



LDB
EMPRESAS

TOLEDO
2º TRIMESTRE 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.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 81,54%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,130000%)	4,17	0,04	0,86	1,29	16.204.758,66	2,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,275000%)	4,22	0,04	0,48	0,48	20.092.837,11	3,43
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,15	0,04	0,86	1,29	36.297.595,77	6,20

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	Trim.				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,61	-0,08	0,38	1,40	26.938.476,92	4,60	6.543.333.888,45	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,97	0,05	1,16	2,85	10.303.638,06	1,76	198.418.875,04	5,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	-0,24	0,20	0,86	5.987.459,06	1,02	4.585.046.250,25	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,72	-0,18	0,37	1,18	40.508.500,86	6,92	7.303.046.549,52	0,55
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,89	0,00	-1,33	-2,71	0,00	0,00	1.144.374.704,79	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,80	-0,51	-1,00	-1,35	28.161.661,94	4,81	4.133.113.700,82	0,68
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	-0,02	0,61	1,97	20.599.790,16	3,52	7.877.165.450,51	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,03	0,78	2,39	101.443.536,31	17,33	11.312.134.510,29	0,90
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	-0,14	0,17	0,55	41.233.608,71	7,05	4.858.229.912,84	0,85
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,69	-0,04	0,94	4,00	44.250.447,93	7,56	704.187.699,29	6,28
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,01	-0,09	0,42	1,55	319.427.119,95	54,58		

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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,12	0,03	0,79	2,47	34.266.314,00	5,86	5.436.885.879,50	0,63
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,04	0,82	2,57	59.119.735,48	10,10	16.508.104.382,05	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,98	-0,03	0,60	1,56	1.328.660,45	0,23	672.683.891,15	0,20
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	5,98	-0,25	-0,74	-3,16	16.022.645,56	2,74	134.858.916,32	11,88
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	7,18	0,00	0,55	1,71	10.708.788,50	1,83	240.221.262,15	4,46
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,39	-0,00	0,59	1,64	121.446.143,99	20,75		
Renda Fixa			0,98	-0,06	0,48	1,60	477.170.859,71	81,54		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

3,94%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	24,79	-1,63	0,91	-11,56	1.071.116,01	0,18	182.320.225,27	0,59
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	20,60	-1,50	0,60	-7,69	768.914,67	0,13	98.735.083,36	0,78
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,31	-1,15	-0,44	-11,33	1.314.098,49	0,22	604.053.530,94	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,92	-0,44	1,78	-1,09	5.017.888,68	0,86	1.013.802.736,53	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	14,18	-0,64	1,00	-6,70	7.760.163,41	1,33	547.635.436,93	1,42
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	12,89	-0,20	1,80	-2,22	5.030.839,13	0,86	1.114.262.445,89	0,45
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	17,33	-0,75	1,03	-10,27	2.094.147,73	0,36	114.389.853,59	1,83
Sub-total Artigo 8º I			14,06	-0,62	1,24	-5,49	23.057.168,12	3,94		
Renda Variável			14,06	-0,62	1,24	-5,49	23.057.168,12	3,94		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 6,83%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	12,98	1,61	10,57	12,52	11.252.338,82	1,92	1.564.931.574,84	0,72
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,09	1,17	11,56	10,28	5.060.193,07	0,86	820.358.590,52	0,62
Sub-total Artigo 9º II			15,39	1,47	10,87	12,15	16.312.531,89	2,79		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,96	0,88	12,73	21,34	23.657.284,02	4,04	2.736.870.167,13	0,86
Sub-total Artigo 9º III			13,96	0,88	12,73	21,34	23.657.284,02	4,04		
Investimentos no Exterior			13,01	1,12	11,97	18,65	39.969.815,91	6,83		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,70%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,06	-0,28	3,90	5,01	19.323.360,86	3,30	1.972.213.735,46	0,98
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	4,13	0,02	0,58	0,90	11.482.821,00	1,96	236.117.556,91	4,86
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,63	-0,40	0,81	-2,29	4.393.494,60	0,75	130.829.324,10	3,36
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	8,50	0,00	-0,70	-5,52	0,00	0,00		
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	9,20	-1,61	-1,64	-1,64	9.836.223,74	1,68	269.422.734,04	3,65
Sub-total Artigo 10º I			5,45	-0,51	1,49	0,79	45.035.900,20	7,70		
Investimentos Estruturados			5,45	-0,51	1,49	0,79	45.035.900,20	7,70		
Total			1,79	-0,04	1,29	2,18	585.233.743,94	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	315.766,92
Sub-total Disponibilidades Financeiras	315.766,92
Total	585.549.510,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	36.297.595,77	6,20	0,00	25,00	60,00	35,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	319.427.119,95	54,58	20,00	23,64	90,00	26,85	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	121.446.143,99	20,75	5,00	16,63	50,00	15,36	70,00
	Total Renda Fixa	477.170.859,71	81,54					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	23.057.168,12	3,94	0,00	8,11	20,00	2,78	40,00
	Total Renda Variável	23.057.168,12	3,94					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	16.312.531,89	2,79	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.657.284,02	4,04	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	39.969.815,91	6,83					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	45.035.900,20	7,70	5,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	45.035.900,20	7,70					15,00
Total		585.233.743,94	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,86 109,63	1,29 109,14				235.028,13	303.050,66
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,42 52,78	1,55 61,31	1,55 61,31	3,52 67,43	8,98 76,79	1.389.899,96	5.373.305,40
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,59 74,50	1,64 64,82	1,64 64,82	3,82 73,15	9,22 78,84	694.003,74	1.990.006,84
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,24 -0,24	-5,49 -2,21	-5,49 -2,21	-7,96 -0,30	0,58 -4,34	283.073,21	-1.338.214,13
Artigo 9º II % do CDI	10,87 1.379,27	12,15 480,11	12,15 480,11	25,40 486,48	43,39 371,09	1.599.749,48	1.724.060,69
Artigo 9º III % do CDI	12,73 1.615,12	21,34 843,39	21,34 843,39	39,52 756,84	52,18 446,26	2.671.946,73	4.160.385,05
Artigo 10º I % do CDI	1,49 189,09	0,79 31,30	0,79 31,30	3,93 75,23	13,97 119,48	609.909,82	319.153,16
TOLEDO (Total)						7.483.611,07	12.531.747,67

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (6,130000%)	16.066.492,44	0,00	0,00	0,00	16.204.758,66	138.266,22	206.288,75
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,00	19.996.075,20	0,00	0,00	20.092.837,11	96.761,91	96.761,91
	16.066.492,44	19.996.075,20	0,00	0,00	36.297.595,77	235.028,13	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	26.835.711,80	0,00	0,00	0,00	26.938.476,92	102.765,12	370.681,14
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.185.783,90	0,00	0,00	0,00	10.303.638,06	117.854,16	285.916,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.975.796,73	0,00	0,00	0,00	5.987.459,06	11.662,33	71.913,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	40.358.222,39	0,00	0,00	0,00	40.508.500,86	150.278,47	472.511,21
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.020.249,36	0,00	-3.966.911,88	0,00	0,00	-53.337,48	-110.317,55
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.331.503,39	0,00	-9.817.259,87	0,00	28.161.661,94	-352.581,58	-489.936,76
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.475.215,08	0,00	0,00	0,00	20.599.790,16	124.575,08	495.535,96
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	94.462.361,07	6.316.195,08	-103.840,53	0,00	101.443.536,31	768.820,69	2.242.432,06
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	53.015.250,15	0,00	-11.888.069,10	0,00	41.233.608,71	106.427,66	333.256,66
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	43.837.012,42	0,00	0,00	0,00	44.250.447,93	413.435,51	1.701.313,48
	337.497.106,29	6.316.195,08	-25.776.081,38	0,00	319.427.119,95	1.389.899,96	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	41.814.161,95	850.509,01	-8.699.359,82	0,00	34.266.314,00	301.002,86	984.223,54
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	54.282.764,81	4.390.857,38	0,00	0,00	59.119.735,48	446.113,29	1.262.593,61
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1.320.750,33	0,00	0,00	0,00	1.328.660,45	7.910,12	86.153,84
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.142.104,94	0,00	0,00	0,00	16.022.645,56	-119.459,38	-522.868,86
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	10.650.351,65	0,00	0,00	0,00	10.708.788,50	58.436,85	179.904,71
	124.210.133,68	5.241.366,39	-8.699.359,82	0,00	121.446.143,99	694.003,74	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.061.415,37	0,00	0,00	0,00	1.071.116,01	9.700,64	-140.015,25
FIA CAIXA CONSUMO	764.312,12	0,00	0,00	0,00	768.914,67	4.602,55	-64.094,91
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.319.955,83	0,00	0,00	0,00	1.314.098,49	-5.857,34	-167.913,78
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.930.306,03	0,00	0,00	0,00	5.017.888,68	87.582,65	-55.247,43
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.683.416,37	0,00	0,00	0,00	7.760.163,41	76.747,04	-556.998,86
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.941.901,55	0,00	0,00	0,00	5.030.839,13	88.937,58	-114.193,49
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.072.787,64	0,00	0,00	0,00	2.094.147,73	21.360,09	-239.750,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
	22.774.094,91	0,00	0,00	0,00	23.057.168,12	283.073,21	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	10.177.018,02	0,00	0,00	0,00	11.252.338,82	1.075.320,80	1.252.338,82
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4.535.764,39	0,00	0,00	0,00	5.060.193,07	524.428,68	471.721,87
	14.712.782,41	0,00	0,00	0,00	16.312.531,89	1.599.749,48	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20.985.337,29	0,00	0,00	0,00	23.657.284,02	2.671.946,73	4.160.385,05
	20.985.337,29	0,00	0,00	0,00	23.657.284,02	2.671.946,73	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18.597.960,79	0,00	0,00	0,00	19.323.360,86	725.400,07	922.360,14
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	11.416.892,00	0,00	0,00	0,00	11.482.821,00	65.929,00	102.587,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.358.327,94	0,00	0,00	0,00	4.393.494,60	35.166,66	-102.793,87
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7.565.353,28	0,00	-7.512.543,63	0,00	0,00	-52.809,65	-439.223,85
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	9.836.223,74	-163.776,26	-163.776,26
	41.938.534,01	10.000.000,00	-7.512.543,63	0,00	45.035.900,20	609.909,82	

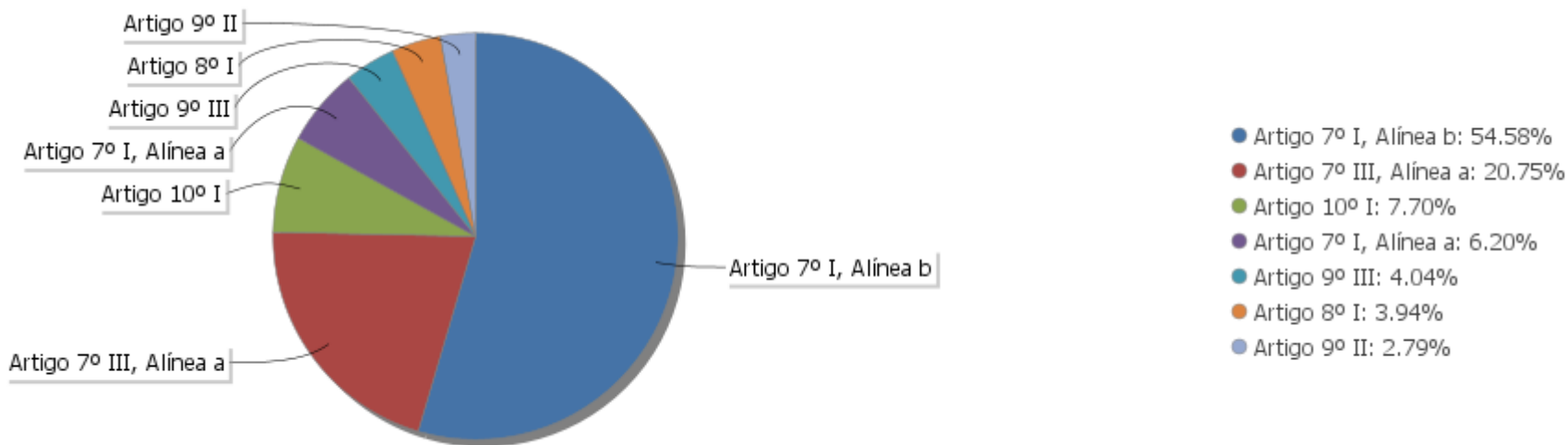
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

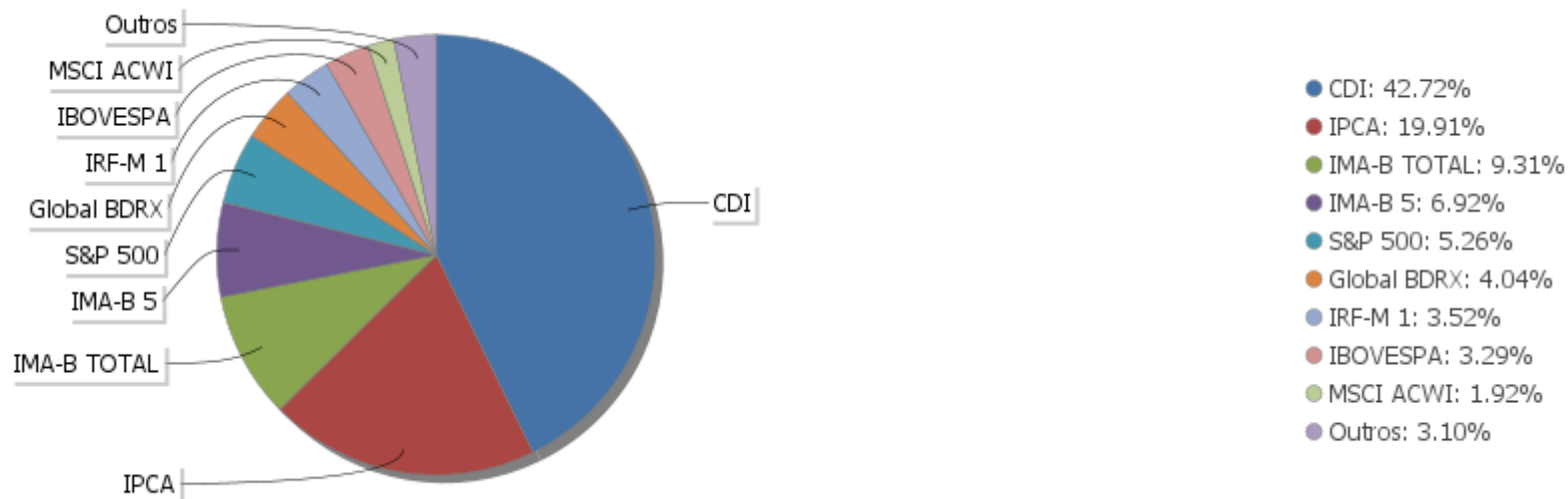
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	466.285.497,76	79,68	50,00	466.285.497,76	79,68	50,00
de 31 dias a 365 dias	68.420.932,07	11,69	10,00	534.706.429,83	91,37	60,00
acima de 365 dias	50.527.314,11	8,63	5,00	585.233.743,94	100,00	65,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

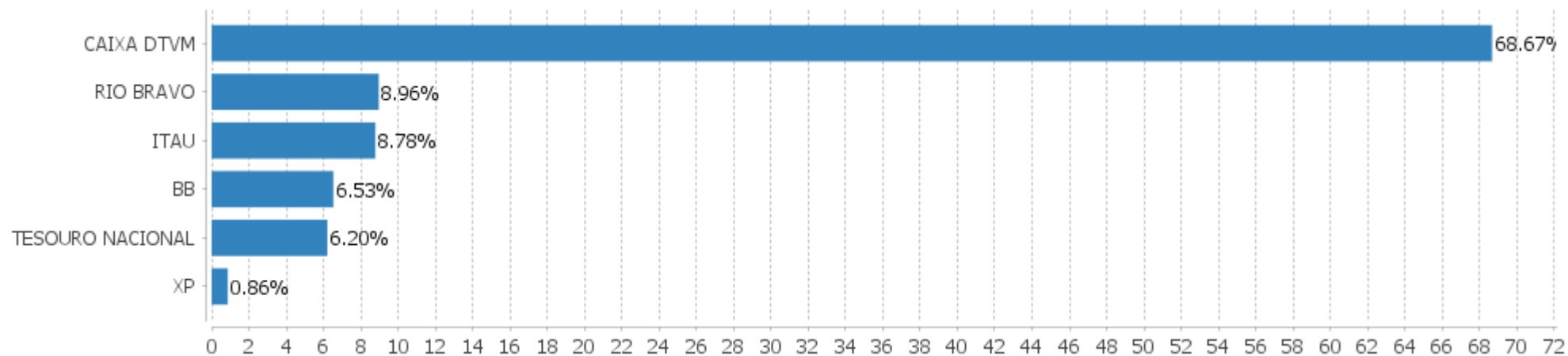


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,50	1,10	0,79	-0,03	0,91	1,29							4,64
INPC + 4,90%	0,99	1,17	0,57	0,79	0,86	0,63							5,12
p.p. indexador	-0,49	-0,07	0,22	-0,82	0,05	0,66							-0,48
2023	1,53	0,31	1,34	0,93	1,82	1,89	1,31	0,27	-0,00	0,06	2,52	1,84	14,69
INPC + 4,89%	0,88	1,11	1,08	0,87	0,78	0,30	0,31	0,64	0,49	0,52	0,48	0,93	8,72
p.p. indexador	0,65	-0,80	0,26	0,06	1,04	1,59	1,00	-0,37	-0,49	-0,46	2,04	0,91	5,98
2022	-0,80	-0,15	1,83	-0,96	0,47	-0,80	1,51	0,85	0,07	1,78	0,07	0,29	4,18
INPC + 4,90%	1,07	1,36	2,14	1,41	0,87	1,02	-0,20	0,13	0,08	0,85	0,76	1,11	11,10
p.p. indexador	-1,87	-1,51	-0,30	-2,36	-0,40	-1,82	1,71	0,73	-0,01	0,93	-0,69	-0,83	-6,92
2021	-0,35	-0,77	0,32	0,99	0,81	0,33	-0,23	-0,33	-0,71	-0,46	0,91	1,12	1,62
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04	1,49	1,35	1,65	1,58	1,26	1,22	16,11
p.p. indexador	-1,04	-1,97	-1,02	0,19	-0,60	-0,72	-1,71	-1,67	-2,36	-2,04	-0,35	-0,10	-14,48
2020	0,52	-0,14	-3,86	1,35	1,57	1,44	1,98	-0,63	-0,87	-0,13	1,81	2,48	5,48
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,61
p.p. indexador	-0,17	-0,72	-4,54	1,12	1,37	0,66	1,02	-1,47	-2,22	-1,50	0,40	0,51	-6,13

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	21	38,89
Meses abaixo - Meta Atuarial	33	61,11

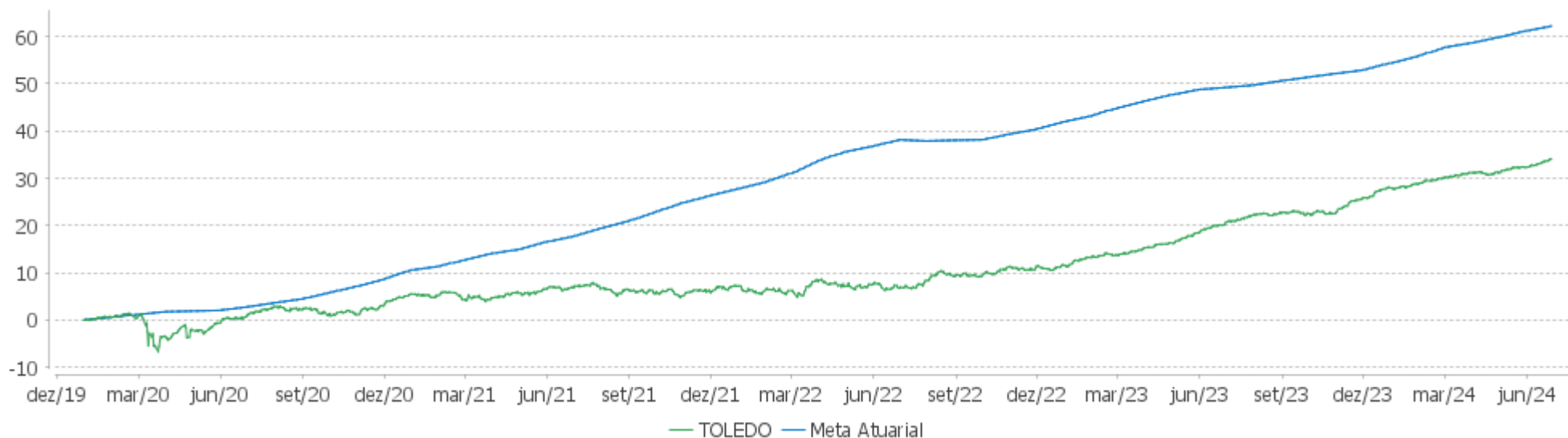
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,52	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03

Relatório

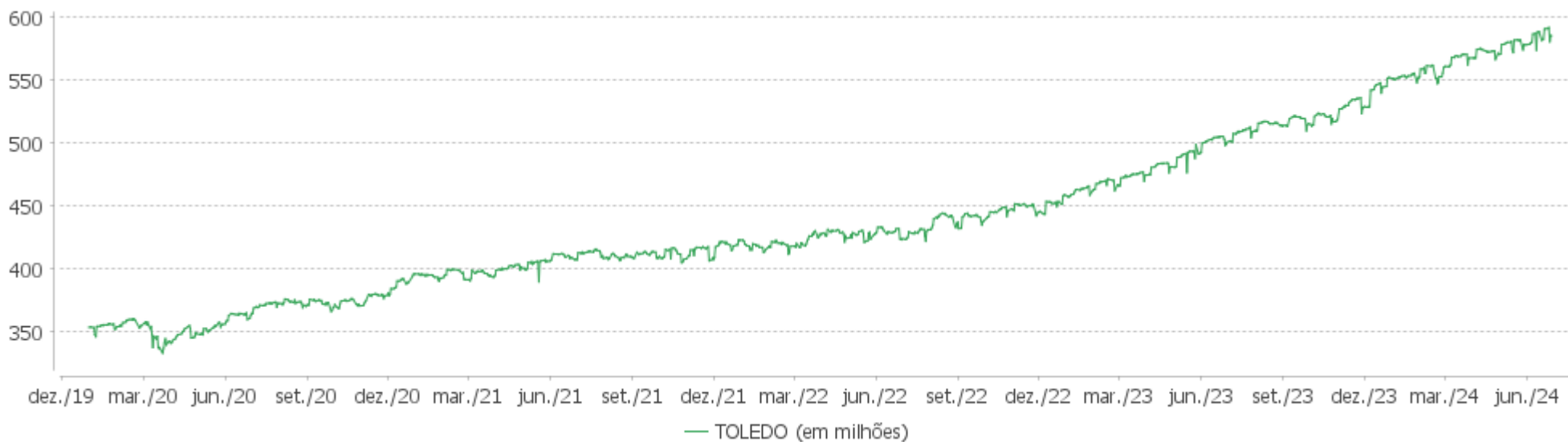
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,18	2,30	-0,12	1,24
06 meses	4,64	5,12	-0,48	1,33
12 meses	11,05	8,71	2,34	1,79
24 meses	25,58	17,43	8,15	2,19
36 meses	25,40	38,21	-12,81	2,96
48 meses	33,00	59,45	-26,45	3,07
Desde 31/12/2019	34,03	64,54	-30,52	4,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

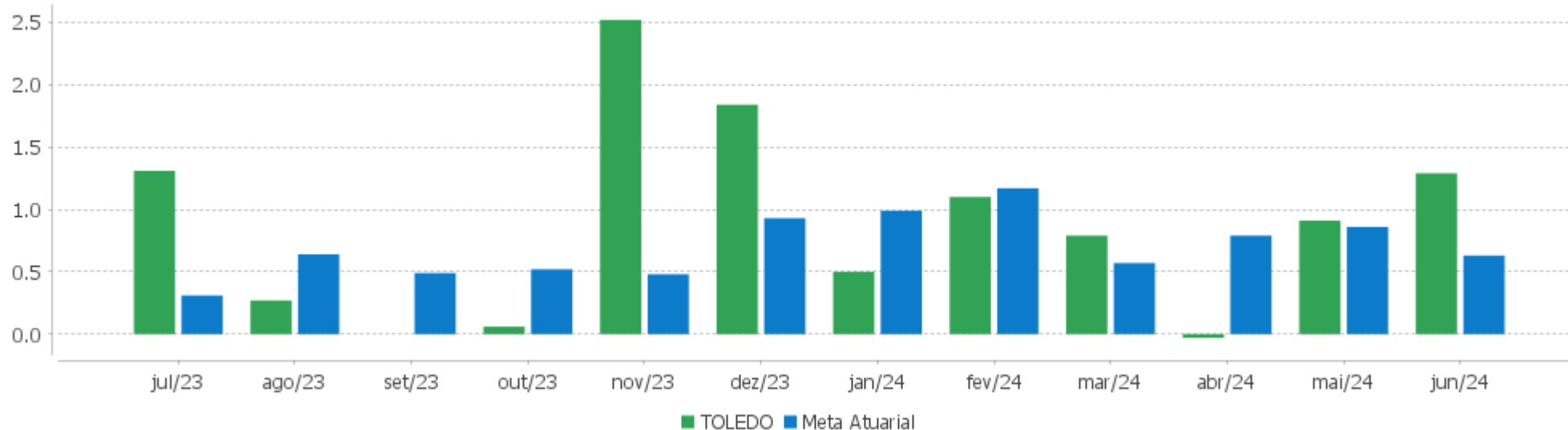


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (6,275000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	-0,42 -1,47	-0,42 -1,47	2,76 0,28	4,19 -0,04		
NTN-B 150535 (6,130000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	-0,42 -1,48	-0,42 -1,48	2,73 0,24	4,12 -0,11		
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,16 2,12	2,85 4,13	2,85 4,13	2,76 3,85	8,21 5,14	17,26 0,26	27,97 6,55
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,00 -0,03	-1,35 -0,08	-1,35 -0,08	-1,22 -0,13	2,87 -0,19	16,57 -0,43	20,68 -0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,02	1,18 -0,06	1,18 -0,06	3,21 -0,11	8,00 -0,23	18,98 -0,31	30,69 -0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,17 -0,04	0,55 -0,50	0,55 -0,50	2,36 -0,12	7,39 3,17	23,06 15,54	27,65 7,35
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,20 0,02	0,86 -0,09	0,86 -0,09	2,96 -0,25	8,08 -0,29	18,05 -0,38	29,46 -0,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,38 0,17	1,40 0,34	1,40 0,34	3,84 1,35	9,79 5,56	25,12 17,60	31,72 11,41
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,03	1,97 -0,04	1,97 -0,04	4,48 -0,02	10,79 -0,16	25,84 -0,44	34,58 -0,78
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,78 98,34	2,39 94,30	2,39 94,30	5,00 95,75	11,34 96,98	26,39 98,42	37,56 99,38
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,25 0,00	-3,61 -0,03	-3,61 -0,03	-5,08 -0,04	-1,41 0,02	14,09 -0,59	11,11 -1,08
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	0,94 119,64	4,00 158,04	4,00 158,04	6,75 129,19	12,41 106,13	24,51 91,39	38,53 101,96
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,74 0,23	-3,16 -1,89	-3,16 -1,89	-4,09 -2,99	-1,14 -4,21		
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,82 103,84	2,57 101,69	2,57 101,69	5,36 102,72	12,19 104,28	27,40 102,16	39,10 103,45
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,79 100,83	2,47 97,59	2,47 97,59	5,23 100,25	12,03 102,93	27,30 101,78	39,04 103,30
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	0,55 0,34	1,71 0,66	1,71 0,66	4,89 2,40	7,55 3,32		
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,60	1,59	1,59	3,80	8,65	23,59	29,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,39	0,54	0,54	1,31	4,42	16,06	9,37
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	0,60 -0,09	-7,69 -0,23	-7,69 -0,23	-14,56 -0,52	-16,02 -0,88	-11,04 -2,35	-52,76 -1,85
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	-0,44 -0,05	-11,33 -0,10	-11,33 -0,10	-15,12 -0,26	-12,55 -0,59	3,93 -1,53	-37,76 -1,47
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	0,91 115,93	-11,56 -456,93	-11,56 -456,93	-17,47 -334,59	-9,88 -84,53	29,25 109,06	-19,56 -51,76
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	1,80 0,32	-2,22 1,06	-2,22 1,06	-0,81 6,85	12,30 7,37	27,30 1,56	-5,22 -2,94
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,78 -0,22	-1,09 -1,51	-1,09 -1,51	-3,39 0,02	8,56 -3,53	27,99 -3,98	11,84 -14,72
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	1,03 -0,45	-10,27 -6,99	-10,27 -6,99	-15,26 -7,60	-12,67 -17,60	-9,58 -35,32	
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	1,00 -0,48	-6,70 -3,42	-6,70 -3,42	-9,38 -1,72	-1,76 -6,69	13,42 -12,32	-18,27 -15,99
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	12,73 -0,06	21,34 -0,40	21,34 -0,40	39,52 -1,55	52,18 -2,61	72,57 -4,56	50,01 -5,70
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	10,57 2,29	15,78 1,84	15,78 1,84	31,47 4,80	46,24 10,77	65,37 22,75	49,33 25,54
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	11,56 10,89	10,28 7,74	10,28 7,74	27,09 21,62	44,10 33,70	81,41 60,71	0,75 -42,41
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	-1,57 -499,08	-1,57 -499,08					
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	3,90 -5,83	5,01 -10,61	5,01 -10,61	16,70 -14,75	29,37 -12,16	66,02 12,93	56,49 15,29
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,81 -0,67	-2,29 0,99	-2,29 0,99	-6,33 1,33	2,69 -2,24	15,65 -10,09	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	0,58 -9,15	0,90 -14,73	0,90 -14,73	-0,23 -31,68	6,40 -35,13		
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.							
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	1,29 0,66	2,18 -0,12	2,18 -0,12	4,64 -0,48	11,05 2,33	25,58 8,14	25,40 -12,48
CDI	0,79	2,53	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-3,28	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%	0,71	2,57	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	2,54	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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 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 MATRIZ RENDA FI	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
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
FIA CAIXA CONSUMO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,60
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		1,90

O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	0,50
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CDI, DE UM DIA, APURADO PELA CETIP	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	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
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3 d.u		
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+1	D+2		1,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,63	2,00	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	-1,14	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	-0,17	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	1,24	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-3,58	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,27	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	0,77	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	0,95	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-7,87	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	2,53	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	9,73	15,63	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (6,130000%)	16.204.758,66	6,130000	15.744.909,87	6,510700	-459.848,79
NTN-B 150535 (6,275000%)	20.092.837,11	6,275000	19.738.516,75	6,510700	-354.320,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
27	05/04/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.174.145,89	0,00	1.119.667,96844100	5,5142650000
28	05/04/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	413.811,60	0,00	75.043,83630400	5,5142650000
29	17/04/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.264,12	0,00	5.293,49337400	5,5283190000
30	26/04/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	8.016.624,10	1.445.934,81563800	5,5442500000
31	29/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.390.857,38	0,00	848.760,72849200	5,1732570000
32	02/05/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	131.739,78	23.733,67717400	5,5507530000
33	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.221.273,77	0,00	1.120.365,21650400	5,5528980000
34	06/05/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	96.818,56	17.428,85467800	5,5550730000
35	08/05/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	40.116,39	7.215,83994400	5,5594900000
36	08/05/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	467.125,10	0,00	84.023,01290200	5,5594900000
37	09/05/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	13.066,99	2.349,40900400	5,5618200000
38	13/05/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	14.102,75	2.533,75205700	5,5659550000
39	15/05/2024	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	7.217.810,06	2.302.984,82247800	3,1341110000
40	16/05/2024	NTN-B 150535 (6,130000%)	15.998.469,91	0,00	3.773,00000000	4.240,2517651700
41	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	45.237,86	0,00	8.118,30822500	5,5723260000
42	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	2.851.217,21224300	3,5072740000
43	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	241.197,12	0,00	46.401,64954800	5,1980290000
44	16/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,00	9.021.856,97	6.724,26331300	1.341,6870443723
45	17/05/2024	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	10.000.000,00	0,00	1.495.094,18980000	6,6885418110
46	20/05/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.728,44	668,64569600	5,5761070000
47	27/05/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	8.378.484,87	4.313.585,85965200	1,9423480000
48	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	83.458,73	0,00	14.933,74280900	5,5886010000
49	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.390.857,38	0,00	841.993,37812300	5,2148360000
50	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	39.256,30	7.016,96653500	5,5944830000
51	05/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	17.766,42	3.173,32071900	5,5986840000
52	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	850.509,01	0,00	418.883,08385300	2,0304210000
53	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.203.409,19	0,00	1.107.294,48663338	5,6023120000
54	10/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	13.277,76	2.369,29473900	5,6040980000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
55	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.966.911,88	1.292.152,86504699	3,0700020000
56	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	9.817.259,87	2.214.238,88427147	4,4336950000
57	12/06/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	6.211.903,45	3.055.983,34017500	2,0327020000
58	12/06/2024	NTN-B 150535 (6,275000%)	19.996.075,20	0,00	4.730,00000000	4.227,5000420000
59	17/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	33.540,05	5.973,23302200	5,6150580000
60	17/06/2024	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,00	7.512.543,63	6.996.695,46478929	1,0737274000
61	19/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.296,99	0,00	230,80389000	5,6194460000
62	20/06/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	2.487.456,37	1.220.574,49641200	2,0379390000
63	20/06/2024	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	10.000.000,00	0,00	9.993.120,73568550	1,0006884000
64	21/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.503,02	0,00	5.245,37765076	5,6245750000
65	26/06/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	11.888.069,10	6.097.734,03393300	1,9495880000
66	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	81.985,88	0,00	14.551,64603024	5,6341310000
67	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.390.857,38	0,00	834.842,00705503	5,2595070000
Total			90.009.335,53	84.922.333,74		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.591.091,43

Value-At-Risk: 0,61%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,88	0,32	5,00	0,16	-0,33	0,49	477.170.859,71	81,54
Artigo 8º	12,76	6,28	20,00	0,15	0,04	1,24	23.057.168,12	3,94
Artigo 9º	14,98	5,60	20,00	0,14	0,75	11,97	39.969.815,91	6,83
Artigo 10º	3,71	2,46	20,00	0,16	0,19	1,49	45.035.900,20	7,70
TOLEDO	1,79	0,61		0,61	-0,36	11,05	585.233.743,94	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,32%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,43	0,86	16.204.758,66	2,77
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,49	0,87	20.092.837,11	3,43
Sub-total	0,17	0,22	-0,00		0,45	0,86	36.297.595,77	6,20

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,00	0,42	0,01	0,42	-0,41	0,38	26.938.476,92	4,60
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,01	0,44	0,00	2,19	0,36	1,16	10.303.638,06	1,76
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,07	1,10	0,01	0,24	-0,29	0,20	5.987.459,06	1,02
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	0,91	0,04	0,01	-0,24	0,37	40.508.500,86	6,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,32	NaN	0,00	NaN	-0,48	-2,25	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,00	2,15	0,05	0,02	-0,45	-1,00	28.161.661,94	4,81
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,23	0,00	0,02	-0,35	0,61	20.599.790,16	3,52
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,07	0,01	0,07	-0,13	0,78	101.443.536,31	17,33
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,85	0,72	0,03	0,72	-0,33	0,17	41.233.608,71	7,05
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,87	0,66	-0,01	0,66	0,18	0,94	44.250.447,93	7,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,98	0,40	0,13		-0,38	0,42	319.427.119,95	54,58

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	0,00	0,05	0,09	0,79	34.266.314,00	5,86
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,81	0,82	59.119.735,48	10,10
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,72	0,52	0,00	0,53	-0,26	0,60	1.328.660,45	0,23
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	4,51	2,08	0,02	2,13	-0,34	-0,74	16.022.645,56	2,74
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	4,16	1,08	0,01	1,08	-0,06	0,55	10.708.788,50	1,83
Sub-total	0,83	0,32	0,03		-0,24	0,59	121.446.143,99	20,75

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,46%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,22	4,79	0,12	4,84	0,50	3,90	19.323.360,86	3,30
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,12	2,98	-0,03	8,53	-1,78	0,58	11.482.821,00	1,96
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,96	4,10	0,01	3,10	0,00	0,81	4.393.494,60	0,75
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	15,68	NaN	0,00	NaN	0,11	2,54	0,00	0,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	9,20	4,37	0,05	4,37	-0,20	-1,57	9.836.223,74	1,68
Sub-total	3,71	2,46	0,16		0,19	1,49	45.035.900,20	7,70

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,60%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	12,88	6,13	0,01	5,58	0,76	10,57	11.252.338,82	1,92
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9,60	7,45	0,02	7,45	1,12	11,56	5.060.193,07	0,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	11,58	6,25	0,03		0,87	10,87	16.312.531,89	2,79

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,32	6,46	0,11	0,94	0,69	12,73	23.657.284,02	4,04
Sub-total	17,32	6,46	0,11		0,69	12,73	23.657.284,02	4,04

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,28%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	21,27	11,52	0,01	11,52	0,01	0,91	1.071.116,01	0,18
FIA CAIXA CONSUMO	20,11	8,56	0,01	0,11	-0,01	0,60	768.914,67	0,13
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,06	9,49	0,01	0,15	-0,06	-0,44	1.314.098,49	0,22
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,96	5,55	0,03	1,83	0,09	1,78	5.017.888,68	0,86
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	14,11	7,03	0,05	2,72	0,01	1,00	7.760.163,41	1,33
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	10,88	5,37	0,03	3,73	0,09	1,80	5.030.839,13	0,86
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	15,01	7,51	0,02	3,57	0,02	1,03	2.094.147,73	0,36
Sub-total	12,76	6,28	0,15		0,04	1,24	23.057.168,12	3,94

(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 (%)