



LDB
EMPRESAS

COLOMBO
JUNHO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

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

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

77,42%

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	2,23	-0,23	0,22	2,73	10.831.597,94	2,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832	4,54	-0,53	-1,24	-1,97	25.228.013,86	5,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	5,18	-0,72	-1,62	-3,42	14.705.820,94	3,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,04	-0,85	-2,01	-4,89	13.577.625,11	2,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,47	-0,97	-2,79	-5,95	8.573.632,93	1,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	7,23	-0,97	-3,08	-7,28	3.612.290,76	0,74
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,75	-0,65	-1,51	-2,88	76.528.981,54	15,67

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,72	-0,18	0,37	3,20	21.985.448,48	4,50	4.972.766.310,86	0,44
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,70	-0,22	0,26	3,11	26.684.470,57	5,46	5.571.325.652,69	0,48
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,81	-0,17	0,31	2,33	11.718.082,75	2,40	116.372.911,49	10,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	-0,24	0,20	2,96	24.435.394,84	5,00	4.585.046.250,25	0,53
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,72	-0,18	0,37	3,21	36.873.192,72	7,55	7.303.046.549,52	0,50
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	-0,02	0,61	4,48	184.744,14	0,04	7.877.165.450,51	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,50	-0,28	-0,32	1,37	606.477,16	0,12	1.975.307.878,59	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,03	0,78	5,00	58.572.388,77	12,00	11.312.134.510,29	0,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	-0,14	0,17	2,36	11.151.882,22	2,28	4.858.229.912,84	0,23
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,69	-0,04	0,94	6,75	32.673.310,16	6,69	704.187.699,29	4,64
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,91	-0,11	0,52	3,82	224.885.391,81	46,06		

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	3,82	-0,50	-0,98	-1,28	15.693.469,08	3,21	843.817.661,01	1,86
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	1,91	-0,29	-0,20	1,81	13.795.766,26	2,83	683.118.622,81	2,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,06	0,04	0,71	4,70	1.007.645,00	0,21	976.883.009,20	0,10
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,79	0,01	0,90	5,11	12.334.396,19	2,53	2.177.822.970,57	0,57
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,20	-0,50	-1,08	-2,42	27.981.341,93	5,73	340.383.364,37	8,22
RJI	RJI	TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	16,18	0,01	0,31	-2,20	1.154.102,13	0,24	40.641.817,01	2,84
GENIAL	RJI	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	55,05	-0,04	-1,12	-53,13	256.110,27	0,05	13.011.512,54	1,97
INFINITY	PLANNER	VANQUISH CORAL FI RF LP	8,70	0,23	0,41	2,43	560.963,29	0,11	11.249.354,23	4,99
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,33	-0,35	-0,50	-0,78	72.783.794,15	14,91		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	PLANNER	AR CAPITAL FIDC IMOBILIARIOS I	40,25	49,17	49,17	48,50	1.420.074,39	0,29	7.744.477,97	18,34
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,50	-0,47	-0,47	-2,76	2.442.425,11	0,50	70.358.280,66	3,47
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			24,68	18,87	18,87	17,20	3.862.499,50	0,79		
Renda Fixa			1,69	-0,07	0,10	1,38	378.060.667,00	77,42		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

10,49%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	12,01	-0,10	1,55	-5,34	7.058.822,63	1,45	292.804.602,94	2,41
PLURAL	BEM	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	12,81	-0,42	2,00	-8,72	3.605.265,36	0,74	354.039.229,75	1,02
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	13,80	-0,67	0,26	-9,75	18.639.188,57	3,82	1.394.601.606,31	1,34
FINACAP	BEM	FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES	14,31	-0,60	1,36	-6,68	21.938.278,02	4,49	459.571.224,62	4,77
Sub-total Artigo 8º I			13,27	-0,54	1,03	-9,75	51.241.554,58	10,49		
Renda Variável			12,99	-0,54	1,03	-7,81	51.241.554,58	10,49		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,09%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,77	1,58	10,16	28,71	11.059.930,49	2,27	469.314.511,48	2,36
Sub-total Artigo 9º II			11,77	1,58	10,16	28,71	11.059.930,49	2,27		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	13,62	0,06	9,77	30,18	8.929.835,86	1,83	1.649.294.012,28	0,54
Sub-total Artigo 9º III			13,62	0,06	9,77	30,18	8.929.835,86	1,83		

Investimentos no Exterior			11,48	0,89	9,99	29,18	19.989.766,35	4,09		
----------------------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,21%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	11,05	-0,28	3,96	16,75	22.909.027,12	4,69	1.326.345.413,32	1,73
Sub-total Artigo 10º I			11,05	-0,28	3,96	16,75	22.909.027,12	4,69		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
KINEA	LIONS TRUST	FIP MULTIESTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	9,66	-4,43	0,49	2,35	1.961.077,24	0,40	157.770.319,05	1,24
A5	PLANNER	W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	57,96	-0,13	-0,13	-44,18	5.476.566,93	1,12	68.445.600,86	8,00
Sub-total Artigo 10º II			64,56	-1,30	0,09	-36,22	7.437.644,17	1,52		
Investimentos Estruturados			20,90	-0,53	2,98	-2,61	30.346.671,29	6,21		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,77%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	ELITE	BR HOTÉIS FII	2,49	-0,06	-0,06	-0,23	6.101.243,19	1,25	124.190.623,79	4,91
PLANNER	PLANNER	CARE11	45,11	1,18	-7,53	25,55	1.109.676,92	0,23	0,00	
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11	19,52	0,00	0,00	14,67	1.444.311,57	0,30	71.188.600,69	2,03
Sub-total Artigo 11º			7,07	0,11	-1,07	4,56	8.655.231,68	1,77		
Fundos Imobiliários			7,10	0,11	-1,07	4,56	8.655.231,68	1,77		
Total			3,34	-0,10	0,72	0,35	488.293.890,90	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	76.528.981,54	15,67	0,00	14,80	50,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	224.885.391,81	46,06	0,00	31,65	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	72.783.794,15	14,91	7,41	14,82	40,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	3.862.499,50	0,79	0,00	1,34	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	378.060.667,00	77,42					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	51.241.554,58	10,49	7,00	21,09	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	51.241.554,58	10,49					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	11.059.930,49	2,27	0,00	3,58	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	8.929.835,86	1,83	0,00	3,58	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	19.989.766,35	4,09					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	22.909.027,12	4,69	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	7.437.644,17	1,52	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	30.346.671,29	6,21					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	8.655.231,68	1,77	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	8.655.231,68	1,77					5,00
Total		488.293.890,90	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-1,51 -192,03	-2,88 -55,15	-2,25 -88,93	-2,88 -55,15		-1.176.339,28	-2.288.758,71
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,52 65,92	3,82 73,07	1,60 63,04	3,82 73,07		1.163.853,49	7.238.592,80
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,50 -63,99	-0,78 -14,91	-0,56 -22,14	-0,78 -14,91		-368.714,65	-571.964,72
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	18,87 2.394,18	17,20 329,38	18,08 714,76	17,20 329,38		758.830,14	691.126,88
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,03 -0,45	-9,75 -2,09	-6,62 -3,34	-9,75 -2,09		521.734,34	-7.298.346,39
Artigo 9º II % do CDI	10,16 1.289,23	28,71 549,84	15,03 593,98	28,71 549,84		1.020.362,16	2.466.924,13
Artigo 9º III % do CDI	9,77 1.239,46	30,18 577,97	14,26 563,56	30,18 577,97		794.869,95	2.070.089,66
Artigo 10º I % do CDI	3,96 502,76	16,75 320,81	5,07 200,35	16,75 320,81		873.365,99	3.286.755,89
Artigo 10º II % do CDI	0,09 10,91	-36,22 -693,77	0,12 4,78	-36,22 -693,77		7.852,95	-4.282.227,33
Artigo 11º % do CDI	-1,07 -136,29	4,56 87,27	-1,03 -40,84	4,56 87,27		-94.003,28	380.338,06
COLOMBO (Total)						3.501.811,81	1.692.530,27

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	14.948.077,07	0,00	0,00	0,00	14.705.820,94	-242.256,13	-530.627,21
NTN-B 150545	8.819.934,27	0,00	0,00	0,00	8.573.632,93	-246.301,34	-551.712,55
NTN-B 150826	10.808.293,77	0,00	0,00	0,00	10.831.597,94	23.304,17	289.579,90
NTN-B 150832	25.545.459,06	0,00	0,00	0,00	25.228.013,86	-317.445,20	-508.380,99
NTN-B 150840	13.856.413,78	0,00	0,00	0,00	13.577.625,11	-278.788,67	-702.570,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850	3.727.142,87	0,00	0,00	0,00	3.612.290,76	-114.852,11	-285.047,59
	77.705.320,82	0,00	0,00	0,00	76.528.981,54	-1.176.339,28	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	21.903.560,76	0,00	0,00	0,00	21.985.448,48	81.887,72	681.974,04
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	26.616.368,91	0,00	0,00	0,00	26.684.470,57	68.101,66	805.714,07
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	11.682.272,07	0,00	0,00	0,00	11.718.082,75	35.810,68	266.569,71
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	24.387.799,77	0,00	0,00	0,00	24.435.394,84	47.595,07	701.420,99
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.681.171,95	6.070.000,00	0,00	0,00	36.873.192,72	122.020,77	823.104,85
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	183.626,92	0,00	0,00	0,00	184.744,14	1.117,22	7.929,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	608.414,76	0,00	0,00	0,00	606.477,16	-1.937,60	8.180,23
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	58.218.199,98	5.257.657,14	-5.387.929,97	0,00	58.572.388,77	484.461,62	2.986.723,96
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	10.828.732,75	307.962,95	-4.340,45	0,00	11.151.882,22	19.526,97	230.503,83
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	32.368.040,78	0,00	0,00	0,00	32.673.310,16	305.269,38	726.471,38
	217.478.188,65	11.635.620,09	-5.392.270,42	0,00	224.885.391,81	1.163.853,49	

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	15.848.931,38	0,00	0,00	0,00	15.693.469,08	-155.462,30	-203.294,66
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	13.823.972,80	0,00	0,00	0,00	13.795.766,26	-28.206,54	244.942,45
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	900.466,98	385.308,03	-286.258,39	0,00	1.007.645,00	8.128,38	39.361,90
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	12.224.907,94	0,00	0,00	0,00	12.334.396,19	109.488,25	599.182,35
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	28.286.908,87	0,00	0,00	0,00	27.981.341,93	-305.566,94	-693.438,03
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.150.583,66	0,00	0,00	0,00	1.154.102,13	3.518,47	-28.130,44
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	259.006,97	0,00	0,00	0,00	256.110,27	-2.896,70	-543.903,50
VANQUISH CORAL FI RF LP	558.680,56	0,00	0,00	0,00	560.963,29	2.282,73	13.315,21
	73.053.459,16	385.308,03	-286.258,39	0,00	72.783.794,15	-368.714,65	

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\$)
AR CAPITAL FIDC IMOBILIARIOS I	1.566.631,25	0,00	0,00	916.830,29	1.420.074,39	770.273,43	760.536,33
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2.453.868,40	0,00	0,00	0,00	2.442.425,11	-11.443,29	-69.409,45
	4.020.499,65	0,00	0,00	916.830,29	3.862.499,50	758.830,14	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	6.951.378,79	0,00	0,00	0,00	7.058.822,63	107.443,84	-398.259,60
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	3.534.658,44	0,00	0,00	0,00	3.605.265,36	70.606,92	-344.352,07
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	18.590.833,42	0,00	0,00	0,00	18.639.188,57	48.355,15	-2.013.406,84
FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES	21.642.949,59	0,00	0,00	0,00	21.938.278,02	295.328,43	-1.571.319,45
	50.719.820,24	0,00	0,00	0,00	51.241.554,58	521.734,34	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.039.568,33	0,00	0,00	0,00	11.059.930,49	1.020.362,16	2.466.924,13
	10.039.568,33	0,00	0,00	0,00	11.059.930,49	1.020.362,16	

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	8.134.965,91	0,00	0,00	0,00	8.929.835,86	794.869,95	2.070.089,66
	8.134.965,91	0,00	0,00	0,00	8.929.835,86	794.869,95	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	22.035.661,13	0,00	0,00	0,00	22.909.027,12	873.365,99	3.286.755,89
	22.035.661,13	0,00	0,00	0,00	22.909.027,12	873.365,99	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2.051.899,34	0,00	0,00	105.654,56	1.961.077,24	14.832,46	51.990,78
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	5.483.546,44	0,00	0,00	0,00	5.476.566,93	-6.979,51	-4.334.218,11
	7.535.445,78	0,00	0,00	105.654,56	7.437.644,17	7.852,95	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BR HOTÉIS FII	6.104.923,93	0,00	0,00	0,00	0,00	6.101.243,19	-3.680,74	-14.642,50
CARE11	1.199.999,46	0,00	0,00	0,00	0,00	1.109.676,92	-90.322,54	225.806,35
FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11	1.444.311,57	0,00	0,00	0,00	0,00	1.444.311,57	0,00	184.814,10
	8.749.234,96	0,00	0,00	0,00	0,00	8.655.231,68	-94.003,28	

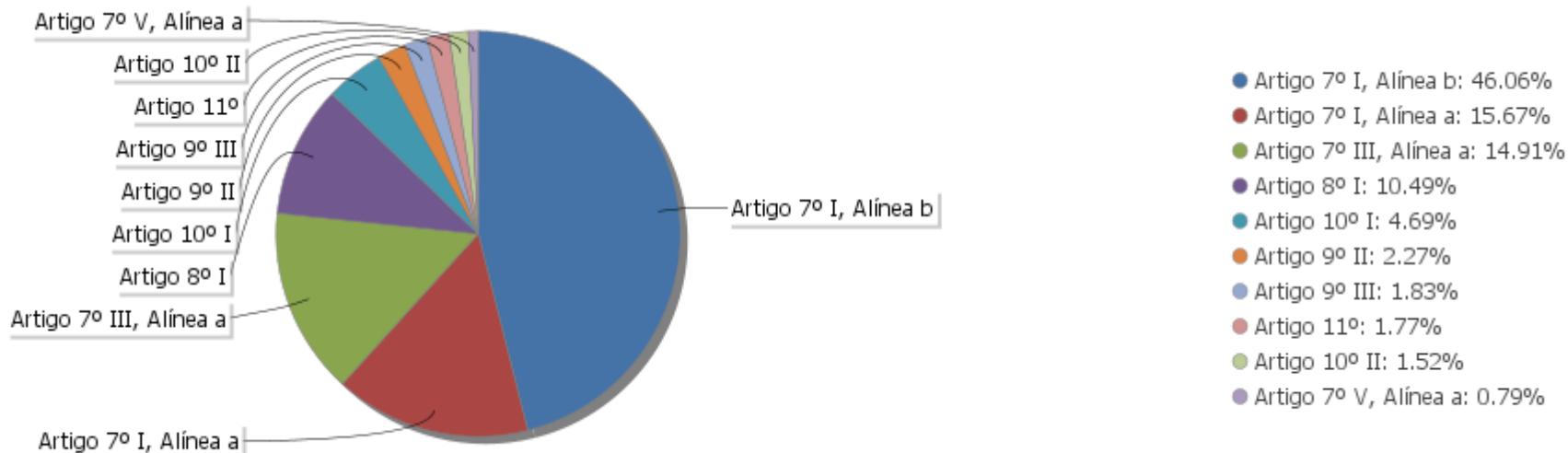
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

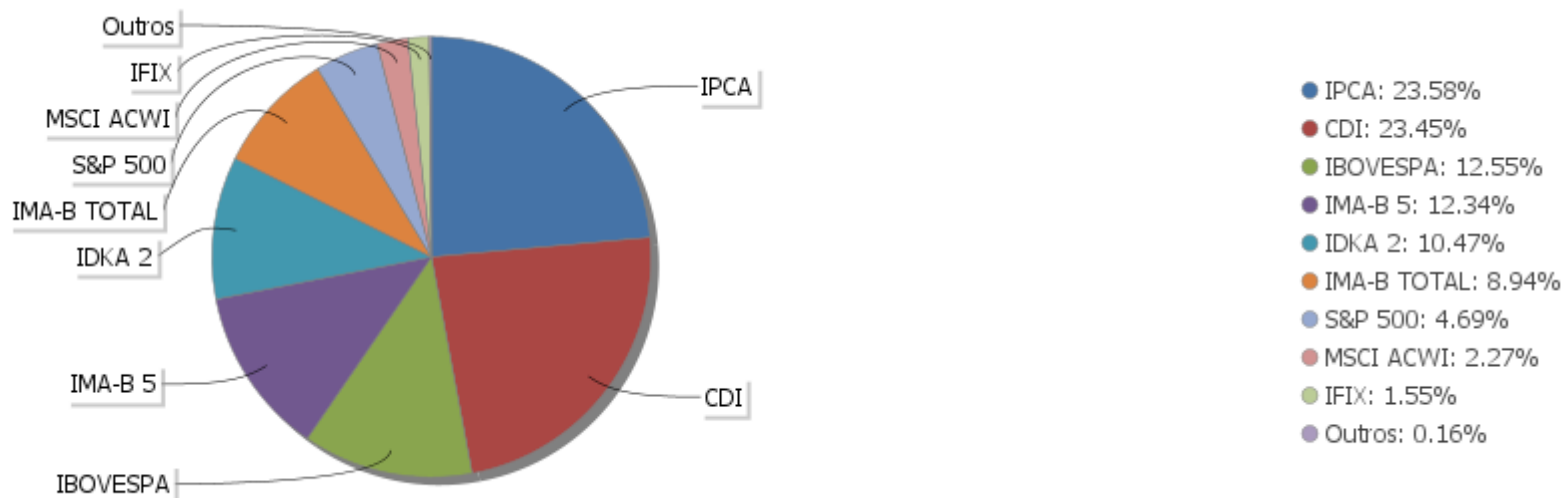
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	410.354.696,96	84,04		410.354.696,96	84,04	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00		410.354.696,96	84,04	
acima de 365 dias	77.939.193,94	15,96		488.293.890,90	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

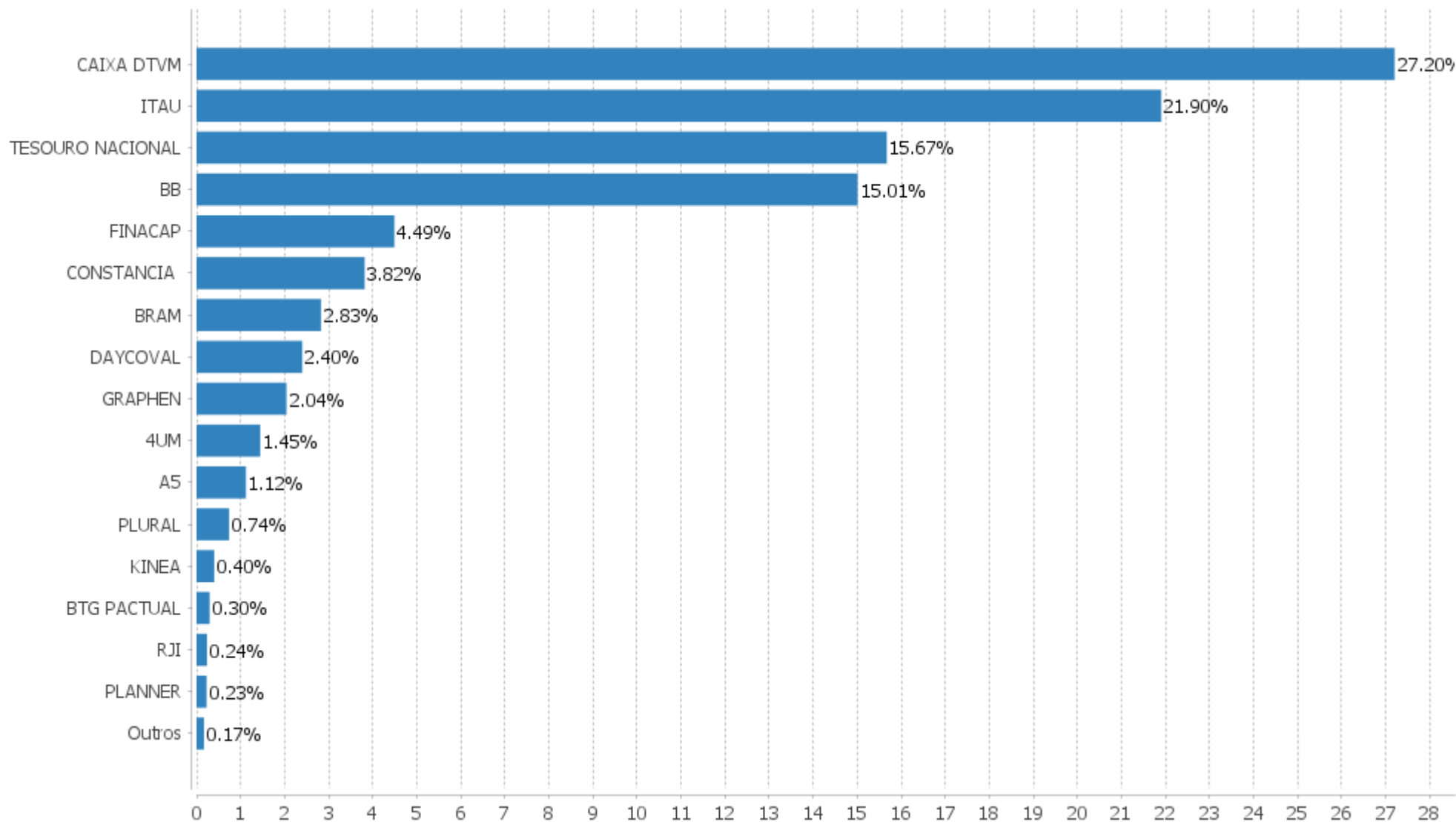


Alocação Por Estratégia



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	-0,71	0,09	0,75	-1,59	1,12	0,72							0,35
IPCA + 5,10%	0,86	1,21	0,56	0,82	0,88	0,61							5,02
p.p. indexador	-1,57	-1,12	0,20	-2,40	0,24	0,11							-4,67

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	50,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	50,00

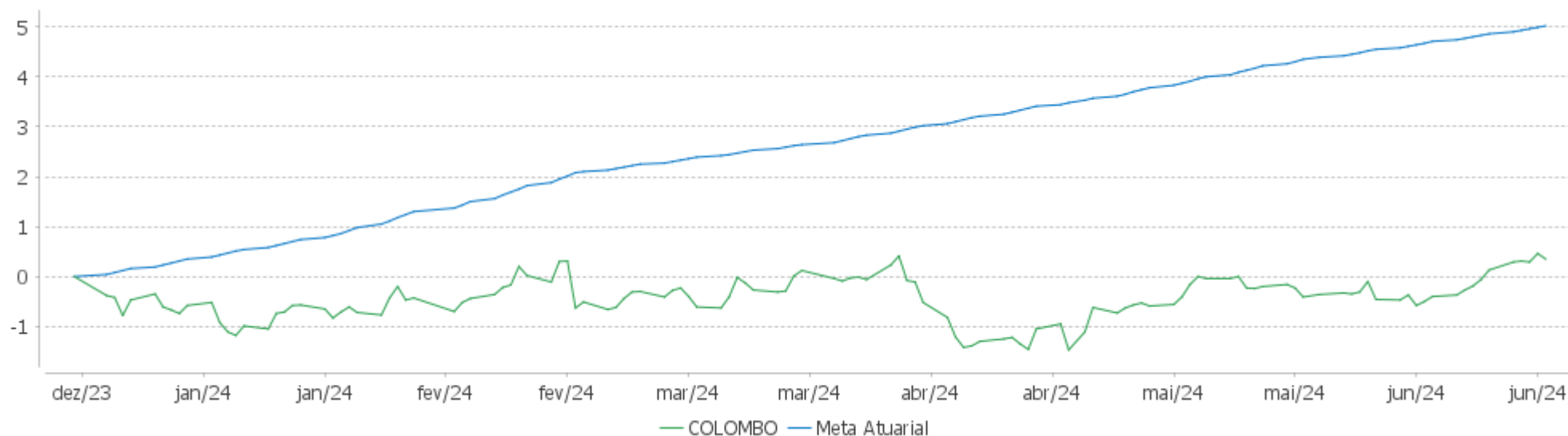
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,12	2024-05
Menor rentabilidade da Carteira	-1,59	2024-04

Relatório

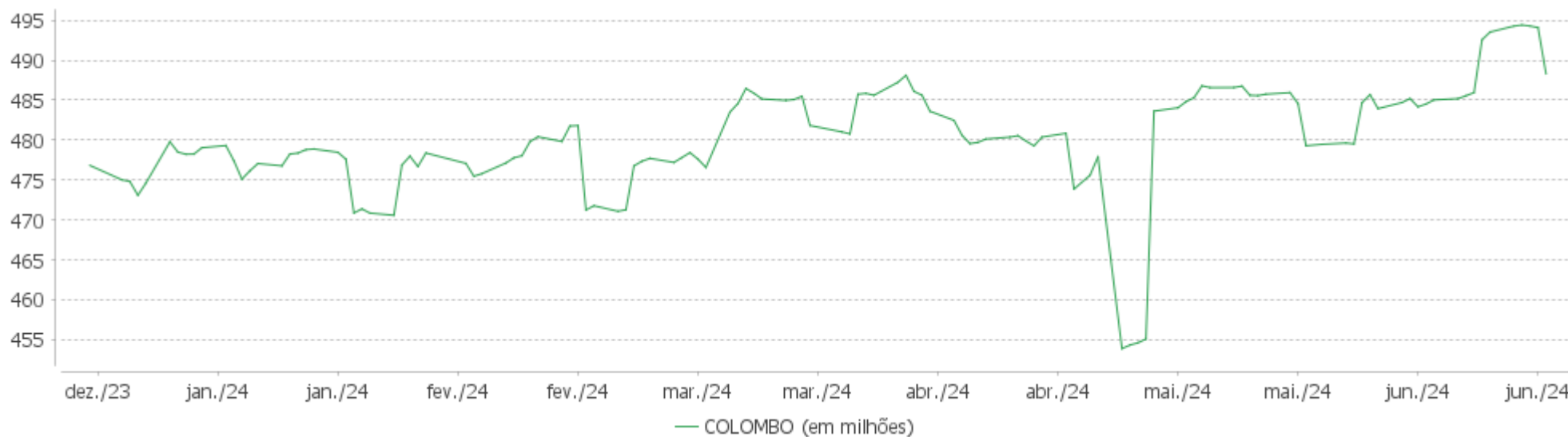
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,23	2,32	-2,09	3,10
06 meses	0,35	5,02	-4,67	3,34
12 meses				
24 meses				
Desde 29/12/2023	0,35	5,02	-4,67	3,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

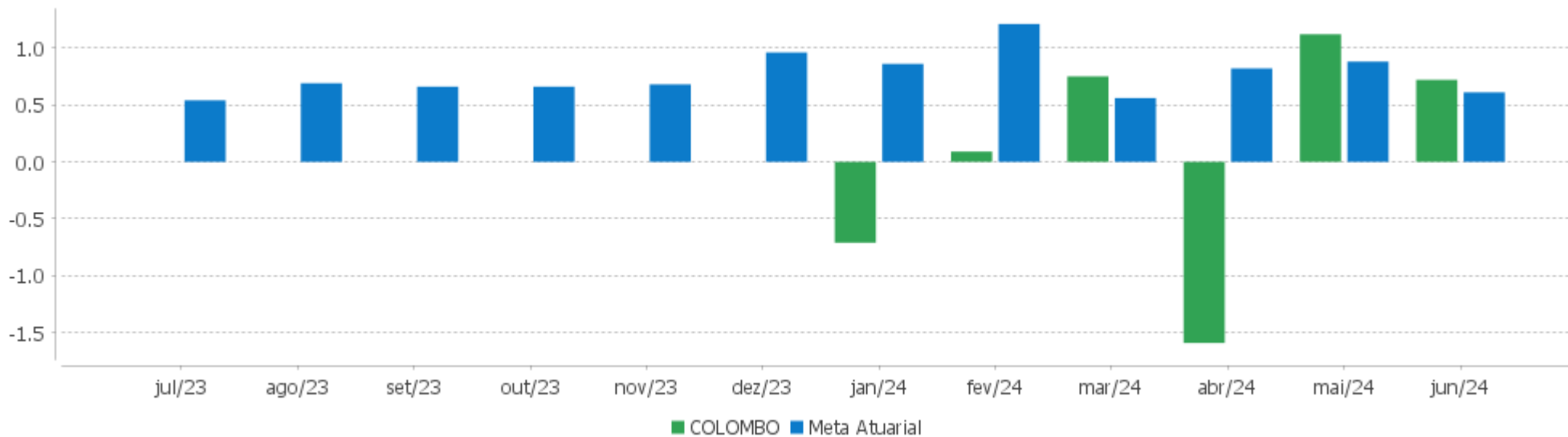


Patrimônio Líquido



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 150545 Var. IPCA p.p.	-2,79 -3,00	-5,95 -8,43	-4,22 -5,28	-5,95 -8,43	-2,07 -6,30	14,98 7,45	9,66 -10,65
NTN-B 150850 Var. IPCA p.p.	-3,08 -3,29	-7,28 -9,76	-5,08 -6,14	-7,28 -9,76	-3,51 -7,74	14,36 6,84	6,95 -13,35
NTN-B 150832 Var. IPCA p.p.	-1,24 -1,45	-1,97 -4,45	-1,78 -2,83	-1,97 -4,45	1,01 -3,22	15,55 8,03	
NTN-B 150826 Var. IPCA p.p.	0,22 0,01	2,73 0,24	0,80 -0,26	2,73 0,24	7,38 3,15	18,67 11,14	28,36 8,06
NTN-B 150535 Var. IPCA p.p.	-1,62 -1,83	-3,42 -5,91	-2,49 -3,54	-3,42 -5,91	-0,32 -4,55	15,44 7,92	15,21 -5,10
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-2,01 -2,22	-4,89 -7,38	-3,15 -4,20	-4,89 -7,38	-1,06 -5,29	15,09 7,57	12,41 -7,89
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,02	3,21 -0,11	1,18 -0,06	3,21 -0,11	8,00 -0,23	18,98 -0,31	30,69 -0,61
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA Var. IPCA p.p.	0,31 0,10	2,33 -0,16	0,64 -0,41	2,33 -0,16	6,84 2,61	17,58 10,06	28,09 7,79
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,26 0,08	3,11 -0,10	1,05 0,09	3,11 -0,10	8,11 -0,26	18,30 -0,13	29,95 -0,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,17 -0,04	2,36 -0,12	0,55 -0,50	2,36 -0,12	7,39 3,17	23,06 15,54	27,65 7,35
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,02	3,20 -0,12	1,18 -0,06	3,20 -0,12	7,97 -0,26	18,82 -0,48	30,38 -0,92
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,20 0,02	2,96 -0,25	0,86 -0,09	2,96 -0,25	8,08 -0,29	18,05 -0,38	29,46 -0,94
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,03	4,48 -0,02	1,97 -0,04	4,48 -0,02	10,79 -0,16	25,84 -0,44	34,58 -0,78
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,78 98,34	5,00 95,75	2,39 94,30	5,00 95,75	11,34 96,98	26,39 98,42	37,56 99,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,32 -0,02	1,37 -0,14	-0,24 -0,08	1,37 -0,14	7,62 -0,26	25,50 -0,45	27,54 -0,62
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	0,94 119,64	6,75 129,19	4,00 158,04	6,75 129,19	12,41 106,13	24,51 91,39	38,53 101,96
AR CAPITAL FIDC IMOBILIARIOS I	49,17	48,50	48,70	48,50	46,03	40,33	74,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	6.236,93	928,83	1.924,78	928,83	393,70	150,38	195,88
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	-0,47	-2,76	-1,33	-2,76	-5,04	-5,40	-1,58
% do CDI	-59,16	-52,92	-52,62	-52,92	-43,13	-20,15	-4,18
VANQUISH CORAL FI RF LP	0,41	2,43	0,94	2,43	-7,37	-86,99	-84,76
% do CDI	51,83	46,57	37,09	46,57	-63,02	-324,36	-224,25
BB PREV RF IMA-B	-0,98	-1,28	-1,34	-1,28	2,67	16,26	20,42
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,18	-0,07	-0,18	-0,39	-0,75	-1,00
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-1,08	-2,42	-2,13	-2,42	1,00	13,67	17,70
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,11	-1,32	-0,86	-1,32	-2,07	-3,33	-3,73
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	-1,12	-53,13	-5,96	-53,13	-62,13	-62,27	-63,73
Var. IMA-B 5 p.p.	-1,51	-56,45	-7,20	-56,45	-70,36	-81,57	-95,03
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,90	5,11	2,98	5,11	10,59	25,04	38,95
% do CDI	113,61	97,79	117,88	97,79	90,56	93,37	103,05
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,31	-2,20	0,79	-2,20	-7,78	-3,94	-2,07
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,09	-5,52	-0,45	-5,52	-16,01	-23,23	-33,37
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,71	4,70	2,27	4,70	10,59	23,51	32,30
% do CDI	89,74	90,00	89,81	90,00	90,59	87,67	85,47
BRANCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	-0,20	1,81	0,27	1,81	7,18	22,58	28,41
Var. IPCA p.p.	-0,41	-0,68	-0,78	-0,68	2,95	15,06	8,10
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	0,26	-9,75	-8,25	-9,75	-3,49	12,92	-6,94
Var. IBOVESPA p.p.	-1,22	-2,09	-4,98	-2,09	-8,42	-12,82	-4,66
FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES	1,36	-6,68	-5,52	-6,68	4,80	29,31	9,83
Var. IBOVESPA p.p.	-0,12	0,98	-2,24	0,98	-0,13	3,57	12,11
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	2,00	-8,72	-4,72	-8,72	2,83	25,86	19,00
Var. IBOVESPA p.p.	0,52	-1,06	-1,45	-1,06	-2,10	0,12	21,29
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	1,55	-5,34	-1,99	-5,34	7,91	28,42	13,89
Var. IBOVESPA p.p.	0,06	2,32	1,29	2,32	2,98	2,68	16,17
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	9,77	30,18	14,26	30,18	42,38	57,22	41,18
Var. IBOVESPA p.p.	8,29	37,84	17,54	37,84	37,45	31,48	43,47
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10,16	28,71	15,03	28,71	40,96	53,47	37,30
Var. MSCI ACWI p.p.	1,89	2,04	1,09	2,04	5,48	10,85	13,51
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	3,96	16,75	5,07	16,75	29,39	66,04	56,41
Var. S&P 500 p.p.	-5,77	-14,70	-10,56	-14,70	-12,14	12,95	15,21
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,13	-44,18	-0,40	-44,18	-44,66	-49,35	-50,08
% do CDI	-16,15	-846,12	-15,83	-846,12	-382,01	-184,00	-132,52
FIP MULTIESTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	0,49	2,35	1,37	2,35	-0,87		

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.	0,28	-0,14	0,31	-0,14	-5,10		
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	-7,53 -9,01	25,55 33,21	-19,63 -16,35	25,55 33,21	-16,50 -21,43	-58,65 -84,39	-57,25 -54,97
BR HOTÉIS FII Var. IFIX p.p.	-0,06 0,97	-0,23 -1,32	-0,20 1,59	-0,23 -1,32	2,27 -3,81	5,10 -14,63	1,98 -19,52
FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11 Var. IFIX p.p.	0,00 1,04	14,67 13,59	14,67 16,46	14,67 13,59			
COLOMBO Var. IPCA + 5,10% p.p.	0,72 0,11	0,35 -4,67	0,23 -2,09	0,35 -4,67			
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	2,00
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,00
BB PREV RF IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BR HOTÉIS FII	Não se aplica	Não se aplica				
BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,40
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES			D+5 du	D+7 du	-	2,00
CARE11	Não se aplica	Não se aplica				
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	D+1 du	D+0	D+14 du	D+15 du		2,00
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	D+0	D+0	D+2 du	D+3 du		0,50
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 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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11						
FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES			D+1 du	D+3 du	-	2,00
FIP MULTIESTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II						
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CDI, DE UM DIA, APURADO PELA CETIP	
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	0,50
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,15
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1 du	D+0	D+1470	D+1471		0,35
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1 du	D+0	D+1470	D+1471		0,70
VANQUISH CORAL FI RF LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,75
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se aplica	Não se aplica				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

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

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
166	03/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	661,20	265,12669000	2,4939020000
181	05/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.993.529,84	0,00	713.297,95359000	5,5986840000
174	05/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.002.771,08	0,00	179.108,35474900	5,5986840000
167	05/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	426,10	170,73639500	2,4956600000
179	06/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.562,81	814,64260400	5,6009960000
168	06/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	21.643,60	8.669,43474500	2,4965410000
185	10/06/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	307.962,95	0,00	158.725,37978800	1,9402250000
176	10/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	92.396,50	0,00	16.487,30982200	5,6040980000
169	10/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	385.308,03	0,00	154.228,08709900	2,4983000000
170	13/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.138,00	455,02856400	2,5009420000
171	14/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	37,10	14,82917600	2,5018240000
187	20/06/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.070.000,00	0,00	1.423.892,58923700	4,2629620000
183	20/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	49.409,55	8.788,11012100	5,6223180000
186	20/06/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	4.340,45	2.228,84358100	1,9474000000
180	20/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.607,97	285,99768600	5,6223180000
177	20/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	10.483,46	1.864,61562900	5,6223180000
172	20/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	4.836,33	1.930,39701600	2,5053550000
178	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.032.038,27	183.176,12242100	5,6341310000
188	27/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	11.571,87	4.610,71819200	2,5097760000
184	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.289.827,91	761.181,91138900	5,6357460000
182	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	110.387,61	0,00	19.587,04490900	5,6357460000
175	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	58.572,11	0,00	10.392,96483500	5,6357460000
173	28/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	245.944,19	97.959,97448600	2,5106600000
Total			12.020.928,12	5.678.528,81		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.785.068,15

Value-At-Risk: 1,39%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	2,84	1,04		0,67	-0,24	0,10	378.060.667,00	77,42
Artigo 8º	13,17	6,79		0,59	0,02	1,03	51.241.554,58	10,49
Artigo 9º	12,79	5,39		0,00	0,72	9,99	19.989.766,35	4,09
Artigo 10º	6,38	3,67		0,12	0,35	3,01	30.346.671,29	6,21
Artigo 11º	7,15	2,79		0,00	-0,26	-1,07	8.655.231,68	1,77
COLOMBO		1,39		1,39			488.293.890,90	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,04%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826	2,06	1,16	0,02	1,16	-0,28	0,22	10.831.597,94	2,22
NTN-B 150832	4,64	2,33	0,09	2,31	-0,44	-1,24	25.228.013,86	5,17
NTN-B 150535	5,53	2,52	0,06	2,51	-0,44	-1,62	14.705.820,94	3,01
NTN-B 150840	6,45	3,05	0,07	3,03	-0,43	-2,01	13.577.625,11	2,78
NTN-B 150545	7,33	3,09	0,04	3,08	-0,49	-2,79	8.573.632,93	1,76
NTN-B 150850	7,52	3,55	0,02	3,53	-0,51	-3,08	3.612.290,76	0,74
Sub-total	5,13	2,40	0,30		-0,45	-1,51	76.528.981,54	15,67

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,72	0,91	0,03	0,01	-0,24	0,37	21.985.448,48	4,50
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,95	0,99	0,04	0,16	-0,27	0,26	26.684.470,57	5,46
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,78	0,92	0,02	0,92	-0,27	0,31	11.718.082,75	2,40
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,07	1,10	0,04	0,24	-0,29	0,20	24.435.394,84	5,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	0,91	0,05	0,01	-0,24	0,37	36.873.192,72	7,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,23	0,00	0,02	-0,35	0,61	184.744,14	0,04
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,60	1,37	0,00	0,02	-0,31	-0,32	606.477,16	0,12
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,07	0,01	0,07	-0,13	0,78	58.572.388,77	12,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,85	0,72	0,01	0,72	-0,33	0,17	11.151.882,22	2,28
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,87	0,66	-0,02	0,66	0,18	0,94	32.673.310,16	6,69
Sub-total	1,02	0,51	0,18		-0,26	0,52	224.885.391,81	46,06

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B	3,99	2,16	0,06	0,02	-0,44	-0,98	15.693.469,08	3,21
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,60	1,06	0,03	1,06	-0,38	-0,20	13.795.766,26	2,83
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	0,01	0,00	0,00	-119,43	0,71	1.007.645,00	0,21
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,38	0,27	-0,00	0,27	0,28	0,90	12.334.396,19	2,53
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,22	2,24	0,11	0,39	-0,44	-1,08	27.981.341,93	5,73
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,02	0,31	-0,00	0,95	-26,55	0,31	1.154.102,13	0,24
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,12	2,40	0,00	2,60	-15,77	-1,12	256.110,27	0,05
VANQUISH CORAL FI RF LP	0,79	0,04	-0,00	0,04	-0,48	0,41	560.963,29	0,11
Sub-total	2,92	1,50	0,19		-0,44	-0,50	72.783.794,15	14,91

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AR CAPITAL FIDC IMOBILIARIOS I	141,95	1,81	-0,00	1,81	0,34	49,17	1.420.074,39	0,29
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,66	0,10	0,00	0,10	-0,76	-0,47	2.442.425,11	0,50
Sub-total	61,37	0,64	-0,00		0,29	18,87	3.862.499,50	0,79

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,79%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	9,96	5,53	0,06	3,36	0,08	1,55	7.058.822,63	1,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	12,84	6,60	0,04	2,27	0,09	2,00	3.605.265,36	0,74
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	13,90	7,12	0,22	3,46	-0,04	0,26	18.639.188,57	3,82
FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES	14,44	7,40	0,27	3,26	0,04	1,36	21.938.278,02	4,49
Sub-total	13,17	6,79	0,59		0,02	1,03	51.241.554,58	10,49

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,67%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	6,20	4,86	0,12	4,84	0,51	3,96	22.909.027,12	4,69
Sub-total	6,20	4,86	0,12		0,51	3,96	22.909.027,12	4,69

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP MULTIESTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	24,62	0,06	0,00	0,13	-0,01	0,49	1.961.077,24	0,40
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	0,45	2,66	-0,00	2,67	-2,03	-0,13	5.476.566,93	1,12
Sub-total	6,95	1,96	-0,00		-0,10	0,09	7.437.644,17	1,52

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,39%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,41	5,78	-0,02	4,75	0,76	10,16	11.059.930,49	2,27
Sub-total	12,41	5,78	-0,02		0,76	10,16	11.059.930,49	2,27

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	13,26	7,06	0,03	9,41	0,68	9,77	8.929.835,86	1,83
Sub-total	13,26	7,06	0,03		0,68	9,77	8.929.835,86	1,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 2,79%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BR HOTÉIS FII	0,21	0,01	0,00	1,73	-3,96	-0,06	6.101.243,19	1,25
CARE11	57,80	21,73	0,00	22,81	-0,14	-7,53	1.109.676,92	0,23
FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11	0,00	0,63	0,00	1,75	0,00	0,00	1.444.311,57	0,30
Sub-total	7,15	2,79	0,00		-0,26	-1,07	8.655.231,68	1,77

(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 (%)