



LDB
EMPRESAS

CAMPO MOURÃO
JANEIRO 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 31.01.2024.

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

85,49%

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 150535 (5,750000%) | 1,51 | 0,17 | 1,03 | 1,03 | 578.881,45 | 0,23 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,680000%) | 0,76 | 0,23 | 1,03 | 1,03 | 10.643.892,22 | 4,23 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,760000%) | 0,56 | 0,28 | 1,03 | 1,03 | 42.705.557,27 | 16,98 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,790000%) | 0,94 | 0,28 | 1,04 | 1,04 | 10.669.627,04 | 4,24 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,790000%) | 1,35 | 0,21 | 1,04 | 1,04 | 10.058.302,57 | 4,00 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,820000%) | 1,76 | 0,21 | 1,04 | 1,04 | 529.202,01 | 0,21 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,640000%) | 3,97 | 0,26 | 1,02 | 1,02 | 18.937.855,69 | 7,53 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,660000%) | 3,98 | 0,26 | 1,02 | 1,02 | 8.228.647,55 | 3,27 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,670000%) | 3,99 | 0,26 | 1,03 | 1,03 | 22.229.981,84 | 8,84 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,820000%) | 1,27 | 0,26 | 1,04 | 1,04 | 5.315.576,46 | 2,11 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,930000%) | 3,22 | 0,27 | 1,05 | 1,05 | 6.371.007,76 | 2,53 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 0,77 | 0,26 | 1,03 | 1,03 | 136.268.531,86 | 54,19 |

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 | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,33 | 0,05 | 0,91 | 0,91 | 16.996.207,43 | 6,76 | 8.572.761.910,40 | 0,20 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|--------|--|---------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,86 | 0,11 | 0,66 | 0,66 | 10.635.253,32 | 4,23 | 7.718.818.121,25 | 0,14 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 1,87 | 0,11 | 0,66 | 0,66 | 17.958.125,02 | 7,14 | 5.294.436.148,21 | 0,34 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 3,04 | 0,13 | 0,48 | 0,48 | 5.662.159,56 | 2,25 | 2.310.441.680,03 | 0,25 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 1,24 | 0,10 | 0,72 | 0,72 | 51.251.745,33 | 20,38 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|-----------|---------------------------------------|---------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|-------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B | 4,19 | 0,20 | -0,49 | -0,49 | 10.503.923,35 | 4,18 | 936.745.684,71 | 1,12 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,09 | 0,04 | 0,97 | 0,97 | 5.410.926,94 | 2,15 | 16.400.080.186,89 | 0,03 |
| BB | BB | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,05 | 0,04 | 0,88 | 0,88 | 37.860,15 | 0,02 | 4.198.417.498,27 | 0,00 |
| BRAM | BRADERSCO | BRADERSCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA | 2,16 | 0,12 | 0,46 | 0,46 | 10.120.092,37 | 4,02 | 742.916.287,32 | 1,36 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 2,40 | 0,14 | 0,18 | 0,18 | 26.072.802,81 | 10,37 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|------------|---|---------------------|-------------------|--------------|--------------|-----------------------|--------------|----------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| GRAPHEN | CM CAPITAL | GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS | 4,47 | -0,38 | -0,38 | -0,38 | 1.382.939,97 | 0,55 | 155.844.626,83 | 0,89 |
| Sub-total Artigo 7º V, Alínea a | | | 4,47 | -0,38 | -0,38 | -0,38 | 1.382.939,97 | 0,55 | | |
| Renda Fixa | | | 0,91 | 0,20 | 0,84 | 0,84 | 214.976.019,97 | 85,49 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

2,00%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|------------------------------|--------|----------------------------------|------------------------|-------------------|--------------|--------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE | 16,43 | 1,04 | -2,73 | -2,73 | 5.020.440,90 | 2,00 | 700.942.861,26 | 0,72 |
| Sub-total Artigo 8º I | | | 16,43 | 1,04 | -2,73 | -2,73 | 5.020.440,90 | 2,00 | | |
| Renda Variável | | | 16,22 | 1,04 | -2,73 | -2,73 | 5.020.440,90 | 2,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,18%

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------------------------------|--------|-------------------------------------|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 14,62 | -1,12 | 4,56 | 4,56 | 10.509.023,15 | 4,18 | 2.108.221.544,73 | 0,50 |
| Sub-total Artigo 9º III | | | 14,62 | -1,12 | 4,56 | 4,56 | 10.509.023,15 | 4,18 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 14,62 | -1,12 | 4,56 | 4,56 | 10.509.023,15 | 4,18 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,04%

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 BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 12,77 | -1,62 | 1,69 | 1,69 | 14.857.940,65 | 5,91 | 1.668.294.580,56 | 0,89 |
| Sub-total Artigo 10º I | | | 12,77 | -1,62 | 1,69 | 1,69 | 14.857.940,65 | 5,91 | | |

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------------------------------|---------|------------------------|---------------------|-------------------|--------------|--------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| A5 | PLANNER | W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | 0,58 | -0,15 | -0,15 | -0,15 | 2.838.589,62 | 1,13 | 122.426.394,90 | 2,32 |
| Sub-total Artigo 10º II | | | 0,58 | -0,15 | -0,15 | -0,15 | 2.838.589,62 | 1,13 | | |

| | | | | | | | | | | |
|-----------------------------------|--|--|-------------|--------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|--|--|
| Investimentos Estruturados | | | 9,98 | -1,39 | 1,39 | 1,39 | 17.696.530,27 | 7,04 | | |
|-----------------------------------|--|--|-------------|--------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|--|--|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,29%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-----------------------------|-------------|-------------------------------|---------------------|-------------------|--------------|--------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| LEGATUS | BTG PACTUAL | FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING | 62,72 | -9,92 | -9,92 | -9,92 | 2.488.111,17 | 0,99 | 654.770.428,64 | 0,38 |
| PLANNER | PLANNER | CARE11 | 43,27 | -1,75 | 22,63 | 22,63 | 758.708,16 | 0,30 | 295.875.695,04 | 0,26 |
| Sub-total Artigo 11º | | | 54,37 | -8,14 | -3,97 | -3,97 | 3.246.819,33 | 1,29 | | |
| Fundos Imobiliários | | | 54,37 | -8,14 | -3,97 | -3,97 | 3.246.819,33 | 1,29 | | |
| Total | | | 1,75 | -0,07 | 0,89 | 0,89 | 251.448.833,62 | 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 | 136.268.531,86 | 54,19 | | | | | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 51.251.745,33 | 20,38 | | | | | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 26.072.802,81 | 10,37 | | | | | 60,00 |
| Artigo 7º V, Alínea a | FIDC Cota Sênior | 1.382.939,97 | 0,55 | | | | | 5,00 |
| | Total Renda Fixa | 214.976.019,97 | 85,49 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 5.020.440,90 | 2,00 | | | | | 30,00 |
| | Total Renda Variável | 5.020.440,90 | 2,00 | | | | | 30,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º III | Fundos de Ações - BDR Nível I | 10.509.023,15 | 4,18 | | | | | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 10.509.023,15 | 4,18 | | | | | 10,00 |
| Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 14.857.940,65 | 5,91 | | | | | 10,00 |
| Artigo 10º II | Fundo de Participação | 2.838.589,62 | 1,13 | | | | | 5,00 |
| | Total Investimentos Estruturados | 17.696.530,27 | 7,04 | | | | | 15,00 |
| Fundos Imobiliários | | | | | | | | |
| Artigo 11º | Fundo de Investimento Imobiliário | 3.246.819,33 | 1,29 | | | | | 5,00 |
| | Total Fundos Imobiliários | 3.246.819,33 | 1,29 | | | | | 5,00 |
| Total | | 251.448.833,62 | 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 | 1,03 106,63 | 1,03 106,63 | 2,79 99,25 | 5,01 82,92 | 10,75 83,55 | 1.390.259,08 | 1.390.259,08 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 0,72 74,05 | 0,72 74,05 | 3,57 127,11 | 5,08 84,17 | 12,13 94,25 | 347.828,78 | 347.828,78 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 0,18 18,30 | 0,18 18,30 | 4,01 142,84 | 4,39 72,75 | 14,50 112,67 | 46.040,95 | 46.040,95 |
| Artigo 7º V, Alínea a % do CDI | -0,38 -39,06 | -0,38 -39,06 | -0,68 -24,35 | -0,80 -13,30 | -0,20 -1,52 | -5.241,92 | -5.241,92 |
| Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p. | -2,73 2,06 | -2,73 2,06 | 18,05 5,14 | 7,36 2,60 | 20,43 7,81 | -140.932,80 | -140.932,80 |
| Artigo 9º III % do CDI | 4,56 471,80 | 4,56 471,80 | 14,15 504,32 | 11,69 193,50 | 25,21 195,87 | 458.393,19 | 458.393,19 |
| Artigo 10º I % do CDI | 1,69 174,34 | 1,69 174,34 | 16,97 604,52 | 8,77 145,15 | 27,16 211,03 | 246.253,05 | 246.253,05 |
| Artigo 10º II % do CDI | -0,15 -15,85 | -0,15 -15,85 | -0,43 -15,39 | -0,88 -14,49 | -0,50 -3,91 | -4.355,34 | -4.355,34 |
| Artigo 11º % do CDI | -3,97 -410,44 | -3,97 -410,44 | 53,89 1.920,10 | 35,35 585,37 | 8,27 64,25 | -134.146,00 | -134.146,00 |
| CAMPO MOURÃO (Total) | | | | | | 2.204.098,99 | 2.204.098,99 |

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 (5,750000%) | 572.966,68 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 578.881,45 | 5.914,77 | 5.914,77 |
| NTN-B 150545 (5,680000%) | 10.535.746,49 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.643.892,22 | 108.145,73 | 108.145,73 |
| NTN-B 150555 (5,760000%) | 42.268.861,17 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 42.705.557,27 | 436.696,10 | 436.696,10 |
| NTN-B 150555 (5,790000%) | 10.560.260,67 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.669.627,04 | 109.366,37 | 109.366,37 |
| NTN-B 150840 (5,790000%) | 9.955.202,44 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.058.302,57 | 103.100,13 | 103.100,13 |
| NTN-B 150840 (5,820000%) | 523.764,59 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 529.202,01 | 5.437,42 | 5.437,42 |
| NTN-B 150850 (5,640000%) | 18.746.059,89 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 18.937.855,69 | 191.795,80 | 191.795,80 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------|----------------|------------|----------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| NTN-B 150850 (5,660000%) | 8.145.176,16 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.228.647,55 | 83.471,39 | 83.471,39 |
| NTN-B 150850 (5,670000%) | 22.004.299,11 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 22.229.981,84 | 225.682,73 | 225.682,73 |
| NTN-B 150850 (5,820000%) | 5.260.960,24 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.315.576,46 | 54.616,22 | 54.616,22 |
| NTN-B 150850 (5,930000%) | 6.304.975,34 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.371.007,76 | 66.032,42 | 66.032,42 |
| | 134.878.272,78 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 136.268.531,86 | 1.390.259,08 | |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|--------------|-------------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 17.840.340,27 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 17.958.125,02 | 117.784,75 | 117.784,75 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 10.565.113,05 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.635.253,32 | 70.140,27 | 70.140,27 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 14.671.144,06 | 2.971.956,97 | -780.000,00 | 0,00 | 16.996.207,43 | 133.106,40 | 133.106,40 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 5.635.362,20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.662.159,56 | 26.797,36 | 26.797,36 |
| | 48.711.959,58 | 2.971.956,97 | -780.000,00 | 0,00 | 51.251.745,33 | 347.828,78 | |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF FLUXO FIC | 37.529,86 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 37.860,15 | 330,29 | 330,29 |
| BB PREV RF IMA-B | 10.555.946,17 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.503.923,35 | -52.022,82 | -52.022,82 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 5.359.118,37 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.410.926,94 | 51.808,57 | 51.808,57 |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA | 10.074.167,46 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.120.092,37 | 45.924,91 | 45.924,91 |
| | 26.026.761,86 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 26.072.802,81 | 46.040,95 | |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS | 1.388.181,89 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.382.939,97 | -5.241,92 | -5.241,92 |
| | 1.388.181,89 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.382.939,97 | -5.241,92 | |

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\$) |
|----------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE | 5.161.373,70 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.020.440,90 | -140.932,80 | -140.932,80 |
| | 5.161.373,70 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.020.440,90 | -140.932,80 | -140.932,80 |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|-------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 10.050.629,96 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.509.023,15 | 458.393,19 | 458.393,19 |
| | 10.050.629,96 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.509.023,15 | 458.393,19 | 458.393,19 |

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 14.611.687,60 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 14.857.940,65 | 246.253,05 | 246.253,05 |
| | 14.611.687,60 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 14.857.940,65 | 246.253,05 | 246.253,05 |

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | 2.842.944,96 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.838.589,62 | -4.355,34 | -4.355,34 |
| | 2.842.944,96 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.838.589,62 | -4.355,34 | -4.355,34 |

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Proventos | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|-------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|-----------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| CARE11 | 618.708,44 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 758.708,16 | 139.999,72 | 139.999,72 |
| FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING | 2.762.256,89 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.488.111,17 | -274.145,72 | -274.145,72 |
| | 3.380.965,33 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.246.819,33 | -134.146,00 | -134.146,00 |

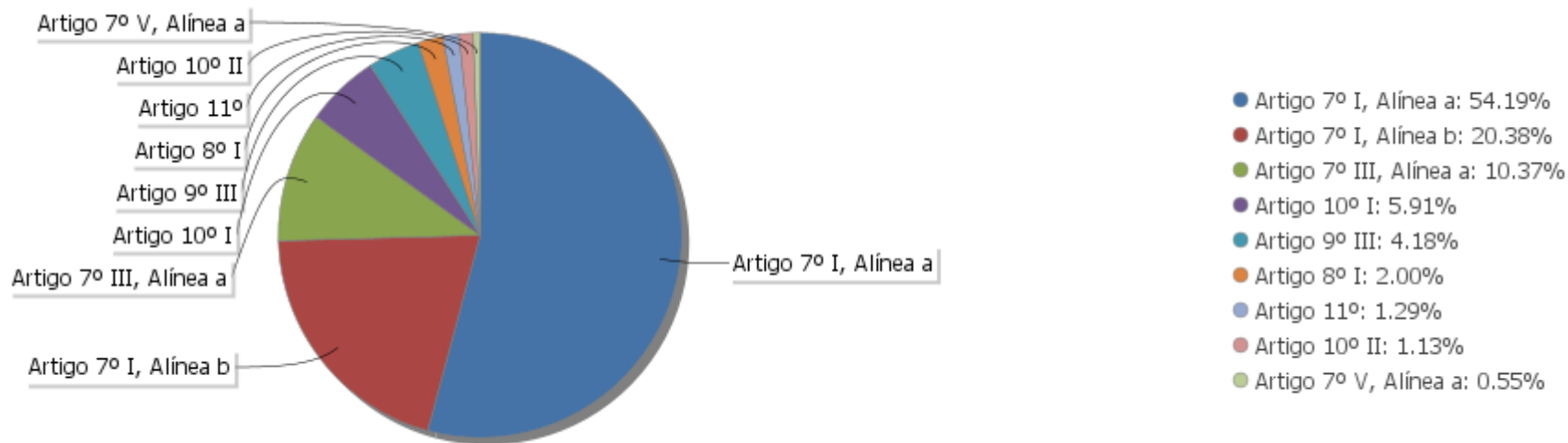
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

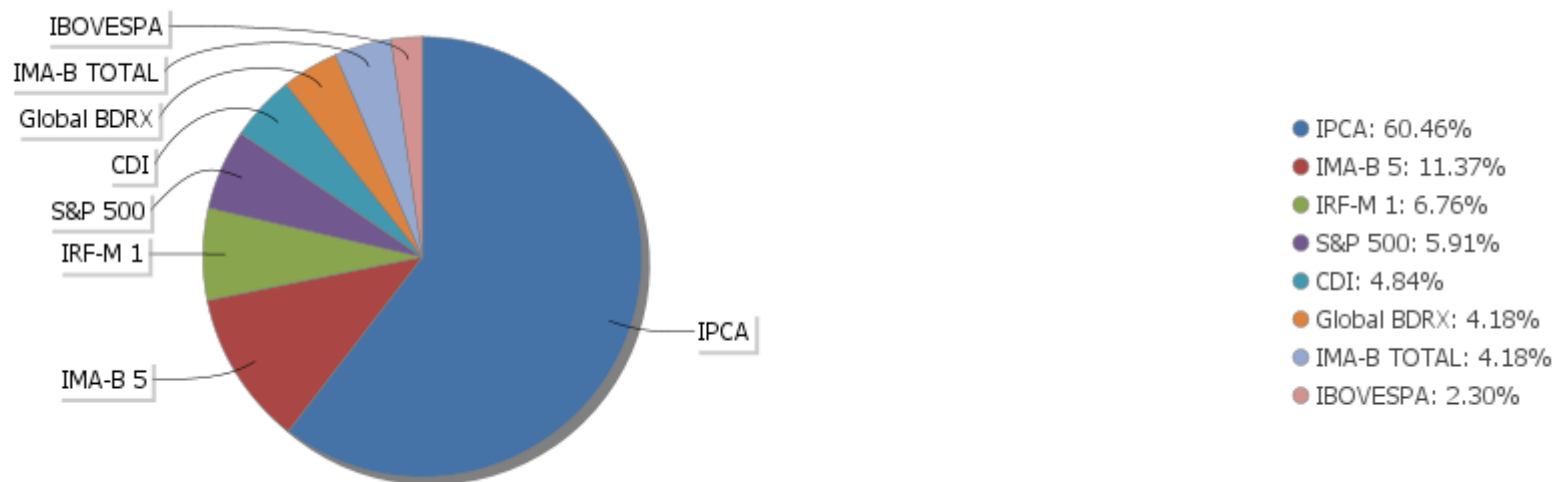
| Período | Valor (R\$) | (%) | (%) Limite Mínimo P.I. | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo Acum. |
|-----------------------|----------------|-------|------------------------|-----------------------|-----------|-------------------------|
| de 0 a 30 dias | 111.309.250,62 | 44,27 | | 111.309.250,62 | 44,27 | |
| de 31 dias a 365 dias | 0,00 | 0,00 | | 111.309.250,62 | 44,27 | |
| acima de 365 dias | 140.139.583,00 | 55,73 | | 251.448.833,62 | 100,00 | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

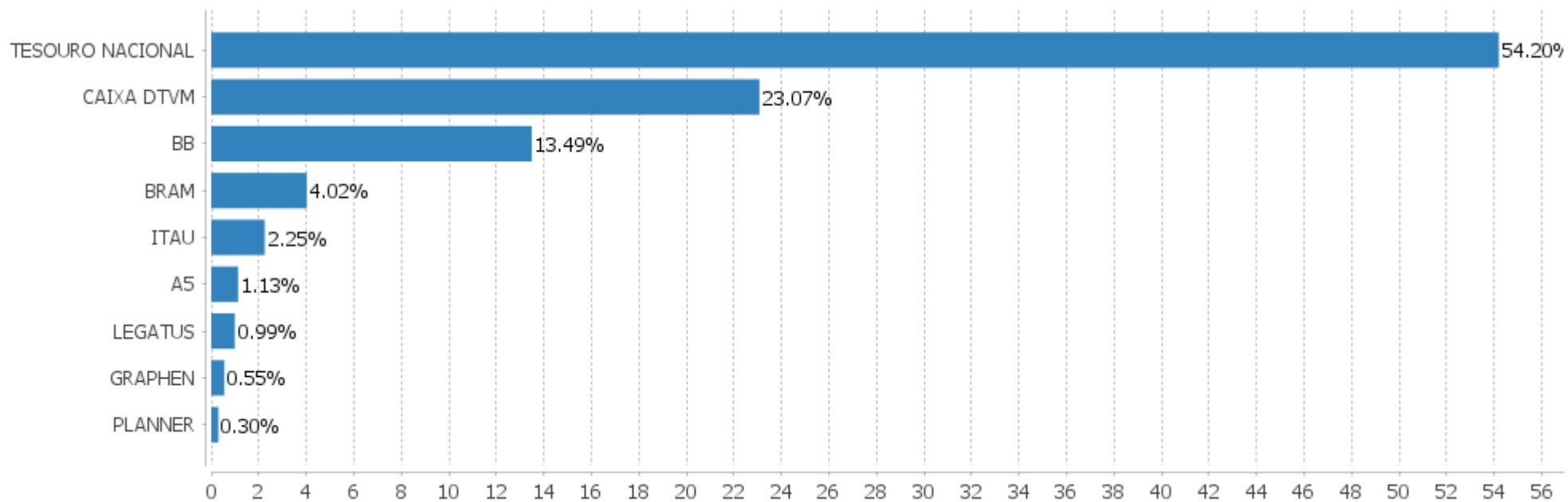


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

| Ano | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Rent. Ano |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| 2024 | 0,89 | | | | | | | | | | | | 0,89 |
| IPCA + 4,95% | 0,84 | | | | | | | | | | | | 0,84 |
| p.p. indexador | 0,05 | | | | | | | | | | | | 0,05 |
| 2023 | 1,86 | 0,69 | 1,57 | 0,86 | 1,33 | 1,45 | 0,95 | 0,57 | -0,03 | -0,02 | 2,77 | 1,41 | 14,22 |
| IPCA + 5,13% | 0,97 | 1,20 | 1,17 | 0,97 | 0,67 | 0,34 | 0,54 | 0,69 | 0,66 | 0,66 | 0,68 | 0,96 | 9,92 |
| p.p. indexador | 0,89 | -0,52 | 0,40 | -0,11 | 0,66 | 1,11 | 0,42 | -0,12 | -0,69 | -0,67 | 2,09 | 0,45 | 4,30 |
| 2022 | -1,33 | -0,06 | 2,37 | -1,00 | 0,82 | -1,40 | 1,40 | -0,18 | -0,61 | 1,46 | 0,74 | 0,14 | 2,31 |
| IPCA + 4,95% | 0,95 | 1,38 | 2,05 | 1,43 | 0,89 | 1,08 | -0,28 | 0,08 | 0,11 | 0,98 | 0,80 | 1,05 | 11,00 |
| p.p. indexador | -2,27 | -1,43 | 0,32 | -2,43 | -0,07 | -2,47 | 1,68 | -0,26 | -0,73 | 0,48 | -0,05 | -0,90 | -8,69 |
| 2021 | -0,51 | -0,51 | 1,29 | 2,00 | 1,14 | 0,28 | -0,25 | -0,09 | -0,91 | 0,03 | -0,18 | 1,93 | 4,23 |
| IPCA + 5,45% | 0,67 | 1,24 | 1,42 | 0,73 | 1,28 | 0,98 | 1,43 | 1,34 | 1,61 | 1,68 | 1,38 | 1,22 | 16,03 |
| p.p. indexador | -1,19 | -1,75 | -0,13 | 1,27 | -0,14 | -0,70 | -1,68 | -1,43 | -2,52 | -1,65 | -1,56 | 0,71 | -11,81 |
| 2020 | 0,13 | -0,88 | -5,49 | 1,11 | 1,81 | 1,72 | 2,31 | -0,61 | -1,04 | 0,13 | 2,62 | 2,64 | 4,25 |
| IPCA + 5,88% | 0,71 | 0,66 | 0,57 | 0,14 | 0,07 | 0,74 | 0,88 | 0,72 | 1,12 | 1,34 | 1,35 | 1,86 | 10,64 |
| p.p. indexador | -0,58 | -1,54 | -6,06 | 0,97 | 1,74 | 0,98 | 1,43 | -1,33 | -2,16 | -1,21 | 1,27 | 0,79 | -6,39 |

Performance Sobre a Meta Atuarial

| | Quantidade | Perc. (%) |
|------------------------------|------------|-----------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 19 | 38,78 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 30 | 61,22 |

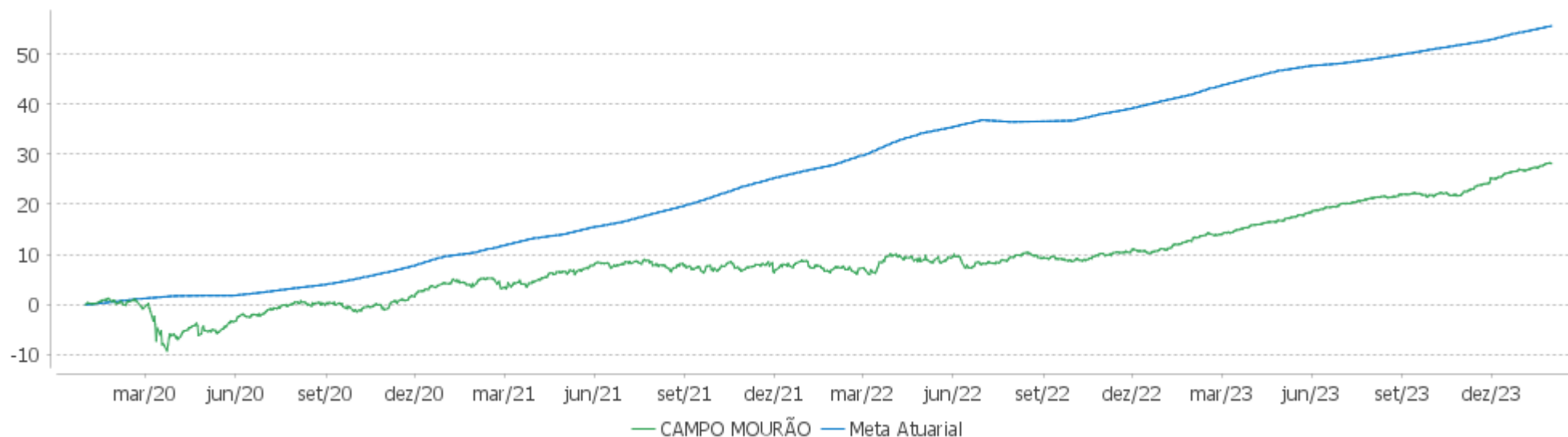
| | Rentabilidade | Mês |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,77 | 2023-11 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -5,49 | 2020-03 |

Relatório

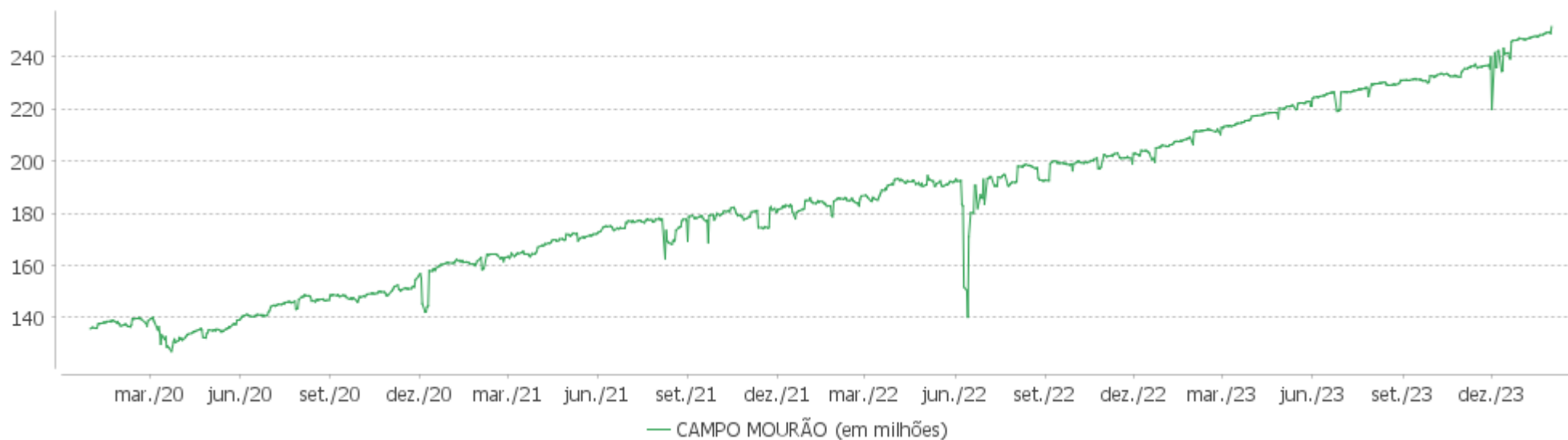
| Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses | 5,14 | 2,50 | 2,64 | 2,07 |
| 06 meses | 5,69 | 4,57 | 1,12 | 1,98 |
| 12 meses | 13,14 | 9,79 | 3,36 | 1,75 |
| 24 meses | 19,49 | 21,89 | -2,40 | 3,10 |
| 36 meses | 23,53 | 41,82 | -18,29 | 3,75 |
| 48 meses | 27,95 | 56,85 | -28,90 | 5,30 |
| Desde 31/12/2019 | 28,12 | 57,96 | -29,84 | 5,27 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

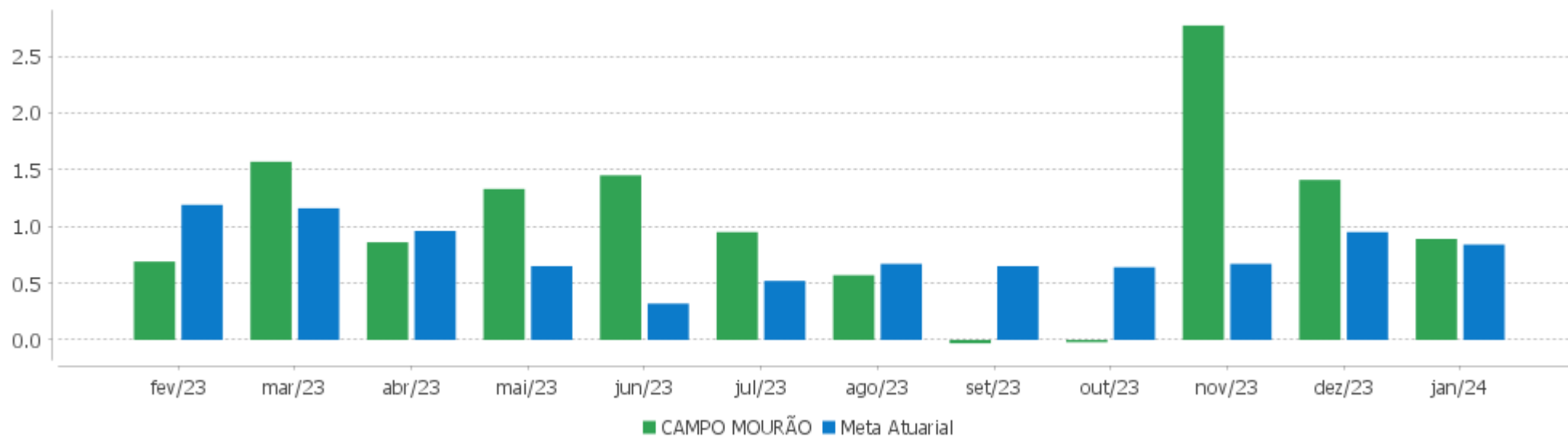


Patrimônio Líquido



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 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p. | 1,03 0,61 | 1,03 0,61 | 2,77 1,50 | 2,08 0,07 | 4,66 0,15 | | |
| NTN-B 150850 (5,660000%) Var. IPCA p.p. | 1,02 0,60 | 1,02 0,60 | 2,76 1,50 | 2,08 0,07 | 4,66 0,15 | | |
| NTN-B 150840 (5,790000%) Var. IPCA p.p. | 1,04 0,62 | 1,04 0,62 | 2,74 1,48 | 4,96 2,96 | 10,72 6,21 | 20,45 9,91 | 32,66 10,64 |
| NTN-B 150535 (5,750000%) Var. IPCA p.p. | 1,03 0,61 | 1,03 0,61 | 2,70 1,43 | 4,91 2,90 | 10,64 6,13 | 20,32 9,78 | 32,45 10,44 |
| NTN-B 150850 (5,640000%) Var. IPCA p.p. | 1,02 0,60 | 1,02 0,60 | 2,76 1,49 | 2,07 0,07 | 4,65 0,15 | | |
| NTN-B 150840 (5,820000%) Var. IPCA p.p. | 1,04 0,62 | 1,04 0,62 | 2,75 1,48 | 4,98 2,97 | 10,75 6,24 | 20,51 9,97 | 32,73 10,72 |
| NTN-B 150850 (5,820000%) Var. IPCA p.p. | 1,04 0,62 | 1,04 0,62 | 2,81 1,54 | 5,04 3,03 | 10,81 6,30 | 20,60 10,05 | 32,86 10,85 |
| NTN-B 150555 (5,790000%) Var. IPCA p.p. | 1,04 0,62 | 1,04 0,62 | 2,81 1,55 | 5,04 3,03 | 10,80 6,29 | 20,57 10,02 | 32,83 10,82 |
| NTN-B 150555 (5,760000%) Var. IPCA p.p. | 1,03 0,61 | 1,03 0,61 | 2,81 1,54 | 5,03 3,02 | 10,77 6,26 | 20,51 9,97 | 32,77 10,75 |
| NTN-B 150545 (5,680000%) Var. IPCA p.p. | 1,03 0,61 | 1,03 0,61 | 2,74 1,48 | 4,94 2,93 | 10,64 6,13 | 20,29 9,75 | 32,47 10,45 |
| NTN-B 150850 (5,930000%) Var. IPCA p.p. | 1,05 0,63 | 1,05 0,63 | 2,83 1,57 | 5,10 3,09 | 10,93 6,42 | 20,80 10,26 | 33,11 11,10 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | 0,66 -0,01 | 0,66 -0,01 | 3,94 -0,06 | 4,34 -0,10 | 11,18 -0,15 | 23,49 -0,30 | 28,83 -0,62 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,66 -0,02 | 0,66 -0,02 | 3,94 -0,05 | 4,32 -0,12 | 11,14 -0,19 | 23,30 -0,49 | 28,53 -0,91 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p. | 0,91 0,08 | 0,91 0,08 | 2,80 0,03 | 5,87 -0,05 | 12,79 -0,16 | 26,67 -0,45 | 30,85 -0,76 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p. | 0,48 0,06 | 0,48 0,06 | 4,75 3,48 | 4,60 2,60 | 15,81 11,30 | 24,85 14,31 | 31,01 9,00 |
| GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS % do CDI | -0,38 -39,06 | -0,38 -39,06 | -0,68 -24,35 | -0,80 -13,30 | -0,20 -1,52 | -2,91 -10,64 | -10,05 -29,83 |
| BB PREV RF IMA-B | -0,49 | -0,49 | 4,89 | 2,70 | 15,25 | 23,11 | 21,41 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|------------------|------------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|------------------|
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,04 | -0,04 | -0,08 | -0,21 | -0,28 | -0,69 | -0,97 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,97 100,00 | 0,97 100,00 | 2,81 100,09 | 6,04 100,08 | 12,80 99,46 | 27,43 100,36 | 34,15 101,32 |
| BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI | 0,88 91,04 | 0,88 91,04 | 2,55 91,03 | 5,51 91,20 | 11,76 91,36 | 24,82 90,80 | 29,63 87,93 |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA Var. IPCA p.p. | 0,46 0,04 | 0,46 0,04 | 3,82 2,55 | 4,85 2,84 | 15,10 10,60 | 25,59 15,04 | 26,42 4,41 |
| FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p. | -2,73 2,06 | -2,73 2,06 | 18,05 5,14 | 7,36 2,60 | 20,43 7,81 | 25,72 11,81 | 39,62 28,59 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p. | 4,56 -0,22 | 4,56 -0,22 | 14,15 -0,56 | 11,69 -0,89 | 25,21 -1,61 | 3,42 -2,20 | 15,15 -4,80 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p. | 1,69 -2,26 | 1,69 -2,26 | 16,97 3,80 | 8,77 -1,55 | 27,16 11,70 | 25,92 26,70 | 58,47 40,45 |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI | -0,15 -15,85 | -0,15 -15,85 | -0,43 -15,39 | -0,88 -14,49 | -1,73 -13,41 | -9,95 -36,41 | -11,28 -33,46 |
| CARE11 Var. IBOVESPA p.p. | 22,63 27,42 | 22,63 27,42 | 23,53 10,62 | -15,58 -20,34 | -33,86 -46,48 | -19,23 -33,15 | -50,64 -61,67 |
| FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING % do CDI | -9,31 -962,67 | -9,31 -962,67 | 66,36 2.364,32 | 65,86 1.090,59 | 70,59 548,40 | 251,72 921,02 | -1,31 -3,88 |
| CAMPO MOURÃO Var. IPCA + 4,95% p.p. | 0,89 0,05 | 0,89 0,05 | 5,14 2,67 | 5,69 1,19 | 13,14 3,52 | 19,49 -2,19 | 23,53 -17,44 |
| CDI | 0,97 | 0,97 | 2,81 | 6,04 | 12,87 | 27,33 | 33,70 |
| IBOVESPA | -4,79 | -4,79 | 12,91 | 4,76 | 12,63 | 13,92 | 11,02 |
| INPC + 6,00% | 1,08 | 1,08 | 2,69 | 4,67 | 9,97 | 23,23 | 44,47 |
| IPCA + 6,00% | 0,93 | 0,93 | 2,73 | 5,02 | 10,70 | 24,12 | 45,22 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|---|---------------|---------------|-----------|------------|-------------|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| BB PREV RF FLUXO FIC | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 1,00 |
| BB PREV RF IMA-B | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,30 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA | D+0 | D+0 | D+3 du | D+4 du | | 0,40 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 1,20 |
| CARE11 | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 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 IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 0,70 |
| FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE | D+1 du | D+0 | D+13 du | D+15 du | | 2,00 |
| GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS | D+0 | D+0 | | D+1600 | | |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 0,40 |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | Não se aplica | Não se aplica | | | | |

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 | 0,83 | 0,83 | 2,77 | 5,92 | 12,95 | 27,12 | 31,60 | 36,12 | 45,12 |
| IRF-M 1+ | 0,60 | 0,60 | 5,55 | 6,14 | 18,37 | 28,70 | 23,39 | 30,51 | 48,22 |
| IRF-M TOTAL | 0,67 | 0,67 | 4,68 | 6,05 | 16,31 | 27,74 | 26,10 | 32,31 | 47,48 |
| IMA-B 5 | 0,68 | 0,68 | 3,99 | 4,44 | 11,33 | 23,79 | 29,45 | 39,23 | 56,02 |
| IMA-B 5+ | -1,47 | -1,47 | 5,89 | 1,54 | 19,03 | 23,38 | 15,40 | 19,65 | 46,36 |
| IMA-B TOTAL | -0,45 | -0,45 | 4,97 | 2,91 | 15,53 | 23,80 | 22,38 | 28,77 | 52,10 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,47 | 0,47 | 3,98 | 5,14 | 14,53 | 26,21 | 28,00 | 33,76 | 48,90 |
| IDKA 2 | 0,81 | 0,81 | 4,15 | 4,81 | 11,43 | 23,53 | 29,55 | 40,17 | 55,62 |
| IDKA 20 | -3,34 | -3,34 | 7,85 | -0,30 | 28,79 | 24,16 | 6,04 | 6,79 | 36,82 |
| CDI | 0,97 | 0,97 | 2,81 | 6,04 | 12,87 | 27,33 | 33,70 | 37,09 | 45,03 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | -4,79 | -4,79 | 12,91 | 4,76 | 12,63 | 13,92 | 11,02 | 12,30 | 31,17 |
| IBRX 100 | -4,51 | -4,51 | 13,20 | 5,15 | 11,88 | 12,72 | 10,34 | 12,15 | 33,43 |
| IBRX 50 | -4,15 | -4,15 | 13,07 | 5,74 | 11,32 | 13,01 | 11,95 | 14,94 | 31,89 |
| SMALL CAP | -6,55 | -6,55 | 12,50 | -6,30 | 6,34 | -10,11 | -19,32 | -22,95 | 11,91 |
| Índice Consumo - ICON | -8,33 | -8,33 | 13,01 | -11,48 | -4,76 | -28,41 | -45,21 | -47,39 | -24,62 |
| Índice Dividendos - IDIV | -3,51 | -3,51 | 14,18 | 8,88 | 15,58 | 28,28 | 35,93 | 29,79 | 64,85 |

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 | 3,94 | 3,94 | 13,17 | 10,31 | 15,47 | -0,78 | 18,02 | 74,30 | 143,07 |

Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX | 0,67 | 0,67 | 5,63 | 4,26 | 18,16 | 20,04 | 15,77 | 8,33 | 38,34 |

Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | 2,86 | 2,86 | 12,43 | 7,98 | 9,50 | -5,80 | 2,83 | 51,79 | 101,82 |

Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA | 0,42 | 0,42 | 1,27 | 2,01 | 4,51 | 10,54 | 22,01 | 27,58 | 32,93 |
| INPC | 0,57 | 0,57 | 1,22 | 1,66 | 3,82 | 9,75 | 21,38 | 28,10 | 33,61 |
| IGPM | 0,07 | 0,07 | 1,41 | 2,15 | -3,32 | 0,35 | 17,32 | 47,48 | 59,00 |
| SELIC | 0,97 | 0,97 | 2,80 | 6,04 | 12,87 | 27,33 | 33,70 | 37,09 | 45,03 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,76 | 0,76 | 2,25 | 4,03 | 8,64 | 19,51 | 37,19 | 49,11 | 61,60 |
| IPCA + 5,00% | 0,85 | 0,85 | 2,49 | 4,53 | 9,67 | 21,80 | 41,17 | 54,89 | 69,49 |
| IPCA + 5,50% | 0,89 | 0,89 | 2,61 | 4,77 | 10,18 | 22,96 | 43,18 | 57,84 | 73,54 |
| IPCA + 5,89% | 0,92 | 0,92 | 2,70 | 4,97 | 10,59 | 23,86 | 44,77 | 60,18 | 76,76 |
| IPCA + 6,00% | 0,93 | 0,93 | 2,73 | 5,02 | 10,70 | 24,12 | 45,22 | 60,84 | 77,68 |
| INPC + 4,00% | 0,91 | 0,91 | 2,21 | 3,67 | 7,92 | 18,65 | 36,48 | 49,72 | 62,43 |
| INPC + 6,00% | 1,08 | 1,08 | 2,69 | 4,67 | 9,97 | 23,23 | 44,47 | 61,50 | 78,60 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

| Ativo | Financeiro Curva (R\$) | Taxa Curva (%) | Financeiro Mercado (R\$) | Taxa Mercado (%) | Diferença (R\$) |
|--------------------------|------------------------|----------------|--------------------------|------------------|-----------------|
| NTN-B 150535 (5,750000%) | 578.881,45 | 5,750000 | 584.815,68 | 5,620000 | 5.934,23 |
| NTN-B 150545 (5,680000%) | 10.643.892,22 | 5,680000 | 10.620.908,34 | 5,698500 | -22.983,88 |
| NTN-B 150555 (5,760000%) | 42.705.557,27 | 5,760000 | 43.117.612,73 | 5,690800 | 412.055,46 |
| NTN-B 150555 (5,790000%) | 10.669.627,04 | 5,790000 | 10.817.335,26 | 5,690800 | 147.708,22 |
| NTN-B 150840 (5,790000%) | 10.058.302,57 | 5,790000 | 10.204.627,19 | 5,645100 | 146.324,62 |
| NTN-B 150840 (5,820000%) | 529.202,01 | 5,820000 | 538.502,75 | 5,645100 | 9.300,74 |
| NTN-B 150850 (5,640000%) | 18.937.855,69 | 5,640000 | 18.786.459,04 | 5,702500 | -151.396,65 |
| NTN-B 150850 (5,660000%) | 8.228.647,55 | 5,660000 | 8.183.887,81 | 5,702500 | -44.759,74 |
| NTN-B 150850 (5,670000%) | 22.229.981,84 | 5,670000 | 22.137.484,10 | 5,702500 | -92.497,74 |
| NTN-B 150850 (5,820000%) | 5.315.576,46 | 5,820000 | 5.395.871,00 | 5,702500 | 80.294,54 |
| NTN-B 150850 (5,930000%) | 6.371.007,76 | 5,930000 | 6.557.920,01 | 5,702500 | 186.912,25 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|---------------------|-------------------|------------------|--------------|
| 451 | 17/01/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 156.099,99 | 0,00 | 45.857,42072100 | 3,4040290000 |
| 452 | 17/01/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 150.000,00 | 44.065,43072100 | 3,4040290000 |
| 450 | 22/01/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 30.000,00 | 8.801,21315300 | 3,4086210000 |
| 454 | 22/01/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 100.000,00 | 29.337,37638300 | 3,4086210000 |
| 449 | 30/01/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 500.000,00 | 146.281,42355000 | 3,4180690000 |
| 453 | 31/01/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.815.856,98 | 0,00 | 823.364,19838822 | 3,4199410000 |
| Total | | | 2.971.956,97 | 780.000,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.098.533,00

Value-At-Risk: 0,83%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | Limite ⁽⁵⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| Artigo 7º | 1,08 | 0,37 | | 0,21 | -0,11 | 0,84 | 214.976.019,97 | 85,49 |
| Artigo 8º | 14,77 | 8,00 | | 0,12 | -0,25 | -2,73 | 5.020.440,90 | 2,00 |
| Artigo 9º | 11,95 | 5,80 | | 0,15 | 0,30 | 4,56 | 10.509.023,15 | 4,18 |
| Artigo 10º | 9,20 | 5,46 | | 0,35 | 0,05 | 1,39 | 17.696.530,27 | 7,04 |
| Artigo 11º | 33,08 | 4,56 | | 0,01 | -0,15 | -3,97 | 3.246.819,33 | 1,29 |
| CAMPO MOURÃO | 1,35 | 0,83 | | 0,83 | -0,06 | 0,89 | 251.448.833,62 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,37%

Artigo 7º I, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| NTN-B 150535 (5,750000%) | 0,67 | 0,14 | 0,00 | 0,15 | 0,10 | 1,03 | 578.881,45 | 0,23 |
| NTN-B 150545 (5,680000%) | 0,96 | 0,14 | -0,00 | 0,14 | 0,06 | 1,03 | 10.643.892,22 | 4,23 |
| NTN-B 150555 (5,760000%) | 1,16 | 0,14 | 0,00 | 0,15 | 0,06 | 1,03 | 42.705.557,27 | 16,98 |
| NTN-B 150555 (5,790000%) | 1,17 | 0,14 | 0,00 | 0,15 | 0,06 | 1,04 | 10.669.627,04 | 4,24 |
| NTN-B 150840 (5,790000%) | 0,82 | 0,14 | 0,00 | 0,15 | 0,08 | 1,04 | 10.058.302,57 | 4,00 |
| NTN-B 150840 (5,820000%) | 0,82 | 0,14 | 0,00 | 0,15 | 0,09 | 1,04 | 529.202,01 | 0,21 |
| NTN-B 150850 (5,640000%) | 1,07 | 0,10 | 0,00 | 0,10 | 0,05 | 1,02 | 18.937.855,69 | 7,53 |
| NTN-B 150850 (5,660000%) | 1,07 | 0,10 | 0,00 | 0,10 | 0,05 | 1,02 | 8.228.647,55 | 3,27 |
| NTN-B 150850 (5,670000%) | 1,07 | 0,10 | 0,00 | 0,10 | 0,06 | 1,03 | 22.229.981,84 | 8,84 |
| NTN-B 150850 (5,820000%) | 1,09 | 0,14 | 0,00 | 0,16 | 0,07 | 1,04 | 5.315.576,46 | 2,11 |
| NTN-B 150850 (5,930000%) | 1,10 | 0,14 | 0,00 | 0,16 | 0,07 | 1,05 | 6.371.007,76 | 2,53 |
| Sub-total | 1,08 | 0,10 | 0,00 | | 0,06 | 1,03 | 136.268.531,86 | 54,19 |

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------|-------------|----------------------|--------------|
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,23 | 0,09 | 0,00 | 0,04 | -0,23 | 0,91 | 16.996.207,43 | 6,76 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,15 | 1,23 | 0,03 | 0,01 | -0,26 | 0,66 | 10.635.253,32 | 4,23 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 1,16 | 1,23 | 0,06 | 0,01 | -0,26 | 0,66 | 17.958.125,02 | 7,14 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 1,36 | 1,87 | 0,03 | 1,87 | -0,36 | 0,48 | 5.662.159,56 | 2,25 |
| Sub-total | 0,85 | 0,90 | 0,12 | | -0,29 | 0,72 | 51.251.745,33 | 20,38 |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------|-------------|----------------------|--------------|
| BB PREV RF IMA-B | 2,70 | 2,18 | 0,06 | 0,03 | -0,54 | -0,49 | 10.503.923,35 | 4,18 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,02 | 0,01 | -0,00 | 0,01 | 0,00 | 0,97 | 5.410.926,94 | 2,15 |
| BB PREV RF FLUXO FIC | 0,02 | 0,01 | -0,00 | 0,01 | -5,20 | 0,88 | 37.860,15 | 0,02 |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA | 1,19 | 0,98 | 0,03 | 0,98 | -0,43 | 0,46 | 10.120.092,37 | 4,02 |
| Sub-total | 1,55 | 1,25 | 0,09 | | -0,51 | 0,18 | 26.072.802,81 | 10,37 |

Artigo 7º V, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------|--------------|---------------------|-------------|
| GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS | 1,28 | 0,06 | -0,00 | 0,06 | -1,05 | -0,38 | 1.382.939,97 | 0,55 |
| Sub-total | 1,28 | 0,06 | -0,00 | | -1,05 | -0,38 | 1.382.939,97 | 0,55 |

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,46%

Artigo 10º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 10,86 | 6,50 | 0,35 | 5,35 | 0,07 | 1,69 | 14.857.940,65 | 5,91 |
| Sub-total | 10,86 | 6,50 | 0,35 | | 0,07 | 1,69 | 14.857.940,65 | 5,91 |

Artigo 10º II

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | 0,52 | 0,03 | -0,00 | 0,03 | -2,16 | -0,15 | 2.838.589,62 | 1,13 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| Sub-total | 0,52 | 0,03 | -0,00 | | -2,16 | -0,15 | 2.838.589,62 | 1,13 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,80%

Artigo 9º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 11,95 | 5,80 | 0,15 | 0,61 | 0,30 | 4,56 | 10.509.023,15 | 4,18 |
| Sub-total | 11,95 | 5,80 | 0,15 | | 0,30 | 4,56 | 10.509.023,15 | 4,18 |

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,00%

Artigo 8º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|----------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE | 14,77 | 8,00 | 0,12 | 3,24 | -0,25 | -2,73 | 5.020.440,90 | 2,00 |
| Sub-total | 14,77 | 8,00 | 0,12 | | -0,25 | -2,73 | 5.020.440,90 | 2,00 |

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 4,56%

Artigo 11º

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING | 33,06 | 2,34 | 0,00 | 2,34 | -0,31 | -9,31 | 2.488.111,17 | 0,99 |
| CARE11 | 75,77 | 18,33 | 0,01 | 19,30 | 0,29 | 22,63 | 758.708,16 | 0,30 |
| Sub-total | 33,08 | 4,56 | 0,01 | | -0,15 | -3,97 | 3.246.819,33 | 1,29 |

(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 (%)