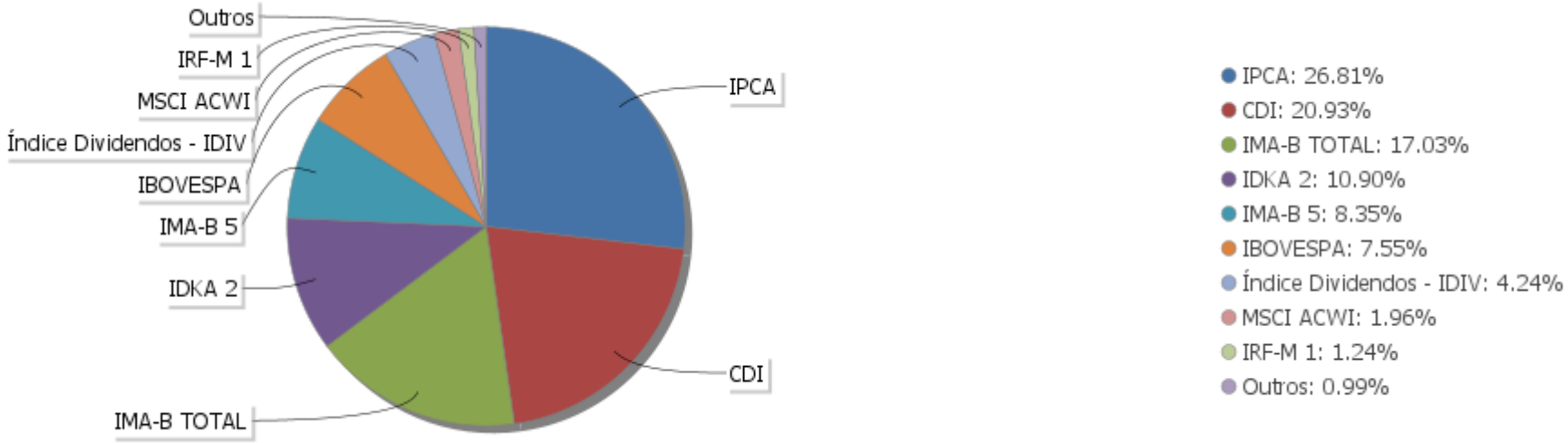
Período	Valor (R$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	308.941.886,65	63,42	68,23	308.941.886,65	63,42	68,23
de 31 dias a 365 dias	41.806.427,47	8,58	9,28	350.748.314,12	72,00	77,51
acima de 365 dias	136.401.337,17	28,00	22,48	487.149.651,29	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

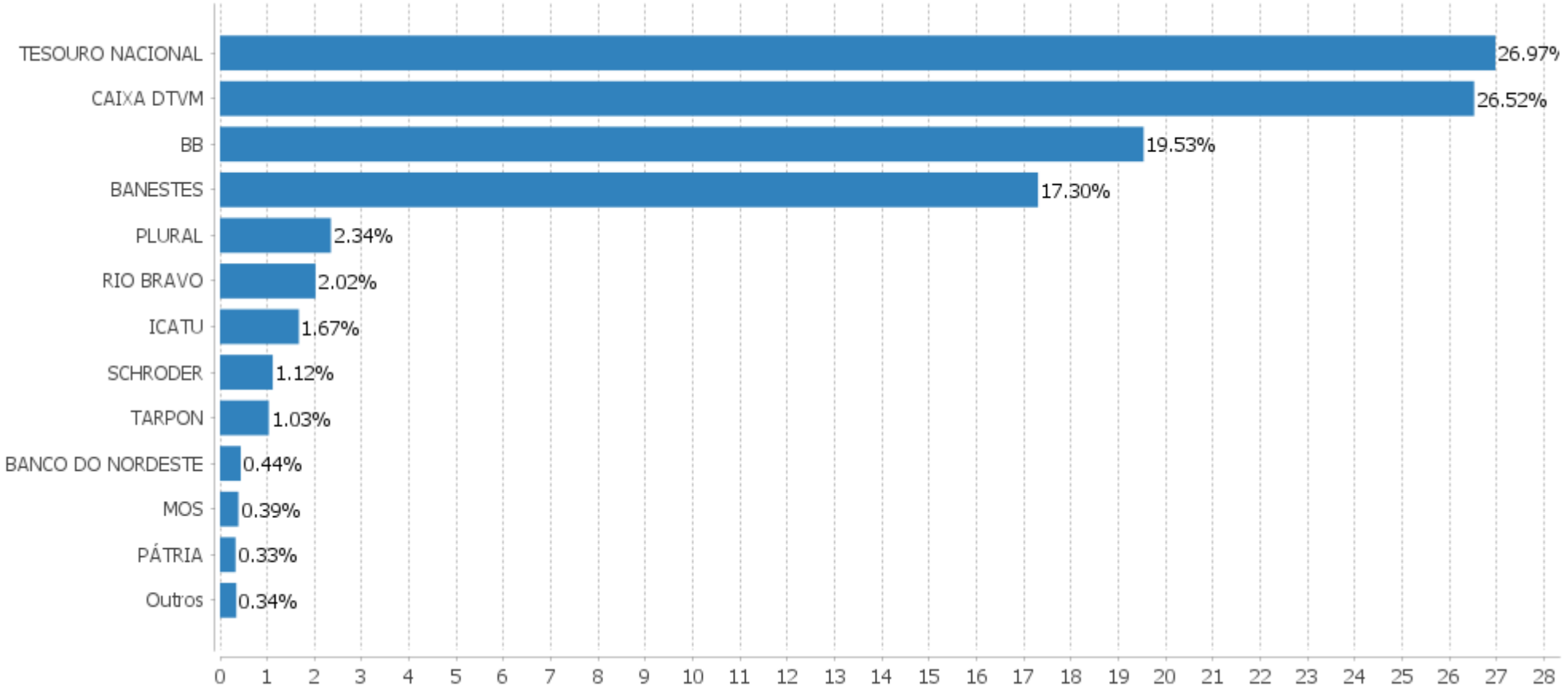


Alocação Por Estratégia



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	0,61	-0,41	0,67	0,60							2,32
INPC + 5,09%	1,01	1,19	0,59	0,81	0,88	0,65							5,22
p.p. indexador	-1,04	-0,31	0,02	-1,22	-0,21	-0,05							-2,90
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	32	41,03
Meses abaixo - Meta Atuarial	46	58,97

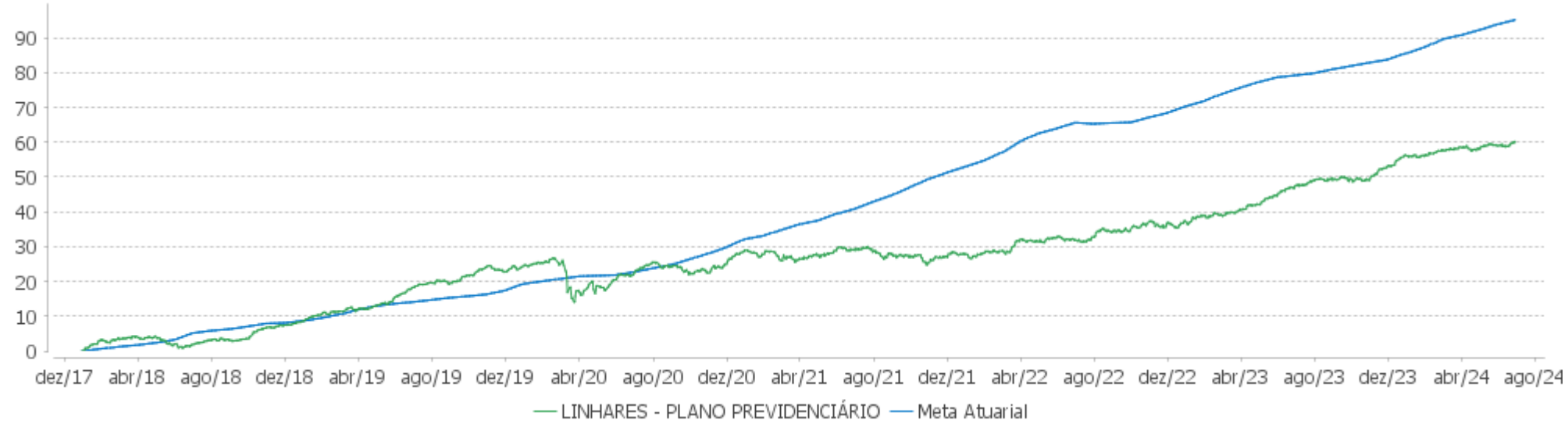
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,27	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-6,00	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,85	2,35	-1,49	2,13
06 meses	2,32	5,22	-2,90	1,96
12 meses	8,48	8,92	-0,44	2,30
24 meses	21,32	17,78	3,53	2,72
36 meses	23,95	38,67	-14,72	2,97
48 meses	30,97	60,10	-29,14	3,11
60 meses	35,44	73,73	-38,29	3,96
Desde 29/12/2017	59,94	100,69	-40,75	3,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

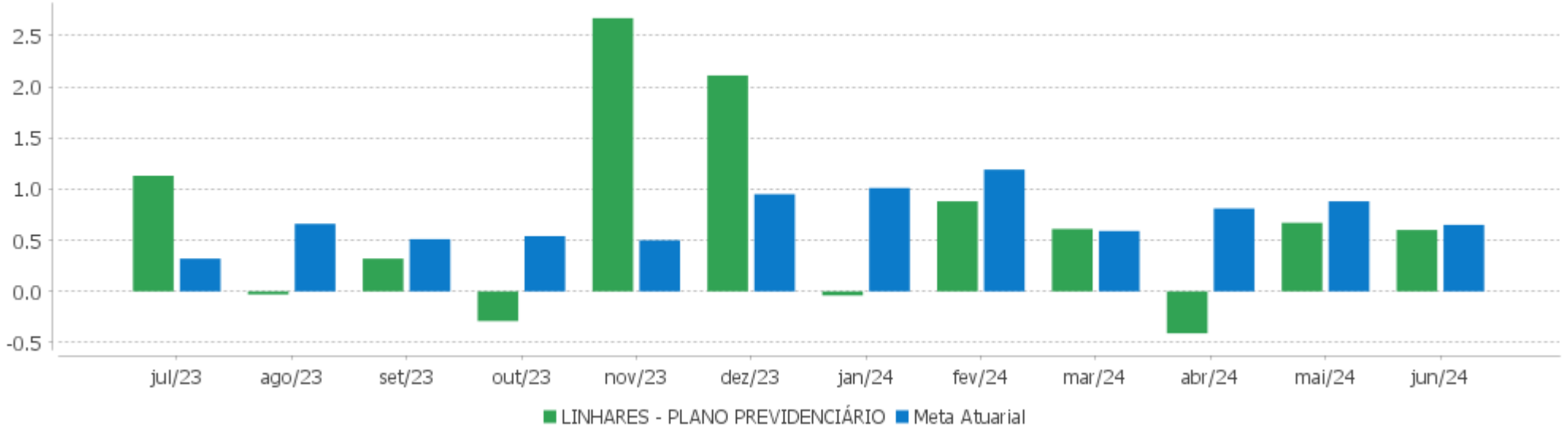


Patrimônio Líquido



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%)	0,84	5,62	2,46	5,62	10,29	14,11	
Var. IPCA p.p.	0,63	3,14	1,41	3,14	6,06	6,59	
NTN-B 150545 (5,920000%)	0,84	5,68	2,49	5,68	10,42	21,05	35,32
Var. IPCA p.p.	0,63	3,20	1,44	3,20	6,19	13,53	15,02
NTN-B 150545 (5,680000%)	0,83	5,56	2,44	5,56	6,92		
Var. IPCA p.p.	0,62	3,08	1,38	3,08	2,69		
NTN-B 150840 (5,750000%)	0,83	5,60	2,45	5,60	7,12	10,80	
Var. IPCA p.p.	0,62	3,11	1,40	3,11	2,89	3,27	
NTN-B 150545 (6,330000%)	0,88	2,74	-0,45	2,74	4,15		
Var. IPCA p.p.	0,67	0,26	-1,51	0,26	-0,08		
NTN-B 150840 (5,480000%)	0,81	5,47	2,39	5,47	6,93		
Var. IPCA p.p.	0,60	2,98	1,33	2,98	2,70		
NTN-B 150828 (5,500000%)	0,81	5,48	2,39	5,48	9,83	19,93	37,50
Var. IPCA p.p.	0,60	2,99	1,34	2,99	5,60	12,41	17,20
NTN-F 010135	-1,47	-4,34	-4,16				
% do CDI	-185,98	-86,07	-164,30				
NTN-B 150840 (6,050500%)	0,85	5,75	2,52	5,75	10,52	14,43	
Var. IPCA p.p.	0,64	3,26	1,47	3,26	6,29	6,90	
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,83	5,66	2,46	5,66	7,03		
Var. IPCA p.p.	0,62	3,18	1,40	3,18	2,80		
NTN-B 150545 (5,470000%)	0,81	5,46	2,38	5,46	9,94	13,65	
Var. IPCA p.p.	0,60	2,98	1,33	2,98	5,71	6,12	
NTN-B 150545 (6,305500%)	0,87	5,87	2,59	5,87	10,82	21,94	36,44
Var. IPCA p.p.	0,66	3,39	1,53	3,39	6,60	14,42	16,14
NTN-B 150545 (6,160000%)	0,86	2,78	-0,38	2,78	4,16		
Var. IPCA p.p.	0,65	0,29	-1,43	0,29	-0,06		
NTN-B 150535 (4,410000%)	0,73	4,94	2,13	4,94	8,76	17,54	37,20
Var. IPCA p.p.	0,52	2,45	1,07	2,45	4,53	10,02	16,90
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,87	5,81	2,56	5,81	10,67	14,63	
Var. IPCA p.p.	0,66	3,33	1,51	3,33	6,44	7,11	
NTN-B 150545 (6,150000%)	0,86	5,79	2,55	5,79	10,66	21,58	35,99
Var. IPCA p.p.	0,65	3,31	1,50	3,31	6,43	14,06	15,69
NTN-B 150850 (6,120000%)	0,86	2,71	2,54	2,71	4,09		

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.	0,65	0,23	1,49	0,23	-0,14		
NTN-B 150830 (4,800000%)	0,76	5,13	2,22	5,13	9,13	18,38	35,02
Var. IPCA p.p.	0,55	2,65	1,17	2,65	4,90	10,86	14,72
NTN-B 150840 (6,132000%)	0,86	5,79	2,54	5,79	10,61	21,50	35,91
Var. IPCA p.p.	0,65	3,30	1,49	3,30	6,38	13,98	15,60
NTN-B 150535 (5,640000%)	0,82	5,54	2,43	5,54	10,05	20,34	38,17
Var. IPCA p.p.	0,61	3,06	1,37	3,06	5,82	12,81	17,87
NTN-B 150828 (5,270000%)	0,80	5,36	2,34	5,36	9,59	19,41	36,65
Var. IPCA p.p.	0,59	2,88	1,28	2,88	5,36	11,89	16,35
NTN-B 150545 (5,825000%)	0,84	5,64	2,47	5,64	10,32	20,84	35,05
Var. IPCA p.p.	0,63	3,15	1,42	3,15	6,09	13,31	14,74
NTN-B 150545 (6,418000%)	0,88	5,93	2,61	5,93	10,94	18,53	
Var. IPCA p.p.	0,67	3,44	1,56	3,44	6,71	11,00	
NTN-B 150545 (5,440500%)	0,81	5,45	2,38	5,45	9,91	13,60	
Var. IPCA p.p.	0,60	2,96	1,32	2,96	5,68	6,08	
NTN-B 150545 (6,281000%)	0,87	5,86	2,58	5,86	10,80	21,88	36,37
Var. IPCA p.p.	0,66	3,38	1,53	3,38	6,57	14,36	16,07
NTN-B 150828 (5,200000%)	0,79	5,33	2,32	5,33	9,52	19,25	36,40
Var. IPCA p.p.	0,58	2,84	1,27	2,84	5,29	11,73	16,09
NTN-B 150545 (6,380000%)	0,88	5,91	2,60	5,91	10,90	18,46	
Var. IPCA p.p.	0,67	3,42	1,55	3,42	6,67	10,94	
NTN-B 150840 (5,910000%)	0,84	5,68	2,49	5,68	10,37	14,22	
Var. IPCA p.p.	0,63	3,19	1,44	3,19	6,14	6,70	
NTN-B 150545 (5,847000%)	0,84	5,65	2,48	5,65	10,34	20,89	35,11
Var. IPCA p.p.	0,63	3,16	1,42	3,16	6,11	13,36	14,81
NTN-B 150824 (5,800000%)	0,84	5,62	2,46	5,62	10,07	20,54	34,55
Var. IPCA p.p.	0,63	3,14	1,41	3,14	5,85	13,02	14,24
NTN-B 150545 (5,550000%)	0,82	5,50	2,40	5,50	10,02	13,83	
Var. IPCA p.p.	0,61	3,02	1,35	3,02	5,80	6,30	
NTN-B 150832 (5,350000%)	0,80	5,40	2,36	5,40	9,73	19,66	33,34
Var. IPCA p.p.	0,59	2,92	1,30	2,92	5,51	12,14	13,03
NTN-B 150535 (3,200000%)	0,64	4,34	1,83	4,34	7,48	14,82	32,47
Var. IPCA p.p.	0,43	1,85	0,78	1,85	3,26	7,30	12,17
NTN-B 150840 (5,800000%)	0,84	5,62	2,46	5,62	10,26	20,74	34,91
Var. IPCA p.p.	0,63	3,14	1,41	3,14	6,03	13,22	14,61
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-1,00	-1,22	-1,35	-1,22	2,87	16,57	20,68

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.	-0,03	-0,13	-0,08	-0,13	-0,19	-0,43	-0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,37	3,21	1,18	3,21	8,00	18,98	30,69
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,11	-0,06	-0,11	-0,23	-0,31	-0,61
BNB IMA-B FI RF	-0,86	-0,98	-1,08	-0,98	3,37	17,08	21,82
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,11	0,11	0,19	0,11	0,30	0,07	0,40
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,61	4,40	1,93	4,40	10,66	25,58	34,27
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,11	-0,08	-0,11	-0,28	-0,70	-1,09
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,37	3,20	1,18	3,20	7,97	18,82	30,38
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,12	-0,06	-0,12	-0,26	-0,48	-0,92
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,78	5,00	2,39	5,00	11,34	26,39	37,56
% do CDI	98,34	95,75	94,30	95,75	96,98	98,42	99,38
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,16	5,70	2,85	5,70	11,30	21,33	34,16
Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,12	6,80	4,12	6,80	8,24	4,32	12,73
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,62	4,51	2,00	4,51	10,87	26,10	35,37
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	0,00	0,00	0,00	-0,08	-0,18	0,01
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	-0,99	-1,36	-1,30	-1,36	2,78	16,73	16,76
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,26	-0,03	-0,26	-0,28	-0,28	-4,66
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,26	3,11	1,05	3,11	8,11	18,30	29,95
Var. IDKA 2 p.p.	0,08	-0,10	0,09	-0,10	-0,26	-0,13	-0,45
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,20	2,96	0,86	2,96	8,08	18,05	29,46
Var. IDKA 2 p.p.	0,02	-0,25	-0,09	-0,25	-0,29	-0,38	-0,94
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,61	4,48	1,97	4,48	10,79	25,84	34,58
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,02	-0,04	-0,02	-0,16	-0,44	-0,78
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,99	-1,23	-1,33	-1,23	2,76	16,42	20,47
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,13	-0,06	-0,13	-0,30	-0,59	-0,95
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,38	3,84	1,40	3,84	9,79	25,12	31,72
Var. IPCA p.p.	0,17	1,35	0,34	1,35	5,56	17,60	11,41
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	-1,15	-1,56	-1,43	-1,56	2,47	16,26	19,06
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,18	-0,47	-0,16	-0,47	-0,59	-0,74	-2,36
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,79	5,83	3,11	5,83	12,30	25,00	35,96
% do CDI	100,42	111,58	122,89	111,58	105,19	93,24	95,14
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	-0,74	-4,09	-3,16	-4,09	-1,14		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,23	-2,99	-1,89	-2,99	-4,21		
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,84	5,51	2,64	5,51	12,32	24,99	36,84
% do CDI	106,75	105,52	104,46	105,52	105,35	93,19	97,47
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,34	3,71	1,60	3,71	9,86	21,64	30,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	43,46	71,13	63,20	71,13	84,34	80,70	79,58
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,79	5,24	2,53	5,24	11,71	26,83	38,23
% do CDI	100,10	100,37	99,91	100,37	100,14	100,06	101,15
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82	5,36	2,57	5,36	12,19	27,40	39,10
% do CDI	103,84	102,72	101,69	102,72	104,28	102,16	103,45
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,81	5,25	2,54	5,25	11,61	26,44	37,49
% do CDI	103,30	100,60	100,24	100,60	99,29	98,61	99,19
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	0,20	-3,03	-5,29	-3,03	20,69	79,31	60,29
Var. IBOVESPA p.p.	-1,28	4,63	-2,02	4,63	15,76	53,57	62,57
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	1,90	-11,11	-3,95	-11,11	0,53	13,12	-7,05
Var. IBOVESPA p.p.	0,41	-3,45	-0,67	-3,45	-4,40	-12,62	-4,76
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	0,61	-5,58	-6,85	-5,58	-0,67	12,90	-20,74
Var. IBOVESPA p.p.	-0,87	2,08	-3,57	2,08	-5,60	-12,84	-18,46
FIA CAIXA DIVIDENDOS	1,90	-3,86	0,13	-3,86	10,80	28,70	19,23
Var. IBOVESPA p.p.	0,42	3,80	3,41	3,80	5,87	2,96	21,51
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-1,16	-10,53	-9,87	-10,53	-3,49	33,09	-7,98
Var. IBOVESPA p.p.	-2,65	-2,87	-6,59	-2,87	-8,42	7,35	-5,70
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	1,78	-3,39	-1,09	-3,39	8,56	27,99	11,84
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,22	0,02	-1,51	0,02	-3,53	-3,98	-14,72
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	2,00	-8,72	-4,72	-8,72	2,83	25,86	19,00
Var. IBOVESPA p.p.	0,52	-1,06	-1,45	-1,06	-2,10	0,12	21,29
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	8,98	17,51	9,29	17,51	24,10	28,47	20,07
Var. MSCI ACWI p.p.	0,70	-9,16	-4,65	-9,16	-11,38	-14,15	-3,72
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	9,06	24,34	13,76	24,34	35,34	48,92	27,20
Var. MSCI ACWI p.p.	0,79	-2,33	-0,17	-2,33	-0,14	6,29	3,41
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	12,97	13,30	4,11	13,30	27,15	43,40	-42,99
Var. MSCI ACWI p.p.	4,69	-13,37	-9,83	-13,37	-8,33	0,78	-66,78
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,56	27,09	10,28	27,09	44,10	81,41	0,75
Var. IPCA + 6,00% p.p.	10,89	21,62	7,74	21,62	33,70	60,71	-42,41
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	1,24	-5,37	-3,75	-5,37	6,95		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,24	2,29	-0,47	2,29	2,02		
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,81	-6,33	-2,29	-6,33	2,69	15,65	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,67	1,33	0,99	1,33	-2,24	-10,09	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,58	-0,23	0,90	-0,23	6,40		
Var. S&P 500 p.p.	-9,15	-31,68	-14,73	-31,68	-35,13		
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	1,25	1,20	-0,03	1,20	9,30	41,36	27,03

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.	-0,23	8,86	3,25	8,86	4,37	15,62	29,32
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	-0,27	-1,91	-1,97	-1,91	5,94	21,71	21,98
% do CDI	-34,07	-36,61	-77,70	-36,61	50,78	80,97	58,16
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	1,14	1,79	-0,42	1,79			
Var. IPCA + 7,00% p.p.	0,39	-4,16	-3,20	-4,16			
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO	0,60	2,32	0,85	2,32	8,48	21,32	23,95
Var. INPC + 5,09% p.p.	-0,05	-2,90	-1,49	-2,90	-0,43	3,45	-14,68
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

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 ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,50
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 PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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		
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+30	D+32	-	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
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D+1 du	D+0	D+10	D+13	-	2,00
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	-	
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	D+1 du	D+1 du	D+30	D+32	O fundo cobrara 20.00 % do que	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					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	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-7,20	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-6,12	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-14,85	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-14,03	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	-3,41	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43

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	9,73	31,45	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	26,67	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	2,68	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	1,10	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150535 (3,200000%)	1.168.388,95	3,200000	901.378,35	6,510700	-267.010,60
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.173.030,00	4,410000	997.358,46	6,510700	-175.671,54
NTN-B 150535 (5,640000%)	2.626.248,83	5,640000	2.457.925,24	6,510700	-168.323,59
NTN-B 150545 (5,440500%)	2.164.239,72	5,440500	1.917.570,20	6,496800	-246.669,52
NTN-B 150545 (5,470000%)	1.593.311,12	5,470000	1.416.621,12	6,496800	-176.690,00
NTN-B 150545 (5,550000%)	2.087.491,16	5,550000	1.872.402,59	6,496800	-215.088,57
NTN-B 150545 (5,680000%)	2.045.851,85	5,680000	1.864.190,30	6,496800	-181.661,55
NTN-B 150545 (5,760000%)	3.064.516,16	5,760000	2.816.816,18	6,496800	-247.699,98
NTN-B 150545 (5,800000%)	9.487.999,14	5,800000	8.766.621,79	6,496800	-721.377,35
NTN-B 150545 (5,825000%)	1.940.873,39	5,825000	1.798.491,97	6,496800	-142.381,42
NTN-B 150545 (5,847000%)	2.130.432,49	5,847000	1.979.162,39	6,496800	-151.270,10
NTN-B 150545 (5,920000%)	5.369.193,70	5,920000	5.030.028,90	6,496800	-339.164,80
NTN-B 150545 (6,150000%)	2.326.840,18	6,150000	2.237.849,59	6,496800	-88.990,59
NTN-B 150545 (6,160000%)	6.933.889,18	6,160000	6.672.487,31	6,496800	-261.401,87
NTN-B 150545 (6,281000%)	2.069.671,43	6,281000	2.020.223,85	6,496800	-49.447,58
NTN-B 150545 (6,305500%)	4.232.814,86	6,305500	4.143.101,35	6,496800	-89.713,51
NTN-B 150545 (6,330000%)	2.326.035,27	6,330000	2.283.017,20	6,496800	-43.018,07
NTN-B 150545 (6,380000%)	4.126.819,77	6,380000	4.073.296,87	6,496800	-53.522,90
NTN-B 150545 (6,418000%)	1.884.806,64	6,418000	1.868.296,45	6,496800	-16.510,19
NTN-B 150824 (5,800000%)	1.571.340,16	5,800000	1.566.983,35	7,999900	-4.356,81
NTN-B 150828 (5,200000%)	4.537.749,66	5,200000	4.331.606,65	6,553700	-206.143,01
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.234.103,60	5,270000	2.137.787,96	6,553700	-96.315,64
NTN-B 150828 (5,500000%)	5.800.225,23	5,500000	5.594.453,16	6,553700	-205.772,07
NTN-B 150830 (4,800000%)	5.820.748,36	4,800000	5.372.127,23	6,460000	-448.621,13
NTN-B 150832 (5,350000%)	2.008.051,87	5,350000	1.870.161,78	6,526000	-137.890,09
NTN-B 150840 (5,480000%)	4.119.807,83	5,480000	3.750.934,97	6,439600	-368.872,86
NTN-B 150840 (5,750000%)	1.285.880,61	5,750000	1.202.492,20	6,439600	-83.388,41
NTN-B 150840 (5,800000%)	16.858.823,65	5,800000	15.843.375,48	6,439600	-1.015.448,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150840 (5,910000%)	3.171.220,02	5,910000	3.012.561,94	6,439600	-158.658,08
NTN-B 150840 (6,050500%)	1.406.286,01	6,050500	1.354.387,09	6,439600	-51.898,92
NTN-B 150840 (6,132000%)	10.852.892,32	6,132000	10.535.528,25	6,439600	-317.364,07
NTN-B 150840 (6,190000%)	2.303.622,93	6,190000	2.248.873,27	6,439600	-54.749,66
NTN-B 150850 (6,120000%)	1.432.997,35	6,120000	1.367.036,64	6,504300	-65.960,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
57	21/06/2024	NTN-B 150545 (6,330000%)	2.321.752,74	0,00	556,00000000	4.175,8142805755
50	24/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	157.610,31	0,00	48.966,10136627	3,2187637080
56	26/06/2024	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	405.150,37	0,00	405,15037000	1.000,0000000000
	Total		**2.884.513,42**	**0,00**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 5.089.630,30** **Value-At-Risk: 1,04%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite(5)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	1,51	0,72	5,00	0,53	-0,35	0,26	411.691.575,13	84,51
Artigo 8º	11,95	5,66	20,00	0,42	0,06	1,48	41.888.894,68	8,60
Artigo 9º	12,24	6,39	20,00	-0,02	0,73	9,75	10.482.081,41	2,15
Artigo 10º	9,03	2,59	20,00	0,11	0,07	1,39	23.087.100,07	4,74
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO		1,04		1,04			487.149.651,29	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,72%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,800000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,28	0,84	1.571.340,16	0,32
NTN-B 150828 (5,200000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,01	0,79	4.537.749,66	0,93
NTN-B 150828 (5,270000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,04	0,80	2.234.103,60	0,46
NTN-B 150828 (5,500000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,14	0,81	5.800.225,23	1,19
NTN-B 150830 (4,800000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	-0,17	0,76	5.820.748,36	1,19
NTN-B 150832 (5,350000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,08	0,80	2.008.051,87	0,41
NTN-F 010135	10,45	4,27	0,06	4,27	-0,22	-1,47	9.229.009,93	1,89
NTN-B 150535 (3,200000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	-0,89	0,64	1.168.388,95	0,24
NTN-B 150535 (4,410000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	-0,34	0,73	1.173.030,00	0,24
NTN-B 150535 (5,640000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,21	0,82	2.626.248,83	0,54
NTN-B 150840 (5,480000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,14	0,81	4.119.807,83	0,85
NTN-B 150840 (5,750000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,26	0,83	1.285.880,61	0,26
NTN-B 150840 (5,800000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,28	0,84	16.858.823,65	3,46
NTN-B 150840 (5,910000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,33	0,84	3.171.220,02	0,65
NTN-B 150840 (6,050500%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,39	0,85	1.406.286,01	0,29
NTN-B 150840 (6,132000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,43	0,86	10.852.892,32	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%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,45	0,87	2.303.622,93	0,47
NTN-B 150545 (5,440500%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,12	0,81	2.164.239,72	0,44
NTN-B 150545 (5,470000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,13	0,81	1.593.311,12	0,33
NTN-B 150545 (5,550000%)	0,34	0,21	-0,00	0,21	0,08	0,82	2.087.491,16	0,43
NTN-B 150545 (5,680000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,22	0,83	2.045.851,85	0,42
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,33	0,19	-0,00	0,20	0,13	0,83	3.064.516,16	0,63
NTN-B 150545 (5,800000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,28	0,84	9.487.999,14	1,95
NTN-B 150545 (5,825000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,29	0,84	1.940.873,39	0,40
NTN-B 150545 (5,847000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,30	0,84	2.130.432,49	0,44
NTN-B 150545 (5,920000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,33	0,84	5.369.193,70	1,10
NTN-B 150545 (6,150000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,43	0,86	2.326.840,18	0,48
NTN-B 150545 (6,160000%)	0,33	0,28	-0,00	0,30	0,23	0,86	6.933.889,18	1,42
NTN-B 150545 (6,281000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,49	0,87	2.069.671,43	0,42
NTN-B 150545 (6,305500%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,50	0,87	4.232.814,86	0,87
NTN-B 150545 (6,330000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,51	0,88	2.326.035,27	0,48
NTN-B 150545 (6,380000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,54	0,88	4.126.819,77	0,85
NTN-B 150545 (6,418000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,55	0,88	1.884.806,64	0,39
NTN-B 150850 (6,120000%)	0,17	0,22	-0,00	0,26	0,42	0,86	1.432.997,35	0,29
Sub-total	0,79	0,30	0,06		-0,15	0,67	131.385.213,37	26,97

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	4,01	2,13	0,08	0,06	-0,44	-0,99	22.239.625,85	4,57
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,51	0,22	0,00	0,03	-0,34	0,62	1.313.690,34	0,27
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,00	0,42	0,01	0,42	-0,41	0,38	8.452.018,15	1,73
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,99	2,16	0,06	0,01	-0,44	-0,99	14.655.965,78	3,01
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,72	0,91	0,02	0,01	-0,24	0,37	14.010.558,35	2,88
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,51	0,24	0,00	0,01	-0,36	0,61	4.033.064,16	0,83
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,02	0,31	0,00	2,17	0,36	1,16	1.578.472,37	0,32
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS	1,95	0,99	0,03	0,16	-0,27	0,26	18.783.094,03	3,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
PÚBLICOS FI								
BNB IMA-B FI RF	3,70	2,02	0,00	0,15	-0,45	-0,86	1.274.608,91	0,26
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,07	1,10	0,06	0,24	-0,29	0,20	34.332.028,96	7,05
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	0,91	0,04	0,01	-0,24	0,37	26.650.334,76	5,47
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,00	2,15	0,08	0,02	-0,45	-1,00	21.763.893,49	4,47
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,23	0,00	0,02	-0,35	0,61	685.039,68	0,14
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,07	0,00	0,07	-0,13	0,78	1.588.679,72	0,33
Sub-total	2,43	1,27	0,38		-0,38	-0,14	171.361.074,55	35,18

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	1,02	0,45	0,01	0,45	-0,44	0,34	10.504.618,95	2,16
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4,34	2,36	0,08	0,37	-0,45	-1,15	18.888.491,75	3,88
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,05	0,03	-0,00	0,03	0,97	0,84	12.003.551,65	2,46
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,05	0,05	-0,00	0,05	0,06	0,79	19.319.880,73	3,97
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,04	0,02	0,00	0,02	0,02	0,79	29.582.096,32	6,07
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,09	0,01	0,00	0,01	0,28	0,81	862.918,23	0,18
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,81	0,82	15.221.310,06	3,12
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	4,51	2,08	0,01	2,13	-0,34	-0,74	2.562.419,52	0,53
Sub-total	0,96	0,48	0,09		-0,43	0,38	108.945.287,21	22,36

Renda Variável **Value-At-Risk: 5,66%**

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	12,41	6,09	0,01	3,25	-0,01	0,61	762.396,13	0,16
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	10,61	5,88	0,04	1,60	0,10	1,90	4.050.281,67	0,83
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	12,84	6,60	0,08	2,27	0,09	2,00	7.287.103,36	1,50
FIA CAIXA DIVIDENDOS	11,06	5,33	0,02	2,66	0,10	1,90	2.216.546,27	0,46
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,96	5,55	0,20	1,83	0,09	1,78	20.653.972,73	4,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	22,39	8,34	0,03	5,24	-0,09	-1,16	1.896.294,89	0,39
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	18,57	7,19	0,05	5,55	-0,03	0,20	5.022.299,63	1,03
Sub-total	11,95	5,66	0,42		0,06	1,48	41.888.894,68	8,60

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 2,59%**

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	12,25	5,65	0,02	0,57	0,04	1,24	2.438.514,05	0,50
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	7,26	2,63	0,02	2,63	-0,15	-0,27	3.643.199,00	0,75
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	7,60	2,73	0,04	3,87	0,06	1,25	8.126.607,58	1,67
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,12	2,98	-0,00	8,53	-1,78	0,58	2.291.315,48	0,47
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,96	4,10	0,03	3,10	0,00	0,81	4.985.520,88	1,02
Sub-total	7,34	2,79	0,11		0,00	0,81	21.485.156,99	4,41

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	4,02	0,15	-0,00	0,19	0,09	1,14	1.601.943,08	0,33
Sub-total	31,71	0,15	-0,00		0,26	9,05	1.601.943,08	0,33

Investimentos no Exterior **Value-At-Risk: 6,39%**

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	10,73	5,45	-0,01	5,00	0,76	8,98	2.760.404,93	0,57
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	25,62	14,24	0,00	13,10	0,48	12,97	1.372.389,60	0,28
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9,60	7,45	-0,00	7,45	1,12	11,56	916.042,40	0,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	12,15	6,37	-0,01	5,96	0,68	9,06	5.433.244,48	1,12
Sub-total	12,24	6,39	-0,02		0,73	9,75	10.482.081,41	2,15

(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 (%)