



LDB
EMPRESAS

LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO
JULHO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.07.2024.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

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 31.07.2024.

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 31.07.2024.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

84,41%

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	0,77	6,44	1.583.506,03	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,200000%)	0,27	0,03	0,72	6,09	4.570.505,04	0,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,270000%)	0,27	0,04	0,73	6,13	2.250.368,72	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,500000%)	0,27	0,04	0,75	6,26	5.843.615,84	1,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (4,800000%)	0,30	0,03	0,69	5,85	5.860.727,93	1,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,350000%)	0,36	0,04	0,73	6,18	2.022.810,27	0,41
TESOURO NACIONAL	NTN-F 010135	11,10	0,74	-2,18	-7,28	9.522.884,18	1,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (3,200000%)	0,30	0,03	0,55	4,91	1.174.763,19	0,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,410000%)	0,35	0,03	0,65	5,62	1.180.685,16	0,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,640000%)	0,39	0,04	0,76	6,35	2.646.215,35	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,480000%)	2,81	0,04	0,75	6,25	4.150.555,24	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,750000%)	2,89	0,04	0,77	6,41	1.295.779,51	0,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,800000%)	0,46	0,04	0,77	6,44	16.989.339,47	3,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,910000%)	0,47	0,04	0,78	6,51	3.196.074,77	0,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,050500%)	0,47	0,04	0,80	6,59	1.417.479,40	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	0,80	6,64	10.940.032,17	2,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,190000%)	0,48	0,04	0,81	6,67	2.322.238,28	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,440500%)	0,51	0,04	0,74	6,23	2.180.317,17	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,470000%)	0,51	0,04	0,75	6,25	1.605.187,76	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,550000%)	0,67	0,09	0,75	6,29	2.103.188,71	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,680000%)	2,81	0,04	0,76	5,29	2.061.477,25	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	2,85	0,09	0,77	4,36	3.088.122,49	0,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,800000%)	0,53	0,04	0,77	6,44	9.561.450,94	1,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,825000%)	0,53	0,04	0,78	6,46	1.955.940,98	0,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,847000%)	0,53	0,04	0,78	6,47	2.147.012,27	0,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,920000%)	0,53	0,04	0,78	6,51	5.411.320,24	1,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,150000%)	0,54	0,04	0,80	6,65	2.345.559,28	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,160000%)	4,19	0,09	0,80	1,74	6.989.706,88	1,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,281000%)	0,55	0,04	0,82	6,72	2.086.558,58	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305500%)	0,55	0,04	0,82	6,74	4.267.438,93	0,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,310000%)	4,26	0,04	0,04	0,04	1.479.537,96	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,330000%)	4,27	0,04	0,82	1,01	2.345.110,02	0,47
TESOURO	NTN-B 150545 (6,380000%)	0,55	0,04	0,82	6,78	4.160.844,00	0,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,418000%)	0,56	0,04	0,83	6,80	1.900.407,54	0,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,120000%)	4,18	0,04	0,80	2,02	1.444.488,95	0,29
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,69	0,09	0,57	5,76	134.101.250,50	27,05

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	4,05	0,29	2,07	0,69	22.700.112,99	4,58	219.450.343,05	10,34
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,36	0,04	0,85	5,40	1.324.827,51	0,27	192.360.166,89	0,69
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,60	0,09	1,04	4,91	8.539.561,38	1,72	6.518.185.291,57	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,92	0,29	2,07	0,82	14.959.979,49	3,02	4.446.980.761,25	0,34
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,74	0,09	0,89	4,12	14.135.747,14	2,85	4.921.617.196,95	0,29
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,38	0,04	0,91	5,35	4.069.600,56	0,82	8.157.420.248,33	0,05
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,84	0,04	0,97	6,73	1.593.802,31	0,32	223.229.708,15	0,71
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,75	0,09	0,76	3,90	18.926.524,33	3,82	5.421.914.339,44	0,35
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB IMA-B FI RF	3,81	0,28	1,99	0,98	1.299.929,37	0,26	218.999.311,59	0,59
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,77	0,10	0,73	3,70	34.581.313,65	6,98	4.447.571.914,17	0,78
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,73	0,09	0,89	4,13	26.888.278,44	5,42	7.242.310.243,82	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,91	0,29	2,07	0,82	22.215.003,04	4,48	3.987.797.714,56	0,56
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,05	0,93	5,46	691.401,73	0,14	7.874.458.233,45	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,04	0,91	5,96	1.603.212,74	0,32	11.174.050.209,03	0,01
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	2,25	0,16	1,27	2,92	173.529.294,68	35,00		

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	0,86	0,10	1,16	4,92	10.626.343,73	2,14	147.057.428,16	7,23
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4,27	0,30	2,15	0,55	19.294.947,66	3,89	150.365.696,87	12,83
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,08	0,04	0,94	6,50	12.116.714,20	2,44	3.223.503.465,57	0,38
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,63	0,04	0,88	6,76	19.484.663,62	3,93	317.185.159,13	6,14
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,97	6,26	29.473.132,09	5,95	17.211.240.215,08	0,17
BANCO DO NORDESTE	SANTANDER	BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,08	0,04	0,89	6,19	1.874.812,76	0,38	1.292.592.506,56	0,15
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,04	0,97	6,39	15.369.293,19	3,10	16.238.092.008,01	0,09
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	5,83	0,01	0,99	-3,14	2.587.739,72	0,52	136.191.496,90	1,90
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,91	0,09	1,18	4,99	110.827.646,97	22,36		
Renda Fixa			1,31	0,12	1,02	4,28	418.458.192,15	84,41		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

8,70%

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	15,87	1,22	5,73	-0,18	806.045,51	0,16	764.018.267,64	0,11
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	12,94	1,58	2,47	-8,91	4.150.229,56	0,84	1.135.111.774,74	0,37
PLURAL	BEM	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	12,61	0,59	3,03	-5,95	7.508.173,54	1,51	411.708.046,49	1,82
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	11,49	0,52	1,74	-2,18	2.255.138,22	0,45	240.896.790,05	0,94
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,53	0,43	2,96	-0,53	21.265.504,06	4,29	1.041.382.903,24	2,04
MOS	BEM	QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	18,34	-0,08	6,36	-1,47	2.016.806,99	0,41	97.008.776,54	2,08
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	15,83	1,20	2,10	-0,99	5.127.664,08	1,03	848.848.485,49	0,60
Sub-total Artigo 8º I			12,02	0,66	2,96	-3,21	43.129.561,96	8,70		
Renda Variável			12,02	0,66	2,96	-3,21	43.129.561,96	8,70		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,16%

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	12,79	0,20	3,99	22,20	2.870.566,49	0,58	67.688.093,07	4,24
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	27,00	-0,16	0,64	14,02	1.381.178,91	0,28	121.038.447,92	1,14
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17,97	1,33	-2,20	24,29	895.849,25	0,18	756.611.993,89	0,12
SCHRODER	INTRAG	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	13,48	0,89	2,36	27,27	5.561.456,79	1,12	356.641.228,77	1,56
Sub-total Artigo 9º II			13,56	0,60	2,17	23,79	10.709.051,44	2,16		
Investimentos no Exterior			13,56	0,60	2,17	23,79	10.709.051,44	2,16		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,73%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	9,49	0,04	1,46	-3,99	2.474.057,36	0,50	192.981.823,71	1,28
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	4,96	0,48	1,62	-0,32	3.702.144,20	0,75	474.595.967,64	0,78
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5,59	0,76	2,23	3,84	8.307.548,87	1,68	485.635.596,88	1,71
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	4,10	0,03	0,70	0,47	2.307.399,04	0,47	237.774.935,03	0,97
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,98	0,86	1,87	-4,58	5.078.718,71	1,02	133.275.009,92	3,81
Sub-total Artigo 10º I			6,06	0,58	1,79	-1,23	21.869.868,18	4,41		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PÁTRIA	XP	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	12,55	6,62	-1,12	8,53	1.584.077,71	0,32	158.407.771,10	1,00
Sub-total Artigo 10º II			12,55	6,62	-1,12	8,53	1.584.077,71	0,32		

Investimentos Estruturados			5,78	0,96	1,59	-0,60	23.453.945,89	4,73		
-----------------------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

Total			2,29	0,22	1,24	3,59	495.750.751,44	100,00		
--------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-------------	-----------------------	---------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	134.101.250,50	27,05	0,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	173.529.294,68	35,00	0,00	15,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	110.827.646,97	22,36	0,00	26,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	418.458.192,15	84,41					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	43.129.561,96	8,70	0,00	14,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	43.129.561,96	8,70					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	10.709.051,44	2,16	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	10.709.051,44	2,16					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	21.869.868,18	4,41	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.584.077,71	0,32	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	23.453.945,89	4,73					15,00
Total		495.750.751,44	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,57 62,75	5,76 93,35	2,11 82,63	4,69 90,83	9,85 85,56	752.984,57	6.451.635,37
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,27 139,49	2,92 47,33	2,24 87,79	2,65 51,43	6,83 59,33	2.168.220,13	4.944.582,71
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,18 129,83	4,99 80,73	2,50 98,08	4,36 84,50	9,88 85,81	1.281.358,50	5.251.576,36
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,96 -0,06	-3,21 1,66	2,57 1,20	0,69 0,76	6,02 1,34	1.240.667,28	-1.864.945,89
Artigo 9º II % do CDI	2,17 238,70	23,79 385,23	14,12 553,70	20,84 403,87	32,02 278,18	226.970,03	2.058.102,83
Artigo 10º I % do CDI	1,79 197,39	-1,23 -19,84	1,38 53,95	1,08 20,84	5,70 49,49	384.711,19	-40.221,27
Artigo 10º II % do CDI	-1,12 -122,94	8,53 138,13	6,97 273,27	10,12 196,16		-17.865,37	114.590,73
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO (Total)						6.037.046,33	16.915.320,84

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%)	1.168.388,95	0,00	0,00	0,00	1.174.763,19	6.374,24	55.824,40
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.173.030,00	0,00	0,00	0,00	1.180.685,16	7.655,16	63.946,71
NTN-B 150535 (5,640000%)	2.626.248,83	0,00	0,00	0,00	2.646.215,35	19.966,52	160.934,50
NTN-B 150545 (5,440500%)	2.164.239,72	0,00	0,00	0,00	2.180.317,17	16.077,45	130.204,83
NTN-B 150545 (5,470000%)	1.593.311,12	0,00	0,00	0,00	1.605.187,76	11.876,64	96.115,42
NTN-B 150545 (5,550000%)	2.087.491,16	0,00	0,00	0,00	2.103.188,71	15.697,55	126.788,64
NTN-B 150545 (5,680000%)	2.045.851,85	0,00	0,00	0,00	2.061.477,25	15.625,40	105.326,45
NTN-B 150545 (5,760000%)	3.064.516,16	0,00	0,00	0,00	3.088.122,49	23.606,33	130.905,64
NTN-B 150545 (5,800000%)	9.487.999,14	0,00	0,00	0,00	9.561.450,94	73.451,80	589.598,48
NTN-B 150545 (5,825000%)	1.940.873,39	0,00	0,00	0,00	1.955.940,98	15.067,59	120.878,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (5,847000%)	2.130.432,49	0,00	0,00	0,00	2.147.012,27	16.579,78	132.940,44
NTN-B 150545 (5,920000%)	5.369.193,70	0,00	0,00	0,00	5.411.320,24	42.126,54	337.199,81
NTN-B 150545 (6,150000%)	2.326.840,18	0,00	0,00	0,00	2.345.559,28	18.719,10	149.069,98
NTN-B 150545 (6,160000%)	6.933.889,18	0,00	0,00	0,00	6.989.706,88	55.817,70	119.571,09
NTN-B 150545 (6,281000%)	2.069.671,43	0,00	0,00	0,00	2.086.558,58	16.887,15	134.083,57
NTN-B 150545 (6,305500%)	4.232.814,86	0,00	0,00	0,00	4.267.438,93	34.624,07	274.787,50
NTN-B 150545 (6,310000%)	0,00	1.478.959,42	0,00	0,00	1.479.537,96	578,54	578,54
NTN-B 150545 (6,330000%)	2.326.035,27	0,00	0,00	0,00	2.345.110,02	19.074,75	23.357,28
NTN-B 150545 (6,380000%)	4.126.819,77	0,00	0,00	0,00	4.160.844,00	34.024,23	269.592,09
NTN-B 150545 (6,418000%)	1.884.806,64	0,00	0,00	0,00	1.900.407,54	15.600,90	123.520,41
NTN-B 150824 (5,800000%)	1.571.340,16	0,00	0,00	0,00	1.583.506,03	12.165,87	96.451,92
NTN-B 150828 (5,200000%)	4.537.749,66	0,00	0,00	0,00	4.570.505,04	32.755,38	263.982,31
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.234.103,60	0,00	0,00	0,00	2.250.368,72	16.265,12	130.807,11
NTN-B 150828 (5,500000%)	5.800.225,23	0,00	0,00	0,00	5.843.615,84	43.390,61	346.739,01
NTN-B 150830 (4,800000%)	5.820.748,36	0,00	0,00	0,00	5.860.727,93	39.979,57	326.073,18
NTN-B 150832 (5,350000%)	2.008.051,87	0,00	0,00	0,00	2.022.810,27	14.758,40	118.416,74
NTN-B 150840 (5,480000%)	4.119.807,83	0,00	0,00	0,00	4.150.555,24	30.747,41	245.784,14
NTN-B 150840 (5,750000%)	1.285.880,61	0,00	0,00	0,00	1.295.779,51	9.898,90	78.573,84
NTN-B 150840 (5,800000%)	16.858.823,65	0,00	0,00	0,00	16.989.339,47	130.515,82	1.034.663,63
NTN-B 150840 (5,910000%)	3.171.220,02	0,00	0,00	0,00	3.196.074,77	24.854,75	196.489,43
NTN-B 150840 (6,050500%)	1.406.286,01	0,00	0,00	0,00	1.417.479,40	11.193,39	88.187,63
NTN-B 150840 (6,132000%)	10.852.892,32	0,00	0,00	0,00	10.940.032,17	87.139,85	685.280,85
NTN-B 150840 (6,190000%)	2.303.622,93	0,00	0,00	0,00	2.322.238,28	18.615,35	146.169,44
NTN-B 150850 (6,120000%)	1.432.997,35	0,00	0,00	0,00	1.444.488,95	11.491,60	28.589,16
NTN-F 010135	9.229.009,93	484.093,14	0,00	0,00	9.522.884,18	-190.218,89	-479.797,19
	131.385.213,37	1.963.052,56	0,00	0,00	134.101.250,50	752.984,57	

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	22.239.625,85	0,00	0,00	0,00	22.700.112,99	460.487,14	154.959,03
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.313.690,34	0,00	0,00	0,00	1.324.827,51	11.137,17	67.830,39
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	8.452.018,15	0,00	0,00	0,00	8.539.561,38	87.543,23	399.875,20
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	14.655.965,78	0,00	0,00	0,00	14.959.979,49	304.013,71	121.943,94
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	14.010.558,35	0,00	0,00	0,00	14.135.747,14	125.188,79	559.787,03
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.033.064,16	0,00	0,00	0,00	4.069.600,56	36.536,40	206.526,90
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1.578.472,37	0,00	0,00	0,00	1.593.802,31	15.329,94	101.182,14
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	18.783.094,03	0,00	0,00	0,00	18.926.524,33	143.430,30	710.569,27
BNB IMA-B FI RF	1.274.608,91	0,00	0,00	0,00	1.299.929,37	25.320,46	12.647,56
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	34.332.028,96	0,00	0,00	0,00	34.581.313,65	249.284,69	1.234.789,77
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.650.334,76	0,00	0,00	0,00	26.888.278,44	237.943,68	1.066.906,73
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.763.893,49	0,00	0,00	0,00	22.215.003,04	451.109,55	181.627,35
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	685.039,68	0,00	0,00	0,00	691.401,73	6.362,05	35.765,90
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.588.679,72	0,00	0,00	0,00	1.603.212,74	14.533,02	90.171,50
	171.361.074,55	0,00	0,00	0,00	173.529.294,68	2.168.220,13	

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	10.504.618,95	0,00	0,00	0,00	10.626.343,73	121.724,78	497.898,62
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	18.888.491,75	0,00	0,00	0,00	19.294.947,66	406.455,91	106.260,11
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	12.003.551,65	0,00	0,00	0,00	12.116.714,20	113.162,55	725.346,59
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	19.319.880,73	0,00	-6.097,68	0,00	19.484.663,62	170.880,57	1.234.426,47
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.582.096,32	0,00	-392.901,06	0,00	29.473.132,09	283.936,83	1.803.996,76
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	862.918,23	1.000.000,00	0,00	0,00	1.874.812,76	11.894,53	54.959,18
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	15.221.310,06	0,00	0,00	0,00	15.369.293,19	147.983,13	912.616,00
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	2.562.419,52	0,00	0,00	0,00	2.587.739,72	25.320,20	-83.927,37
	108.945.287,21	1.000.000,00	-398.998,74	0,00	110.827.646,97	1.281.358,50	

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	762.396,13	0,00	0,00	0,00	806.045,51	43.649,38	-1.424,43
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	4.050.281,67	0,00	0,00	0,00	4.150.229,56	99.947,89	-406.083,81
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	7.287.103,36	0,00	0,00	0,00	7.508.173,54	221.070,18	-306.413,29
FIA CAIXA DIVIDENDOS	2.216.546,27	0,00	0,00	0,00	2.255.138,22	38.591,95	-50.354,72
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	20.653.972,73	0,00	0,00	0,00	21.265.504,06	611.531,33	-113.151,62
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	1.896.294,89	0,00	0,00	0,00	2.016.806,99	120.512,10	-30.153,92
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	5.022.299,63	0,00	0,00	0,00	5.127.664,08	105.364,45	-51.391,92
	41.888.894,68	0,00	0,00	0,00	43.129.561,96	1.240.667,28	

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	2.760.404,93	0,00	0,00	0,00	2.870.566,49	110.161,56	521.417,86
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.372.389,60	0,00	0,00	0,00	1.381.178,91	8.789,31	169.867,20
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	916.042,40	0,00	0,00	0,00	895.849,25	-20.193,15	175.054,53
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	5.433.244,48	0,00	0,00	0,00	5.561.456,79	128.212,31	1.191.763,24
	10.482.081,41	0,00	0,00	0,00	10.709.051,44	226.970,03	

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	2.438.514,05	0,00	0,00	0,00	2.474.057,36	35.543,31	-102.731,84
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	3.643.199,00	0,00	0,00	0,00	3.702.144,20	58.945,20	-12.058,05
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	8.126.607,58	0,00	0,00	0,00	8.307.548,87	180.941,29	307.548,87
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.291.315,48	0,00	0,00	0,00	2.307.399,04	16.083,56	10.765,34
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.985.520,88	0,00	0,00	0,00	5.078.718,71	93.197,83	-243.745,59
	21.485.156,99	0,00	0,00	0,00	21.869.868,18	384.711,19	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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 CLASSE C	1.601.943,08	0,00	0,00	0,00	1.584.077,71	-17.865,37	114.590,73
	1.601.943,08	0,00	0,00	0,00	1.584.077,71	-17.865,37	

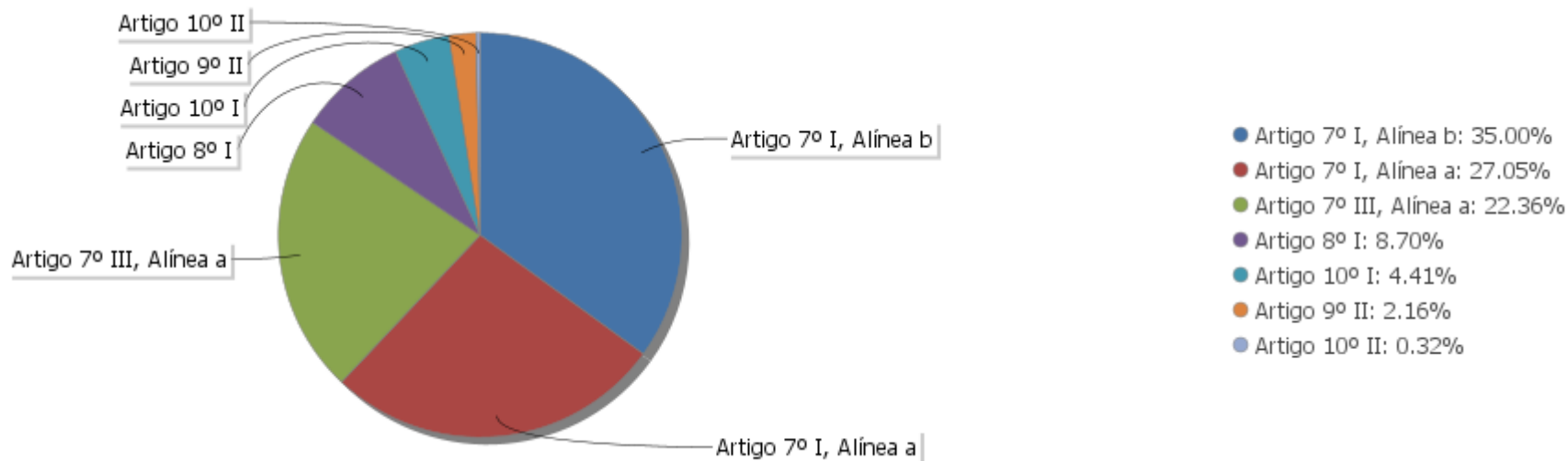
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

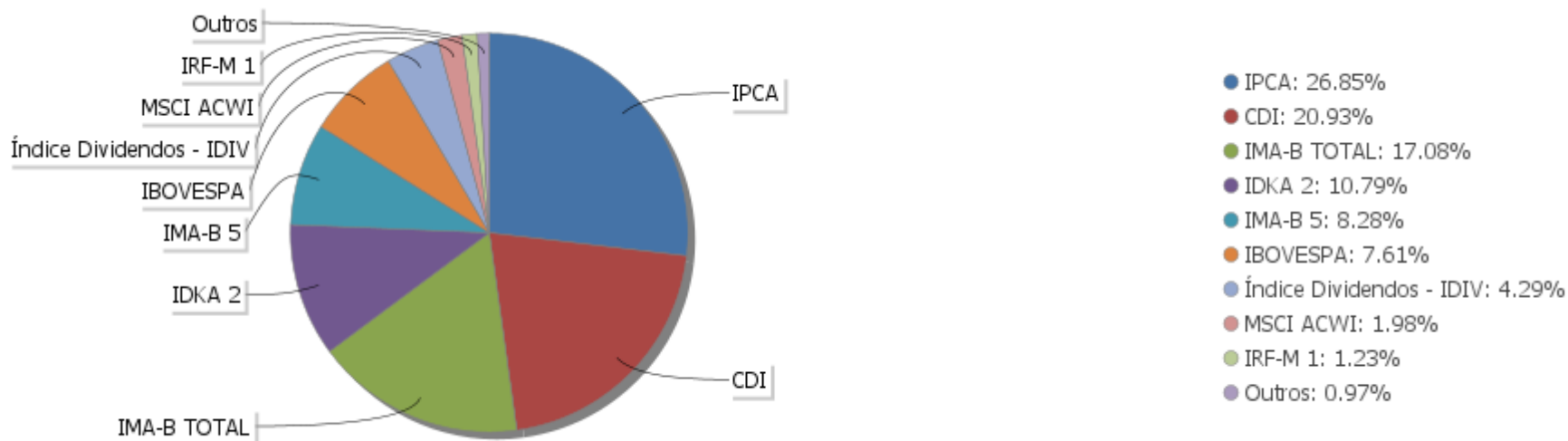
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	316.974.354,78	63,94	68,23	316.974.354,78	63,94	68,23
de 31 dias a 365 dias	39.595.855,77	7,99	9,28	356.570.210,55	71,93	77,51
acima de 365 dias	139.180.540,89	28,07	22,48	495.750.751,44	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

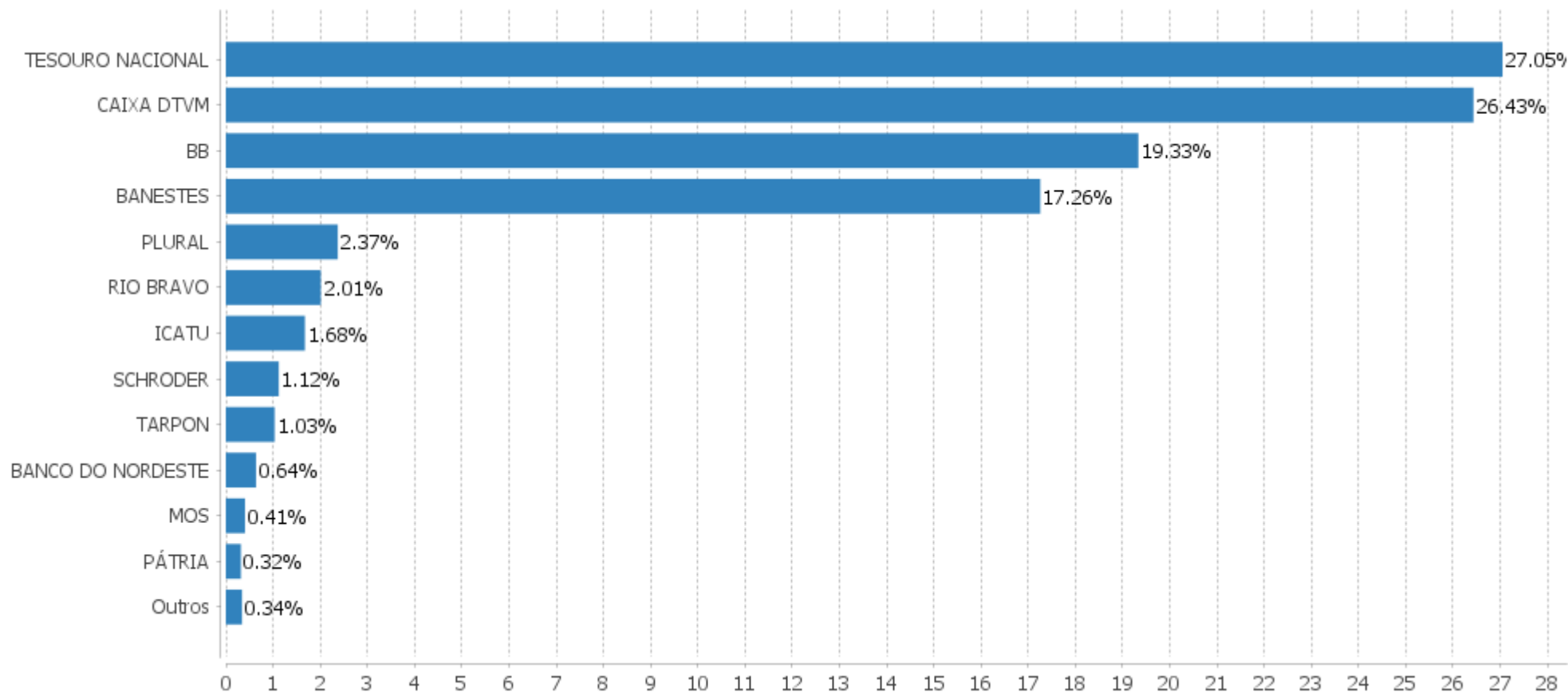


Alocação Por Estratégia



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	1,24						3,59
INPC + 5,09%	1,01	1,19	0,59	0,81	0,88	0,65	0,72						5,97
p.p. indexador	-1,04	-0,31	0,02	-1,22	-0,21	-0,05	0,52						-2,38
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	33	41,77
Meses abaixo - Meta Atuarial	46	58,23

	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	2,52	2,25	0,27	2,06
06 meses	3,63	4,91	-1,29	2,01
12 meses	8,59	9,34	-0,75	2,29
24 meses	21,95	18,87	3,09	2,71
36 meses	26,04	37,61	-11,57	2,94
48 meses	29,01	59,69	-30,68	3,10
60 meses	35,45	73,87	-38,42	3,97
Desde 29/12/2017	61,92	102,12	-40,20	3,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

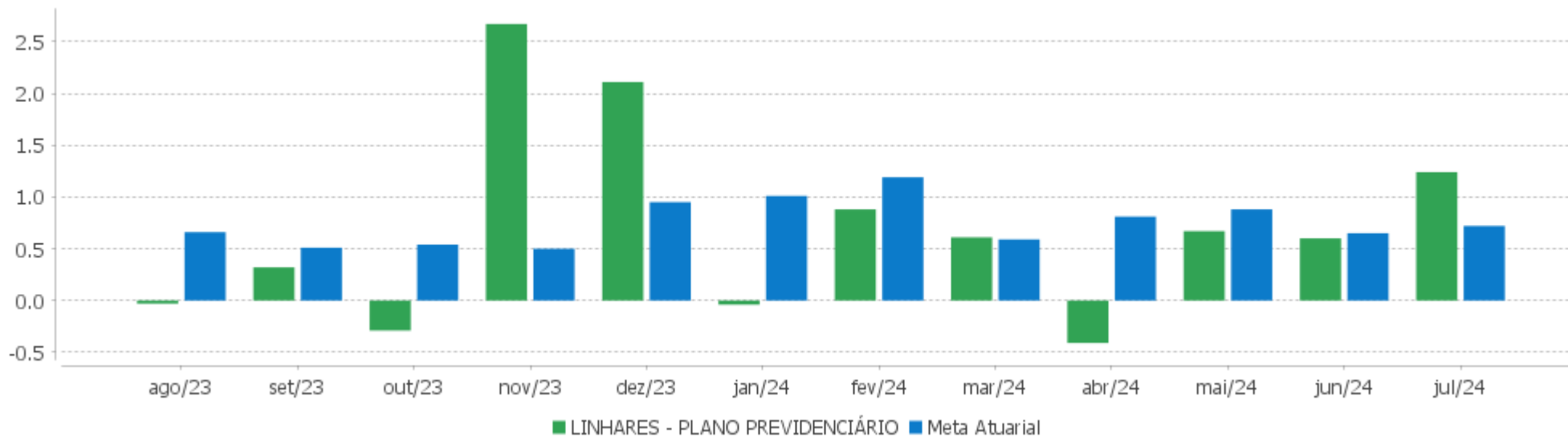


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150545 (5,800000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,44 3,57	2,51 1,46	5,35 2,91	10,62 6,12	14,45 5,78	
NTN-B 150545 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,51 3,64	2,54 1,49	5,41 2,96	10,75 6,25	21,41 12,74	34,75 15,14
NTN-B 150545 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	6,37 3,50	2,48 1,43	5,29 2,85	7,24 2,74		
NTN-B 150545 (6,310000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,44	3,58 0,71	-0,40 -1,46	2,47 0,03	4,46 -0,04		
NTN-B 150840 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,41 3,54	2,50 1,44	5,32 2,88	7,44 2,94	11,12 2,45	
NTN-B 150545 (6,330000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,44	3,58 0,71	-0,41 -1,46	2,48 0,03	4,46 -0,03		
NTN-B 150840 (5,480000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	6,25 3,38	2,43 1,38	5,19 2,75	7,24 2,75	10,82 2,14	
NTN-B 150828 (5,500000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	6,26 3,39	2,44 1,38	5,20 2,76	10,15 5,65	20,28 11,61	36,92 17,31
NTN-F 010135 % do CDI	-2,20 -241,98	-6,44 -107,44	-2,84 -111,24	-7,12 -137,95			
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,48 3,60	2,50 1,45	5,39 2,95	7,35 2,85		
NTN-B 150840 (6,050500%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,42	6,59 3,71	2,57 1,52	5,47 3,03	10,85 6,35	14,77 6,10	
NTN-B 150545 (5,470000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	6,25 3,37	2,43 1,38	5,19 2,74	10,27 5,77	13,98 5,31	
NTN-B 150545 (6,160000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,42	3,60 0,73	-0,33 -1,39	2,51 0,07	4,48 -0,02		
NTN-B 150545 (6,305500%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,44	6,74 3,86	2,63 1,58	5,60 3,15	11,16 6,66	22,31 13,64	35,87 16,25
NTN-B 150535 (4,410000%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,27	5,62 2,75	2,17 1,11	4,66 2,22	9,07 4,57	17,88 9,21	36,61 17,00
NTN-B 150840 (6,190000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,43	6,67 3,80	2,61 1,55	5,54 3,10	11,00 6,50	14,97 6,30	
NTN-B 150545 (6,150000%)	0,80	6,65	2,60	5,52	10,99	21,95	35,42

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.	0,42	3,77	1,54	3,08	6,49	13,27	15,81
NTN-B 150850 (6,120000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,42	3,53 0,66	2,59 1,54	2,44 0,00	4,40 -0,10		
NTN-B 150830 (4,800000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,31	5,85 2,98	2,26 1,21	4,85 2,41	9,45 4,95	18,72 10,05	34,45 14,84
NTN-B 150535 (5,640000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	6,35 3,47	2,47 1,42	5,27 2,83	10,38 5,88	20,69 12,02	37,59 17,97
NTN-B 150840 (6,132000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,42	6,64 3,76	2,59 1,54	5,51 3,07	10,94 6,44	21,86 13,19	35,33 15,72
NTN-B 150828 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,35	6,13 3,26	2,38 1,33	5,09 2,64	9,91 5,41	19,76 11,09	36,07 16,46
NTN-B 150545 (5,825000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,46 3,58	2,52 1,46	5,36 2,92	10,65 6,15	21,19 12,52	34,48 14,86
NTN-B 150545 (6,418000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,45	6,80 3,93	2,66 1,61	5,65 3,21	11,28 6,78	18,88 10,21	
NTN-B 150545 (5,440500%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,36	6,23 3,36	2,42 1,37	5,17 2,73	10,23 5,74	13,94 5,27	
NTN-B 150840 (5,910000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,51 3,63	2,54 1,48	5,40 2,96	10,70 6,20	14,56 5,89	
NTN-B 150828 (5,200000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,34	6,09 3,21	2,36 1,31	5,05 2,61	9,84 5,34	19,60 10,93	35,82 16,20
NTN-B 150545 (6,380000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,44	6,78 3,91	2,65 1,60	5,63 3,19	11,24 6,74	18,81 10,14	32,01 12,40
NTN-B 150545 (6,281000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,44	6,72 3,85	2,63 1,57	5,59 3,14	11,13 6,63	22,25 13,58	35,80 16,18
NTN-B 150545 (5,847000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,47 3,59	2,52 1,47	5,37 2,93	10,67 6,17	21,24 12,57	34,54 14,93
NTN-B 150545 (5,550000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	6,29 3,42	2,45 1,40	5,22 2,78	10,35 5,85	14,16 5,49	
NTN-B 150824 (5,800000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,44 3,57	2,51 1,46	5,35 2,91	10,40 5,90	20,90 12,23	33,98 14,37
NTN-B 150832 (5,350000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,35	6,18 3,30	2,40 1,35	5,13 2,68	10,06 5,56	20,01 11,34	32,77 13,16
NTN-B 150535 (3,200000%) Var. IPCA p.p.	0,55 0,17	4,91 2,03	1,86 0,81	4,06 1,61	7,78 3,28	15,14 6,47	31,90 12,29
NTN-B 150840 (5,800000%)	0,77	6,44	2,51	5,35	10,58	21,10	34,34

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.	0,39	3,57	1,46	2,91	6,09	12,43	14,73
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,07 -0,02	0,82 -0,15	2,37 -0,08	1,30 -0,13	4,17 -0,21	20,10 -0,41	23,67 -0,76
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,89 -0,02	4,13 -0,13	2,31 -0,06	3,45 -0,12	7,93 -0,23	20,02 -0,35	31,84 -0,63
BNB IMA-B FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,11	0,98 0,01	2,41 -0,04	1,50 0,07	4,58 0,20	20,32 -0,19	24,61 0,18
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 -0,03	5,35 -0,15	2,27 -0,10	4,44 -0,18	10,50 -0,31	25,41 -0,73	35,27 -1,11
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,89 -0,02	4,12 -0,14	2,31 -0,06	3,44 -0,12	7,91 -0,25	19,88 -0,49	31,52 -0,94
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,91 100,85	5,96 96,50	2,50 98,19	4,96 96,18	11,19 97,26	26,26 98,50	38,30 99,34
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,97 -1,12	6,73 5,76	3,04 0,59	5,57 4,14	11,21 6,83	22,14 1,63	35,09 10,66
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,07 -0,02	0,69 -0,29	2,38 -0,07	1,35 -0,08	4,11 -0,27	20,37 -0,14	20,04 -4,39
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,85 -0,09	5,40 -0,10	2,24 -0,12	4,47 -0,15	10,58 -0,23	25,84 -0,31	36,42 0,05
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,76 0,01	3,90 -0,08	2,08 0,08	3,17 0,01	7,92 -0,20	19,47 -0,05	30,83 -0,78
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,73 -0,02	3,70 -0,28	1,96 -0,05	2,95 -0,20	7,87 -0,25	19,26 -0,27	30,48 -1,13
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,07 -0,02	0,82 -0,15	2,39 -0,06	1,31 -0,12	4,13 -0,25	19,89 -0,62	23,44 -0,99
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,93 -0,01	5,46 -0,04	2,31 -0,05	4,50 -0,12	10,64 -0,17	25,71 -0,43	35,60 -0,77
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,04 0,66	4,91 2,04	2,15 1,10	4,03 1,59	10,06 5,56	25,62 16,95	33,23 13,62
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,15 0,06	0,55 -0,42	2,33 -0,12	1,22 -0,21	3,86 -0,52	20,15 -0,36	22,31 -2,12
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,88 97,53	6,76 109,49	2,49 97,78	5,74 111,24	12,08 104,96	24,88 93,35	36,56 94,82
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,99 -1,11	-3,14 -4,11	0,99 -1,46	-2,04 -3,47	-1,45 -5,83		
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,94	6,50	2,67	5,43	12,10	24,87	37,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	103,93	105,32	104,68	105,17	105,14	93,31	97,12
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	1,16	4,92	2,43	4,25	9,96	22,16	31,54
% do CDI	127,74	79,60	95,22	82,38	86,57	83,13	81,82
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,97	6,26	2,62	5,25	11,61	26,75	39,03
% do CDI	107,18	101,42	102,65	101,68	100,84	100,36	101,23
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,97	6,39	2,65	5,33	12,00	27,35	39,82
% do CDI	107,18	103,43	104,11	103,33	104,30	102,61	103,29
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,89	6,19	2,53	5,15	11,44	26,30	38,16
% do CDI	97,85	100,18	99,37	99,91	99,40	98,64	98,98
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	2,10	-0,99	-0,99	5,50	16,35	66,92	65,51
Var. IBOVESPA p.p.	-0,92	3,88	-2,36	5,58	11,66	43,19	60,71
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	2,47	-8,91	1,38	-2,62	-0,25	11,41	-2,03
Var. IBOVESPA p.p.	-0,55	-4,04	0,01	-2,54	-4,93	-12,33	-6,83
FIA CAIXA DIVIDENDOS	1,74	-2,18	2,55	1,40	9,81	28,57	25,60
Var. IBOVESPA p.p.	-1,28	2,68	1,17	1,48	5,13	4,83	20,80
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	5,73	-0,18	2,58	2,98	0,86	15,02	-12,31
Var. IBOVESPA p.p.	2,70	4,69	1,21	3,06	-3,82	-8,71	-17,11
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	6,36	-4,85	4,56	-1,31	-0,35	36,63	5,81
Var. IBOVESPA p.p.	3,33	0,02	3,19	-1,23	-5,03	12,90	1,01
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	2,96	-0,53	3,23	2,62	8,79	27,50	18,92
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,07	1,05	0,33	0,62	-2,27	-4,36	-12,29
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	3,03	-5,95	2,73	-3,10	4,20	23,98	27,91
Var. IBOVESPA p.p.	0,01	-1,08	1,36	-3,02	-0,48	0,24	23,11
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	3,99	22,20	15,30	16,64	28,85	25,37	16,99
Var. MSCI ACWI p.p.	0,59	-8,78	-2,51	-10,69	-8,64	-13,96	-7,29
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,36	27,27	15,51	23,81	36,07	41,58	22,44
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,04	-3,70	-2,30	-3,52	-1,42	2,26	-1,84
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	0,64	14,02	10,17	19,09	21,31	28,45	-43,64
Var. MSCI ACWI p.p.	-2,76	-16,95	-7,64	-8,25	-16,18	-10,88	-67,92
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-2,20	24,29	8,47	19,46	36,07	58,79	-2,61
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-3,12	17,86	5,91	14,01	25,32	36,75	-44,97
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	1,46	-3,99	-0,62	-1,69	3,97	20,92	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,57	0,88	-2,00	-1,61	-0,71	-2,81	
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1,87	-4,58	0,81	0,28	2,57	16,02	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,15	0,29	-0,56	0,36	-2,11	-7,71	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,70	0,47	-2,59	-0,69	6,20		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 p.p.	-2,31	-34,94	-22,65	-30,96	-37,50		
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	2,23 -0,80	3,46 8,33	3,77 2,39	4,46 4,54	9,55 4,87	40,07 16,33	33,33 28,53
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO % do CDI	1,62 178,36	-0,32 -5,26	0,85 33,19	0,36 6,90	5,91 51,39	21,77 81,67	24,99 64,83
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C Var. IPCA + 7,00% p.p.	6,62 5,62	8,53 1,52	6,97 4,16	10,12 4,18			
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO Var. INPC + 5,09% p.p.	1,24 0,52	3,59 -2,38	2,52 0,27	3,63 -1,29	8,59 -0,74	21,95 3,02	26,04 -11,57
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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 VARIACÃO 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

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	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

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração

exceder 100.00 %
o índice
IBOV_FEC. A taxa
de performance
sera paga no(s)
mes(es) de Janeiro

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,94	5,49	2,37	4,62	10,81	26,14	36,37	39,08	46,74
IRF-M 1+	1,55	1,77	1,44	1,17	7,38	27,10	28,37	24,09	39,00
IRF-M TOTAL	1,34	2,87	1,71	2,19	8,37	26,19	30,49	28,67	41,29
IMA-B 5	0,91	4,27	2,37	3,56	8,16	20,37	32,46	39,16	51,45
IMA-B 5+	3,24	-1,97	2,52	-0,51	1,03	20,60	16,72	17,12	26,27
IMA-B TOTAL	2,09	0,97	2,45	1,43	4,38	20,51	24,43	27,57	37,98
IMA-GERAL TOTAL	1,36	3,81	2,36	3,33	8,64	24,49	31,89	34,10	43,92
IDKA 2	0,75	3,98	2,01	3,15	8,12	19,52	31,61	39,35	51,45
IDKA 20	6,19	-6,65	2,88	-3,43	-3,72	23,96	4,78	3,52	8,64
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

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

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (3,200000%)	1.174.763,19	3,200000	930.049,66	6,202900	-244.713,53
NTN-B 150535 (4,410000%)	1.180.685,16	4,410000	1.029.082,72	6,202900	-151.602,44
NTN-B 150535 (5,640000%)	2.646.215,35	5,640000	2.536.107,63	6,202900	-110.107,72
NTN-B 150545 (5,440500%)	2.180.317,17	5,440500	1.981.043,11	6,278700	-199.274,06
NTN-B 150545 (5,470000%)	1.605.187,76	5,470000	1.463.512,26	6,278700	-141.675,50
NTN-B 150545 (5,550000%)	2.103.188,71	5,550000	1.934.380,42	6,278700	-168.808,29
NTN-B 150545 (5,680000%)	2.061.477,25	5,680000	1.925.896,30	6,278700	-135.580,95
NTN-B 150545 (5,760000%)	3.088.122,49	5,760000	2.910.054,76	6,278700	-178.067,73
NTN-B 150545 (5,800000%)	9.561.450,94	5,800000	9.056.803,08	6,278700	-504.647,86
NTN-B 150545 (5,825000%)	1.955.940,98	5,825000	1.858.023,30	6,278700	-97.917,68
NTN-B 150545 (5,847000%)	2.147.012,27	5,847000	2.044.674,04	6,278700	-102.338,23
NTN-B 150545 (5,920000%)	5.411.320,24	5,920000	5.196.526,36	6,278700	-214.793,88
NTN-B 150545 (6,150000%)	2.345.559,28	6,150000	2.311.923,97	6,278700	-33.635,31
NTN-B 150545 (6,160000%)	6.989.706,88	6,160000	6.893.351,29	6,278700	-96.355,59
NTN-B 150545 (6,281000%)	2.086.558,58	6,281000	2.087.094,67	6,278700	536,09
NTN-B 150545 (6,305500%)	4.267.438,93	6,305500	4.280.240,89	6,278700	12.801,96
NTN-B 150545 (6,310000%)	1.479.537,96	6,310000	1.484.721,82	6,278700	5.183,86
NTN-B 150545 (6,330000%)	2.345.110,02	6,330000	2.358.586,66	6,278700	13.476,64
NTN-B 150545 (6,380000%)	4.160.844,00	6,380000	4.208.125,83	6,278700	47.281,83
NTN-B 150545 (6,418000%)	1.900.407,54	6,418000	1.930.138,36	6,278700	29.730,82
NTN-B 150824 (5,800000%)	1.583.506,03	5,800000	1.582.577,85	7,231400	-928,18
NTN-B 150828 (5,200000%)	4.570.505,04	5,200000	4.378.747,74	6,479500	-191.757,30
NTN-B 150828 (5,270000%)	2.250.368,72	5,270000	2.161.053,61	6,479500	-89.315,11
NTN-B 150828 (5,500000%)	5.843.615,84	5,500000	5.655.337,87	6,479500	-188.277,97
NTN-B 150830 (4,800000%)	5.860.727,93	4,800000	5.467.854,97	6,260000	-392.872,96
NTN-B 150832 (5,350000%)	2.022.810,27	5,350000	1.916.754,66	6,250700	-106.055,61
NTN-B 150840 (5,480000%)	4.150.555,24	5,480000	3.888.287,39	6,149800	-262.267,85
NTN-B 150840 (5,750000%)	1.295.779,51	5,750000	1.246.525,28	6,149800	-49.254,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150840 (5,800000%)	16.989.339,47	5,800000	16.423.531,11	6,149800	-565.808,36
NTN-B 150840 (5,910000%)	3.196.074,77	5,910000	3.122.876,49	6,149800	-73.198,28
NTN-B 150840 (6,050500%)	1.417.479,40	6,050500	1.403.982,29	6,149800	-13.497,11
NTN-B 150840 (6,132000%)	10.940.032,17	6,132000	10.921.320,15	6,149800	-18.712,02
NTN-B 150840 (6,190000%)	2.322.238,28	6,190000	2.331.222,92	6,149800	8.984,64
NTN-B 150850 (6,120000%)	1.444.488,95	6,120000	1.416.366,92	6,280200	-28.122,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
58	01/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	392.901,06	121.830,82393180	3,2249725260
59	01/07/2024	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	6.097,68	220,42921548	27,6627578000
67	03/07/2024	NTN-F 010135	484.093,14	0,00	550,00000000	880,1693454545
65	16/07/2024	BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	1.000.000,00	0,00	135.460,91864448	7,3822030000
66	30/07/2024	NTN-B 150545 (6,310000%)	1.478.959,42	0,00	350,00000000	4.225,5983428571
Total			2.963.052,56	398.998,74		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.461.282,78

Value-At-Risk: 1,10%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,81	0,77	5,00	0,58	0,06	1,02	418.458.192,15	84,41
Artigo 8º	9,84	5,63	20,00	0,43	0,21	2,96	43.129.561,96	8,70
Artigo 9º	12,89	6,15	20,00	-0,02	0,10	2,17	10.709.051,44	2,16
Artigo 10º	7,33	2,65	20,00	0,11	0,09	1,59	23.453.945,89	4,73
LINHARES - PLANO PREVIDENCIÁRIO		1,10		1,10			495.750.751,44	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,77%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,800000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,59	0,77	1.583.506,03	0,32
NTN-B 150828 (5,200000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,82	0,72	4.570.505,04	0,92
NTN-B 150828 (5,270000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,79	0,73	2.250.368,72	0,45
NTN-B 150828 (5,500000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,70	0,75	5.843.615,84	1,18
NTN-B 150830 (4,800000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,98	0,69	5.860.727,93	1,18
NTN-B 150832 (5,350000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,76	0,73	2.022.810,27	0,41
NTN-F 010135	20,45	4,84	0,06	4,84	-0,15	-2,20	9.522.884,18	1,92
NTN-B 150535 (3,200000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-1,60	0,55	1.174.763,19	0,24
NTN-B 150535 (4,410000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-1,13	0,65	1.180.685,16	0,24
NTN-B 150535 (5,640000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,65	0,76	2.646.215,35	0,53
NTN-B 150840 (5,480000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,71	0,75	4.150.555,24	0,84
NTN-B 150840 (5,750000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,61	0,77	1.295.779,51	0,26
NTN-B 150840 (5,800000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,59	0,77	16.989.339,47	3,43
NTN-B 150840 (5,910000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,55	0,78	3.196.074,77	0,64
NTN-B 150840 (6,050500%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,49	0,80	1.417.479,40	0,29
NTN-B 150840 (6,132000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,46	0,80	10.940.032,17	2,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,44	0,81	2.322.238,28	0,47
NTN-B 150545 (5,440500%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,73	0,74	2.180.317,17	0,44
NTN-B 150545 (5,470000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,72	0,75	1.605.187,76	0,32
NTN-B 150545 (5,550000%)	0,36	0,26	-0,00	0,27	-0,43	0,75	2.103.188,71	0,42
NTN-B 150545 (5,680000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,64	0,76	2.061.477,25	0,42
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,36	0,26	-0,00	0,26	-0,38	0,77	3.088.122,49	0,62
NTN-B 150545 (5,800000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,59	0,77	9.561.450,94	1,93
NTN-B 150545 (5,825000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,58	0,78	1.955.940,98	0,39
NTN-B 150545 (5,847000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,57	0,78	2.147.012,27	0,43
NTN-B 150545 (5,920000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,54	0,78	5.411.320,24	1,09
NTN-B 150545 (6,150000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,45	0,80	2.345.559,28	0,47
NTN-B 150545 (6,160000%)	0,35	0,29	-0,00	0,30	-0,29	0,80	6.989.706,88	1,41
NTN-B 150545 (6,281000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,40	0,82	2.086.558,58	0,42
NTN-B 150545 (6,305500%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,40	0,82	4.267.438,93	0,86
NTN-B 150545 (6,310000%)	0,23	0,24	-0,00	0,25	-0,39	0,82	1.479.537,96	0,30
NTN-B 150545 (6,330000%)	0,23	0,24	-0,00	0,25	-0,39	0,82	2.345.110,02	0,47
NTN-B 150545 (6,380000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,37	0,82	4.160.844,00	0,84
NTN-B 150545 (6,418000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,35	0,83	1.900.407,54	0,38
NTN-B 150850 (6,120000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,47	0,80	1.444.488,95	0,29
Sub-total	1,41	0,35	0,06		-0,24	0,57	134.101.250,50	27,05

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	4,49	2,20	0,09	0,05	0,26	2,07	22.700.112,99	4,58
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,49	0,28	0,00	0,04	-0,12	0,85	1.324.827,51	0,27
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,92	0,43	0,01	0,43	0,14	1,04	8.539.561,38	1,72
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,44	2,23	0,06	0,01	0,26	2,07	14.959.979,49	3,02
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,76	1,01	0,02	0,01	-0,01	0,89	14.135.747,14	2,85
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	0,27	0,00	0,02	-0,00	0,91	4.069.600,56	0,82
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,54	0,31	0,00	2,26	0,12	0,97	1.593.802,31	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,98	1,12	0,03	0,19	-0,07	0,76	18.926.524,33	3,82
BNB IMA-B FI RF	4,19	2,08	0,00	0,15	0,26	1,99	1.299.929,37	0,26
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,17	1,22	0,07	0,20	-0,08	0,73	34.581.313,65	6,98
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	1,01	0,05	0,01	-0,01	0,89	26.888.278,44	5,42
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,46	2,21	0,09	0,02	0,26	2,07	22.215.003,04	4,48
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,60	0,28	0,00	0,03	0,04	0,93	691.401,73	0,14
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,06	0,07	0,00	0,07	0,14	0,91	1.603.212,74	0,32
Sub-total	2,63	1,36	0,42		0,14	1,27	173.529.294,68	35,00

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	1,10	0,51	0,01	0,51	0,23	1,16	10.626.343,73	2,14
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4,68	2,43	0,08	0,34	0,27	2,15	19.294.947,66	3,89
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,05	0,03	-0,00	0,03	0,68	0,94	12.116.714,20	2,44
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,05	0,05	-0,00	0,05	-0,42	0,88	19.484.663,62	3,93
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,02	0,00	0,02	0,82	0,97	29.473.132,09	5,95
BNB PLUS FIC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,01	0,01	0,00	0,01	-1,39	0,89	1.874.812,76	0,38
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,02	0,00	0,02	1,10	0,97	15.369.293,19	3,10
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	4,42	2,10	0,01	1,85	0,02	0,99	2.587.739,72	0,52
Sub-total	1,01	0,50	0,10		0,27	1,18	110.827.646,97	22,36

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,63%

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	11,15	6,16	0,01	3,24	0,43	5,73	806.045,51	0,16
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	10,59	5,54	0,04	1,52	0,15	2,47	4.150.229,56	0,84
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	9,81	6,05	0,08	2,10	0,22	3,03	7.508.173,54	1,51
FIA CAIXA DIVIDENDOS	10,38	5,27	0,02	2,69	0,08	1,74	2.255.138,22	0,45
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	9,41	5,54	0,20	1,76	0,22	2,96	21.265.504,06	4,29

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	13,81	8,77	0,03	5,22	0,39	6,36	2.016.806,99	0,41
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	14,31	7,71	0,06	5,57	0,08	2,10	5.127.664,08	1,03
Sub-total	9,84	5,63	0,43		0,21	2,96	43.129.561,96	8,70

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,65%

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	2,07	5,02	0,02	2,32	0,27	1,46	2.474.057,36	0,50
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	5,84	2,77	0,02	2,77	0,12	1,62	3.702.144,20	0,75
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	6,38	3,02	0,04	3,23	0,21	2,23	8.307.548,87	1,68
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,05	2,91	-0,00	8,35	-3,85	0,70	2.307.399,04	0,47
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	12,09	4,36	0,03	3,05	0,08	1,87	5.078.718,71	1,02
Sub-total	5,44	2,83	0,11		0,16	1,79	21.869.868,18	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	21,23	0,48	0,00	0,48	0,27	6,62	1.584.077,71	0,32
Sub-total	33,48	0,48	0,00		-0,06	-1,12	1.584.077,71	0,32

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,15%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	16,16	5,82	-0,01	6,09	0,19	3,99	2.870.566,49	0,58
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	23,85	12,20	0,00	11,24	-0,01	0,64	1.381.178,91	0,28
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	14,47	6,80	-0,00	6,81	-0,21	-2,20	895.849,25	0,18

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	13,30	6,52	-0,01	6,75	0,11	2,36	5.561.456,79	1,12
Sub-total	12,89	6,15	-0,02		0,10	2,17	10.709.051,44	2,16

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)