



LDB
EMPRESAS

JALES
ABRIL 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 30.04.2024.

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 75,80%

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 150824	4,11	0,03	0,81	3,69	3.301.251,76	4,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,62	-1,16	-2,96	-4,70	2.699.633,33	3,95
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		4,45	-0,51	-0,92	-0,22	6.000.885,09	8,79

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	0,90	-0,14	0,28	2,70	1.271.708,25	1,86	6.756.075.412,20	0,02
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,86	0,03	0,80	3,63	3.319.969,03	4,86	2.887.006.869,37	0,11
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	3,18	-0,37	-1,28	-0,27	1.366.723,98	2,00	425.925.075,59	0,32
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,89	-0,62	-1,64	-1,51	3.866.941,15	5,66	4.738.343.434,12	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,31	-0,05	0,58	3,07	1.469,61	0,00	8.588.764.215,21	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,69	-0,21	-0,36	1,71	814.595,81	1,19	4.827.216.534,64	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,29	-0,34	-0,55	1,05	5.416.733,64	7,94	2.405.204.748,42	0,23
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	2,64	-0,41	-0,23	1,36	2.549.417,09	3,73	2.247.094.886,70	0,11
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,85	0,03	0,79	3,60	9.098.530,56	13,33	3.622.578.957,72	0,25
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,06	-0,21	-0,07	1,93	27.706.089,12	40,59		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,04	0,89	3,64	3.928.936,70	5,76	15.720.644.238,34	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	3,94	-0,62	-1,64	-1,57	2.906.756,24	4,26	891.566.546,86	0,33
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,04	0,94	2,08	4.992.952,13	7,31	2.900.137.907,64	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,06	-0,02	0,33	2,51	4.189.956,54	6,14	722.002.114,02	0,58
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,67	-0,10	0,27	2,38	16.018.601,61	23,47		

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	1,97	0,65	0,65	0,85	2.016.900,54	2,95		
Sub-total Artigo 7º IV			1,97	0,65	0,65	0,85	2.016.900,54	2,95		
Renda Fixa			23,26	-0,18	-0,04	16,34	51.742.476,36	75,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

14,05%

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	14,68	-1,49	-6,08	-4,20	1.137.054,27	1,67	693.903.194,65	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	20,25	-2,04	-7,83	-11,77	486.733,19	0,71	627.807.911,11	0,08
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	14,70	-1,02	-2,32	-6,48	920.523,86	1,35	770.829.305,32	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,78	-1,96	-5,35	-4,54	5.529.850,32	8,10	678.112.484,28	0,82
BRAM	BEM	BRANCO F I A SELECTION	15,30	-2,07	-6,73	-9,55	1.513.477,76	2,22	371.277.783,63	0,41
Sub-total Artigo 8º I			13,85	-1,83	-5,50	-5,90	9.587.639,40	14,05		
Renda Variável			13,85	-1,83	-5,50	-5,90	9.587.639,40	14,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,52%

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	13,84	-0,92	-2,04	11,60	3.770.232,73	5,52	1.401.576.586,91	0,27
Sub-total Artigo 9º III			13,84	-0,92	-2,04	11,60	3.770.232,73	5,52		
Investimentos no Exterior			15,75	-0,92	-2,04	11,60	3.770.232,73	5,52		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,63%

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	3,16	-0,04	0,36	2,73	3.160.027,05	4,63	71.830.833,46	4,40
Sub-total Artigo 10º I			3,16	-0,04	0,36	2,73	3.160.027,05	4,63		
Investimentos Estruturados			1,07	-0,04	0,36	2,73	3.160.027,05	4,63		
Total			2,77	-0,45	-0,95	1,18	68.260.375,54	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	1.469.170,92
Sub-total Disponibilidades Financeiras	1.469.170,92
Total	69.729.546,46

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	6.000.885,09	8,79	0,00	12,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	27.706.089,12	40,59	0,00	28,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	16.018.601,61	23,47	0,00	22,00	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	2.016.900,54	2,95	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	51.742.476,36	75,80					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.587.639,40	14,05	0,00	15,30	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	9.587.639,40	14,05					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	3.770.232,73	5,52	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	3.770.232,73	5,52					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.160.027,05	4,63	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	3.160.027,05	4,63					15,00
Total		68.260.375,54	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	-0,92 -103,77	-0,22 -6,29	-0,15 -5,77			-55.771,94	-11.555,80
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,07 -7,39	1,93 54,67	1,22 47,89			-18.394,25	525.074,26
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,27 30,60	2,38 67,38	1,66 65,05			41.771,30	381.782,62
Artigo 7º IV % do CDI	0,65 73,15	0,85 71,91				13.008,89	16.900,54
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-5,50 -3,80	-5,90 0,25	-2,74 -1,31			-558.469,39	-601.618,36
Artigo 9º III % do CDI	-2,04 -230,40	11,60 328,18	6,96 273,64			-78.697,15	391.963,76
Artigo 10º I % do CDI	0,36 40,85	2,73 77,28	1,68 66,15			11.413,84	84.046,30
JALES (Total)						-645.138,70	786.593,32

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 150545	2.781.889,03	0,00	0,00	0,00	2.699.633,33	-82.255,70	-133.240,50
NTN-B 150824	3.274.768,00	0,00	0,00	0,00	3.301.251,76	26.483,76	121.684,70
	6.056.657,03	0,00	0,00	0,00	6.000.885,09	-55.771,94	

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1.268.095,07	0,00	0,00	0,00	1.271.708,25	3.613,18	31.111,29
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	3.293.672,21	0,00	0,00	0,00	3.319.969,03	26.296,82	117.740,51
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	1.384.456,74	0,00	0,00	0,00	1.366.723,98	-17.732,76	-3.462,11
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	9.027.223,96	0,00	0,00	0,00	9.098.530,56	71.306,60	319.712,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	817.556,03	0,00	0,00	0,00	814.595,81	-2.960,22	13.840,26
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.931.248,73	0,00	0,00	0,00	3.866.941,15	-64.307,58	-60.386,19
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.570.910,62	0,00	-1.570.000,00	0,00	1.469,61	558,99	23.317,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.216.906,56	229.051,25	0,00	0,00	5.416.733,64	-29.224,17	48.827,68
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2.555.362,20	0,00	0,00	0,00	2.549.417,09	-5.945,11	34.147,67
	29.065.432,12	229.051,25	-1.570.000,00	0,00	27.706.089,12	-18.394,25	

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	2.955.210,33	0,00	0,00	0,00	2.906.756,24	-48.454,09	-46.494,75
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.893.414,02	0,00	-1.000.000,00	0,00	3.928.936,70	35.522,68	259.940,82
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	4.176.236,45	0,00	0,00	0,00	4.189.956,54	13.720,09	102.445,24
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	3.336.673,68	1.615.295,83	0,00	0,00	4.992.952,13	40.982,62	65.891,31
	15.361.534,48	1.615.295,83	-1.000.000,00	0,00	16.018.601,61	41.771,30	

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	2.003.891,65	0,00	0,00	0,00	2.016.900,54	13.008,89	16.900,54
	2.003.891,65	0,00	0,00	0,00	2.016.900,54	13.008,89	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	1.210.725,74	0,00	0,00	0,00	1.137.054,27	-73.671,47	-49.834,49
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	942.353,00	0,00	0,00	0,00	920.523,86	-21.829,14	-63.827,42
BRADESCO F I A SELECTION	1.622.707,94	0,00	0,00	0,00	1.513.477,76	-109.230,18	-159.779,26
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	528.089,06	0,00	0,00	0,00	486.733,19	-41.355,87	-64.904,73
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	5.842.233,05	0,00	0,00	0,00	5.529.850,32	-312.382,73	-263.272,46
	10.146.108,79	0,00	0,00	0,00	9.587.639,40	-558.469,39	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	3.848.929,88	0,00	0,00	0,00	3.770.232,73	-78.697,15	391.963,76
	3.848.929,88	0,00	0,00	0,00	3.770.232,73	-78.697,15	

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	3.148.613,21	0,00	0,00	0,00	3.160.027,05	11.413,84	84.046,30
	3.148.613,21	0,00	0,00	0,00	3.160.027,05	11.413,84	

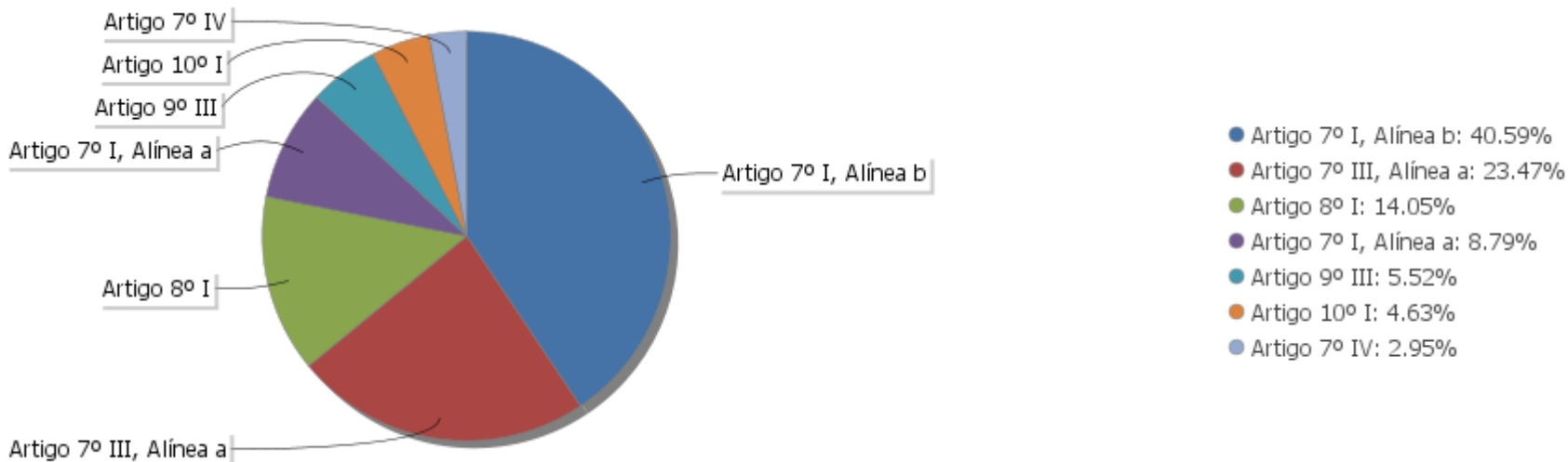
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

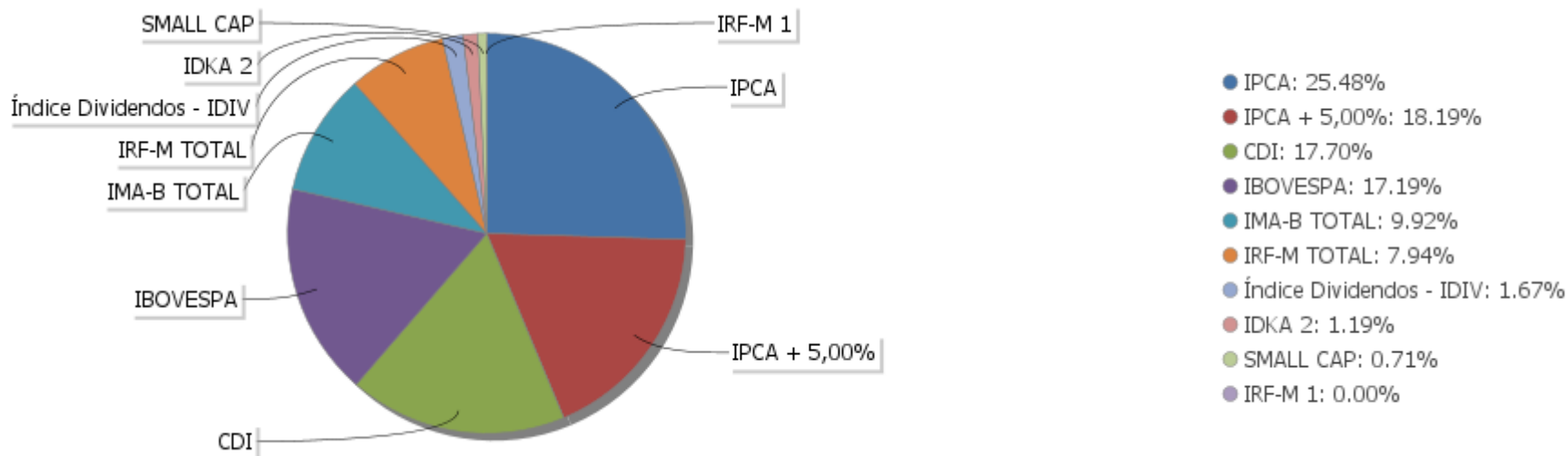
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	45.536.842,48	66,71		45.536.842,48	66,71	
de 31 dias a 365 dias	16.640.275,21	24,38		62.177.117,69	91,09	
acima de 365 dias	6.083.257,85	8,91		68.260.375,54	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

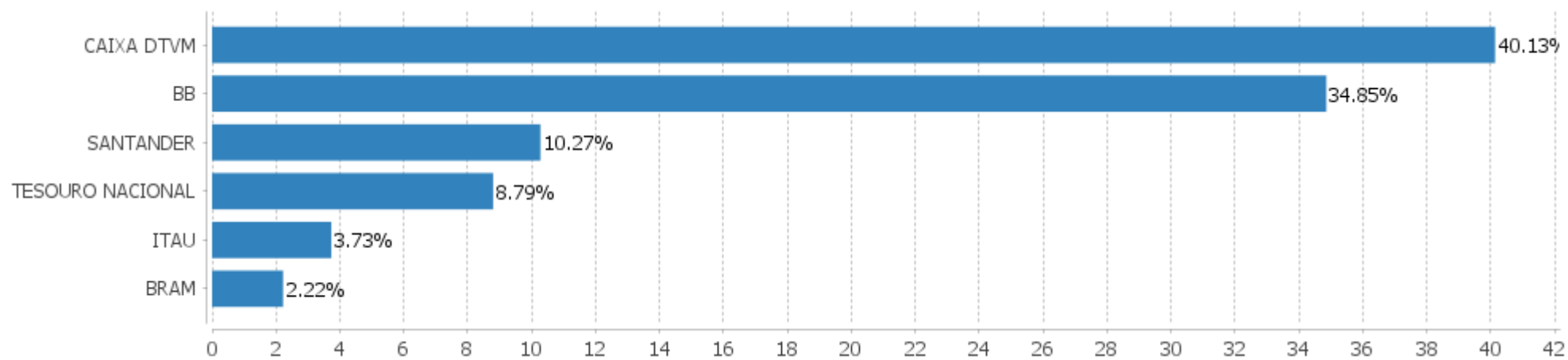


Alocação Por Estratégia



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									1,18
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80									3,43
p.p. indexador	-0,62	-0,02	0,19	-1,75									-2,25

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	1	25,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	75,00

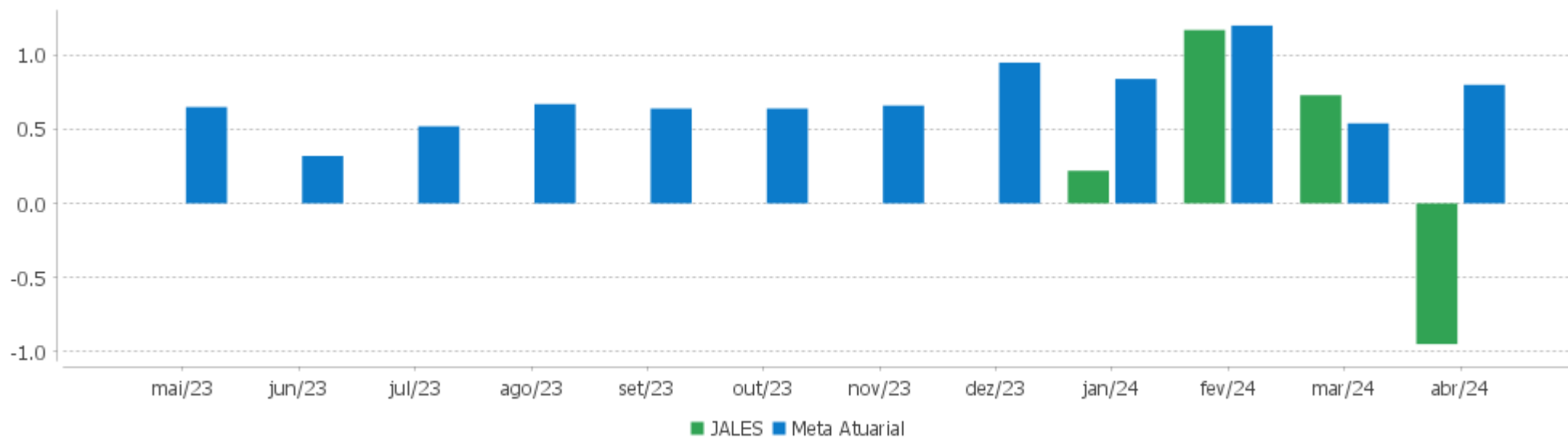
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,17	2024-02
Menor rentabilidade da Carteira	-0,95	2024-04

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,95	2,57	-1,61	2,85
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 29/12/2023	1,18	3,43	-2,25	2,77

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.	0,65 0,27	0,85 0,41					
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	-2,96 -3,34	-4,70 -6,50	-3,17 -4,54	2,46 -0,19	7,59 3,90	16,09 8,06	13,95 -7,18
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	0,81 0,43	3,69 1,89	2,43 1,06	5,40 2,74	10,26 6,57	19,99 11,96	30,10 8,97
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,64 -0,02	-1,51 -0,07	-1,05 -0,05	3,81 -0,11	7,65 -0,18	16,91 -0,38	22,07 -0,73
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,36 -0,07	1,71 -0,23	0,97 -0,15	4,92 -0,40	8,27 -0,12	17,88 -0,64	28,61 -0,90
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,58 0,01	3,07 0,02	2,14 -0,06	5,00 -0,03	11,80 -0,17	26,43 -0,44	33,23 -0,78
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,79 -0,02	3,60 0,15	2,46 -0,12	5,38 0,24	10,11 1,26	19,57 0,52	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,28 -0,10	2,70 0,90	1,84 0,46	4,81 2,15	12,62 8,94	25,48 17,45	31,12 9,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,55 -0,03	1,05 -0,09	0,38 -0,10	5,06 -0,12	11,95 -0,25	26,28 -0,41	27,59 -0,63
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,80 -0,01	3,63 0,18	2,49 -0,09	5,43 0,29			
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,23 -0,61	1,36 -0,44	0,88 -0,50	5,67 3,01	11,40 7,71	22,40 14,38	31,75 10,62
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI Var. IPCA p.p.	-1,28 -1,66	-0,27 -2,07	-0,34 -1,71	4,27 1,61			
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,64 -0,03	-1,57 -0,13	-1,09 -0,09	3,75 -0,17	7,57 -0,25	16,51 -0,79	21,81 -0,99
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,89 100,46	3,64 102,85	2,61 102,47	5,61 103,38	12,90 104,64	28,00 102,37	37,57 103,32
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,94 106,12	3,76 106,34	2,69 105,78	5,73 105,59	13,16 106,73	28,31 103,52	38,26 105,22
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,33 -0,05	2,51 0,71	1,61 0,23	4,75 2,09	10,94 7,25	23,70 15,67	28,45 7,32
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	-5,35	-4,54	-1,86	15,85	25,16	19,72	16,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-3,64	1,61	-0,43	4,55	4,58	2,99	10,28
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	-7,83 -0,08	-11,77 -0,24	-5,54 -0,22	5,88 -0,64	11,15 -1,21	-11,30 -1,32	-30,27 -1,57
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-6,73 -5,03	-9,55 -3,39	-5,50 -4,07	6,62 -4,67	10,25 -10,33	5,37 -11,36	-8,05 -13,96
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-6,08 -5,52	-4,20 0,15	-2,51 -1,64	13,88 0,69	19,90 -1,85	16,57 -8,26	12,29 -17,23
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,32 -0,61	-6,48 -0,33	-2,01 -0,58	11,16 -0,13	16,50 -4,08	5,68 -11,05	0,64 -5,27
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,04 -0,34	11,60 17,76	6,96 8,39	22,02 10,72	27,73 7,15	29,97 13,24	15,21 9,29
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO % do CDI	0,36 40,85	2,73 77,28	1,68 66,15	2,32 42,85	7,68 62,28	25,35 92,70	33,12 91,08
JALES Var. IPCA + 4,94% p.p.	-0,95 -1,75	1,18 -2,25	0,95 -1,61				
CDI	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36
IBOVESPA	-1,70	-6,16	-1,43	11,30	20,58	16,73	5,91
INPC + 6,00%	0,88	3,93	2,82	5,58	9,40	20,38	43,48
IPCA + 6,00%	0,89	3,77	2,82	5,62	9,88	21,32	44,17

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 TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	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
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
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 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	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 BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		
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 ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

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	0,58	3,05	2,20	5,03	11,97	26,87	34,02	37,14	46,19
IRF-M 1+	-1,02	0,33	-0,26	5,27	12,67	27,40	26,02	27,83	45,63
IRF-M TOTAL	-0,52	1,14	0,47	5,18	12,20	26,69	28,23	30,71	46,00
IMA-B 5	-0,20	1,85	1,16	5,20	8,42	18,91	30,15	41,76	54,05
IMA-B 5+	-2,91	-4,38	-2,95	2,77	6,84	15,52	15,49	27,38	38,18
IMA-B TOTAL	-1,61	-1,44	-1,00	3,93	7,83	17,30	22,80	34,66	46,69
IMA-GERAL TOTAL	-0,22	1,41	0,94	4,96	10,96	23,84	29,96	35,96	47,48
IDKA 2	-0,29	1,94	1,12	5,32	8,39	18,52	29,51	41,70	53,91
IDKA 20	-4,90	-9,27	-6,13	1,23	7,00	14,11	3,87	18,01	24,63
CDI	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36	39,29	46,54

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,70	-6,16	-1,43	11,30	20,58	16,73	5,91	56,42	30,69
IBRX 100	-1,34	-5,57	-1,11	11,93	21,16	15,35	3,64	56,75	33,05
IBRX 50	-0,62	-4,66	-0,53	12,46	22,10	17,11	6,05	62,71	32,79
SMALL CAP	-7,76	-11,53	-5,32	6,51	12,36	-9,98	-28,71	11,14	6,04
Índice Consumo - ICON	-5,98	-12,66	-4,71	7,68	6,01	-22,89	-46,53	-30,89	-30,19
Índice Dividendos - IDIV	-0,56	-4,35	-0,87	13,19	21,76	24,83	29,53	77,48	64,74

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	-0,79	12,78	8,50	22,79	24,91	28,13	15,27	64,77	124,09

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,77	2,12	1,45	7,16	18,32	20,22	18,20	29,89	34,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,00	11,18	8,09	21,53	19,47	21,69	3,18	47,40	88,97

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,38	1,80	1,38	2,66	3,69	8,03	21,13	29,32	32,42
INPC	0,37	1,95	1,38	2,62	3,23	7,19	20,55	29,70	32,89
IGPM	0,31	-0,60	-0,68	0,73	-3,04	-5,14	8,77	43,59	53,19
SELIC	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36	39,29	46,54

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,72	3,12	2,34	4,64	7,82	16,81	36,19	51,17	61,01
IPCA + 5,00%	0,81	3,45	2,58	5,13	8,85	19,05	40,14	57,04	68,88
IPCA + 5,50%	0,85	3,61	2,70	5,38	9,37	20,19	42,15	60,03	72,92
IPCA + 5,89%	0,88	3,74	2,79	5,57	9,77	21,07	43,72	62,40	76,13
IPCA + 6,00%	0,89	3,77	2,82	5,62	9,88	21,32	44,17	63,07	77,05
INPC + 4,00%	0,71	3,28	2,34	4,60	7,35	15,90	35,54	51,62	61,59
INPC + 6,00%	0,88	3,93	2,82	5,58	9,40	20,38	43,48	63,56	77,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
33	01/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.570.000,00	451.931,21455700	3,4739800000
34	01/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	900.000,00	175.387,10761500	5,1315060000
31	02/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19.051,25	0,00	6.444,05741200	2,9564060000
36	03/04/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	938.252,60	0,00	3.630,59470100	258,4294523000
35	16/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	100.000,00	19.401,20897500	5,1543180000
37	19/04/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	677.043,23	0,00	2.607,04011700	259,6980483000
32	22/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	210.000,00	0,00	71.232,39160700	2,9480970000
Total			1.844.347,08	2.570.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 852.622,08

Value-At-Risk: 1,25%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,49	0,45		0,24	-0,62	-0,03	51.742.476,36	75,80
Artigo 8º	15,94	6,66		0,87	-0,40	-5,50	9.587.639,40	14,05
Artigo 9º	20,19	6,80		0,14	-0,15	-2,04	3.770.232,73	5,52
Artigo 10º	1,11	0,98		-0,00	-0,47	0,36	3.160.027,05	4,63
JALES		1,25		1,25			68.260.375,54	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,45%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	0,54	0,42	0,00	0,43	-0,15	0,81	3.301.251,76	4,84
NTN-B 150545	5,74	2,05	0,05	2,04	-0,67	-2,96	2.699.633,33	3,95
Sub-total	2,63	0,96	0,05		-0,69	-0,92	6.000.885,09	8,79

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	0,98	0,24	0,00	0,25	-0,61	0,28	1.271.708,25	1,86
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,54	0,29	0,00	0,31	-0,16	0,80	3.319.969,03	4,86
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI	3,56	1,21	0,02	1,20	-0,61	-1,28	1.366.723,98	2,00
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,47	1,23	0,05	0,01	-0,73	-1,64	3.866.941,15	5,66
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,68	0,15	0,00	0,06	-0,45	0,58	1.469,61	0,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,46	0,62	0,00	0,11	-0,51	-0,36	814.595,81	1,19
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,03	0,92	0,05	0,02	-0,48	-0,55	5.416.733,64	7,94
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,30	0,62	0,02	0,62	-0,49	-0,23	2.549.417,09	3,73
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,54	0,29	0,00	0,31	-0,18	0,79	9.098.530,56	13,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	1,56	0,49	0,14		-0,61	-0,07	27.706.089,12	40,59

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,12	0,89	3.928.936,70	5,76
BB PREV RF IMA-B	3,47	1,25	0,04	0,04	-0,73	-1,64	2.906.756,24	4,26
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,03	0,00	0,03	0,61	0,94	4.992.952,13	7,31
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,91	0,52	0,02	0,52	-0,62	0,33	4.189.956,54	6,14
Sub-total	0,86	0,34	0,06		-0,71	0,27	16.018.601,61	23,47

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	2,19	0,44	-0,00	0,45	-0,11	0,65	2.016.900,54	2,95
Sub-total	2,19	0,44	-0,00		-0,11	0,65	2.016.900,54	2,95

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,66%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,56	6,87	0,10	4,44	-0,48	-6,08	1.137.054,27	1,67
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,89	8,38	0,05	0,09	-0,44	-7,83	486.733,19	0,71
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	12,33	6,12	0,07	0,89	-0,26	-2,32	920.523,86	1,35
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,75	7,01	0,52	3,39	-0,37	-5,35	5.529.850,32	8,10
BRANCO F I A SELECTION	16,71	6,43	0,13	2,26	-0,46	-6,73	1.513.477,76	2,22
Sub-total	15,94	6,66	0,87		-0,40	-5,50	9.587.639,40	14,05

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,80%

Artigo 9º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	20,19	6,80	0,14	9,02	-0,15	-2,04	3.770.232,73	5,52
Sub-total	20,19	6,80	0,14		-0,15	-2,04	3.770.232,73	5,52

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,98%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA HEDGE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	1,11	0,98	-0,00	0,98	-0,47	0,36	3.160.027,05	4,63
Sub-total	1,11	0,98	-0,00		-0,47	0,36	3.160.027,05	4,63

(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 (%)