



LDB
EMPRESAS

JALES
DEZEMBRO 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 31.12.2024.

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

74,84%

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 150826 (6,420000%)	0,22	0,06	1,04	4,47	1.560.359,89	2,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,450000%)	3,49	0,05	1,05	3,99	44.559,25	0,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,350000%)	0,22	0,05	1,04	4,45	1.559.084,57	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,160000%)	3,49	0,05	1,02	3,89	44.668,26	0,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,360000%)	0,23	0,07	1,04	4,45	1.558.605,28	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (8,250000%)	0,22	0,06	0,33	0,33	1.002.668,19	1,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (7,910000%)	0,22	0,06	0,33	0,33	1.004.606,79	1,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	7,77	0,06	-4,89	-9,92	2.400.811,32	3,39
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,73	0,06	-0,84	2,78	9.175.363,55	12,97

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,82	0,05	0,17	8,12	1.338.875,18	1,89	5.307.578.902,09	0,03
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	2,40	0,06	0,10	3,24	2.830.475,53	4,00	3.989.816.161,41	0,07
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	3,68	0,06	-1,35	1,12	1.385.860,54	1,96	866.343.412,93	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,34	0,06	-0,29	5,43	844.419,63	1,19	3.604.057.716,61	0,02

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 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,66	0,05	-2,66	-2,72	3.819.604,88	5,40	2.738.410.858,21	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,21	0,05	-1,69	1,59	4.759.005,43	6,73	1.237.222.864,67	0,38
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	0,05	0,05	0,61	0,61	3.864.355,23	5,46	3.764.444.627,39	0,10
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,40	0,05	-1,12	3,82	18.842.596,42	26,64		

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	4,60	0,00	-1,65	-1,84	0,00	0,00	601.103.699,33	0,00
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,09	0,04	0,86	4,53	7.194.696,67	10,17	15.214.543.760,15	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	0,83	11,03	3.139.594,70	4,44	18.901.575.347,13	0,02
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,06	0,04	0,86	5,52	7.572.233,98	10,71	6.911.306.522,53	0,11
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,08	0,04	0,84	9,38	3.268.059,46	4,62	3.156.991.525,99	0,10
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,56	0,00	0,14	4,85	0,00	0,00	921.018.548,51	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,81	0,04	0,50	8,77	21.174.584,81	29,94		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SANTANDER	SANTANDER	LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 5,74% a.a	2,99	0,86	0,86	7,68	2.153.627,46	3,05		
SANTANDER	SANTANDER	LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a.a	3,45	0,93	0,93	5,48	1.582.192,05	2,24		
Sub-total Artigo 7º IV			2,97	0,89	0,89	7,51	3.735.819,51	5,28		
Renda Fixa			1,59	0,11	-0,24	6,28	52.928.364,29	74,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

12,92%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,35	-0,01	-5,86	-8,34	1.087.945,91	1,54	717.828.046,04	0,15
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	12,11	-0,01	-4,79	-11,36	872.505,68	1,23	662.015.115,05	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,08	-0,00	-7,99	-25,56	410.664,77	0,58	480.746.975,23	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	17,04	-0,01	-7,69	-8,24	5.315.789,45	7,52	620.069.096,40	0,86
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	15,45	-0,01	-1,21	-2,88	1.449.243,88	2,05	604.011.896,67	0,24
Sub-total Artigo 8º I			15,28	-0,01	-6,24	-10,12	9.136.149,69	12,92		
Renda Variável			15,28	-0,01	-6,24	-10,12	9.136.149,69	12,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,44%

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				
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	15,98	-0,00	3,21	55,74	5.261.426,77	7,44	1.932.886.786,33	0,27
Sub-total Artigo 9º III			15,98	-0,00	3,21	55,74	5.261.426,77	7,44		
Investimentos no Exterior			15,98	-0,00	3,21	55,74	5.261.426,77	7,44		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,80%

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	FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	0,83	0,04	0,92	10,31	3.393.047,96	4,80	59.623.974,92	5,69
Sub-total Artigo 10º I			0,83	0,04	0,92	10,31	3.393.047,96	4,80		
Investimentos Estruturados			0,83	0,04	0,92	10,31	3.393.047,96	4,80		
Total			3,01	0,08	-0,78	6,44	70.718.988,71	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	79.337,30
Sub-total Disponibilidades Financeiras	79.337,30
Total	70.798.326,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	9.175.363,55	12,97	0,00	12,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	18.842.596,42	26,64	0,00	28,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	21.174.584,81	29,94	0,00	22,00	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	3.735.819,51	5,28	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	52.928.364,29	74,84					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.136.149,69	12,92	0,00	15,30	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	9.136.149,69	12,92					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	5.261.426,77	7,44	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.261.426,77	7,44					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.393.047,96	4,80	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	3.393.047,96	4,80					15,00
Total		70.718.988,71	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	-0,84 -90,24	2,78 25,55	-0,40 -14,92	2,40 44,62	2,78 25,55	-67.806,12	-0,10	181.418,89
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,12 -120,93	3,82 35,09	-1,02 -38,38	0,65 12,16	3,82 35,09	-199.742,36	-0,29	1.202.799,33
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,50 53,41	8,77 80,66	1,94 72,50	4,85 90,24	8,77 80,66	101.747,19	0,15	1.539.045,23
Artigo 7º IV % do CDI	0,89 95,69	7,51 89,96	2,91 109,06	5,12 95,33		32.875,51	0,05	235.819,51
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-6,24 -1,95	-10,12 0,24	-7,59 1,16	-1,96 0,96	-10,12 0,24	-607.607,43	-0,87	-1.053.108,07
Artigo 9º III % do CDI	3,21 346,24	55,74 512,63	18,37 688,04	19,64 365,57	55,74 512,63	163.766,31	0,23	1.883.157,80
Artigo 10º I % do CDI	0,92 99,61	10,31 94,79	2,32 86,79	5,13 95,57	10,31 94,79	31.071,77	0,04	317.067,21
JALES (Total)						-545.695,13	-0,78	4.306.199,90

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 150527 (6,350000%)	1.543.063,82	0,00	0,00	0,00	1.559.084,57	16.020,75	67.701,71
NTN-B 150529 (7,910000%)	0,00	1.001.347,52	0,00	0,00	1.004.606,79	3.259,27	3.259,27
NTN-B 150545	2.524.270,06	0,00	0,00	0,00	2.400.811,32	-123.458,74	-271.361,38
NTN-B 150826 (6,420000%)	1.544.248,82	0,00	0,00	0,00	1.560.359,89	16.111,07	66.964,26
NTN-B 150826 (6,450000%)	44.097,92	0,00	0,00	0,00	44.559,25	461,33	1.710,88
NTN-B 150828 (6,160000%)	44.215,87	0,00	0,00	0,00	44.668,26	452,39	1.672,26
NTN-B 150828 (6,360000%)	1.542.584,54	0,00	0,00	0,00	1.558.605,28	16.020,74	66.542,21
NTN-B 150828 (8,250000%)	0,00	999.341,12	0,00	0,00	1.002.668,19	3.327,07	3.327,07
	7.242.481,03	2.000.688,64	0,00	0,00	9.175.363,55	-67.806,12	181.418,89

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1.336.609,96	0,00	0,00	0,00	1.338.875,18	2.265,22	98.278,22
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	2.827.534,93	0,00	0,00	0,00	2.830.475,53	2.940,60	89.110,76
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	1.404.867,42	0,00	0,00	0,00	1.385.860,54	-19.006,88	15.674,45
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	846.863,42	0,00	0,00	0,00	844.419,63	-2.443,79	43.664,08
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.924.068,93	0,00	0,00	0,00	3.819.604,88	-104.464,05	-107.722,46
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.025.759,84	0,00	-1.172.114,65	0,00	4.759.005,43	-94.639,76	84.967,82
SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	0,00	3.848.748,93	0,00	0,00	3.864.355,23	15.606,30	15.606,30
	16.365.704,50	3.848.748,93	-1.172.114,65	0,00	18.842.596,42	-199.742,36	1.202.799,33

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 IMA-B	2.947.594,83	0,00	-2.884.808,96	0,00	0,00	-62.785,87	-68.442,03
BRDESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	7.133.101,13	0,00	0,00	0,00	7.194.696,67	61.595,54	277.756,54
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.064.994,08	1.052.867,22	-3.007.298,04	0,00	3.139.594,70	29.031,44	556.913,70
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	7.507.938,65	0,00	0,00	0,00	7.572.233,98	64.295,33	318.202,14
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	1.073.903,46	3.607.973,46	-1.421.275,96	0,00	3.268.059,46	7.458,50	230.247,67
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	1.576.919,72	0,00	-1.579.071,97	0,00	0,00	2.152,25	70.513,74
	25.304.451,87	4.660.840,68	-8.892.454,93	0,00	21.174.584,81	101.747,19	1.539.045,23

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 5,74% a.a	2.135.306,80	0,00	0,00	0,00	2.153.627,46	18.320,66	153.627,46
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a.a	1.567.637,20	0,00	0,00	0,00	1.582.192,05	14.554,85	82.192,05
	3.702.944,00	0,00	0,00	0,00	3.735.819,51	32.875,51	235.819,51

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\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	1.155.628,04	0,00	0,00	0,00	1.087.945,91	-67.682,13	-98.942,85
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	916.370,28	0,00	0,00	0,00	872.505,68	-43.864,60	-111.845,60
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	446.337,43	0,00	0,00	0,00	410.664,77	-35.672,66	-140.973,15
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	5.758.389,91	0,00	0,00	0,00	5.315.789,45	-442.600,46	-477.333,33
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	1.467.031,46	0,00	0,00	0,00	1.449.243,88	-17.787,58	-44.080,14
	9.743.757,12	0,00	0,00	0,00	9.136.149,69	-607.607,43	-1.053.108,07

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	5.097.660,46	0,00	0,00	0,00	5.261.426,77	163.766,31	1.883.157,80
	5.097.660,46	0,00	0,00	0,00	5.261.426,77	163.766,31	1.883.157,80

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	3.361.976,19	0,00	0,00	0,00	3.393.047,96	31.071,77	317.067,21
	3.361.976,19	0,00	0,00	0,00	3.393.047,96	31.071,77	317.067,21

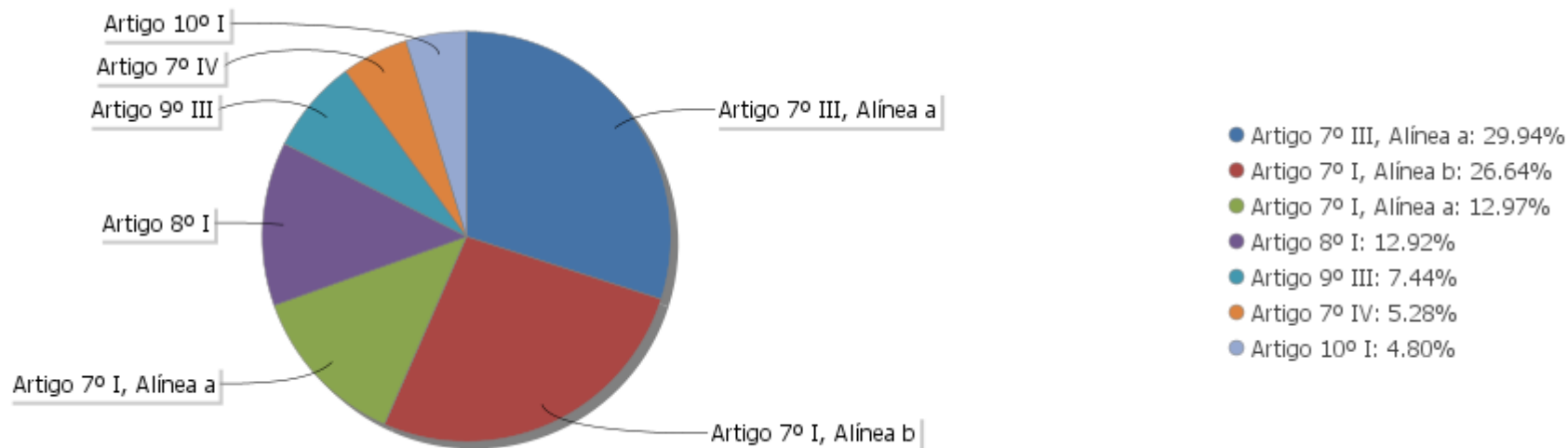
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

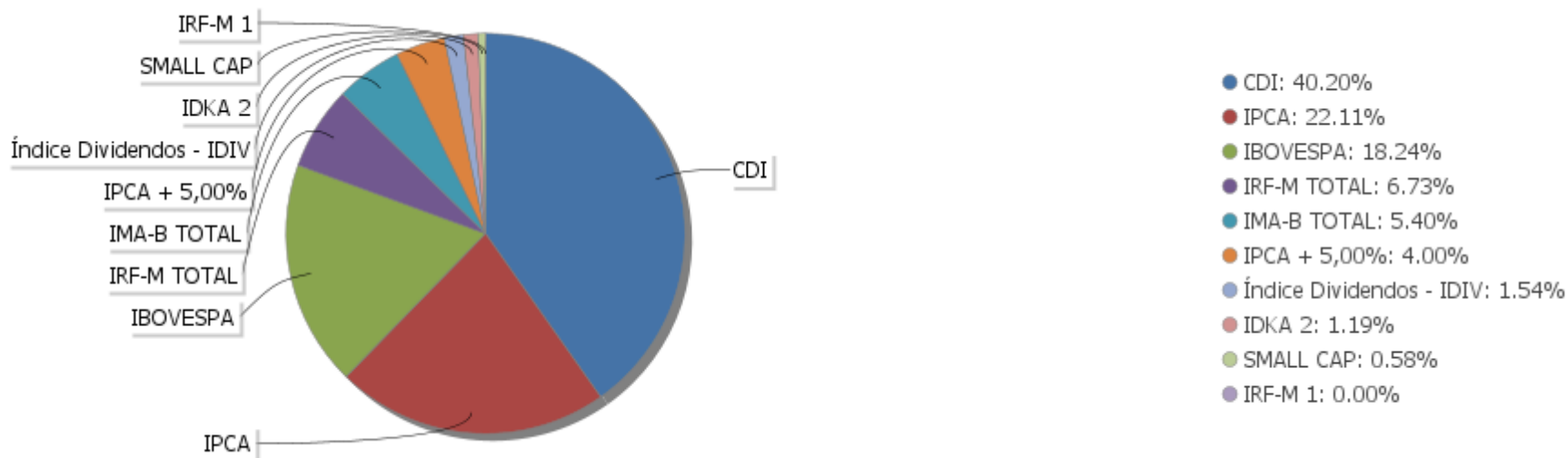
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	51.269.720,02	72,50		51.269.720,02	72,50	
de 31 dias a 365 dias	2.321.749,56	3,28		53.591.469,58	75,78	
acima de 365 dias	17.127.519,13	24,22		70.718.988,71	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

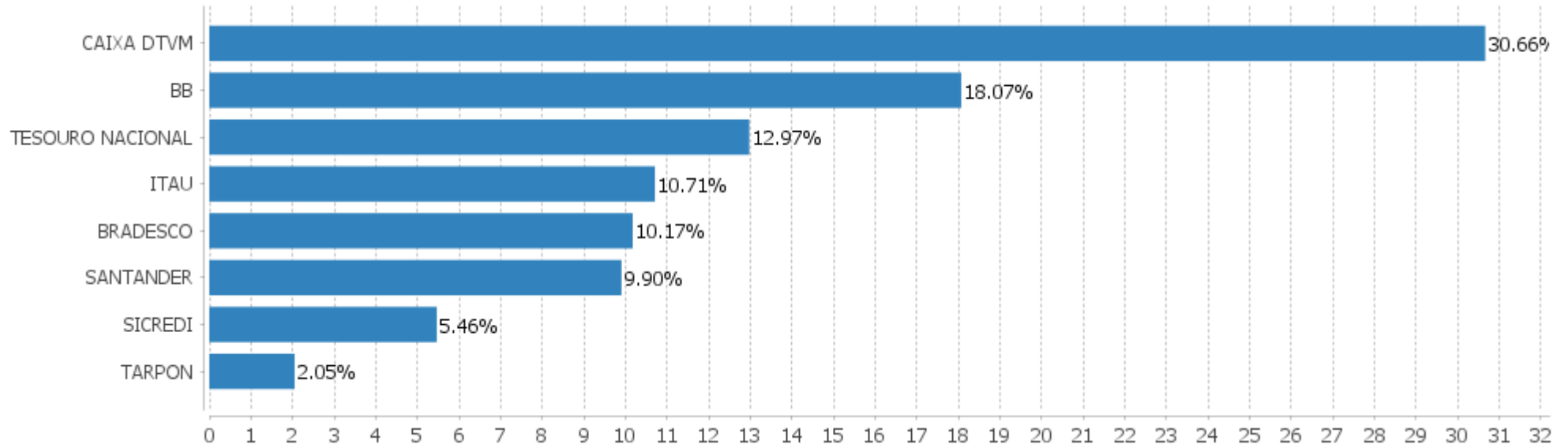


Alocação Por Estratégia



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	0,22	1,17	0,73	-0,95	0,73	0,84	1,11	1,76	-0,04	0,78	0,71	-0,78	6,44
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59	0,82	0,40	0,84	1,00	0,76	0,92	10,03
p.p. indexador	-0,62	-0,02	0,19	-1,75	-0,14	0,25	0,28	1,36	-0,88	-0,23	-0,04	-1,71	-3,59

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	4	33,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	8	66,67

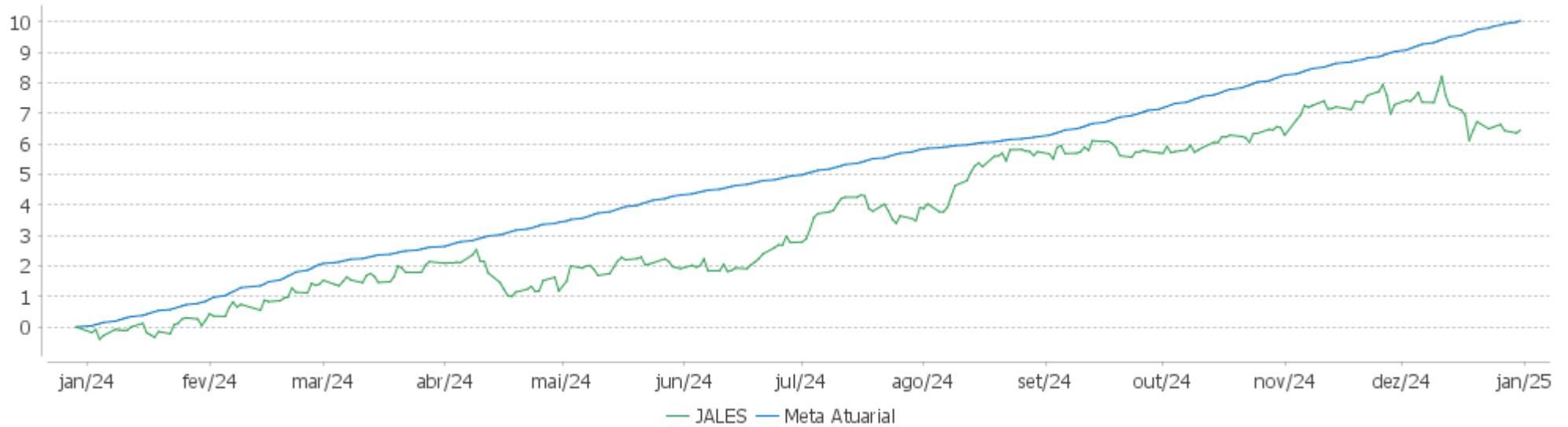
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,76	2024-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,95	2024-04

Relatório

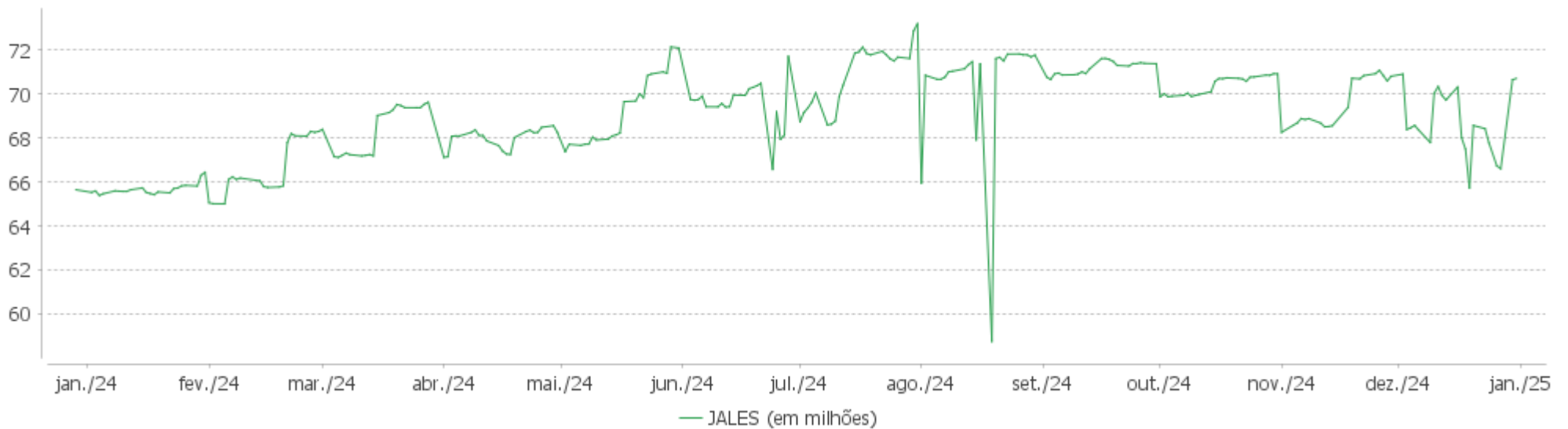
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,70	2,71	-2,01	3,66
06 meses	3,57	4,85	-1,28	3,26
12 meses	6,44	10,03	-3,59	3,01
24 meses				
Desde 29/12/2023	6,44	10,03	-3,59	3,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

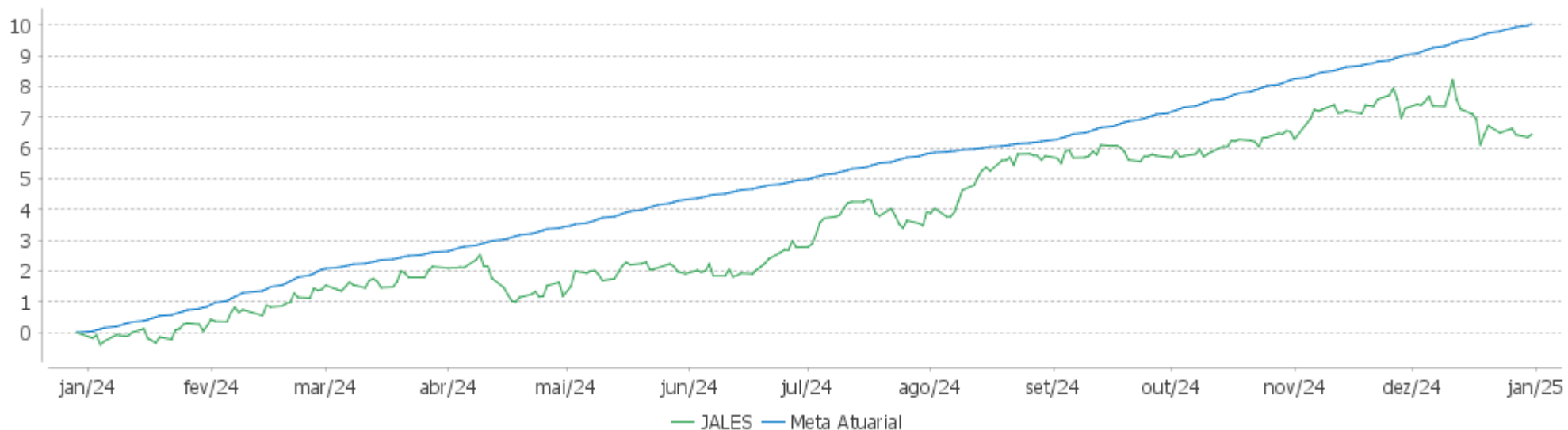


Patrimônio Líquido No Ano

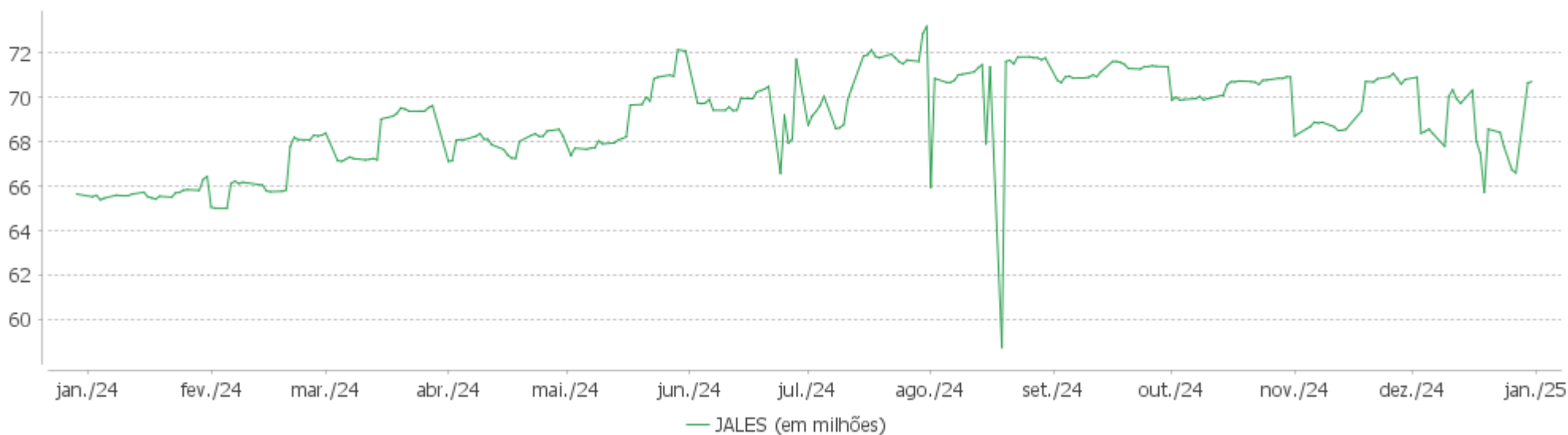


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

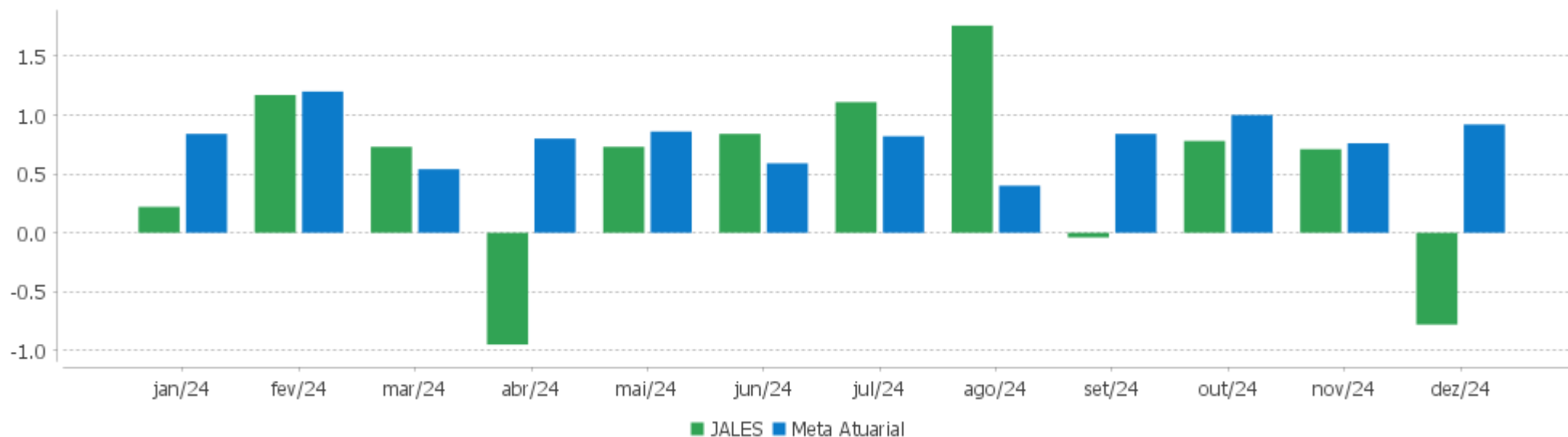


Patrimônio Líquido



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
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 5,74% a.a Var. IPCA p.p.	0,86 0,34	7,68 4,26	2,82 1,34	4,93 2,64			
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a.a Var. IPCA p.p.	0,93 0,41	5,48 3,17	3,04 1,56	5,38 3,09			
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,66 -0,04	-2,72 -0,28	-3,33 -0,09	-1,51 -0,16	-2,72 -0,28	12,71 -0,51	19,69 -0,74
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,10 -0,83	3,81 -2,22	1,40 -1,32	3,24 -1,64			
SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,86 92,82	10,88 100,06	2,63 98,66	5,37 100,00	10,88 100,06	25,31 99,87	40,77 99,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,29 -0,05	5,43 -0,40	0,67 -0,11	2,41 -0,14	5,43 -0,40	17,98 -0,69	28,65 -1,11
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,17 -0,35	8,12 3,29	1,38 -0,10	4,13 1,84	8,12 3,29	24,33 14,65	35,89 19,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-1,69 -0,03	1,59 -0,27	-2,03 -0,07	0,22 -0,12	1,59 -0,27	18,17 -0,51	28,48 -0,67
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI Var. IPCA p.p.	-1,35 -1,87	1,12 -3,71	-1,08 -2,55	0,55 -1,74	1,12 -3,71		
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	-4,89 -5,41	-9,92 -14,76	-7,02 -8,50	-4,23 -6,52	-9,92 -14,76	8,64 -1,03	11,80 -4,22
NTN-B 150826 (6,450000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,53	11,70 6,87	3,05 1,57	5,44 3,15	11,70 6,87		
NTN-B 150828 (8,250000%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,67	13,60 8,77	3,48 2,00	6,35 4,06	13,60 8,77		
NTN-B 150828 (6,360000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,52	11,62 6,79	3,02 1,55	5,41 3,12	11,62 6,79		
NTN-B 150826 (6,420000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,52	11,68 6,85	3,04 1,56	5,43 3,14	11,68 6,85		
NTN-B 150529 (7,910000%) Var. IPCA p.p.	1,16 0,64	13,24 8,41	3,40 1,92	6,17 3,88	13,24 8,41		
NTN-B 150828 (6,160000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,50	11,40 6,57	2,98 1,50	5,29 3,00	11,40 6,57		
NTN-B 150527 (6,350000%)	1,04	11,60	3,02	5,39	11,60		

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.	0,52	6,77	1,54	3,10	6,77		
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	0,86 92,30	11,18 102,85	2,61 97,66	5,40 100,46	11,18 102,85	26,27 103,68	42,85 104,90
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	0,86 93,07	11,52 105,91	2,62 98,20	5,52 102,70	11,52 105,91	26,71 105,41	43,18 105,71
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO Var. IRF-M 1 p.p.	0,56 -0,14	9,21 -0,24	1,91 -0,21	4,44 -0,29	9,21 -0,24	23,85 -0,11	38,93 0,07
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,57 0,05	-2,75 -0,31	-3,21 0,02	-1,49 -0,14	-2,75 -0,31	12,58 -0,64	19,40 -1,04
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,83 89,31	11,03 101,42	2,57 96,30	5,38 100,08	11,03 101,42	25,82 101,88	41,76 102,23
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA % do CDI	0,84 90,01	11,18 102,77	2,58 96,60	5,40 100,45	11,18 102,77	26,01 102,63	42,23 103,37
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-1,21 3,07	-1,04 9,32	-3,65 5,10	2,24 5,17	-1,04 9,32	53,68 44,06	76,74 61,99
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	-7,69 -3,40	-8,24 2,12	-7,88 0,87	-1,48 1,44	-8,24 2,12	17,37 7,75	20,27 5,52
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	-7,99	-25,56	-13,18	-12,30	-25,56	-13,30	-26,59
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-5,86 -0,97	-8,34 -5,71	-8,83 -2,24	-2,64 -3,46	-8,34 -5,71	17,01 -6,50	19,07 -20,06
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,79 -0,50	-11,36 -1,00	-7,72 1,03	-4,07 -1,15	-11,36 -1,00	3,42 -6,20	-0,17 -14,92
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,21 7,50	55,74 66,10	18,37 27,12	19,64 22,56	55,74 66,10	83,43 73,81	37,30 22,55
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO % do CDI	0,92 99,61	10,31 94,79	2,32 86,79	5,13 95,57	10,31 94,79	21,58 85,15	34,27 83,89
JALES Var. IPCA + 4,94% p.p.	-0,78 -1,71	6,44 -3,59	0,70 -2,01	3,57 -1,28	6,44 -3,59		
CDI	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85
IBOVESPA	-4,28	-10,36	-8,75	-2,92	-10,36	9,61	14,75
INPC + 6,00%	0,97	11,08	2,91	5,12	11,08	22,02	36,99
IPCA + 6,00%	1,01	11,15	2,97	5,39	11,15	23,17	38,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+3 du		1,00
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+1	D+1		0,10
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	D+1 du	D+0	D+13 du	D+15 du		2,00
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	D+1	D+1	D+90	D+92	O fundo cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro	2,00

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	0,70	9,46	2,13	4,74	9,46	23,96	38,86	42,92	48,41
IRF-M 1+	-2,96	-1,81	-4,20	-2,02	-1,81	16,38	25,01	18,77	28,81
IRF-M TOTAL	-1,66	1,86	-1,97	0,34	1,86	18,67	29,15	26,57	35,05
IMA-B 5	-0,28	6,16	0,82	2,75	6,16	19,03	30,68	36,64	47,63
IMA-B 5+	-4,37	-8,63	-6,17	-3,78	-8,63	8,98	12,58	5,20	10,99
IMA-B TOTAL	-2,62	-2,44	-3,23	-1,36	-2,44	13,22	20,43	18,91	26,53
IMA-GERAL TOTAL	-0,59	5,10	0,10	2,61	5,10	20,65	32,31	33,58	40,70
IDKA 2	-0,24	5,84	0,79	2,55	5,84	18,67	29,76	36,21	47,96
IDKA 20	-8,35	-20,91	-12,95	-10,03	-20,91	0,55	-1,38	-15,68	-13,82
CDI	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85	47,04	51,11

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,28	-10,36	-8,75	-2,92	-10,36	9,61	14,75	1,06	4,01
IBRX 100	-4,38	-9,71	-8,59	-2,71	-9,71	9,50	13,89	1,17	4,71
IBRX 50	-4,02	-8,13	-7,92	-2,14	-8,13	10,30	16,61	4,32	8,10
SMALL CAP									
Índice Consumo - ICON	-7,28	-22,56	-12,77	-9,92	-22,56	-17,15	-38,16	-54,30	-53,93
Índice Dividendos - IDIV	-4,89	-2,62	-6,59	0,81	-2,62	23,51	39,14	30,22	28,91

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	-0,26	57,72	16,01	19,99	57,72	81,80	36,93	86,59	179,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,67	-5,89	-5,74	-6,90	-5,89	8,69	11,11	8,58	-2,54

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,22	48,02	12,27	16,86	48,02	64,93	23,68	55,12	128,67

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,52	4,83	1,48	2,29	4,83	9,68	16,02	27,69	33,46
INPC	0,48	4,77	1,43	2,04	4,77	8,65	15,10	26,79	33,70
IGPM	0,94	6,54	3,80	5,38	6,54	3,15	8,77	28,11	57,76
SELIC	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85	47,04	51,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,85	9,04	2,48	4,36	9,04	18,59	30,45	49,29	62,25
IPCA + 5,00%	0,93	10,09	2,72	4,88	10,09	20,87	34,23	55,09	70,17
IPCA + 5,50%	0,97	10,62	2,84	5,13	10,62	22,02	36,15	58,05	74,24
IPCA + 5,89%	1,00	11,03	2,94	5,33	11,03	22,92	37,66	60,40	77,48
IPCA + 6,00%	1,01	11,15	2,97	5,39	11,15	23,17	38,09	61,06	78,40
INPC + 4,00%	0,81	8,98	2,43	4,10	8,98	17,48	29,41	48,24	62,54
INPC + 6,00%	0,97	11,08	2,91	5,12	11,08	22,02	36,99	59,92	78,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150527 (6,350000%)	1.559.084,57	6,350000	1.505.748,06	8,035900	-53.336,51
NTN-B 150529 (7,910000%)	1.004.606,79	7,910000	1.005.170,68	7,894200	563,89
NTN-B 150826 (6,420000%)	1.560.359,89	6,420000	1.525.153,08	8,009900	-35.206,81
NTN-B 150826 (6,450000%)	44.559,25	6,450000	43.575,80	8,009900	-983,45
NTN-B 150828 (6,160000%)	44.668,26	6,160000	42.116,27	8,118800	-2.551,99
NTN-B 150828 (6,360000%)	1.558.605,28	6,360000	1.478.280,97	8,118800	-80.324,31
NTN-B 150828 (8,250000%)	1.002.668,19	8,250000	1.006.578,78	8,118800	3.910,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
158	03/12/2024	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,00	1.000.000,00	3.609,65183500	277,0350288000
165	03/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.500.000,00	272.549,12385500	5,5035950000
155	09/12/2024	SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	1.010.000,00	0,00	667.355,56261670	1,5134361000
176	09/12/2024	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,00	1.579.071,97	601.086,08907700	2,6270313000
156	10/12/2024	SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	1.579.071,97	0,00	1.042.929,94742850	1,5140729000
162	10/12/2024	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	420.000,00	0,00	1.512,90165200	277,6122291000
160	16/12/2024	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	700.176,22	0,00	2.517,78791000	278,0918192000
171	17/12/2024	BB PREV RF IMA-B	0,00	2.200.000,00	321.389,06072400	6,8452858820
159	19/12/2024	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,00	421.275,96	1.512,90165200	278,4556167000
166	19/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	126.899,74	22.941,89843000	5,5313530000
168	19/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	19.051,19	0,00	3.444,21880100	5,5313530000
169	19/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	280.398,30	50.692,53383500	5,5313530000
170	19/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.172.114,65	393.604,17196400	2,9779020000
161	20/12/2024	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	678.694,54	0,00	2.436,67945200	278,5325495000
174	20/12/2024	NTN-B 150529 (7,910000%)	1.001.347,52	0,00	243,00000000	4.120,7716872428
175	20/12/2024	NTN-B 150828 (8,250000%)	999.341,12	0,00	239,00000000	4.181,3435983264
172	24/12/2024	BB PREV RF IMA-B	0,00	466.031,28	67.645,03147900	6,8893644780
173	24/12/2024	BB PREV RF IMA-B	0,00	218.777,68	31.755,85777400	6,8893644780
167	26/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.100.000,00	198.635,16048900	5,5377910000
157	30/12/2024	SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	1.259.676,96	0,00	827.690,64501250	1,5219176000
163	30/12/2024	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	1.809.102,70	0,00	6.484,30594300	278,9971226000
164	30/12/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.033.816,03	0,00	186.542,51923400	5,5419860000
Total			10.510.278,25	10.064.569,58		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.069.275,23

Value-At-Risk: 1,51%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	3,47	0,75	1,64	0,39	-0,35	-0,28	52.928.364,29	74,84
Artigo 8º	21,83	8,78	8,52	1,02	-0,33	-6,24	9.136.149,69	12,92
Artigo 9º	16,46	7,16	9,40	0,10	0,14	3,21	5.261.426,77	7,44
Artigo 10º	0,49	0,13	8,52	-0,00	-0,01	0,92	3.393.047,96	4,80
JALES		1,51		1,51			70.718.988,71	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,75%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (6,420000%)	0,22	0,09	-0,00	0,10	0,53	1,04	1.560.359,89	2,21
NTN-B 150826 (6,450000%)	0,21	0,08	-0,00	0,10	0,57	1,05	44.559,25	0,06
NTN-B 150527 (6,350000%)	0,21	0,08	-0,00	0,10	0,53	1,04	1.559.084,57	2,20
NTN-B 150828 (6,160000%)	0,21	0,08	-0,00	0,10	0,46	1,02	44.668,26	0,06
NTN-B 150828 (6,360000%)	0,23	0,09	-0,00	0,11	0,48	1,04	1.558.605,28	2,20
NTN-B 150828 (8,250000%)	0,21	0,08	-0,00	0,10	1,24	1,19	1.002.668,19	1,42
NTN-B 150529 (7,910000%)	0,21	0,08	-0,00	0,10	1,11	1,16	1.004.606,79	1,42
NTN-B 150545	15,85	5,18	0,11	5,19	-0,37	-4,89	2.400.811,32	3,39
Sub-total	5,43	1,37	0,11		-0,33	-0,84	9.175.363,55	12,97

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,62	0,45	0,01	0,47	-0,47	0,17	1.338.875,18	1,89
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VÉRTICE 2026 FI FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA	4,17	1,09	0,03	1,09	-0,20	0,10	2.830.475,53	4,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	7,77	2,24	0,03	2,24	-0,29	-1,35	1.385.860,54	1,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,06	1,17	0,01	0,17	-0,24	-0,29	844.419,63	1,19
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9,74	3,43	0,12	0,01	-0,37	-2,66	3.819.604,88	5,40
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,29	1,92	0,09	0,03	-0,42	-1,69	4.759.005,43	6,73
SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL REFERENCIADO DI	0,10	0,03	-0,00	0,04	-0,67	0,86	3.864.355,23	5,46
Sub-total	5,36	1,49	0,29		-0,38	-1,12	18.842.596,42	26,64

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B	9,49	NaN	0,00	NaN	-0,37	-2,57	0,00	0,00
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,08	0,03	-0,00	0,04	-0,80	0,86	7.194.696,67	10,17
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,13	0,03	-0,00	0,04	-0,76	0,83	3.139.594,70	4,44
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,07	0,02	-0,00	0,03	-0,99	0,86	7.572.233,98	10,71
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,10	0,03	-0,00	0,04	-0,94	0,84	3.268.059,46	4,62
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,65	NaN	0,00	NaN	-0,56	0,56	0,00	0,00
Sub-total	1,00	0,02	-0,00		-0,43	0,50	21.174.584,81	29,94

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 5,74% a. a	2,96	0,19	0,00	0,21	-0,02	0,86	2.153.627,46	3,05
LETRA FINANCEIRA - SANB - BANCO SANTANDER 6,63% a. a	3,20	0,20	0,00	0,23	0,00	0,93	1.582.192,05	2,24
Sub-total	3,06	0,19	0,00		-0,01	0,89	3.735.819,51	5,28

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,78%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	19,30	7,83	0,10	4,06	-0,35	-5,86	1.087.945,91	1,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,95	5,78	0,06	1,68	-0,34	-4,79	872.505,68	1,23
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,33	10,53	0,05	16,23	-0,35	-7,99	410.664,77	0,58
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	25,98	10,31	0,68	5,64	-0,33	-7,69	5.315.789,45	7,52
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	14,48	8,19	0,12	5,86	-0,15	-1,21	1.449.243,88	2,05
Sub-total	21,83	8,78	1,02		-0,33	-6,24	9.136.149,69	12,92

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,16%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	16,46	7,16	0,10	10,03	0,14	3,21	5.261.426,77	7,44
Sub-total	16,46	7,16	0,10		0,14	3,21	5.261.426,77	7,44

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,13%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	0,49	0,13	-0,00	0,12	-0,01	0,92	3.393.047,96	4,80
Sub-total	0,49	0,13	-0,00		-0,01	0,92	3.393.047,96	4,80

(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 (%)