



LDB
EMPRESAS

COLOMBO
NOVEMBRO 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 29.11.2024.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

78,05%

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	1,90	-0,11	0,41	5,98	10.851.440,11	2,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832	4,46	0,18	-0,35	-0,93	24.765.821,70	4,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	5,30	0,31	-0,35	-2,38	14.415.198,78	2,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,501000%)	3,03	0,04	0,89	1,58	7.883.226,84	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,520000%)	3,03	0,04	0,89	4,21	60.266.475,44	11,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,26	0,21	-0,31	-4,55	13.241.786,32	2,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,401000%)	4,27	0,04	0,88	1,56	12.187.120,10	2,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,430000%)	3,04	0,04	0,88	4,17	90.372.083,51	17,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,56	0,37	0,35	-5,29	8.366.152,23	1,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	7,17	0,28	-0,10	-6,99	3.519.760,07	0,69
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,26	0,09	0,57	0,91	245.869.065,10	48,09

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,66	0,00	0,66	6,59	0,00	0,00	6.786.887.264,23	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,04	0,81	9,67	58.734.586,31	11,49	11.355.883.585,27	0,52
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,24	0,00	0,62	6,15	0,00	0,00	3.931.535.018,92	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,45	0,04	1,09	12,36	24.208.989,86	4,74	1.191.627.106,25	2,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,76	0,04	0,88	8,25	82.943.576,17	16,22		

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05	0,04	0,17	0,17	50.353.212,32	9,85	19.373.615.271,47	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,03	0,04	0,71	8,84	1.537.786,57	0,30	1.247.283.464,76	0,12
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,59	0,04	0,82	9,93	12.900.423,94	2,52	2.152.693.853,65	0,60
RJI	RJI	TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 *	16,20	0,02	0,33	-5,22	1.118.457,75	0,22	39.386.597,56	2,84
GENIAL	RJI	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 *	54,69	-0,14	-2,66	-57,26	233.514,20	0,05	11.863.533,12	1,97
INFINITY	PLANNER	VANQUISH CORAL FI RF LP *	0,81	-0,34	-0,92	0,32	549.377,99	0,11	11.017.026,84	4,99
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,83	0,04	0,71	2,69	66.692.772,77	13,05		

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 *	152,73	-0,04	-0,04	108,37	1.209.331,37	0,24	6.597.270,46	18,33
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC *	4,76	-0,42	-0,42	-8,58	2.296.318,12	0,45	65.840.937,25	3,49
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			49,26	-0,29	-0,29	31,71	3.505.649,49	0,69		
Renda Fixa			1,62	0,07	0,67	5,31	399.011.063,53	78,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

9,53%

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	11,22	1,05	-2,08	-3,63	7.186.152,47	1,41	302.705.773,39	2,37
PLURAL	BEM	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	12,09	0,08	-4,55	-12,00	0,00	0,00	453.488.775,84	0,00
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	12,12	0,55	-1,86	-7,24	19.158.352,19	3,75	1.160.355.505,29	1,65
FINACAP	BEM	FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES	13,48	0,84	-4,62	-4,90	22.358.124,05	4,37	481.051.877,84	4,65
Sub-total Artigo 8º I			12,64	0,71	-3,27	-8,10	48.702.628,71	9,53		
Renda Variável			12,48	0,71	-3,27	-6,13	48.702.628,71	9,53		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,55%

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 FIA IE	13,85	0,76	8,52	50,06	12.894.944,10	2,52	514.126.669,22	2,51
Sub-total Artigo 9º II			13,85	0,76	8,52	50,06	12.894.944,10	2,52		

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	15,56	0,73	8,59	50,90	10.351.057,72	2,02	1.841.476.070,49	0,56
Sub-total Artigo 9º III			15,56	0,73	8,59	50,90	10.351.057,72	2,02		

Investimentos no Exterior			12,95	0,74	8,55	50,23	23.246.001,82	4,55		
----------------------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,29%

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	11,92	0,60	6,02	31,19	25.741.773,74	5,04	1.404.416.137,82	1,83
Sub-total Artigo 10º I			11,92	0,60	6,02	31,19	25.741.773,74	5,04		

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 MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	7,12	0,61	0,61	5,79	2.027.035,78	0,40	163.076.739,95	1,24
A5	PLANNER	W7 FIP MULTISTRATÉGIA *	61,49	-0,12	-0,12	-55,30	4.385.130,65	0,86	54.804.936,71	8,00
Sub-total Artigo 10º II			49,74	0,11	0,11	-45,02	6.412.166,43	1,25		
Investimentos Estruturados			17,14	0,50	4,79	3,19	32.153.940,17	6,29		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,59%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	RJI	BR HOTÉIS FII *	2,50	-0,05	-0,05	-0,79	6.067.273,46	1,19	123.499.170,90	4,91
PLANNER	PLANNER	CARE11 *	42,92	6,06	-2,78	2,19	903.225,40	0,18	250.052.298,45	0,36
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11 *	27,18	0,00	0,00	-8,10	1.157.531,07	0,23	71.188.600,69	1,63
Sub-total Artigo 11º			7,04	0,60	-0,35	-1,81	8.128.029,93	1,59		
Fundos Imobiliários			7,05	0,60	-0,35	-1,81	8.128.029,93	1,59		
Total			2,87	0,20	0,82	4,51	511.241.664,16	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	245.869.065,10	48,09	0,00	14,80	50,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	82.943.576,17	16,22	0,00	31,65	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	66.692.772,77	13,05	0,00	14,82	40,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	3.505.649,49	0,69	0,00	1,34	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	399.011.063,53	78,05					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	48.702.628,71	9,53	0,00	21,09	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	48.702.628,71	9,53					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	12.894.944,10	2,52	0,00	3,58	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	10.351.057,72	2,02	0,00	3,58	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.246.001,82	4,55					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	25.741.773,74	5,04	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	6.412.166,43	1,25	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	32.153.940,17	6,29					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	8.128.029,93	1,59	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	8.128.029,93	1,59					5,00
Total		511.241.664,16	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	0,57 72,12	0,91 9,20	1,11 43,05	2,33 44,49		1.410.718,02	0,28	5.127.907,60
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,88 111,68	8,25 83,69	2,64 102,65	4,81 92,06		1.080.183,82	0,21	13.041.129,27
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,71 90,31	2,69 27,30	2,29 88,88	2,97 56,91		190.428,01	0,04	-2.417,58
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,29 -36,75	31,71 321,74	24,38 946,66	33,59 642,68		-10.223,91	-0,00	1.251.107,16
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,27 -0,15	-8,10 -1,76	-5,88 1,72	2,88 -0,05		-1.764.010,12	-0,34	-6.361.419,68
Artigo 9º II % do CDI	8,52 1.076,42	50,06 508,01	11,65 452,43	28,44 544,17		1.012.012,58	0,20	4.301.937,74
Artigo 9º III % do CDI	8,59 1.085,99	50,90 516,46	14,88 578,03	27,24 521,21		819.019,92	0,16	3.491.311,52
Artigo 10º I % do CDI	6,02 760,79	31,19 316,46	8,15 316,44	16,82 321,79		1.461.498,61	0,29	6.119.502,51
Artigo 10º II % do CDI	0,11 14,31	-45,02 -456,80	0,33 12,80	-13,71 -262,38		7.252,41	0,00	-5.307.705,07
Artigo 11º % do CDI	-0,35 -44,40	-1,81 -18,39	-5,46 -211,87	-7,10 -135,85		-28.656,64	-0,01	-146.863,69
COLOMBO (Total)						4.178.222,70	0,82	21.514.489,78

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	14.916.154,58	0,00	0,00	454.004,77	14.415.198,78	-46.951,03	-367.244,60
NTN-B 150535 (6,501000%)	8.052.533,20	0,00	0,00	240.143,27	7.883.226,84	70.836,91	125.238,94
NTN-B 150535 (6,520000%)	61.562.586,85	0,00	0,00	1.838.435,89	60.266.475,44	542.324,48	2.502.924,53
NTN-B 150545	8.603.635,11	0,00	0,00	269.001,69	8.366.152,23	31.518,81	-490.191,56
NTN-B 150826	10.807.102,44	0,00	0,00	0,00	10.851.440,11	44.337,67	627.476,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150832	24.852.142,53	0,00	0,00	0,00	24.765.821,70	-86.320,83	-215.049,60
NTN-B 150840	13.282.305,73	0,00	0,00	0,00	13.241.786,32	-40.519,41	-627.859,45
NTN-B 150840 (6,401000%)	12.080.491,17	0,00	0,00	0,00	12.187.120,10	106.628,93	187.614,34
NTN-B 150840 (6,430000%)	89.579.589,32	0,00	0,00	0,00	90.372.083,51	792.494,19	3.651.327,48
NTN-B 150850	3.523.391,77	0,00	0,00	0,00	3.519.760,07	-3.631,70	-266.329,29
	247.259.932,70	0,00	0,00	2.801.585,62	245.869.065,10	1.410.718,02	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	42.533.226,58	0,00	-42.813.711,01	0,00	0,00	280.484,43	2.040.557,13
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	56.061.827,49	7.932.506,34	-5.753.436,55	0,00	58.734.586,31	493.689,03	5.853.803,36
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	7.190.411,30	224.969,62	-7.460.761,42	0,00	0,00	45.380,50	476.876,97
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	23.948.360,00	0,00	0,00	0,00	24.208.989,86	260.629,86	2.262.151,08
	129.733.825,37	8.157.475,96	-56.027.908,98	0,00	82.943.576,17	1.080.183,82	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	50.272.056,39	0,00	0,00	50.353.212,32	81.155,93	81.155,93
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	1.408.339,67	405.246,99	-287.374,67	0,00	1.537.786,57	11.574,58	94.099,36
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	12.794.883,38	0,00	0,00	0,00	12.900.423,94	105.540,56	1.165.210,10
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.114.806,54	0,00	0,00	0,00	1.118.457,75	3.651,21	-63.774,82
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	239.894,31	0,00	0,00	0,00	233.514,20	-6.380,11	-566.499,57
VANQUISH CORAL FI RF LP	554.492,15	0,00	0,00	0,00	549.377,99	-5.114,16	1.729,91
	16.112.416,05	50.677.303,38	-287.374,67	0,00	66.692.772,77	190.428,01	

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	1.209.864,48	0,00	0,00	0,00	1.209.331,37	-533,11	1.466.623,60
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2.306.008,92	0,00	0,00	0,00	2.296.318,12	-9.690,80	-215.516,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	3.515.873,40	0,00	0,00	0,00	3.505.649,49	-10.223,91	

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	7.339.039,98	0,00	0,00	0,00	7.186.152,47	-152.887,51	-270.929,76
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	3.641.390,47	0,00	-3.475.852,58	0,00	0,00	-165.537,89	-473.764,85
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	19.522.161,77	0,00	0,00	0,00	19.158.352,19	-363.809,58	-1.494.243,22
FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES	23.439.899,19	0,00	0,00	0,00	22.358.124,05	-1.081.775,14	-1.151.473,42
	53.942.491,41	0,00	-3.475.852,58	0,00	48.702.628,71	-1.764.010,12	

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 FIA IE	11.882.931,52	0,00	0,00	0,00	12.894.944,10	1.012.012,58	4.301.937,74
	11.882.931,52	0,00	0,00	0,00	12.894.944,10	1.012.012,58	

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	9.532.037,80	0,00	0,00	0,00	10.351.057,72	819.019,92	3.491.311,52
	9.532.037,80	0,00	0,00	0,00	10.351.057,72	819.019,92	

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	24.280.275,13	0,00	0,00	0,00	25.741.773,74	1.461.498,61	6.119.502,51
	24.280.275,13	0,00	0,00	0,00	25.741.773,74	1.461.498,61	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2.014.707,22	0,00	0,00	0,00	2.027.035,78	12.328,56	117.949,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	4.390.206,80	0,00	0,00	0,00	4.385.130,65	-5.076,15	-5.425.654,39
	6.404.914,02	0,00	0,00	0,00	6.412.166,43	7.252,41	

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	6.070.123,66	0,00	0,00	0,00	0,00	6.067.273,46	-2.850,20	-48.612,23
CARE11	929.031,84	0,00	0,00	0,00	0,00	903.225,40	-25.806,44	19.354,83
FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11	1.157.531,07	0,00	0,00	0,00	0,00	1.157.531,07	0,00	-101.966,40
	8.156.686,57	0,00	0,00	0,00	0,00	8.128.029,93	-28.656,64	

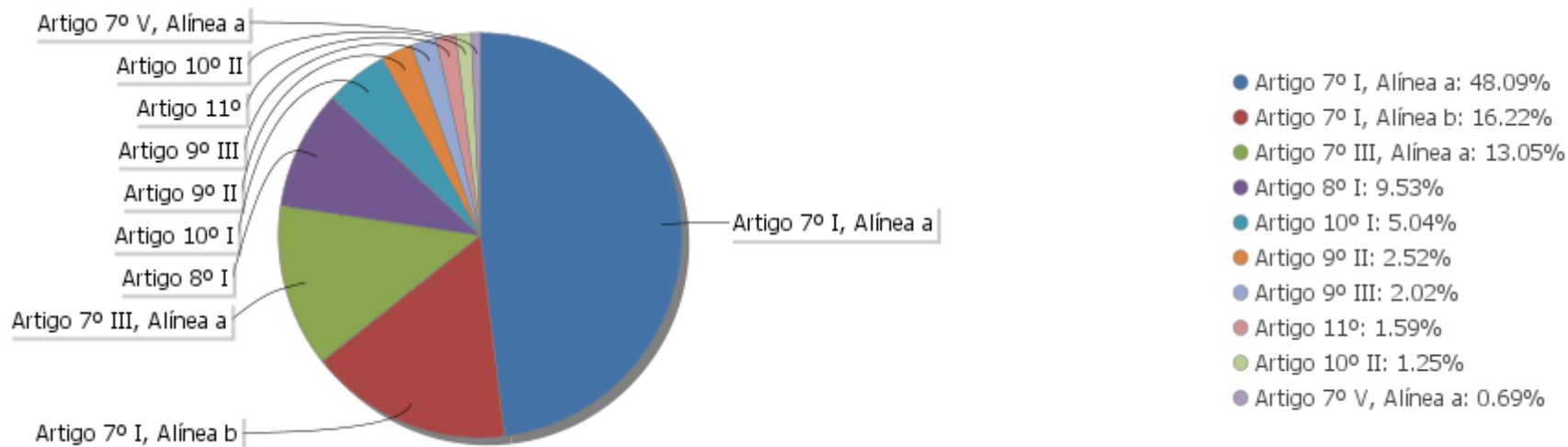
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

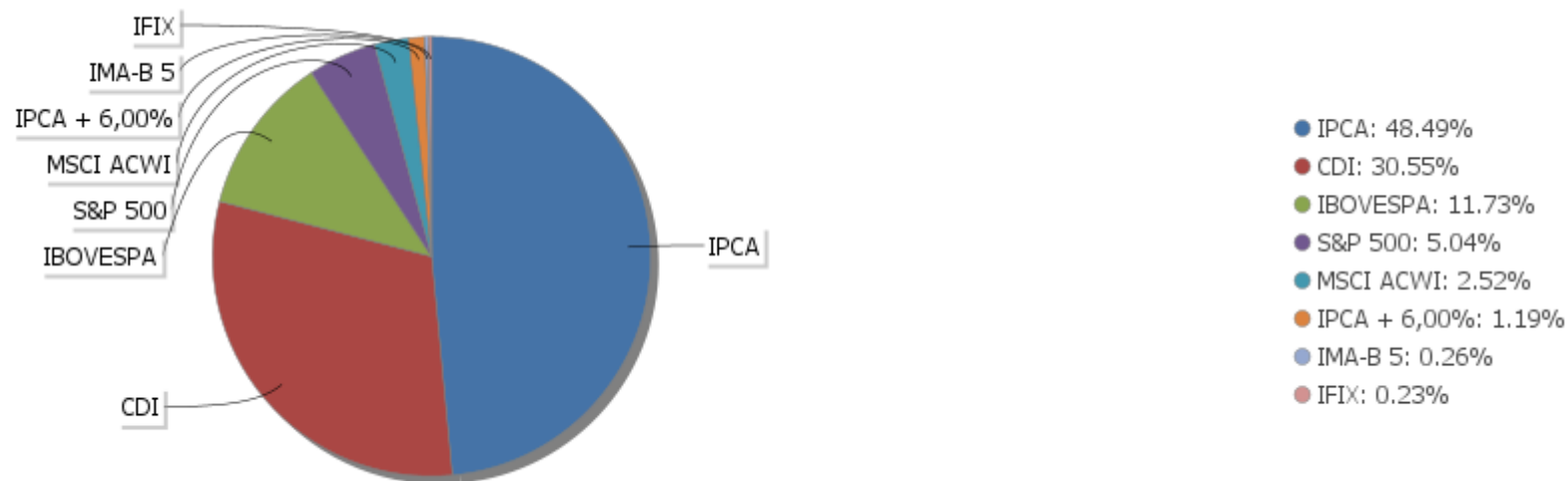
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	257.339.178,34	50,34		257.339.178,34	50,34	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00		257.339.178,34	50,34	
acima de 365 dias	253.902.485,82	49,66		511.241.664,16	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

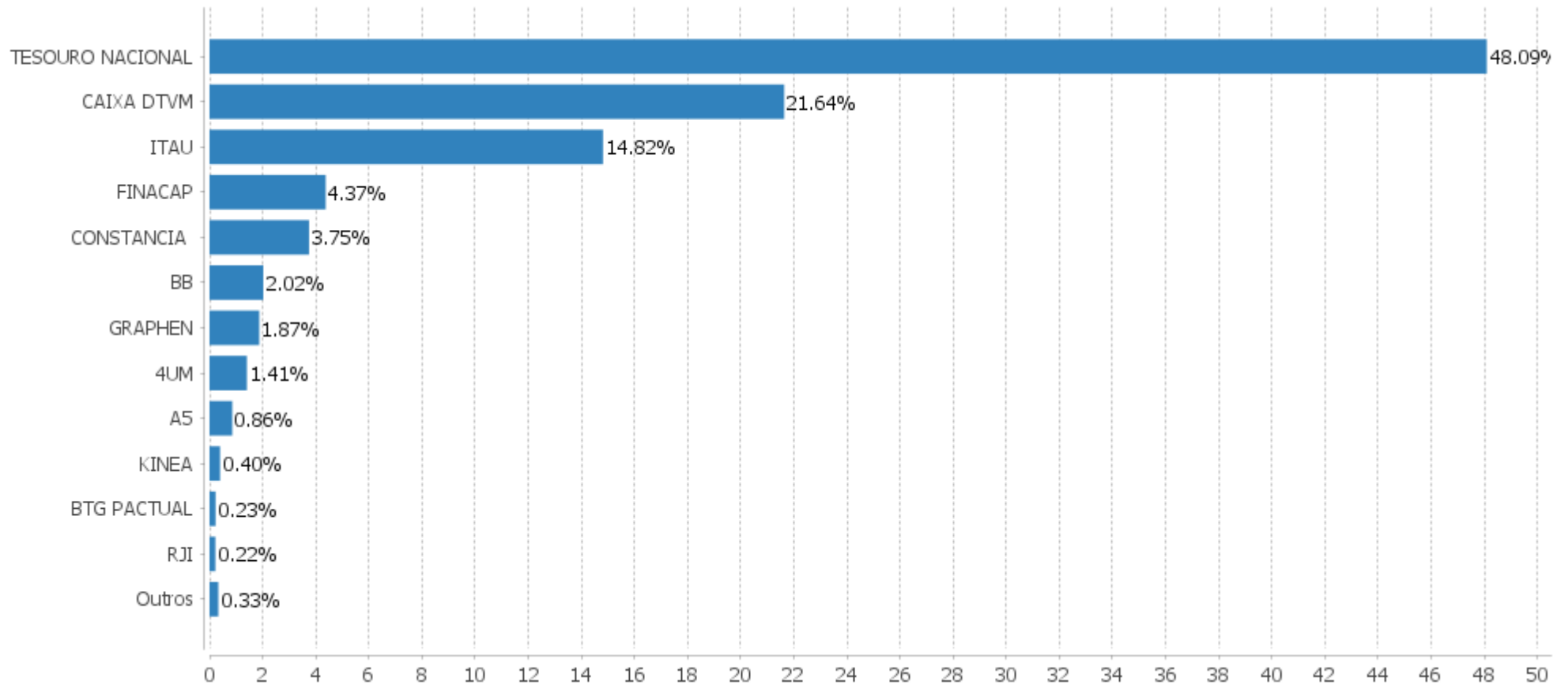


Alocação Por Estratégia



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	1,15	1,32	0,29	0,51	0,82		4,51
IPCA + 5,10%	0,86	1,21	0,56	0,82	0,88	0,61	0,84	0,42	0,86	1,02	0,77		9,18
p.p. indexador	-1,57	-1,12	0,20	-2,40	0,24	0,11	0,31	0,90	-0,57	-0,51	0,05		-4,66

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	6	54,55
Meses abaixo - Meta Atuarial	5	45,45

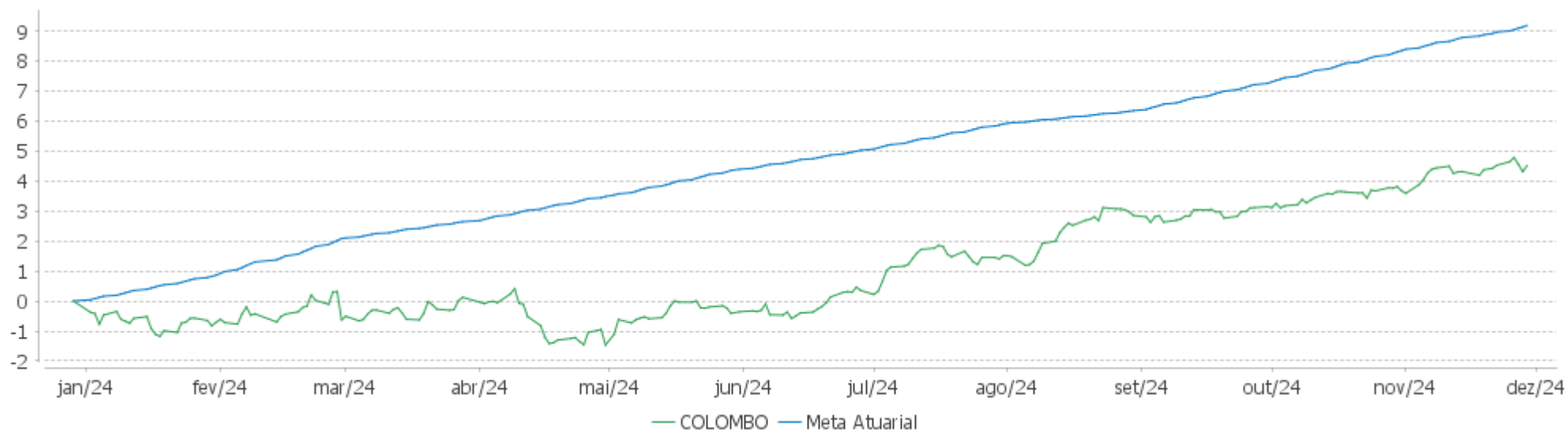
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,32	2024-08
Menor rentabilidade da Carteira	-1,59	2024-04

Relatório

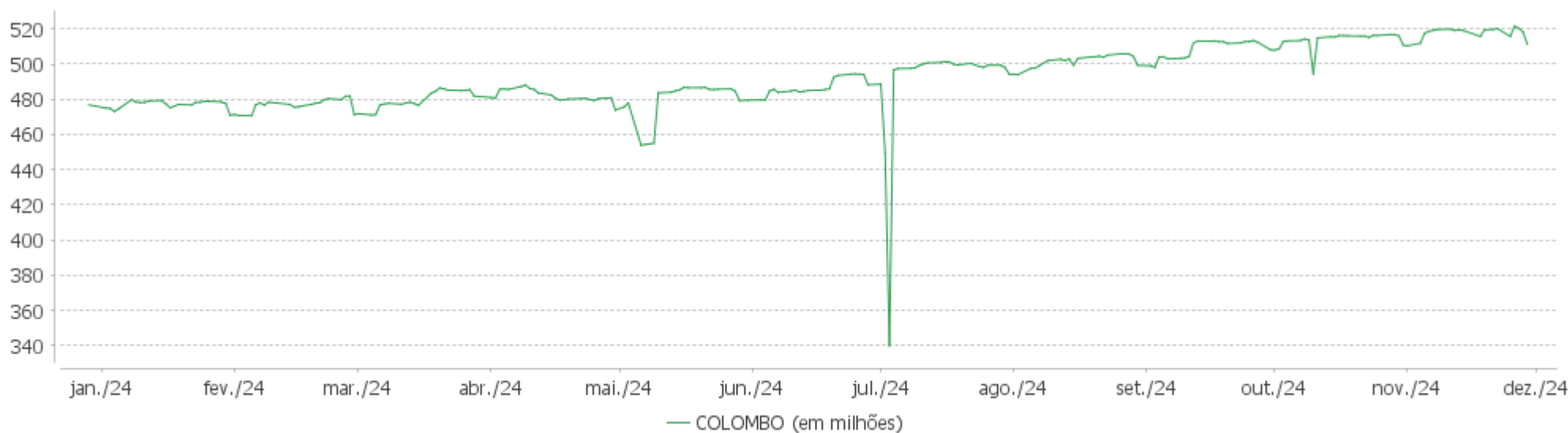
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,62	2,67	-1,04	1,92
06 meses	4,89	4,58	0,31	2,19
12 meses				
24 meses				
Desde 29/12/2023	4,51	9,18	-4,66	2,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

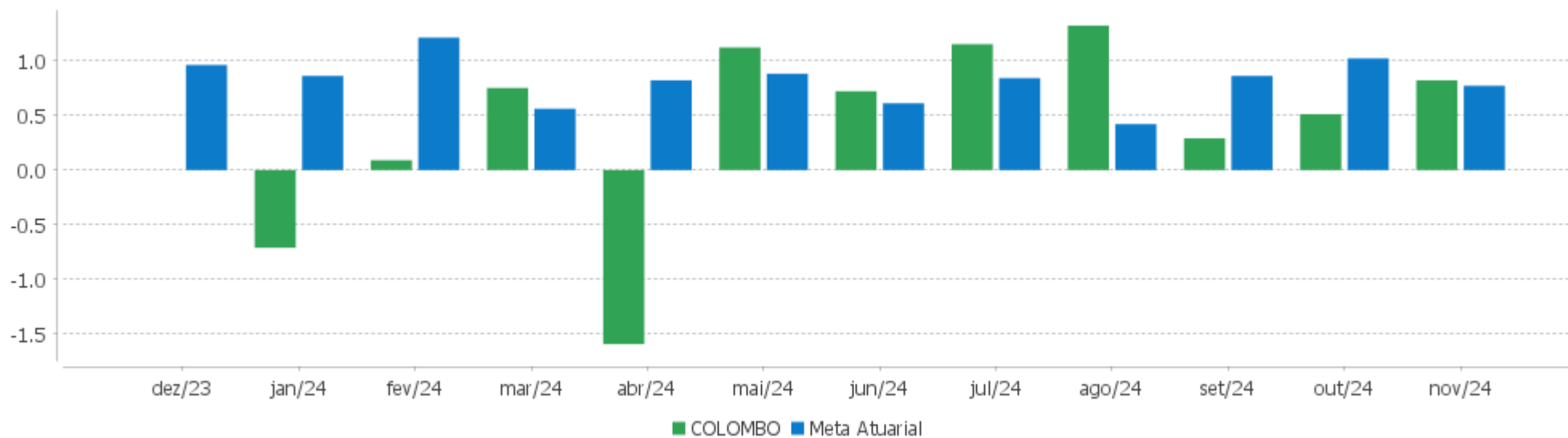


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,34 -0,02	6,25 -0,21	1,44 -0,06	3,33 -0,11	7,78 -0,24	20,06 -0,43	31,46 -0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,53 0,14	6,05 1,76	1,93 0,53	3,78 1,81	7,33 2,46	21,83 12,05	34,45 18,19
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,81 102,25	9,67 98,15	2,62 101,63	5,26 100,66	10,66 98,31	25,26 98,75	40,39 99,43
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	1,09 137,55	12,36 125,41	3,70 143,87	6,25 119,62	13,86 127,83	27,03 105,66	38,29 94,26
NTN-B 150840 (6,430000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,49	7,23 2,94	2,70 1,31	5,26 3,28	8,16 3,29		
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	0,35 -0,04	-5,29 -9,58	-3,63 -5,03	-2,11 -4,09	-1,59 -6,47	12,36 2,58	15,89 -0,37
NTN-B 150840 (6,401000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,49	4,02 -0,27	2,70 1,30	2,11 0,14	4,93 0,05		
NTN-B 150535 (6,501000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,50	7,31 3,02	2,72 1,33	5,29 3,32	8,25 3,37		
NTN-B 150850 Var. IPCA p.p.	-0,10 -0,49	-6,99 -11,28	-4,08 -5,47	-2,78 -4,76	-2,48 -7,36	11,16 1,38	14,06 -2,20
NTN-B 150832 Var. IPCA p.p.	-0,35 -0,74	-0,93 -5,22	-1,99 -3,39	-0,20 -2,18	1,58 -3,30	15,40 5,61	
NTN-B 150535 Var. IPCA p.p.	-0,35 -0,74	-2,38 -6,67	-2,49 -3,88	-0,56 -2,53	0,76 -4,12	14,46 4,68	19,82 3,56
NTN-B 150826 Var. IPCA p.p.	0,41 0,02	5,98 1,69	1,82 0,43	3,39 1,41	7,62 2,75	20,85 11,07	30,81 14,55
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-0,31 -0,70	-4,55 -8,84	-3,99 -5,39	-1,66 -3,63	-0,44 -5,31	12,54 2,76	17,24 0,97
NTN-B 150535 (6,520000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,50	7,32 3,03	2,73 1,33	5,30 3,33	8,26 3,39		
AR CAPITAL FIDC IMOBILIARIOS I % do CDI	-0,04 -5,57	108,37 1.099,64	145,17 5.637,27	109,31 2.091,37	108,04 996,73	99,73 389,82	107,68 265,09
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,42 -53,11	-8,58 -87,07	-1,25 -48,37	-6,42 -122,84	-8,98 -82,88	-11,50 -44,94	-8,55 -21,06
VANQUISH CORAL FI RF LP	-0,92	0,32	-1,97	-1,67	-1,09	-88,36	-85,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-116,57	3,21	-76,51	-31,86	-10,02	-345,37	-211,11
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-2,66 -3,02	-57,26 -63,72	-5,90 -7,40	-9,84 -13,28	-65,12 -73,14	-65,82 -86,31	-65,25 -97,33
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,82 104,26	9,93 100,76	2,85 110,57	5,53 105,72	11,17 103,05	25,30 98,88	39,15 96,38
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,81 102,32	10,12 102,65	2,60 100,91	5,37 102,67	11,13 102,72	26,22 102,48	41,65 102,55
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,33 -0,03	-5,22 -11,68	-0,64 -2,15	-2,79 -6,23	-14,32 -22,33	-7,88 -28,37	-4,40 -36,47
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,71 90,20	8,84 89,66	2,32 89,93	4,69 89,66	9,72 89,69	22,61 88,39	35,13 86,49
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-1,86 1,26	-7,24 -0,89	-5,63 1,97	3,05 0,13	-1,21 0,10	7,42 -4,30	16,78 -6,52
FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-4,62 -1,50	-4,90 1,45	-5,51 2,09	3,30 0,38	1,23 2,54	16,52 4,80	30,05 6,75
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-4,55 -1,43	-12,00 -5,65	-10,82 -3,22	-1,66 -4,59	-8,29 -6,99	7,07 -4,65	32,29 8,98
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,08 1,04	-3,63 2,71	-5,17 2,43	3,38 0,45	3,55 4,85	19,76 8,04	28,14 4,83
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,59 11,71	50,90 57,24	14,88 22,48	27,24 24,32	55,47 56,78	69,21 57,49	37,01 13,70
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	8,52 -0,05	50,06 1,72	11,65 0,93	28,44 1,64	56,93 4,58	69,39 13,08	36,77 8,89
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	6,02 -4,75	31,19 -26,95	8,15 -6,15	16,82 -15,19	37,97 -24,01	66,17 -2,89	62,28 20,01
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,12 -14,61	-55,30 -561,18	-0,37 -14,43	-20,03 -383,26	-55,37 -510,78	-56,14 -219,45	-59,79 -147,20
FIP MULTIESTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II Var. IPCA p.p.	0,61 0,22	5,79 1,50	1,88 0,48	3,87 1,90	6,18 1,31	6,86 -2,93	
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	-2,78 0,34	3,40 9,75	-14,63 -7,03	-23,84 -26,76	0,47 1,78	-56,01 -67,72	-19,05 -42,36
BR HOTÉIS FII Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,05 -0,88	-0,79 -10,82	-0,45 -3,33	-0,62 -5,65	1,69 -9,48	4,64 -18,68	2,07 -36,37
FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11 Var. IFIX p.p.	0,00 2,11	-8,10 -2,84	-19,86 -12,31	-19,86 -12,61			
COLOMBO	0,82	4,51	1,62	4,89			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 5,10% p.p.	0,05	-4,66	-1,04	0,31			
CDI	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58	40,62
IBOVESPA	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72	23,31
INPC + 6,00%	0,77	10,01	2,91	4,86	11,13	22,31	37,39
IPCA + 6,00%	0,83	10,04	2,88	5,04	11,17	23,33	38,44

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
BR HOTÉIS FII	Não se aplica	Não se aplica				
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
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 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
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 MULTISTRATEGIA 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 PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CDI, DE UM DIA, APURADO PELA CETIP	0,50
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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 WORLD EQUITIES FIC FIA IE	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	0,57	8,70	2,25	4,67	9,69	24,55	39,10	42,37	47,99
IRF-M 1+	-1,13	1,19	-1,16	0,25	2,94	21,88	31,77	26,13	33,70
IRF-M TOTAL	-0,52	3,57	0,03	1,73	5,11	22,46	33,80	31,22	38,18
IMA-B 5	0,36	6,46	1,51	3,44	8,02	20,49	32,08	39,53	49,87
IMA-B 5+	-0,23	-4,45	-3,28	-1,64	-0,68	12,61	17,33	18,28	19,09
IMA-B TOTAL	0,02	0,19	-1,29	0,32	2,94	16,04	23,95	28,04	32,54
IMA-GERAL TOTAL	0,32	5,72	1,04	3,28	7,44	22,31	34,25	37,09	42,81
IDKA 2	0,22	6,09	1,42	2,97	7,63	20,43	31,15	38,90	50,09
IDKA 20	-0,82	-13,71	-7,94	-6,77	-8,03	6,06	5,14	2,45	-2,26
CDI	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58	40,62	45,93	50,28

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72	23,31	15,40	16,11
IBRX 100	-2,91	-5,57	-7,24	3,28	-0,40	11,51	22,85	15,49	17,47
IBRX 50	-2,62	-4,28	-7,20	3,62	0,80	11,99	26,06	18,92	20,01
SMALL CAP	-4,48	-18,66	-9,94	-4,85	-12,93	-7,61	-16,01	-27,09	-24,11
Índice Consumo - ICON	-5,91	-16,48	-10,36	-2,17	-11,49	-15,37	-33,32	-48,25	-46,33
Índice Dividendos - IDIV	-0,07	2,38	-2,50	8,11	9,45	27,77	48,64	49,15	49,07

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	10,77	58,14	14,30	32,01	61,98	69,06	42,28	89,11	175,24

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,11	-5,26	-7,55	-7,24	-1,23	9,42	21,68	11,71	8,55

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,57	48,34	10,72	26,80	52,35	56,31	27,87	58,39	126,10

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,39	4,29	1,40	1,98	4,87	9,78	16,26	28,75	34,30
INPC	0,33	4,27	1,43	1,80	4,84	8,88	15,38	28,03	34,68
IGPM	1,30	5,55	3,48	5,25	6,33	2,65	8,70	28,14	59,57
SELIC									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,69	8,12	2,40	4,03	9,07	18,72	30,76	50,55	63,27
IPCA + 5,00%	0,76	9,08	2,64	4,53	10,12	21,01	34,56	56,40	71,24
IPCA + 5,50%	0,80	9,56	2,76	4,79	10,64	22,17	36,49	59,39	75,34
IPCA + 5,89%	0,82	9,93	2,86	4,98	11,05	23,07	38,01	61,76	78,59
IPCA + 6,00%	0,83	10,04	2,88	5,04	11,17	23,33	38,44	62,43	79,51
INPC + 4,00%	0,63	8,10	2,43	3,85	9,03	17,74	29,77	49,70	63,73
INPC + 6,00%	0,77	10,01	2,91	4,86	11,13	22,31	37,39	61,52	80,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (6,501000%)	7.883.226,84	6,501000	7.624.838,40	6,957200	-258.388,44
NTN-B 150535 (6,520000%)	60.266.475,44	6,520000	58.372.555,78	6,957200	-1.893.919,66
NTN-B 150840 (6,401000%)	12.187.120,10	6,401000	11.698.694,38	6,835600	-488.425,72
NTN-B 150840 (6,430000%)	90.372.083,51	6,430000	86.989.236,40	6,835600	-3.382.847,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
326	05/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	890.268,96	0,00	152.271,59234400	5,8465860000
340	05/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.050.613,44	0,00	692.816,87466800	5,8465860000
321	06/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	96.570,38	16.510,59097000	5,8489960000
318	07/11/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	31.143,05	11.996,34918700	2,5960440000
320	08/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.241,14	0,00	382,85026700	5,8538290000
333	08/11/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	224.969,62	0,00	111.677,88146700	2,0144510000
317	12/11/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	405.246,99	0,00	155.924,43774400	2,5989960000
325	14/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	9.636,20	1.643,28907400	5,8639730000
339	14/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	267.224,72	45.570,59166000	5,8639730000
319	14/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	355,85	60,68410600	5,8639730000
332	14/11/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	2.310,54	1.146,84238800	2,0146970000
316	14/11/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	89,81	34,52950100	2,6009640000
324	19/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.217,22	0,00	377,78407000	5,8690140000
338	19/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.813.117,41	0,00	479.316,86821600	5,8690140000
328	25/11/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	42.813.711,01	9.712.401,05838600	4,4081490000
335	25/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.709.766,45	0,00	1.222.211,96188200	5,4898550000
330	25/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	38.516.544,63	0,00	7.015.949,35203200	5,4898550000
331	25/11/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	7.458.450,88	3.694.131,19305100	2,0190000000
329	26/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.297.060,88	0,00	782.399,21313200	5,4921590000
334	26/11/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	748.684,43	0,00	136.318,78283200	5,4921590000
323	28/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	961.809,35	163.460,43172600	5,8840500000
315	28/11/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	8.864,69	3.397,91319300	2,6088630000
327	29/11/2024	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	0,00	3.475.852,58	1.353.395,76277310	2,5682455000
322	29/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	66.018,70	0,00	11.215,07027900	5,8866060000
336	29/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.417.840,05	750.490,18998900	5,8866060000
337	29/11/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	108.029,47	0,00	18.351,74122400	5,8866060000
314	29/11/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	247.277,12	94.747,52844000	2,6098530000
Total			58.834.779,34	59.791.136,23		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.255.791,93

Value-At-Risk: 1,03%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,51	0,44		0,15	-0,09	0,65	399.011.063,53	78,05
Artigo 8º	15,54	6,09		0,44	-0,26	-3,27	48.702.628,71	9,53
Artigo 9º	16,26	7,83		0,14	0,48	8,55	23.246.001,82	4,55
Artigo 10º	9,45	6,26		0,30	0,43	4,84	32.153.940,17	6,29
Artigo 11º	4,44	1,95		0,00	-0,26	-0,35	8.128.029,93	1,59
COLOMBO		1,03		1,03			511.241.664,16	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,44%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826	2,28	1,04	0,01	1,04	-0,17	0,41	10.851.440,11	2,12
NTN-B 150832	6,28	2,50	0,05	2,51	-0,18	-0,35	24.765.821,70	4,84
NTN-B 150535	7,80	2,69	0,03	2,70	-0,15	-0,35	14.415.198,78	2,82
NTN-B 150535 (6,501000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,68	0,89	7.883.226,84	1,54
NTN-B 150535 (6,520000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,69	0,89	60.266.475,44	11,79
NTN-B 150840	9,76	3,17	0,03	3,18	-0,11	-0,31	13.241.786,32	2,59
NTN-B 150840 (6,401000%)	0,14	0,19	-0,00	0,19	0,63	0,88	12.187.120,10	2,38
NTN-B 150840 (6,430000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,65	0,88	90.372.083,51	17,68
NTN-B 150545	10,49	3,47	0,02	3,47	-0,04	0,35	8.366.152,23	1,64
NTN-B 150850	11,86	3,91	0,01	3,92	-0,08	-0,10	3.519.760,07	0,69
Sub-total	2,19	0,78	0,16		-0,10	0,57	245.869.065,10	48,09

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,26	NaN	0,00	NaN	-0,20	0,34	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,02	0,04	-0,00	0,04	0,74	0,81	58.734.586,31	11,49
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,10	NaN	0,00	NaN	-0,24	0,53	0,00	0,00
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,96	0,90	-0,01	0,90	0,31	1,09	24.208.989,86	4,74
Sub-total	0,64	0,26	-0,01		0,15	0,88	82.943.576,17	16,22

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	0,03	0,02	0,00	0,02	0,68	0,81	50.353.212,32	9,85
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,01	0,01	-0,00	0,00	-6,10	0,71	1.537.786,57	0,30
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,22	0,24	-0,00	0,24	0,15	0,82	12.900.423,94	2,52
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,03	0,25	-0,00	1,03	-13,79	0,33	1.118.457,75	0,22
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,52	0,30	-0,00	1,05	-6,62	-2,66	233.514,20	0,05
VANQUISH CORAL FI RF LP	1,50	0,40	-0,00	0,41	-1,15	-0,92	549.377,99	0,11
Sub-total	0,12	0,05	-0,00		-0,65	0,71	66.692.772,77	13,05

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AR CAPITAL FIDC IMOBILIARIOS I	0,16	1,55	-0,00	1,55	-5,20	-0,04	1.209.331,37	0,24
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,53	0,28	-0,00	0,28	-0,79	-0,42	2.296.318,12	0,45
Sub-total	1,06	0,67	-0,00		-1,02	-0,29	3.505.649,49	0,69

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,09%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	14,66	5,97	0,06	3,21	-0,20	-2,08	7.186.152,47	1,41
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	18,91	NaN	0,00	NaN	-0,28	-4,55	0,00	0,00
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	12,35	5,46	0,15	3,05	-0,21	-1,86	19.158.352,19	3,75
FINACAP MAURITSSTAD FI EM AÇÕES	19,06	7,06	0,23	2,71	-0,28	-4,62	22.358.124,05	4,37
Sub-total	15,54	6,09	0,44		-0,26	-3,27	48.702.628,71	9,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,83%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC FIA IE	17,54	7,91	0,03	6,56	0,44	8,52	12.894.944,10	2,52
Sub-total	17,54	7,91	0,03		0,44	8,52	12.894.944,10	2,52

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	14,67	10,14	0,12	11,51	0,53	8,59	10.351.057,72	2,02
Sub-total	14,67	10,14	0,12		0,53	8,59	10.351.057,72	2,02

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,26%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	11,70	7,84	0,30	5,94	0,45	6,02	25.741.773,74	5,04
Sub-total	11,70	7,84	0,30		0,45	6,02	25.741.773,74	5,04

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2,22	0,15	0,00	0,17	-0,08	0,61	2.027.035,78	0,40
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	0,42	1,02	-0,00	1,02	-2,15	-0,12	4.385.130,65	0,86
Sub-total	0,41	0,67	-0,00		-1,64	0,11	6.412.166,43	1,25

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 1,95%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BR HOTÉIS FII	0,17	0,03	-0,00	0,08	-4,90	-0,05	6.067.273,46	1,19
CARE11	40,63	17,45	0,00	17,99	-0,09	-2,78	903.225,40	0,18
FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11	0,00	1,01	0,00	3,05	0,00	0,00	1.157.531,07	0,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	4,44	1,95	0,00		-0,26	-0,35	8.128.029,93	1,59

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 18,33% do patrimônio líquido do fundo AR CAPITAL FIDC IMOBILIARIOS I, percentual este superior ao permitido no Artigo 19 da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo AR CAPITAL FIDC IMOBILIARIOS I não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo VANQUISH CORAL FI RF LP não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo W7 FIP MULTIESTRATÉGIA não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo CARE11 não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo BR HOTÉIS FII não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo FII - MULTI SHOPPINGS FI IMOBILIARIO - SHOP11 não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.