



LDB
EMPRESAS

CAMPO MOURÃO
OUTUBRO 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 31.10.2024.

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

78,56%

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	0,05	1,02	8,97	606.784,84	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,250000%)	4,18	0,05	1,07	3,81	8.358.150,05	2,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,790000%)	1,35	0,05	1,03	9,00	10.251.099,99	3,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,820000%)	1,76	0,05	1,03	9,03	539.369,99	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,030000%)	2,91	0,05	1,05	4,23	17.615,08	0,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,680000%)	0,79	0,05	1,02	8,90	11.157.291,69	4,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,030000%)	4,11	0,05	1,05	4,23	35.762,55	0,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,630000%)	2,77	0,05	1,01	7,21	2.071.961,44	0,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,640000%)	0,57	0,05	1,01	8,87	19.308.796,34	6,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,660000%)	0,57	0,05	1,01	8,89	8.389.822,78	3,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	0,57	0,05	1,02	8,90	22.665.398,78	8,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	2,80	0,05	1,02	6,09	5.894.071,57	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,770000%)	2,83	-0,01	1,02	5,95	7.621.363,74	2,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,820000%)	1,29	0,05	1,03	9,03	5.419.646,44	1,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,930000%)	3,20	0,05	1,04	9,12	6.495.654,65	2,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,070000%)	2,93	0,05	1,05	4,25	1.713.955,23	0,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,190000%)	4,19	0,05	1,06	1,64	2.634.281,41	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,320000%)	3,02	0,05	1,07	3,79	2.358.594,76	0,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,350000%)	4,27	0,05	1,07	1,34	10.132.178,82	3,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,760000%)	0,63	0,05	1,02	8,97	44.787.064,64	16,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,790000%)	0,98	0,05	1,03	9,00	11.190.781,73	4,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,070000%)	4,13	0,05	1,05	4,25	106.743,54	0,04
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,81	0,04	1,03	8,97	181.756.390,06	65,12

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 IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,61	0,00	0,47	5,63	0,00	0,00	6.810.595.873,00	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,41	0,04	0,83	7,99	12.262.427,42	4,39	8.121.204.821,20	0,15
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,01	0,04	0,83	6,93	12.262.427,42	4,39		

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	0,04	0,04	0,85	8,10	1.130.951,45	0,41	4.036.357.184,84	0,03
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,04	0,93	9,12	21.030.481,81	7,54	20.409.457.658,47	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,04	0,83	0,83	1.757.751,51	0,63	19.218.803.160,79	0,01
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,54	0,04	0,93	5,39	23.919.184,77	8,57		

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 *	4,72	-0,22	-0,22	-5,21	1.315.867,00	0,47	155.844.626,83	0,84
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			4,72	-0,22	-0,22	-5,21	1.315.867,00	0,47		
Renda Fixa			0,61	0,04	1,00	7,99	219.253.869,25	78,56		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

1,86%

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	14,96	-0,29	1,08	0,68	5.196.592,90	1,86	704.827.937,64	0,74
Sub-total Artigo 8º I			14,96	-0,29	1,08	0,68	5.196.592,90	1,86		
Renda Variável			14,96	-0,29	1,08	0,68	5.196.592,90	1,86		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,34%

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	15,43	-1,25	5,92	48,88	26.060.628,65	9,34	2.836.421.099,25	0,92
Sub-total Artigo 9º III			15,43	-1,25	5,92	48,88	26.060.628,65	9,34		
Investimentos no Exterior			15,43	-1,25	5,92	48,88	26.060.628,65	9,34		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,10%

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	12,09	-1,75	-0,34	23,65	24.111.673,97	8,64	2.064.997.259,47	1,17
Sub-total Artigo 10º I			12,09	-1,75	-0,34	23,65	24.111.673,97	8,64		

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 *	61,37	-0,14	-0,14	-55,25	1.272.183,24	0,46	54.944.868,36	2,32
Sub-total Artigo 10º II			61,37	-0,14	-0,14	-55,25	1.272.183,24	0,46		

Investimentos Estruturados			12,69	-1,67	-0,33	11,29	25.383.857,21	9,10		
-----------------------------------	--	--	--------------	--------------	--------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,14%

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 *	45,40	4,35	-9,43	6,36	650.321,28	0,23	250.052.298,45	0,26
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,18	2,52	2,52	-7,93	2.543.325,36	0,91	652.863.701,14	0,39
Sub-total Artigo 11º			48,06	2,89	-0,17	-5,26	3.193.646,64	1,14		
Fundos Imobiliários			48,06	2,89	-0,17	-5,26	3.193.646,64	1,14		
Total			1,95	-0,21	1,30	9,67	279.088.594,65	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	181.756.390,06	65,12	0,00	65,00	100,00	65,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	12.262.427,42	4,39	0,00	3,32	100,00	2,82	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	23.919.184,77	8,57	0,00	8,00	60,00	8,09	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.315.867,00	0,47	0,00	0,49	5,00	0,54	5,00
	Total Renda Fixa	219.253.869,25	78,56					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	5.196.592,90	1,86	0,00	2,00	30,00	3,55	30,00
	Total Renda Variável	5.196.592,90	1,86					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	26.060.628,65	9,34	0,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	26.060.628,65	9,34					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	24.111.673,97	8,64	0,00	9,53	10,00	9,36	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.272.183,24	0,46	0,00	0,47	5,00	0,64	5,00
	Total Investimentos Estruturados	25.383.857,21	9,10					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	3.193.646,64	1,14	0,00	1,19	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	3.193.646,64	1,14					5,00
Total		279.088.594,65	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Atribuição Desemp. (%)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,03 110,69	8,97 99,72	2,41 90,84	4,97 94,28	10,86 98,92	1.847.919,18	0,67	13.372.020,27
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,83 89,00	6,93 77,05	2,17 81,62	4,53 85,88	9,96 90,68	104.743,16	0,04	2.712.328,88
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 99,99	5,39 59,99	2,68 101,12	4,83 91,60	9,43 85,86	214.593,09	0,08	801.719,90
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,22 -23,99	-5,21 -57,93	-0,64 -23,97	-1,26 -23,84	-5,50 -50,10	-2.936,30	-0,00	-72.314,89
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,08 2,67	0,68 4,02	7,35 5,73	5,48 2,47	22,19 7,55	55.431,17	0,02	35.219,20
Artigo 9º III % do CDI	5,92 637,79	48,88 543,57	6,17 232,65	28,45 539,83	62,54 569,65	1.456.173,05	0,53	5.509.998,69
Artigo 10º I % do CDI	-0,34 -36,55	23,65 262,98	4,51 170,17	15,67 297,25	42,23 384,66	-82.066,23	-0,03	3.656.807,13
Artigo 10º II % do CDI	-0,14 -15,00	-55,25 -614,42	-0,37 -14,08	-20,05 -380,34	-55,38 -504,40	-1.773,50	-0,00	-1.570.761,72
Artigo 11º % do CDI	-0,17 -17,80	-5,26 -58,55	-1,99 -75,20	-4,01 -76,12	51,81 471,93	-5.283,55	-0,00	-177.722,03
CAMPO MOURÃO (Total)						3.586.800,07	1,30	24.267.295,43

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%)	600.645,77	0,00	0,00	0,00	606.784,84	6.139,07	50.609,27
NTN-B 150535 (6,250000%)	8.270.026,30	0,00	0,00	0,00	8.358.150,05	88.123,75	306.975,01
NTN-B 150545 (5,680000%)	11.045.076,62	0,00	0,00	0,00	11.157.291,69	112.215,07	924.542,63
NTN-B 150545 (6,030000%)	35.392,19	0,00	0,00	0,00	35.762,55	370,36	1.452,34
NTN-B 150555 (5,760000%)	44.333.554,29	0,00	0,00	0,00	44.787.064,64	453.510,35	3.738.020,64
NTN-B 150555 (5,790000%)	11.077.177,99	0,00	0,00	0,00	11.190.781,73	113.603,74	936.548,47
NTN-B 150555 (6,070000%)	105.634,44	0,00	0,00	0,00	106.743,54	1.109,10	4.351,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,790000%)	10.147.035,48	0,00	0,00	0,00	10.251.099,99	104.064,51	869.208,74
NTN-B 150840 (5,820000%)	533.880,73	0,00	0,00	0,00	539.369,99	5.489,26	45.859,28
NTN-B 150840 (6,030000%)	17.432,65	0,00	0,00	0,00	17.615,08	182,43	726,29
NTN-B 150850 (5,630000%)	2.051.211,17	0,00	0,00	0,00	2.071.961,44	20.750,27	142.120,60
NTN-B 150850 (5,640000%)	19.115.257,54	0,00	0,00	0,00	19.308.796,34	193.538,80	1.614.311,20
NTN-B 150850 (5,660000%)	8.305.585,16	0,00	0,00	0,00	8.389.822,78	84.237,62	702.740,92
NTN-B 150850 (5,670000%)	22.437.634,09	0,00	0,00	0,00	22.665.398,78	227.764,69	1.900.248,53
NTN-B 150850 (5,730000%)	5.834.539,73	0,00	0,00	0,00	5.894.071,57	59.531,84	344.881,66
NTN-B 150850 (5,770000%)	7.544.094,49	0,00	0,00	0,00	7.621.363,74	77.269,25	436.499,09
NTN-B 150850 (5,820000%)	5.364.489,82	0,00	0,00	0,00	5.419.646,44	55.156,62	460.720,86
NTN-B 150850 (5,930000%)	6.428.937,67	0,00	0,00	0,00	6.495.654,65	66.716,98	557.759,83
NTN-B 150850 (6,070000%)	1.696.146,69	0,00	0,00	0,00	1.713.955,23	17.808,54	70.947,80
NTN-B 150850 (6,190000%)	2.606.641,37	0,00	0,00	0,00	2.634.281,41	27.640,04	42.526,20
NTN-B 150850 (6,320000%)	2.333.586,75	0,00	0,00	0,00	2.358.594,76	25.008,01	87.372,85
NTN-B 150850 (6,350000%)	10.024.489,94	0,00	0,00	0,00	10.132.178,82	107.688,88	133.596,20
	179.908.470,88	0,00	0,00	0,00	181.756.390,06	1.847.919,18	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	65.158,05	0,00	-65.465,07	0,00	0,00	307,02	649.973,71
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.531.507,55	158.483,73	-1.532.000,00	0,00	12.262.427,42	104.436,14	1.339.980,62
	13.596.665,60	158.483,73	-1.597.465,07	0,00	12.262.427,42	104.743,16	

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	1.121.466,90	0,00	0,00	0,00	1.130.951,45	9.484,55	15.091,01
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	20.836.075,98	0,00	0,00	0,00	21.030.481,81	194.405,83	671.363,44
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.747.048,80	0,00	0,00	1.757.751,51	10.702,71	10.702,71
	21.957.542,88	1.747.048,80	0,00	0,00	23.919.184,77	214.593,09	

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	1.318.803,30	0,00	0,00	0,00	1.315.867,00	-2.936,30	-72.314,89
	1.318.803,30	0,00	0,00	0,00	1.315.867,00	-2.936,30	

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	5.141.161,73	0,00	0,00	0,00	5.196.592,90	55.431,17	35.219,20
	5.141.161,73	0,00	0,00	0,00	5.196.592,90	55.431,17	

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	24.604.455,60	0,00	0,00	0,00	26.060.628,65	1.456.173,05	5.509.998,69
	24.604.455,60	0,00	0,00	0,00	26.060.628,65	1.456.173,05	

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	24.193.740,20	0,00	0,00	0,00	24.111.673,97	-82.066,23	3.656.807,13
	24.193.740,20	0,00	0,00	0,00	24.111.673,97	-82.066,23	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
W7 FIP MULTIELSTRATÉGIA	1.273.956,74	0,00	0,00	0,00	1.272.183,24	-1.773,50	-1.570.761,72
	1.273.956,74	0,00	0,00	0,00	1.272.183,24	-1.773,50	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CARE11	718.063,08	0,00	0,00	0,00	0,00	650.321,28	-67.741,80	41.209,50
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.480.867,11	0,00	0,00	0,00	0,00	2.543.325,36	62.458,25	-218.931,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	3.198.930,19	0,00	0,00	0,00	0,00	3.193.646,64	-5.283,55	

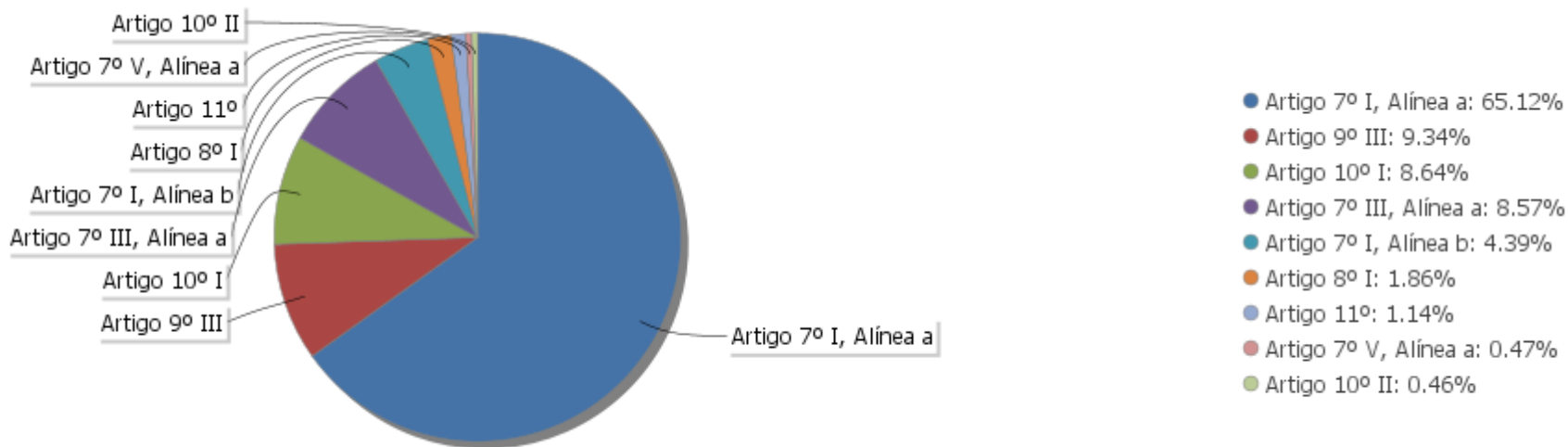
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

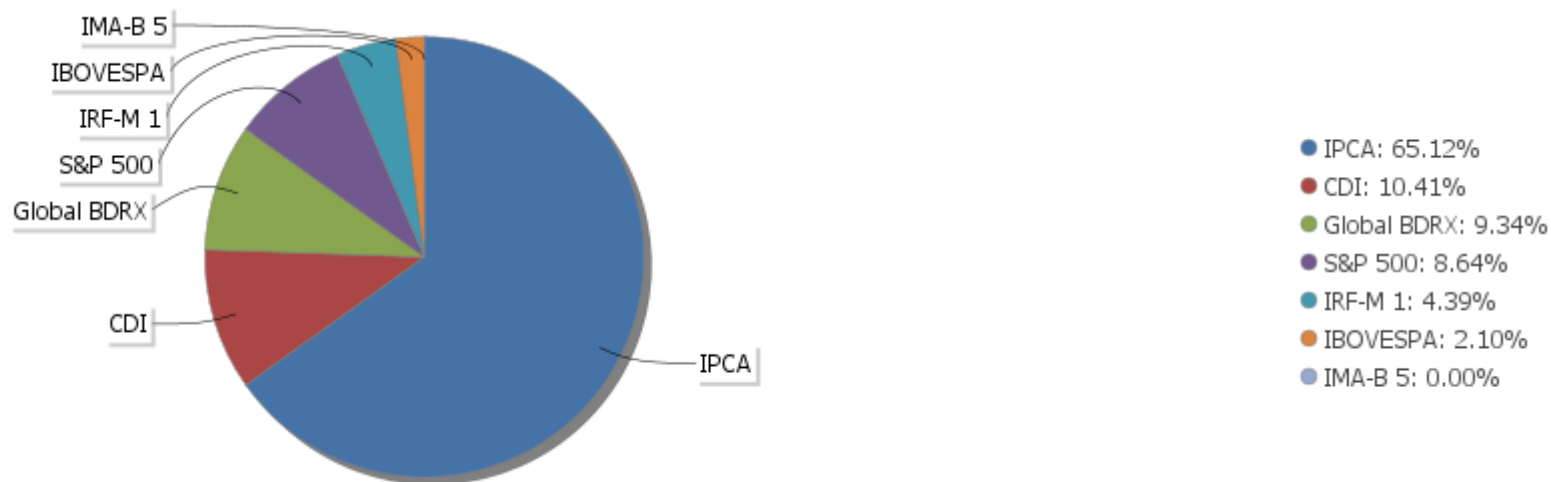
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	92.200.828,99	33,04		92.200.828,99	33,04	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00		92.200.828,99	33,04	
acima de 365 dias	186.887.765,66	66,96		279.088.594,65	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

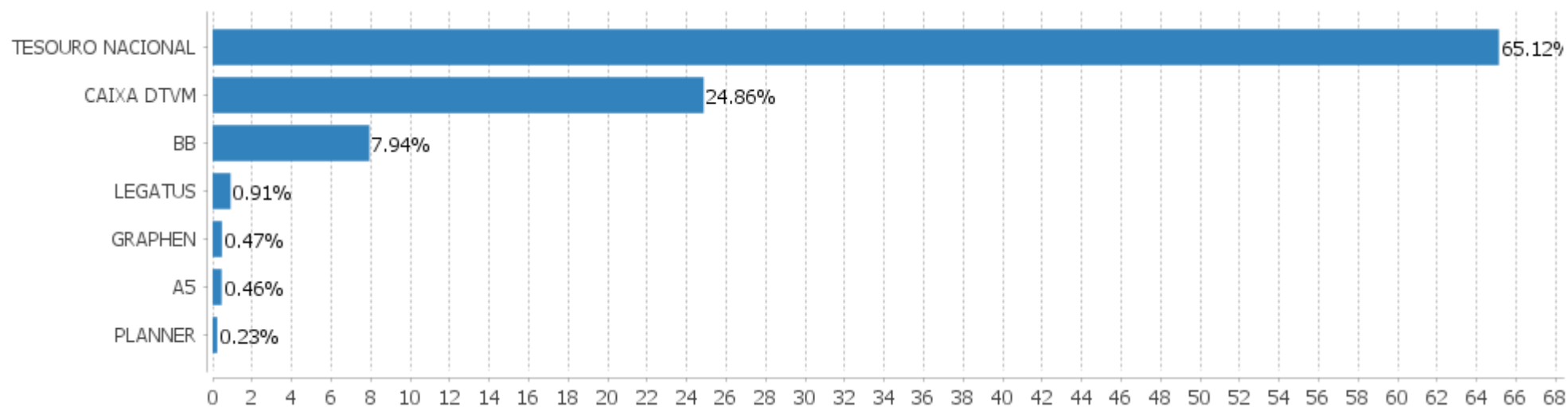


Alocação Por Estratégia



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	0,67	0,97	0,67	1,30			9,67
IPCA + 5,04%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41	0,85	1,01			8,29
p.p. indexador	0,04	-0,29	0,61	-0,78	0,45	0,75	-0,16	0,56	-0,18	0,29			1,38
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

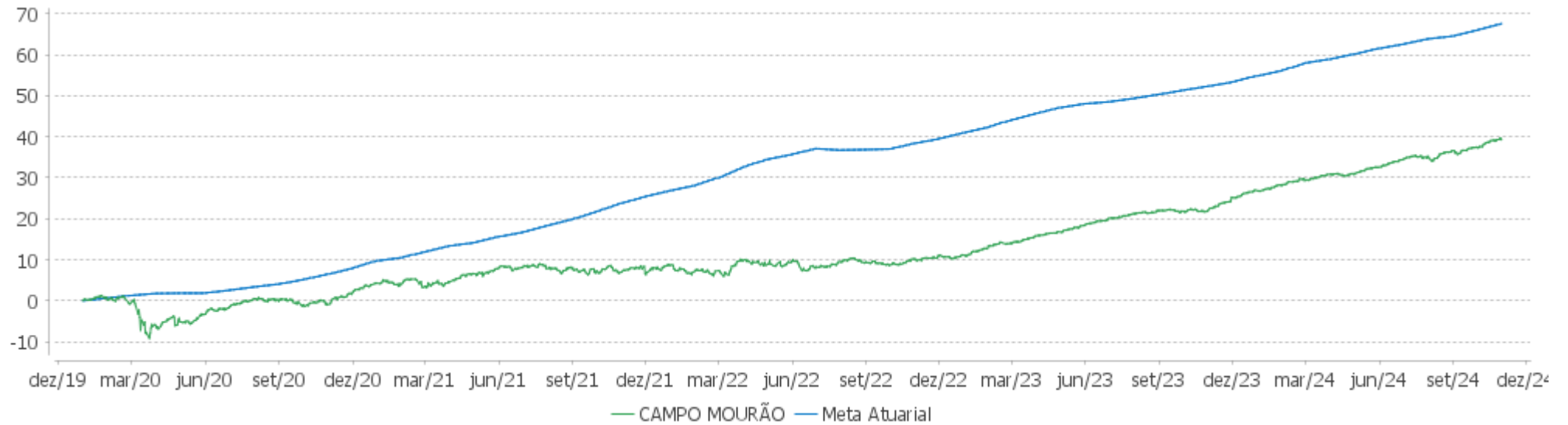
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	24	41,38
Meses abaixo - Meta Atuarial	34	58,62
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,77	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-5,49	2020-03

Relatório

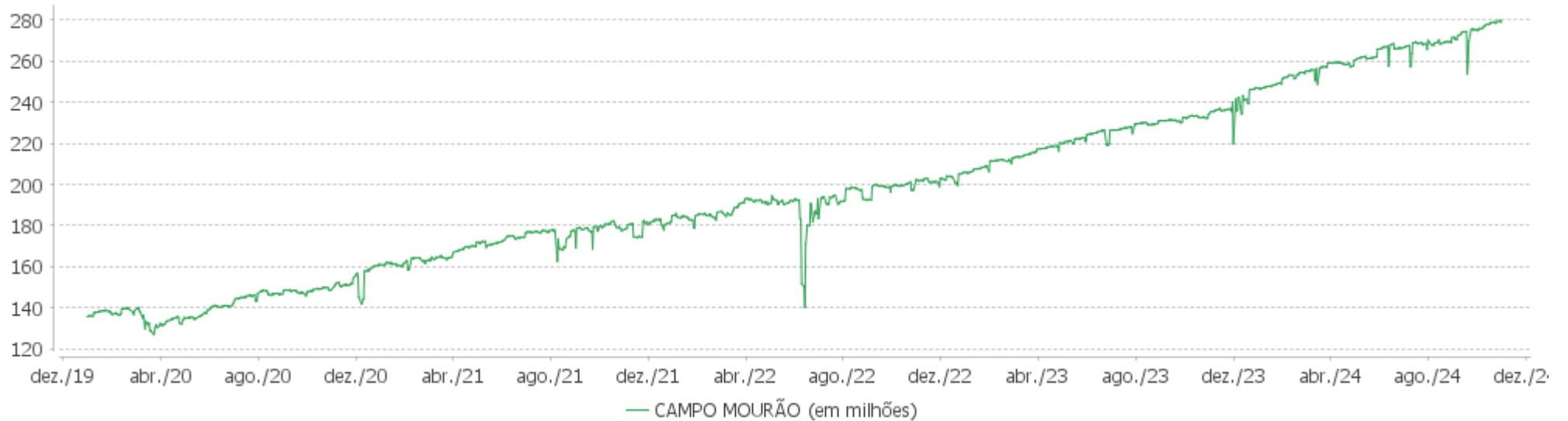
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,97	2,29	0,68	2,37
06 meses	6,45	4,67	1,78	1,99
12 meses	14,29	10,07	4,21	1,95
24 meses	26,38	21,24	5,14	1,89
36 meses	30,40	35,58	-5,18	3,12
48 meses	40,71	58,27	-17,57	3,49
Desde 31/12/2019	39,26	69,63	-30,37	4,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

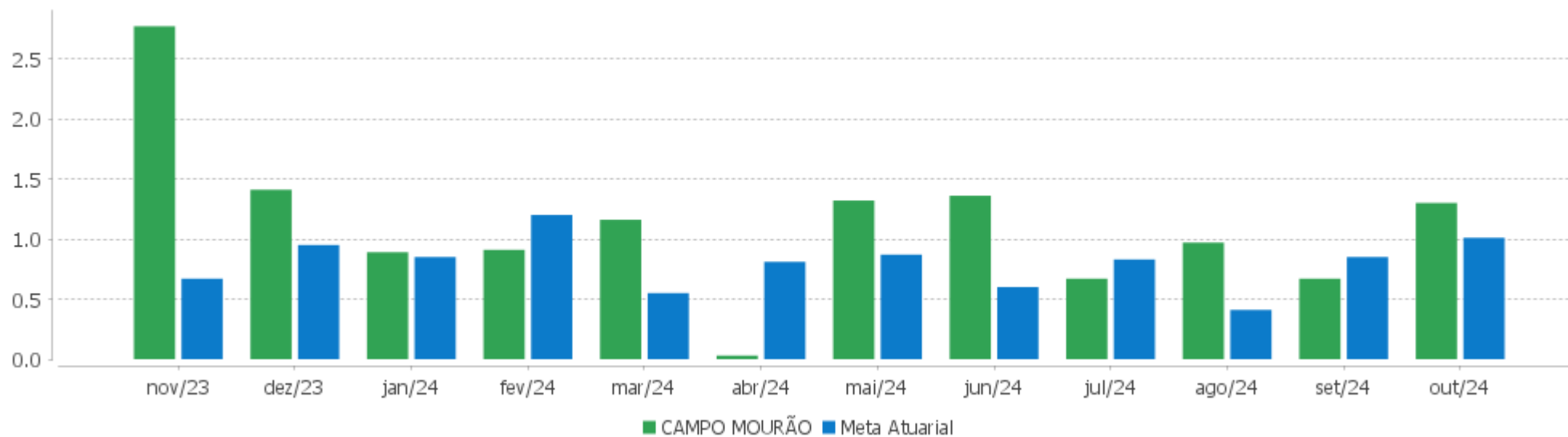


Patrimônio Líquido



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.	1,03 0,47	9,00 5,12	2,41 1,43	4,98 2,93	10,84 6,08	23,21 13,41	35,38 18,47
NTN-B 150535 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,46	8,97 5,08	2,40 1,42	4,96 2,91	10,76 6,00	23,08 13,27	31,38 14,47
NTN-B 150555 (6,070000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,49	6,09 2,21	2,48 1,50	2,09 0,04	4,64 -0,12		
NTN-B 150850 (6,320000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,51	6,20 2,32	2,54 1,56	5,25 3,20	7,90 3,15		
NTN-B 150840 (5,820000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	9,03 5,14	2,42 1,44	4,99 2,95	10,87 6,11	23,28 13,48	35,48 18,57
NTN-B 150850 (5,820000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	9,03 5,14	2,42 1,44	4,99 2,95	10,93 6,17	23,35 13,54	35,58 18,67
NTN-B 150555 (5,790000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	9,00 5,12	2,41 1,43	4,98 2,93	10,92 6,16	23,30 13,50	31,73 14,82
NTN-B 150850 (6,070000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,49	6,09 2,21	2,48 1,50	5,12 3,08	7,75 2,99		
NTN-B 150545 (6,030000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,49	6,07 2,19	2,47 1,49	2,08 0,04	4,63 -0,12		
NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,46	5,94 2,05	2,39 1,41	4,95 2,90	7,54 2,78	12,97 3,16	
NTN-B 150545 (5,680000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,46	8,90 5,02	2,38 1,40	4,92 2,88	10,76 6,00	22,99 13,19	31,33 14,42
NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,46	8,90 5,01	2,38 1,40	4,92 2,87	10,77 6,01	16,34 6,53	
NTN-B 150535 (6,250000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,51	6,21 2,32	2,53 1,54	2,14 0,10	4,75 -0,01		
NTN-B 150850 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,46	5,89 2,01	2,40 1,42	4,97 2,92	7,50 2,74	12,94 3,13	
NTN-B 150850 (5,660000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,45	8,89 5,00	2,38 1,39	4,91 2,87	10,76 6,00	16,32 6,52	
NTN-B 150850 (6,190000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,50	3,04 -0,84	-0,49 -1,47	2,11 0,06	4,67 -0,09		
NTN-B 150850 (5,640000%)	1,01	8,87	2,37	4,90	10,74	16,30	

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.	0,45	4,99	1,39	2,86	5,98	6,49	
NTN-B 150850 (5,630000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,45	5,89 2,01	2,37 1,39	4,90 2,85	7,47 2,72	12,88 3,07	
NTN-B 150840 (6,030000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,49	6,07 2,19	2,47 1,49	5,10 3,06	7,72 2,97		
NTN-B 150850 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,51	3,05 -0,83	-0,51 -1,49	2,12 0,08	4,70 -0,06		
NTN-B 150555 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,46	8,97 5,09	2,40 1,42	4,96 2,92	10,89 6,13	23,23 13,42	31,65 14,74
NTN-B 150850 (5,930000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,48	9,12 5,24	2,45 1,46	5,05 3,00	11,05 6,29	23,61 13,80	35,95 19,04
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,72 -0,02	5,89 -0,19	1,69 -0,05	4,04 -0,12	9,33 -0,24	19,24 -0,43	34,25 -0,64
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,83 -0,02	7,99 -0,10	2,40 -0,05	4,77 -0,11	10,00 -0,15	24,59 -0,42	38,60 -0,80
GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS % do CDI	-0,22 -23,99	-2,16 -24,02	-0,64 -23,97	-1,26 -23,84	-2,46 -22,41	-2,19 -8,46	-8,97 -22,23
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,93 100,55	9,12 101,45	2,69 101,41	5,38 102,04	11,11 101,23	25,94 100,28	40,79 101,14
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,85 91,14	8,10 90,09	2,40 90,56	4,75 90,13	9,90 90,14	23,39 90,42	36,21 89,77
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,91 98,23	9,23 102,66	2,67 100,77	5,40 102,44	11,31 102,99	26,50 102,45	41,39 102,62
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	1,08 2,67	0,68 4,02	7,35 5,73	5,48 2,47	22,19 7,55	20,71 8,93	38,86 13,53
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	5,92 -0,10	48,88 -1,62	6,17 -0,21	28,45 -0,68	62,54 -2,23	89,30 -5,72	33,96 -4,24
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-0,34 -5,34	23,65 -19,11	4,51 -0,92	15,67 -10,91	42,23 -13,19	66,12 4,17	52,31 25,46
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,14 -15,00	-55,25 -614,42	-0,37 -14,08	-20,05 -380,34	-55,38 -504,40	-56,15 -217,07	-59,79 -148,24
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	-9,43 -7,84	6,36 9,69	-16,28 -17,89	-22,91 -25,91	7,14 -7,51	-61,55 -73,34	-42,86 -68,19
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING % do CDI	2,52 271,31	-7,29 -81,11	2,48 93,33	2,42 45,87	70,05 638,06	244,09 943,57	2,01 4,97
CAMPO MOURÃO	1,30	9,67	2,97	6,45	14,29	26,38	30,40

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.	0,29	1,38	0,68	1,78	4,23	5,23	-5,09
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24

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 REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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 CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	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 MULTISTRATÉGIA	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	0,84	8,08	2,45	4,88	10,15	25,01	39,40	41,88	47,64
IRF-M 1+	-0,14	2,35	0,56	2,01	7,39	21,52	36,19	28,16	34,10
IRF-M TOTAL	0,21	4,12	1,21	2,94	8,27	22,29	36,91	32,39	38,26
IMA-B 5	0,74	6,08	1,74	4,16	9,57	19,66	34,90	40,87	48,92
IMA-B 5+	-1,66	-4,23	-2,31	0,15	2,92	11,54	22,86	21,61	14,50
IMA-B TOTAL	-0,65	0,16	-0,80	1,63	5,62	15,10	28,22	30,57	29,26
IMA-GERAL TOTAL	0,38	5,39	1,52	3,92	9,08	21,85	36,23	37,66	41,34
IDKA 2	0,81	5,86	1,81	3,85	9,37	19,24	34,15	40,34	49,79
IDKA 20	-4,24	-13,00	-6,80	-4,11	-2,93	4,69	12,47	6,78	-7,39
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33	38,06	20,98
IBRX 100	-1,53	-2,74	1,84	2,99	15,29	11,28	24,40	37,33	22,16
IBRX 50	-1,49	-1,71	1,51	3,10	15,95	12,48	27,12	41,91	24,29
SMALL CAP	-1,37	-14,85	-1,46	-3,76	2,51	-14,14	-14,08	-10,98	-16,47
Índice Consumo - ICON	-0,02	-11,24	1,22	1,62	9,43	-22,91	-34,44	-40,10	-41,26
Índice Dividendos - IDIV	-1,72	2,45	4,09	7,11	21,24	28,86	50,07	70,74	52,68

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	5,00	42,76	5,43	26,58	55,42	61,95	26,85	74,67	171,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-3,06	-3,22	-4,75	-5,23	1,56	7,13	19,78	15,83	14,79

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,63	36,63	4,32	22,90	49,35	56,01	14,35	51,21	124,74

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	3,88	0,98	2,05	4,76	9,81	16,91	29,39	34,46
INPC	0,61	3,92	0,95	1,93	4,60	8,93	15,97	28,82	34,96
IGPM	1,52	4,20	2,45	4,83	5,59	0,76	7,33	30,65	58,00
SELIC	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,92	7,39	2,02	4,13	8,97	18,77	31,51	51,32	63,49
IPCA + 5,00%	1,01	8,26	2,28	4,65	10,02	21,06	35,34	57,21	71,47
IPCA + 5,50%	1,05	8,69	2,41	4,90	10,54	22,22	37,28	60,22	75,58
IPCA + 5,89%	1,09	9,03	2,51	5,10	10,95	23,12	38,81	62,60	78,84
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24	63,27	79,77
INPC + 4,00%	0,97	7,43	1,99	4,02	8,80	17,82	30,45	50,65	64,10
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12	62,56	80,45

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%)	606.784,84	5,750000	562.953,62	6,785700	-43.831,22
NTN-B 150535 (6,250000%)	8.358.150,05	6,250000	8.042.194,58	6,785700	-315.955,47
NTN-B 150545 (5,680000%)	11.157.291,69	5,680000	9.889.235,76	6,780000	-1.268.055,93
NTN-B 150545 (6,030000%)	35.762,55	6,030000	32.964,12	6,780000	-2.798,43
NTN-B 150555 (5,760000%)	44.787.064,64	5,760000	39.550.220,46	6,717600	-5.236.844,18
NTN-B 150555 (5,790000%)	11.190.781,73	5,790000	9.922.348,83	6,717600	-1.268.432,90
NTN-B 150555 (6,070000%)	106.743,54	6,070000	98.241,08	6,717600	-8.502,46
NTN-B 150840 (5,790000%)	10.251.099,99	5,790000	9.385.942,58	6,706700	-865.157,41
NTN-B 150840 (5,820000%)	539.369,99	5,820000	495.300,40	6,706700	-44.069,59
NTN-B 150840 (6,030000%)	17.615,08	6,030000	16.510,01	6,706700	-1.105,07
NTN-B 150850 (5,630000%)	2.071.961,44	5,630000	1.806.140,60	6,736300	-265.820,84
NTN-B 150850 (5,640000%)	19.308.796,34	5,640000	16.853.287,91	6,736300	-2.455.508,43
NTN-B 150850 (5,660000%)	8.389.822,78	5,660000	7.341.746,37	6,736300	-1.048.076,41
NTN-B 150850 (5,670000%)	22.665.398,78	5,670000	19.859.484,55	6,736300	-2.805.914,23
NTN-B 150850 (5,730000%)	5.894.071,57	5,730000	5.204.275,91	6,736300	-689.795,66
NTN-B 150850 (5,770000%)	7.621.363,74	5,770000	6.767.983,04	6,736300	-853.380,70
NTN-B 150850 (5,820000%)	5.419.646,44	5,820000	4.840.623,09	6,736300	-579.023,35
NTN-B 150850 (5,930000%)	6.495.654,65	5,930000	5.883.094,51	6,736300	-612.560,14
NTN-B 150850 (6,070000%)	1.713.955,23	6,070000	1.579.869,47	6,736300	-134.085,76
NTN-B 150850 (6,190000%)	2.634.281,41	6,190000	2.464.758,00	6,736300	-169.523,41
NTN-B 150850 (6,320000%)	2.358.594,76	6,320000	2.242.525,72	6,736300	-116.069,04
NTN-B 150850 (6,350000%)	10.132.178,82	6,350000	9.669.124,42	6,736300	-463.054,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
536	02/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	340.000,00	0,00	62.848,19517500	5,4098610000
539	03/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.000.000,00	275.180,68363688	3,6339760000
535	03/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.000.000,00	0,00	184.769,48805300	5,4121490000
533	16/10/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	65.465,07	14.985,47903100	4,3685670000
538	30/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	532.000,00	145.420,71126900	3,6583510000
537	31/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	158.483,73	0,00	43.305,48199800	3,6596690000
534	31/10/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	407.048,80	0,00	74.622,25408800	5,4547910000
Total			1.905.532,53	1.597.465,07		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.856.671,31

Value-At-Risk: 1,38%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,09	0,06		-0,01	0,79	1,00	219.253.869,25	78,56
Artigo 8º	12,53	7,77		0,01	0,01	1,08	5.196.592,90	1,86
Artigo 9º	13,86	8,97		0,76	0,36	5,92	26.060.628,65	9,34
Artigo 10º	10,61	7,37		0,62	-0,12	-0,33	25.383.857,21	9,10
Artigo 11º	12,54	3,67		-0,00	-0,09	-0,17	3.193.646,64	1,14
CAMPO MOURÃO	2,06	1,38		1,38	0,18	1,30	279.088.594,65	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,06%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,750000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,27	1,02	606.784,84	0,22
NTN-B 150535 (6,250000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,86	1,07	8.358.150,05	2,99
NTN-B 150840 (5,790000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,32	1,03	10.251.099,99	3,67
NTN-B 150840 (5,820000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,35	1,03	539.369,99	0,19
NTN-B 150840 (6,030000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,60	1,05	17.615,08	0,01
NTN-B 150545 (5,680000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,19	1,02	11.157.291,69	4,00
NTN-B 150545 (6,030000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,60	1,05	35.762,55	0,01
NTN-B 150850 (5,630000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,13	1,01	2.071.961,44	0,74
NTN-B 150850 (5,640000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,14	1,01	19.308.796,34	6,92
NTN-B 150850 (5,660000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,16	1,01	8.389.822,78	3,01
NTN-B 150850 (5,670000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,18	1,02	22.665.398,78	8,12
NTN-B 150850 (5,730000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,25	1,02	5.894.071,57	2,11
NTN-B 150850 (5,770000%)	0,29	0,23	-0,00	0,23	0,33	1,02	7.621.363,74	2,73
NTN-B 150850 (5,820000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,35	1,03	5.419.646,44	1,94
NTN-B 150850 (5,930000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,48	1,04	6.495.654,65	2,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (6,070000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,65	1,05	1.713.955,23	0,61
NTN-B 150850 (6,190000%)	0,07	0,20	-0,00	0,20	1,79	1,06	2.634.281,41	0,94
NTN-B 150850 (6,320000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,94	1,07	2.358.594,76	0,85
NTN-B 150850 (6,350000%)	0,07	0,20	-0,00	0,20	1,98	1,07	10.132.178,82	3,63
NTN-B 150555 (5,760000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,28	1,02	44.787.064,64	16,05
NTN-B 150555 (5,790000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,32	1,03	11.190.781,73	4,01
NTN-B 150555 (6,070000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,65	1,05	106.743,54	0,04
Sub-total	0,07	0,07	-0,00		1,34	1,03	181.756.390,06	65,12

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,86	NaN	0,00	NaN	-0,11	0,72	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,30	0,24	-0,00	0,02	-0,34	0,83	12.262.427,42	4,39
Sub-total	0,30	0,24	-0,00		-0,34	0,83	12.262.427,42	4,39

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,02	-0,00	0,02	-1,34	0,85	1.130.951,45	0,41
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,02	-0,00	0,02	0,10	0,93	21.030.481,81	7,54
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,03	-0,00	0,03	-0,40	0,91	1.757.751,51	0,63
Sub-total	0,05	0,02	-0,00		-0,00	0,93	23.919.184,77	8,57

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	0,74	0,05	-0,00	0,05	-1,56	-0,22	1.315.867,00	0,47
Sub-total	0,74	0,05	-0,00		-1,56	-0,22	1.315.867,00	0,47

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,77%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	12,53	7,77	0,01	4,81	0,01	1,08	5.196.592,90	1,86
Sub-total	12,53	7,77	0,01		0,01	1,08	5.196.592,90	1,86

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,97%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,86	8,97	0,76	1,01	0,36	5,92	26.060.628,65	9,34
Sub-total	13,86	8,97	0,76		0,36	5,92	26.060.628,65	9,34

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,37%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,15	7,76	0,62	6,17	-0,11	-0,34	24.111.673,97	8,64
Sub-total	11,15	7,76	0,62		-0,11	-0,34	24.111.673,97	8,64

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	0,46	1,02	-0,00	1,02	-2,31	-0,14	1.272.183,24	0,46
Sub-total	0,46	1,02	-0,00		-2,31	-0,14	1.272.183,24	0,46

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 3,67%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARE11	39,86	17,92	-0,00	19,18	-0,26	-9,43	650.321,28	0,23
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	8,23	0,11	-0,00	0,11	0,19	2,52	2.543.325,36	0,91
Sub-total	12,54	3,67	-0,00		-0,09	-0,17	3.193.646,64	1,14

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

-Referente ao mês de outubro de 2024, vale observar que:

- O fundo GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo W7 FIP MULTISTRATÉGIA não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo CARE11 não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações