



LDB
EMPRESAS

CAMPO MOURÃO
JUNHO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

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

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

84,70%

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%) | 1,52 | 0,04 | 0,83 | 5,60 | 588.036,28 | 0,22 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (6,250000%) | 4,21 | 0,04 | 0,44 | 0,44 | 8.086.415,63 | 3,04 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,790000%) | 1,36 | 0,04 | 0,83 | 5,62 | 10.219.634,65 | 3,84 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,820000%) | 1,77 | 0,04 | 0,84 | 5,63 | 537.705,82 | 0,20 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (6,030000%) | 4,15 | 0,04 | 0,85 | 0,92 | 17.558,85 | 0,01 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,680000%) | 0,80 | 0,04 | 0,83 | 5,56 | 10.815.080,24 | 4,06 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (6,030000%) | 4,14 | 0,04 | 0,85 | 0,92 | 34.625,20 | 0,01 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,630000%) | 3,94 | 0,04 | 0,82 | 3,94 | 2.065.095,72 | 0,78 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,640000%) | 2,86 | 0,04 | 0,82 | 5,54 | 19.244.858,05 | 7,23 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,660000%) | 2,87 | 0,04 | 0,83 | 5,55 | 8.362.079,90 | 3,14 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,670000%) | 2,87 | 0,04 | 0,83 | 5,56 | 22.590.503,70 | 8,49 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,730000%) | 3,99 | 0,04 | 0,83 | 2,82 | 5.874.681,53 | 2,21 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,770000%) | 4,01 | -0,02 | 0,83 | 2,67 | 7.596.378,87 | 2,85 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,820000%) | 1,30 | 0,04 | 0,84 | 5,63 | 5.401.945,12 | 2,03 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,930000%) | 3,23 | 0,04 | 0,85 | 5,69 | 6.474.643,95 | 2,43 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Emissor | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira |
|--|--------------------------|---------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|
| | | | Dia | Mês | Ano | | |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (6,070000%) | 4,17 | 0,04 | 0,86 | 0,92 | 1.708.487,44 | 0,64 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (6,320000%) | 4,30 | 0,04 | 0,40 | 0,40 | 2.351.284,93 | 0,88 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,760000%) | 0,64 | 0,04 | 0,83 | 5,60 | 43.401.775,08 | 16,30 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,790000%) | 0,99 | 0,04 | 0,83 | 5,62 | 10.843.558,21 | 4,07 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (6,070000%) | 4,16 | 0,04 | 0,86 | 0,92 | 103.335,03 | 0,04 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 0,82 | 0,03 | 0,83 | 5,59 | 166.317.684,20 | 62,47 |

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 | | | | |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 1,72 | -0,18 | 0,37 | 3,20 | 10.894.015,26 | 4,09 | 4.972.766.310,86 | 0,22 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,72 | -0,18 | 0,37 | 3,21 | 12.563.888,78 | 4,72 | 7.303.046.549,52 | 0,17 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,35 | -0,02 | 0,61 | 4,48 | 18.452.502,47 | 6,93 | 7.877.165.450,51 | 0,23 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 1,11 | -0,11 | 0,49 | 3,72 | 41.910.406,51 | 15,74 | | |

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 FLUXO FIC | 0,06 | 0,04 | 0,71 | 4,71 | 39.389,03 | 0,01 | 5.048.562.747,13 | 0,00 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B | 3,82 | 0,00 | -1,25 | -1,55 | 0,00 | 0,00 | 843.817.661,01 | 0,00 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,07 | 0,04 | 0,79 | 5,24 | 5.639.955,45 | 2,12 | 17.821.452.916,03 | 0,03 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA | 1,91 | -0,29 | -0,20 | 1,81 | 10.256.266,44 | 3,85 | 683.118.622,81 | 1,50 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 2,15 | -0,17 | -0,27 | 1,29 | 15.935.610,92 | 5,99 | | |

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| 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 | 4,78 | -0,24 | -0,24 | -4,42 | 1.326.769,25 | 0,50 | 119.483.175,37 | 1,11 |
| | | Sub-total Artigo 7º V, Alínea a | 4,78 | -0,24 | -0,24 | -4,42 | 1.326.769,25 | 0,50 | | |
| | | Renda Fixa | 0,82 | -0,01 | 0,63 | 4,60 | 225.490.470,88 | 84,70 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,81%

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 | 15,59 | -0,97 | -0,11 | -6,86 | 4.807.286,02 | 1,81 | 660.651.400,16 | 0,73 |
| Sub-total Artigo 8º I | | | 15,59 | -0,97 | -0,11 | -6,86 | 4.807.286,02 | 1,81 | | |
| Renda Variável | | | 15,37 | -0,97 | -0,11 | -6,86 | 4.807.286,02 | 1,81 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,27%

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 | 13,96 | 0,88 | 12,73 | 39,52 | 14.022.281,63 | 5,27 | 2.736.870.167,13 | 0,51 |
| Sub-total Artigo 9º III | | | 13,96 | 0,88 | 12,73 | 39,52 | 14.022.281,63 | 5,27 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 13,96 | 0,88 | 12,73 | 39,52 | 14.022.281,63 | 5,27 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,00%

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 | 11,06 | -0,28 | 3,90 | 16,70 | 17.051.537,59 | 6,41 | 1.972.213.735,46 | 0,86 |
| Sub-total Artigo 10º I | | | 11,06 | -0,28 | 3,90 | 16,70 | 17.051.537,59 | 6,41 | | |

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 MULTISTRATÉGIA | 57,96 | -0,13 | -0,13 | -44,18 | 1.586.985,98 | 0,60 | 68.445.600,86 | 2,32 |
| Sub-total Artigo 10º II | | | 57,96 | -0,13 | -0,13 | -44,18 | 1.586.985,98 | 0,60 | | |

| | | | | | | | | | | |
|-----------------------------------|--|--|--------------|--------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|--|--|
| Investimentos Estruturados | | | 11,48 | -0,27 | 3,54 | 6,78 | 18.638.523,57 | 7,00 | | |
|-----------------------------------|--|--|--------------|--------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|--|--|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,22%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-----------------------------|-------------|-------------------------------|---------------------|-------------------|--------------|--------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| PLANNER | PLANNER | CARE11 | 45,22 | 1,18 | -6,43 | 27,04 | 776.772,64 | 0,29 | 0,00 | |
| LEGATUS | BTG PACTUAL | FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING | 62,64 | -0,02 | -0,02 | -10,13 | 2.482.319,21 | 0,93 | 653.246.216,70 | 0,38 |
| Sub-total Artigo 11º | | | 48,58 | 0,26 | -1,63 | -3,32 | 3.259.091,85 | 1,22 | | |
| Fundos Imobiliários | | | 48,58 | 0,26 | -1,63 | -3,32 | 3.259.091,85 | 1,22 | | |
| Total | | | 1,72 | 0,01 | 1,36 | 5,80 | 266.217.653,95 | 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 | 166.317.684,20 | 62,47 | 0,00 | 60,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 41.910.406,51 | 15,74 | 0,00 | 8,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 15.935.610,92 | 5,99 | 0,00 | 10,00 | 60,00 | 0,00 | 60,00 |
| Artigo 7º V, Alínea a | FIDC Cota Sênior | 1.326.769,25 | 0,50 | 0,00 | 0,65 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Renda Fixa | 225.490.470,88 | 84,70 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 4.807.286,02 | 1,81 | 0,00 | 2,50 | 30,00 | 0,00 | 30,00 |
| | Total Renda Variável | 4.807.286,02 | 1,81 | | | | | 30,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º III | Fundos de Ações - BDR Nível I | 14.022.281,63 | 5,27 | 0,00 | 5,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 14.022.281,63 | 5,27 | | | | | 10,00 |
| Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 17.051.537,59 | 6,41 | 0,00 | 6,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º II | Fundo de Participação | 1.586.985,98 | 0,60 | 0,00 | 1,35 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Investimentos Estruturados | 18.638.523,57 | 7,00 | | | | | 15,00 |
| Fundos Imobiliários | | | | | | | | |
| Artigo 11º | Fundo de Investimento Imobiliário | 3.259.091,85 | 1,22 | 0,00 | 1,50 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Fundos Imobiliários | 3.259.091,85 | 1,22 | | | | | 5,00 |
| Total | | 266.217.653,95 | 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 | 0,83 105,58 | 5,59 107,03 | 2,45 96,84 | 5,59 107,03 | 10,26 87,77 | 1.328.885,09 | 7.932.392,77 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 0,49 61,77 | 3,72 71,19 | 1,55 61,24 | 3,72 71,19 | 9,29 79,47 | 211.643,97 | 1.684.302,13 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | -0,27 -34,84 | 1,29 24,79 | 0,13 4,97 | 1,29 24,79 | 6,47 55,37 | -108.156,59 | 301.318,78 |
| Artigo 7º V, Alínea a % do CDI | -0,24 -30,20 | -4,42 -84,73 | -0,56 -21,94 | -4,42 -84,73 | -4,82 -41,22 | -3.166,35 | -61.412,64 |
| Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p. | -0,11 -1,59 | -6,86 0,80 | -7,64 -4,37 | -6,86 0,80 | 4,76 -0,17 | -5.276,34 | -354.087,68 |
| Artigo 9º III % do CDI | 12,73 1.615,12 | 39,52 756,84 | 21,34 843,39 | 39,52 756,84 | 52,18 446,26 | 1.583.731,64 | 3.971.651,67 |
| Artigo 10º I % do CDI | 3,90 494,77 | 16,70 319,81 | 5,01 198,12 | 16,70 319,81 | 29,37 251,18 | 640.115,68 | 2.439.849,99 |
| Artigo 10º II % do CDI | -0,13 -16,15 | -44,18 -846,12 | -0,40 -15,83 | -44,18 -846,12 | -44,66 -382,01 | -2.022,51 | -1.255.958,98 |
| Artigo 11º % do CDI | -1,63 -207,09 | -3,32 -63,66 | -5,25 -207,53 | -3,32 -63,66 | 34,39 294,17 | -54.152,11 | -112.276,82 |
| CAMPO MOURÃO (Total) | | | | | | 3.591.602,48 | 14.545.779,22 |

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%) | 583.185,02 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 588.036,28 | 4.851,26 | 31.860,71 |
| NTN-B 150535 (6,250000%) | 0,00 | 8.051.175,04 | 0,00 | 0,00 | 8.086.415,63 | 35.240,59 | 35.240,59 |
| NTN-B 150545 (5,680000%) | 10.726.420,29 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.815.080,24 | 88.659,95 | 582.331,18 |
| NTN-B 150545 (6,030000%) | 34.332,34 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 34.625,20 | 292,86 | 314,99 |
| NTN-B 150555 (5,760000%) | 43.043.390,50 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 43.401.775,08 | 358.384,58 | 2.352.731,08 |
| NTN-B 150555 (5,790000%) | 10.753.776,85 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.843.558,21 | 89.781,36 | 589.324,95 |
| NTN-B 150555 (6,070000%) | 102.457,95 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 103.335,03 | 877,08 | 943,35 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------|----------------|---------------|----------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| NTN-B 150840 (5,790000%) | 10.135.019,20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.219.634,65 | 84.615,45 | 547.628,48 |
| NTN-B 150840 (5,820000%) | 533.241,78 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 537.705,82 | 4.464,04 | 28.885,62 |
| NTN-B 150840 (6,030000%) | 17.410,34 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 17.558,85 | 148,51 | 159,74 |
| NTN-B 150850 (5,630000%) | 2.048.243,39 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.065.095,72 | 16.852,33 | 78.227,07 |
| NTN-B 150850 (5,640000%) | 19.087.665,88 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 19.244.858,05 | 157.192,17 | 1.018.240,40 |
| NTN-B 150850 (5,660000%) | 8.293.653,75 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.362.079,90 | 68.426,15 | 443.186,78 |
| NTN-B 150850 (5,670000%) | 22.405.479,35 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 22.590.503,70 | 185.024,35 | 1.198.302,07 |
| NTN-B 150850 (5,730000%) | 5.826.303,29 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.874.681,53 | 48.378,24 | 161.169,71 |
| NTN-B 150850 (5,770000%) | 7.533.569,47 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.596.378,87 | 62.809,40 | 197.819,19 |
| NTN-B 150850 (5,820000%) | 5.357.098,11 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.401.945,12 | 44.847,01 | 290.179,75 |
| NTN-B 150850 (5,930000%) | 6.420.361,96 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.474.643,95 | 54.281,99 | 350.993,93 |
| NTN-B 150850 (6,070000%) | 1.693.986,28 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.708.487,44 | 14.501,16 | 15.596,57 |
| NTN-B 150850 (6,320000%) | 0,00 | 2.342.028,32 | 0,00 | 0,00 | 2.351.284,93 | 9.256,61 | 9.256,61 |
| | 154.595.595,75 | 10.393.203,36 | 0,00 | 0,00 | 166.317.684,20 | 1.328.885,09 | |

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 | 10.853.439,05 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.894.015,26 | 40.576,21 | 453.674,99 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 12.517.279,25 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.563.888,78 | 46.609,53 | 347.067,59 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 21.565.544,24 | 0,00 | -3.237.500,00 | 0,00 | 18.452.502,47 | 124.458,23 | 799.621,82 |
| | 44.936.262,54 | 0,00 | -3.237.500,00 | 0,00 | 41.910.406,51 | 211.643,97 | |

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 | 39.019,09 | 256.366,61 | -256.454,63 | 0,00 | 39.389,03 | 457,96 | 1.947,19 |
| BB PREV RF IMA-B | 10.524.183,99 | 0,00 | -10.392.381,70 | 0,00 | 0,00 | -131.802,29 | -163.564,47 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 5.595.797,95 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.639.955,45 | 44.157,50 | 280.837,08 |
| BRANCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA | 10.277.236,20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.256.266,44 | -20.969,76 | 182.098,98 |
| | 26.436.237,23 | 256.366,61 | -10.648.836,33 | 0,00 | 15.935.610,92 | -108.156,59 | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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 | 1.329.935,60 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.326.769,25 | -3.166,35 | -61.412,64 |
| | 1.329.935,60 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.326.769,25 | -3.166,35 | |

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|----------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE | 4.812.562,36 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.807.286,02 | -5.276,34 | -354.087,68 |
| | 4.812.562,36 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.807.286,02 | -5.276,34 | |

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 | 12.438.549,99 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 14.022.281,63 | 1.583.731,64 | 3.971.651,67 |
| | 12.438.549,99 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 14.022.281,63 | 1.583.731,64 | |

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 | 16.411.421,91 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 17.051.537,59 | 640.115,68 | 2.439.849,99 |
| | 16.411.421,91 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 17.051.537,59 | 640.115,68 | |

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | 1.589.008,49 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.586.985,98 | -2.022,51 | -1.255.958,98 |
| | 1.589.008,49 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.586.985,98 | -2.022,51 | |

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Proventos | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|-------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|-----------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| CARE11 | 839.998,32 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.596,66 | 776.772,64 | -53.629,02 | 167.660,86 |
| FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING | 2.482.842,30 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.482.319,21 | -523,09 | -279.937,68 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Proventos | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|-------|----------------|------------|----------|-------------|-----------|--------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 3.322.840,62 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.596,66 | 3.259.091,85 | -54.152,11 | |

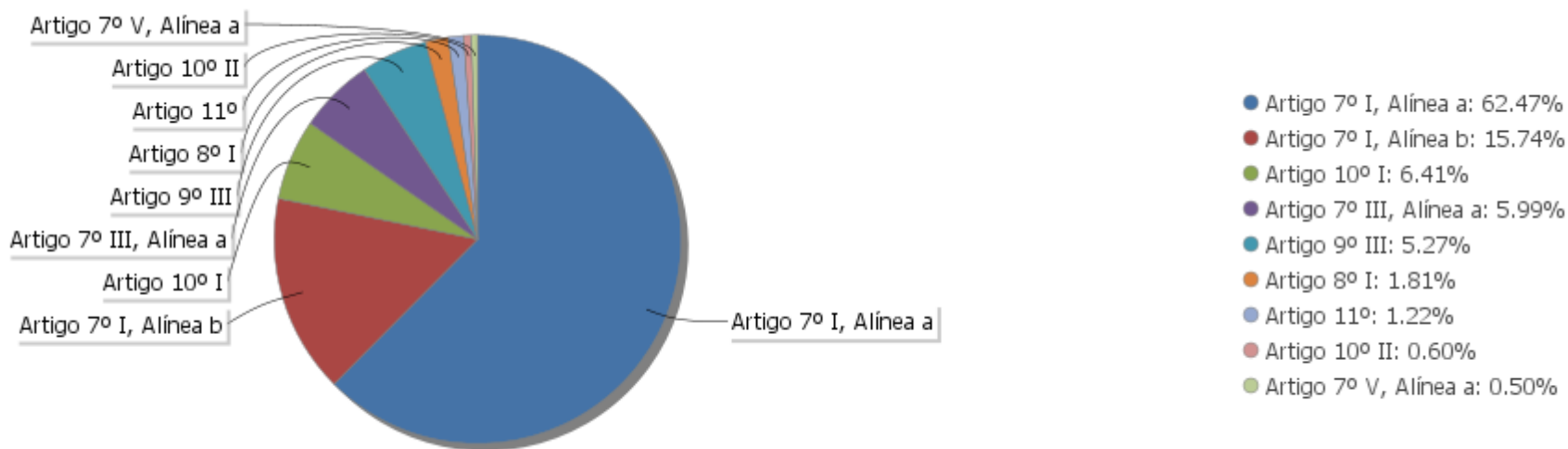
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

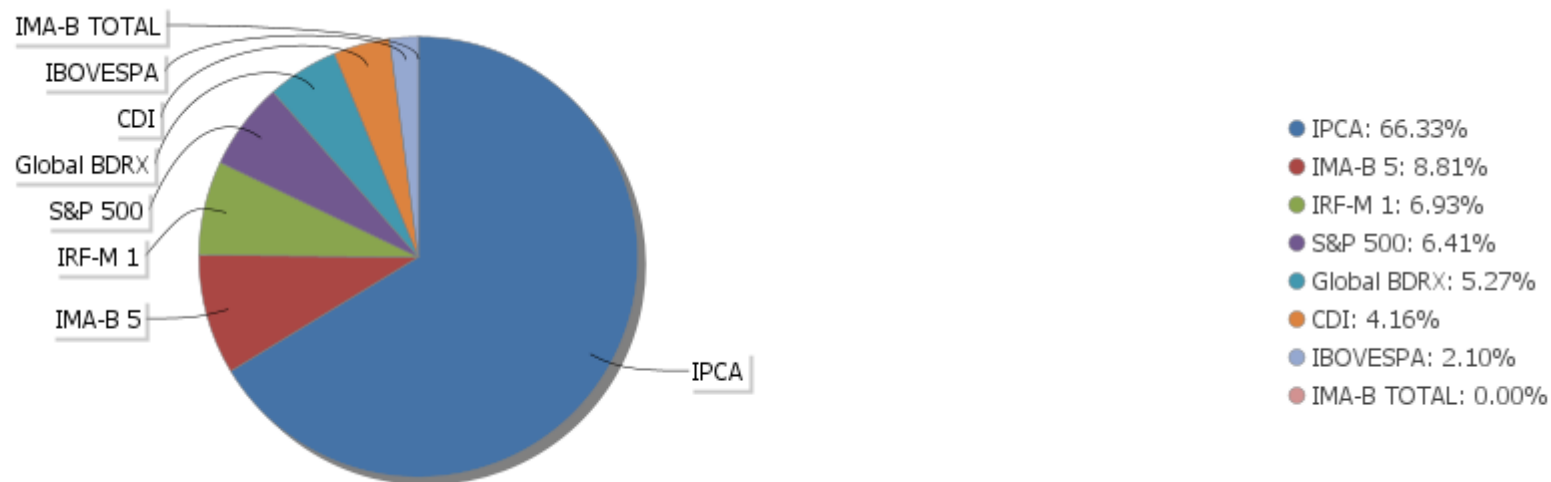
| Período | Valor (R\$) | (%) | (%) Limite Mínimo P.I. | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo Acum. |
|-----------------------|----------------|-------|------------------------|-----------------------|-----------|-------------------------|
| de 0 a 30 dias | 96.090.881,29 | 36,09 | | 96.090.881,29 | 36,09 | |
| de 31 dias a 365 dias | 0,00 | 0,00 | | 96.090.881,29 | 36,09 | |
| acima de 365 dias | 170.126.772,66 | 63,91 | | 266.217.653,95 | 100,00 | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

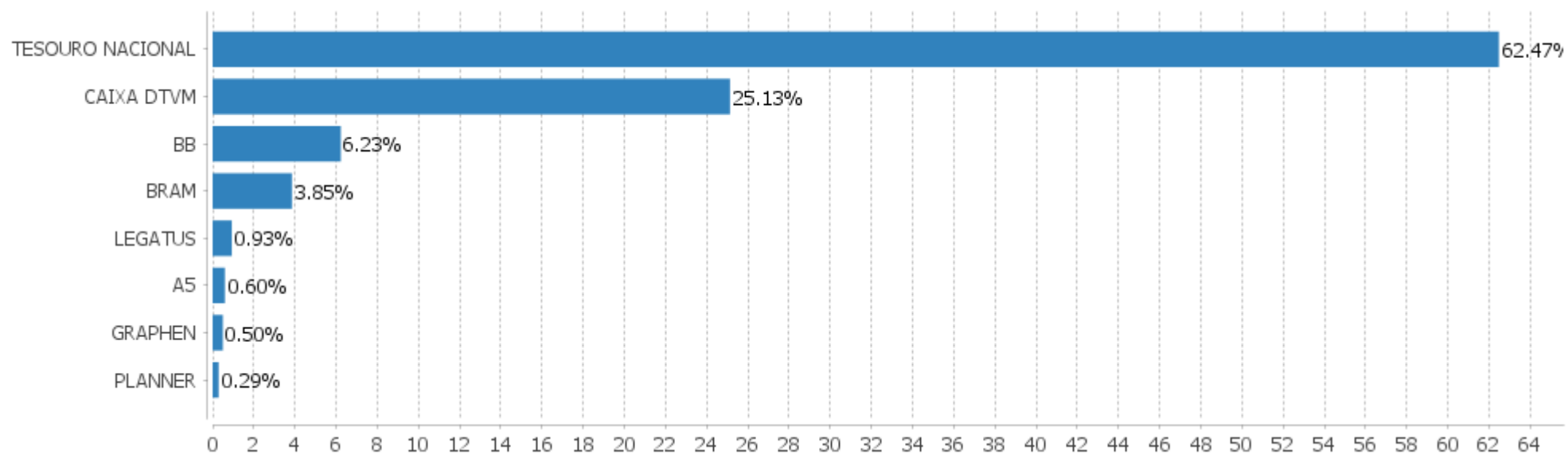


Alocação Por Estratégia



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 | 0,91 | 1,16 | 0,03 | 1,32 | 1,36 | | | | | | | 5,80 |
| IPCA + 5,04% | 0,85 | 1,20 | 0,55 | 0,81 | 0,87 | 0,60 | | | | | | | 4,99 |
| p.p. indexador | 0,04 | -0,29 | 0,61 | -0,78 | 0,45 | 0,75 | | | | | | | 0,81 |
| 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 | 22 | 40,74 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 32 | 59,26 |

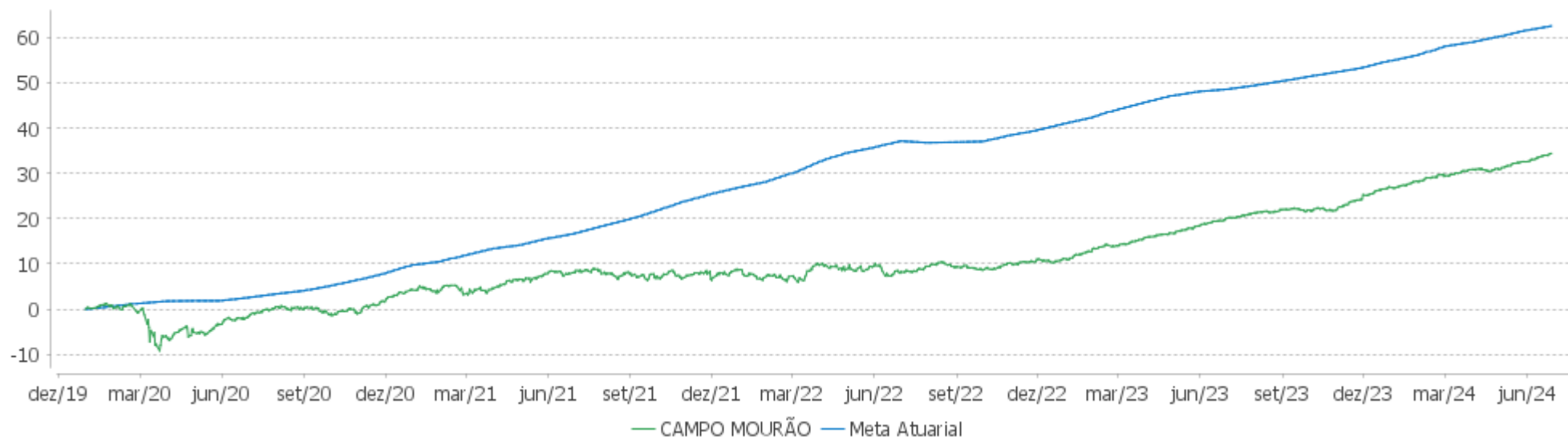
| | Rentabilidade | Mês |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,77 | 2023-11 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -5,49 | 2020-03 |

Relatório

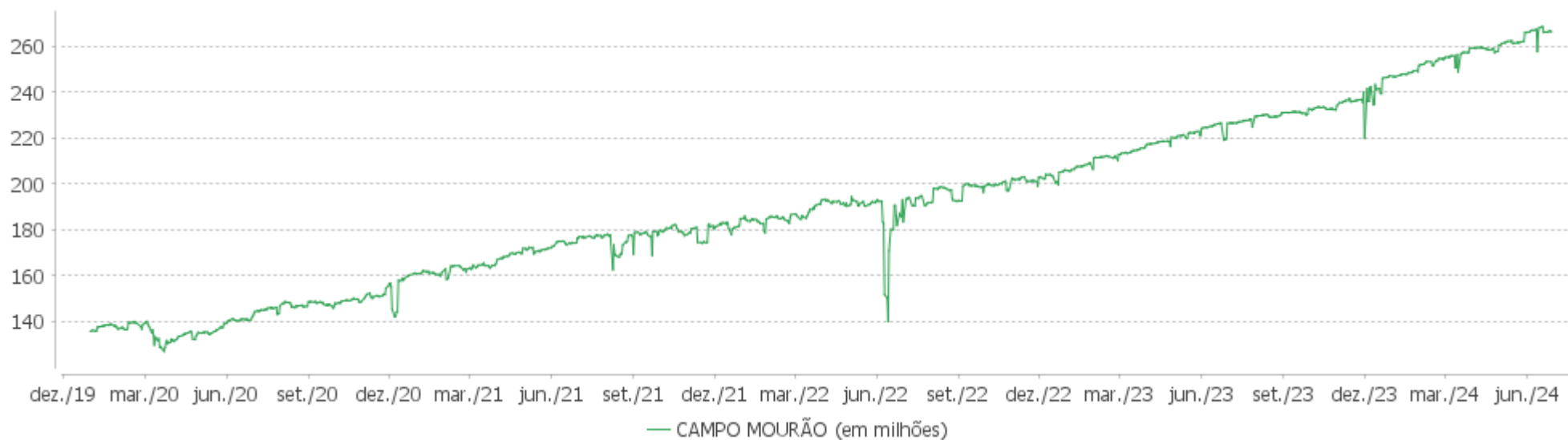
| Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses | 2,73 | 2,30 | 0,42 | 1,26 |
| 06 meses | 5,80 | 4,99 | 0,81 | 1,42 |
| 12 meses | 11,89 | 9,46 | 2,43 | 1,72 |
| 24 meses | 24,44 | 18,59 | 5,85 | 1,94 |
| 36 meses | 24,26 | 39,59 | -15,33 | 3,41 |
| 48 meses | 36,78 | 59,78 | -23,01 | 3,63 |
| Desde 31/12/2019 | 34,35 | 64,46 | -30,11 | 5,05 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

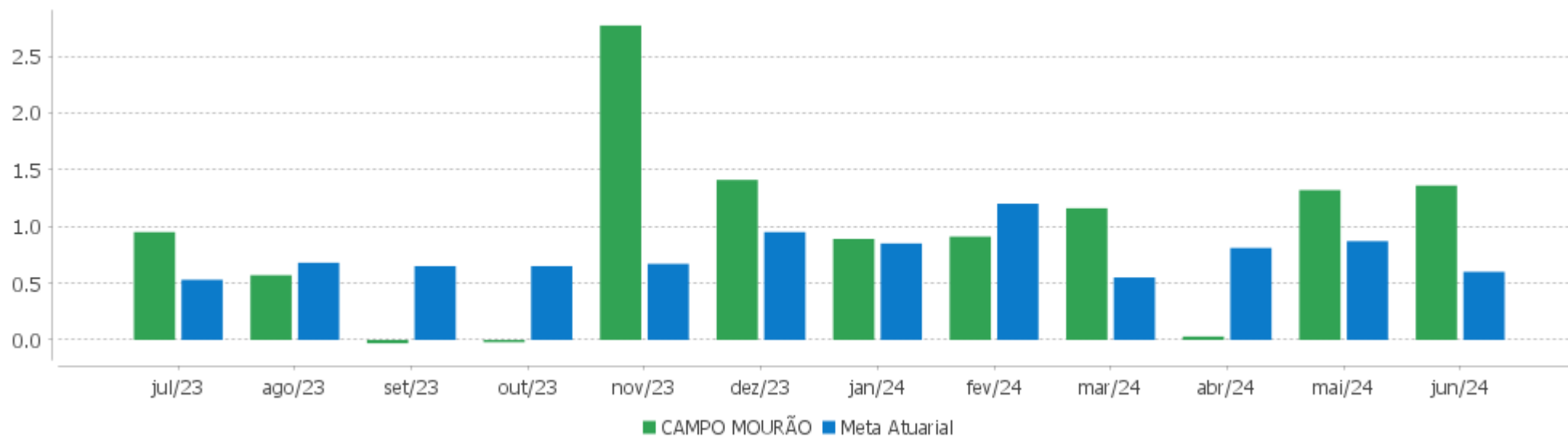


Patrimônio Líquido



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 150840 (5,790000%) Var. IPCA p.p. | 0,83 0,62 | 5,62 3,13 | 2,46 1,41 | 5,62 3,13 | 10,24 6,02 | 20,72 13,19 | 34,88 14,58 |
| NTN-B 150535 (5,750000%) Var. IPCA p.p. | 0,83 0,62 | 5,60 3,11 | 2,45 1,40 | 5,60 3,11 | 10,17 5,94 | 20,59 13,06 | 34,68 14,37 |
| NTN-B 150850 (6,320000%) Var. IPCA p.p. | 0,87 0,66 | 2,73 0,24 | 2,59 1,54 | 2,73 0,24 | 4,12 -0,10 | | |
| NTN-B 150555 (6,070000%) Var. IPCA p.p. | 0,86 0,65 | 2,70 0,22 | -0,43 -1,48 | 2,70 0,22 | 4,08 -0,15 | | |
| NTN-B 150840 (5,820000%) Var. IPCA p.p. | 0,84 0,63 | 5,63 3,15 | 2,47 1,42 | 5,63 3,15 | 10,28 6,05 | 20,79 13,26 | 34,97 14,67 |
| NTN-B 150850 (5,820000%) Var. IPCA p.p. | 0,84 0,63 | 5,63 3,15 | 2,47 1,42 | 5,63 3,15 | 10,34 6,11 | 20,85 13,33 | 35,08 14,78 |
| NTN-B 150850 (6,070000%) Var. IPCA p.p. | 0,86 0,65 | 2,70 0,22 | 2,53 1,48 | 2,70 0,22 | 4,08 -0,15 | | |
| NTN-B 150555 (5,790000%) Var. IPCA p.p. | 0,83 0,62 | 5,62 3,13 | 2,46 1,41 | 5,62 3,13 | 10,32 6,10 | 20,80 13,28 | 35,03 14,73 |
| NTN-B 150545 (6,030000%) Var. IPCA p.p. | 0,85 0,64 | 2,70 0,22 | -0,42 -1,48 | 2,70 0,22 | 4,07 -0,16 | | |
| NTN-B 150545 (5,680000%) Var. IPCA p.p. | 0,83 0,62 | 5,56 3,08 | 2,44 1,38 | 5,56 3,08 | 10,16 5,94 | 20,50 12,98 | 34,62 14,32 |
| NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p. | 0,83 0,62 | 2,67 0,19 | 2,45 1,39 | 2,67 0,19 | 4,01 -0,22 | | |
| NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p. | 0,83 0,62 | 5,56 3,08 | 2,43 1,38 | 5,56 3,08 | 7,15 2,93 | | |
| NTN-B 150535 (6,250000%) Var. IPCA p.p. | 0,87 0,66 | 2,75 0,27 | -0,42 -1,47 | 2,75 0,27 | 4,18 -0,05 | | |
| NTN-B 150850 (5,770000%) Var. IPCA p.p. | 0,83 0,62 | 2,61 0,13 | 2,46 1,40 | 2,61 0,13 | 3,95 -0,28 | | |
| NTN-B 150850 (5,660000%) Var. IPCA p.p. | 0,83 0,62 | 5,55 3,07 | 2,43 1,38 | 5,55 3,07 | 7,15 2,92 | | |
| NTN-B 150850 (5,640000%) Var. IPCA p.p. | 0,82 0,61 | 5,54 3,06 | 2,43 1,37 | 5,54 3,06 | 7,13 2,91 | | |
| NTN-B 150850 (5,630000%) | 0,82 | 2,66 | 2,42 | 2,66 | 3,98 | | |

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. | 0,61 | 0,18 | 1,37 | 0,18 | -0,24 | | |
| NTN-B 150840 (6,030000%) Var. IPCA p.p. | 0,85 0,64 | 2,70 0,22 | 2,52 1,47 | 2,70 0,22 | 4,07 -0,16 | | |
| NTN-B 150555 (5,760000%) Var. IPCA p.p. | 0,83 0,62 | 5,60 3,12 | 2,45 1,40 | 5,60 3,12 | 10,29 6,07 | 20,74 13,21 | 34,95 14,65 |
| NTN-B 150850 (5,930000%) Var. IPCA p.p. | 0,85 0,64 | 5,69 3,20 | 2,50 1,44 | 5,69 3,20 | 10,45 6,23 | 21,11 13,58 | 35,39 15,09 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | 0,37 -0,02 | 3,21 -0,11 | 1,18 -0,06 | 3,21 -0,11 | 8,00 -0,23 | 18,98 -0,31 | 30,69 -0,61 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,37 -0,02 | 3,20 -0,12 | 1,18 -0,06 | 3,20 -0,12 | 7,97 -0,26 | 18,82 -0,48 | 30,38 -0,92 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p. | 0,61 -0,03 | 4,48 -0,02 | 1,97 -0,04 | 4,48 -0,02 | 10,79 -0,16 | 25,84 -0,44 | 34,58 -0,78 |
| GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS % do CDI | -0,24 -30,20 | -1,35 -25,85 | -0,56 -21,94 | -1,35 -25,85 | -1,76 -15,03 | -5,41 -20,18 | -10,46 -27,69 |
| BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,98 -0,01 | -1,28 -0,18 | -1,34 -0,07 | -1,28 -0,18 | 2,67 -0,39 | 16,26 -0,75 | 20,42 -1,00 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,79 100,10 | 5,24 100,37 | 2,53 99,91 | 5,24 100,37 | 11,71 100,14 | 26,83 100,06 | 38,23 101,15 |
| BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI | 0,71 90,20 | 4,71 90,16 | 2,27 89,82 | 4,71 90,16 | 10,59 90,55 | 24,34 90,76 | 33,64 89,02 |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA Var. IPCA p.p. | -0,20 -0,41 | 1,81 -0,68 | 0,27 -0,78 | 1,81 -0,68 | 7,18 2,95 | 22,58 15,06 | 28,41 8,10 |
| FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p. | -0,11 -1,59 | -6,86 0,80 | -7,64 -4,37 | -6,86 0,80 | 4,76 -0,17 | 26,67 0,93 | 7,51 9,79 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p. | 12,73 -0,06 | 39,52 -1,55 | 21,34 -0,40 | 39,52 -1,55 | 52,18 -2,61 | 72,57 -4,56 | 50,01 -5,70 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p. | 3,90 -5,83 | 16,70 -14,75 | 5,01 -10,61 | 16,70 -14,75 | 29,37 -12,16 | 66,02 12,93 | 56,49 15,29 |
| W7 FIP MULTIELSTRATÉGIA % do CDI | -0,13 -16,15 | -44,18 -846,12 | -0,40 -15,83 | -44,18 -846,12 | -44,66 -382,01 | -49,35 -184,00 | -50,08 -132,52 |
| CARE11 Var. IBOVESPA p.p. | -6,43 -7,91 | 27,04 34,70 | -18,67 -15,39 | 27,04 34,70 | -15,51 -20,44 | -58,16 -83,90 | -56,74 -54,46 |
| FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING % do CDI | -0,02 -2,67 | -9,52 -182,28 | -0,04 -1,54 | -9,52 -182,28 | 65,29 558,44 | 243,78 909,04 | -1,01 -2,68 |
| CAMPO MOURÃO | 1,36 | 5,80 | 2,73 | 5,80 | 11,89 | 24,44 | 24,26 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Var. IPCA + 5,04% p.p. | 0,75 | 0,81 | 0,42 | 0,81 | 2,47 | 5,90 | -15,06 |
| CDI | 0,79 | 5,22 | 2,53 | 5,22 | 11,69 | 26,82 | 37,79 |
| IBOVESPA | 1,48 | -7,66 | -3,28 | -7,66 | 4,93 | 25,74 | -2,28 |
| INPC + 6,00% | 0,71 | 5,66 | 2,57 | 5,66 | 9,84 | 19,90 | 42,24 |
| IPCA + 6,00% | 0,67 | 5,46 | 2,54 | 5,46 | 10,40 | 20,70 | 43,15 |

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

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

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

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

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%) | 588.036,28 | 5,750000 | 555.015,38 | 6,510700 | -33.020,90 |
| NTN-B 150535 (6,250000%) | 8.086.415,63 | 6,250000 | 7.928.791,08 | 6,510700 | -157.624,55 |
| NTN-B 150545 (5,680000%) | 10.815.080,24 | 5,680000 | 9.854.750,49 | 6,496800 | -960.329,75 |
| NTN-B 150545 (6,030000%) | 34.625,20 | 6,030000 | 32.849,17 | 6,496800 | -1.776,03 |
| NTN-B 150555 (5,760000%) | 43.401.775,08 | 5,760000 | 39.408.819,64 | 6,477700 | -3.992.955,44 |
| NTN-B 150555 (5,790000%) | 10.843.558,21 | 5,790000 | 9.886.874,23 | 6,477700 | -956.683,98 |
| NTN-B 150555 (6,070000%) | 103.335,03 | 6,070000 | 97.889,84 | 6,477700 | -5.445,19 |
| NTN-B 150840 (5,790000%) | 10.219.634,65 | 5,790000 | 9.594.630,05 | 6,439600 | -625.004,60 |
| NTN-B 150840 (5,820000%) | 537.705,82 | 5,820000 | 506.312,93 | 6,439600 | -31.392,89 |
| NTN-B 150840 (6,030000%) | 17.558,85 | 6,030000 | 16.877,10 | 6,439600 | -681,75 |
| NTN-B 150850 (5,630000%) | 2.065.095,72 | 5,630000 | 1.851.711,49 | 6,504300 | -213.384,23 |
| NTN-B 150850 (5,640000%) | 19.244.858,05 | 5,640000 | 17.278.514,64 | 6,504300 | -1.966.343,41 |
| NTN-B 150850 (5,660000%) | 8.362.079,90 | 5,660000 | 7.526.986,60 | 6,504300 | -835.093,30 |
| NTN-B 150850 (5,670000%) | 22.590.503,70 | 5,670000 | 20.360.560,89 | 6,504300 | -2.229.942,81 |
| NTN-B 150850 (5,730000%) | 5.874.681,53 | 5,730000 | 5.335.585,44 | 6,504300 | -539.096,09 |
| NTN-B 150850 (5,770000%) | 7.596.378,87 | 5,770000 | 6.938.746,59 | 6,504300 | -657.632,28 |
| NTN-B 150850 (5,820000%) | 5.401.945,12 | 5,820000 | 4.962.757,26 | 6,504300 | -439.187,86 |
| NTN-B 150850 (5,930000%) | 6.474.643,95 | 5,930000 | 6.031.531,36 | 6,504300 | -443.112,59 |
| NTN-B 150850 (6,070000%) | 1.708.487,44 | 6,070000 | 1.619.731,29 | 6,504300 | -88.756,15 |
| NTN-B 150850 (6,320000%) | 2.351.284,93 | 6,320000 | 2.299.107,08 | 6,504300 | -52.177,85 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|----------------------|----------------------|--------------------|------------------|
| 485 | 12/06/2024 | BB PREV RF FLUXO FIC | 256.366,61 | 0,00 | 90.431,98466700 | 2,8349108000 |
| 484 | 12/06/2024 | BB PREV RF IMA-B | 0,00 | 10.392.381,70 | 1.504.049,63071800 | 6,9096002510 |
| 491 | 13/06/2024 | NTN-B 150535 (6,250000%) | 8.051.175,04 | 0,00 | 1.900,00000000 | 4.237,4605473680 |
| 486 | 14/06/2024 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 256.454,63 | 90.399,49343000 | 2,8369033970 |
| 492 | 14/06/2024 | NTN-B 150850 (6,320000%) | 2.342.028,32 | 0,00 | 555,00000000 | 4.219,8708468470 |
| 487 | 17/06/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 1.500,00 | 425,00322294 | 3,5293850000 |
| 490 | 19/06/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 1.000.000,00 | 283.136,44968410 | 3,5318660000 |
| 488 | 19/06/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 1.636.000,00 | 463.211,23168320 | 3,5318660000 |
| 489 | 27/06/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 600.000,00 | 169.416,24526729 | 3,5415730000 |
| Total | | | 10.649.569,97 | 13.886.336,33 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.651.441,18

Value-At-Risk: 0,62%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | Limite ⁽⁵⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| Artigo 7º | 0,50 | 0,17 | | 0,04 | -0,21 | 0,68 | 225.490.470,88 | 84,70 |
| Artigo 8º | 18,07 | 7,60 | | 0,05 | -0,05 | -0,11 | 4.807.286,02 | 1,81 |
| Artigo 9º | 17,32 | 6,46 | | 0,25 | 0,69 | 12,73 | 14.022.281,63 | 5,27 |
| Artigo 10º | 5,73 | 4,37 | | 0,29 | 0,48 | 3,56 | 18.638.523,57 | 7,00 |
| Artigo 11º | 13,67 | 5,17 | | 0,00 | -0,18 | -1,63 | 3.259.091,85 | 1,22 |
| CAMPO MOURÃO | 0,89 | 0,62 | | 0,62 | 0,63 | 1,36 | 266.217.653,95 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,17%

Artigo 7º I, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| NTN-B 150535 (5,750000%) | 0,17 | 0,08 | 0,00 | 0,12 | 0,26 | 0,83 | 588.036,28 | 0,22 |
| NTN-B 150535 (6,250000%) | 0,17 | 0,22 | -0,00 | 0,25 | 0,48 | 0,87 | 8.086.415,63 | 3,04 |
| NTN-B 150840 (5,790000%) | 0,17 | 0,08 | 0,00 | 0,12 | 0,27 | 0,83 | 10.219.634,65 | 3,84 |
| NTN-B 150840 (5,820000%) | 0,17 | 0,08 | 0,00 | 0,12 | 0,29 | 0,84 | 537.705,82 | 0,20 |
| NTN-B 150840 (6,030000%) | 0,17 | 0,23 | -0,00 | 0,27 | 0,38 | 0,85 | 17.558,85 | 0,01 |
| NTN-B 150545 (5,680000%) | 0,17 | 0,08 | 0,00 | 0,12 | 0,23 | 0,83 | 10.815.080,24 | 4,06 |
| NTN-B 150545 (6,030000%) | 0,17 | 0,23 | -0,00 | 0,25 | 0,38 | 0,85 | 34.625,20 | 0,01 |
| NTN-B 150850 (5,630000%) | 0,17 | 0,21 | -0,00 | 0,26 | 0,20 | 0,82 | 2.065.095,72 | 0,78 |
| NTN-B 150850 (5,640000%) | 0,17 | 0,08 | 0,00 | 0,12 | 0,21 | 0,82 | 19.244.858,05 | 7,23 |
| NTN-B 150850 (5,660000%) | 0,17 | 0,08 | 0,00 | 0,12 | 0,22 | 0,83 | 8.362.079,90 | 3,14 |
| NTN-B 150850 (5,670000%) | 0,17 | 0,08 | 0,00 | 0,12 | 0,22 | 0,83 | 22.590.503,70 | 8,49 |
| NTN-B 150850 (5,730000%) | 0,17 | 0,21 | -0,00 | 0,26 | 0,25 | 0,83 | 5.874.681,53 | 2,21 |
| NTN-B 150850 (5,770000%) | 0,36 | 0,30 | -0,00 | 0,33 | 0,12 | 0,83 | 7.596.378,87 | 2,85 |
| NTN-B 150850 (5,820000%) | 0,17 | 0,08 | 0,00 | 0,12 | 0,29 | 0,84 | 5.401.945,12 | 2,03 |
| NTN-B 150850 (5,930000%) | 0,17 | 0,08 | 0,00 | 0,12 | 0,34 | 0,85 | 6.474.643,95 | 2,43 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| NTN-B 150850 (6,070000%) | 0,17 | 0,23 | -0,00 | 0,27 | 0,40 | 0,86 | 1.708.487,44 | 0,64 |
| NTN-B 150850 (6,320000%) | 0,17 | 0,22 | -0,00 | 0,27 | 0,51 | 0,87 | 2.351.284,93 | 0,88 |
| NTN-B 150555 (5,760000%) | 0,17 | 0,07 | 0,00 | 0,12 | 0,26 | 0,83 | 43.401.775,08 | 16,30 |
| NTN-B 150555 (5,790000%) | 0,17 | 0,07 | 0,00 | 0,12 | 0,27 | 0,83 | 10.843.558,21 | 4,07 |
| NTN-B 150555 (6,070000%) | 0,17 | 0,23 | -0,00 | 0,25 | 0,40 | 0,86 | 103.335,03 | 0,04 |
| Sub-total | 0,17 | 0,07 | 0,00 | | 0,26 | 0,83 | 166.317.684,20 | 62,47 |

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 1,72 | 0,91 | 0,01 | 0,01 | -0,24 | 0,37 | 10.894.015,26 | 4,09 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,71 | 0,91 | 0,01 | 0,01 | -0,24 | 0,37 | 12.563.888,78 | 4,72 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,52 | 0,23 | 0,00 | 0,02 | -0,35 | 0,61 | 18.452.502,47 | 6,93 |
| Sub-total | 1,15 | 0,59 | 0,03 | | -0,26 | 0,49 | 41.910.406,51 | 15,74 |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BB PREV RF FLUXO FIC | 0,01 | 0,01 | 0,00 | 0,01 | -5,87 | 0,71 | 39.389,03 | 0,01 |
| BB PREV RF IMA-B | 3,99 | NaN | 0,00 | NaN | -0,44 | -0,98 | 0,00 | 0,00 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,04 | 0,02 | 0,00 | 0,02 | 0,02 | 0,79 | 5.639.955,45 | 2,12 |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA | 2,60 | 1,06 | 0,01 | 1,06 | -0,38 | -0,20 | 10.256.266,44 | 3,85 |
| Sub-total | 2,22 | 0,69 | 0,01 | | -0,48 | -0,27 | 15.935.610,92 | 5,99 |

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 | 0,85 | 0,04 | -0,00 | 0,04 | -1,21 | -0,24 | 1.326.769,25 | 0,50 |
| Sub-total | 0,85 | 0,04 | -0,00 | | -1,21 | -0,24 | 1.326.769,25 | 0,50 |

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,37%

Artigo 10º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 6,22 | 4,79 | 0,29 | 4,84 | 0,50 | 3,90 | 17.051.537,59 | 6,41 |
| Sub-total | 6,22 | 4,79 | 0,29 | | 0,50 | 3,90 | 17.051.537,59 | 6,41 |

Artigo 10º II

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-----------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| W7 FIP MULTISTRATÉGIA | 0,45 | 2,66 | -0,00 | 2,67 | -2,03 | -0,13 | 1.586.985,98 | 0,60 |
| Sub-total | 0,45 | 2,66 | -0,00 | | -2,03 | -0,13 | 1.586.985,98 | 0,60 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,46%

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 | 0,25 | 0,94 | 0,69 | 12,73 | 14.022.281,63 | 5,27 |
| Sub-total | 17,32 | 6,46 | 0,25 | | 0,69 | 12,73 | 14.022.281,63 | 5,27 |

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,60%

Artigo 8º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|----------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE | 18,07 | 7,60 | 0,05 | 3,95 | -0,05 | -0,11 | 4.807.286,02 | 1,81 |
| Sub-total | 18,07 | 7,60 | 0,05 | | -0,05 | -0,11 | 4.807.286,02 | 1,81 |

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 5,17%

Artigo 11º

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| CARE11 | 58,97 | 21,68 | 0,00 | 22,75 | -0,12 | -6,43 | 776.772,64 | 0,29 |
| FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING | 0,07 | 0,01 | -0,00 | 0,01 | -10,82 | -0,02 | 2.482.319,21 | 0,93 |
| Sub-total | 13,67 | 5,17 | 0,00 | | -0,18 | -1,63 | 3.259.091,85 | 1,22 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)
- (2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
- (3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
- (4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
- (5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações