



LDB
EMPRESAS

VILA VELHA - CONSOLIDADO
SETEMBRO 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 30.09.2024.

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

87,73%

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 150525 (6,240000%)	2,94	0,02	0,70	4,20	15.177.786,78	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,401000%)	4,16	-0,00	0,71	0,94	90.848.689,00	11,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,580000%)	4,34	-0,00	0,73	0,78	40.310.852,94	4,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,415000%)	4,18	-0,02	0,40	0,40	30.117.110,99	3,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,580000%)	4,21	-0,02	0,19	0,19	20.035.542,74	2,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,710000%)	4,23	-0,03	0,14	0,14	20.027.318,00	2,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,840000%)	4,24	-0,03	0,09	0,09	50.043.037,90	6,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,250000%)	0,41	-0,05	0,62	7,53	28.389.495,60	3,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,270000%)	0,67	-0,12	0,62	7,55	34.280.099,58	4,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (3,680000%) ..	0,60	-0,10	0,50	6,32	8.030.730,31	0,98
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,67	-0,12	0,55	6,79	411.441,96	0,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,76	-0,14	0,61	7,42	16.087.042,09	1,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,82	-0,16	0,66	7,90	28.771.171,17	3,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,085000%)	4,17	-0,16	0,69	0,57	60.340.209,26	7,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,290000%)	0,88	-0,18	0,63	7,56	28.662.875,51	3,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,190000%)	3,04	-0,20	0,70	2,71	89.735.581,41	10,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,260000%)	0,94	-0,19	0,62	7,54	23.306.943,93	2,85
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,44	-0,09	0,69	8,22	584.575.929,17	71,46

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				
BANESTES	BANESTES	BANESTES IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LONGO PRAZO	1,82	-0,09	0,39	3,28	2.943.441,16	0,36	29.907.248,65	9,84
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,04	0,03	0,60	5,73	2.463.740,46	0,30	1.469.872.790,33	0,17
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,65	0,02	0,71	5,32	16.534.946,50	2,02	6.153.638.080,30	0,27
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,93	-0,25	-0,69	0,60	1.232.356,40	0,15	4.321.577.868,21	0,03
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,71	-0,07	0,32	3,70	1.019.271,11	0,12	3.419.686.698,34	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,90	-0,09	0,40	4,73	77.002,38	0,01	4.168.680.215,13	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	-0,08	0,38	5,14	3.813.793,56	0,47	6.913.810.528,18	0,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,03	-0,02	0,39	5,44	28.084.551,57	3,43		

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				
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,07	0,04	0,88	8,43	40.635.527,45	4,97	3.307.294.747,20	1,23
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,04	0,04	0,75	7,19	2.870.571,03	0,35	3.861.447.255,05	0,07
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,04	0,84	8,11	18.820.441,06	2,30	20.065.228.623,01	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,04	0,85	8,08	41.812.862,43	5,11	5.910.577.806,47	0,71
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,04	0,04	0,75	7,17	855.458,27	0,10	1.178.841.947,20	0,07
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,06	0,04	0,85	8,15	104.994.860,24	12,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,45

-0,07

0,70

7,76

717.655.340,98

87,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

4,06%

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 BOLSA AMERICANA FIA	12,54	0,16	2,30	22,74	12.478.382,91	1,53	1.448.470.329,08	0,86
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	12,73	-0,72	-3,37	-1,56	333.295,38	0,04	645.563.640,82	0,05
PLURAL	BEM	BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	12,23	-0,51	-4,87	-1,22	2.815.256,82	0,34	457.095.113,70	0,62
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	12,45	-0,68	-3,04	-1,89	13.149.913,04	1,61	298.065.702,49	4,41
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	11,38	-0,26	-0,78	3,31	4.467.930,12	0,55	253.323.501,90	1,76
Sub-total Artigo 8º I			11,89	-0,30	-0,96	-2,09	33.244.778,27	4,06		
Renda Variável			11,89	-0,30	-0,96	-2,09	33.244.778,27	4,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,76%

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 ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	15,47	0,57	0,09	30,57	7.144.622,17	0,87	891.054.322,04	0,80
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,68	0,53	-0,32	40,56	31.801.301,22	3,89	2.640.148.103,06	1,20
Sub-total Artigo 9º III			15,18	0,54	-0,25	36,74	38.945.923,39	4,76		
Investimentos no Exterior			15,18	0,54	-0,25	36,74	38.945.923,39	4,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,45%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,47	0,39	2,33	24,07	12.994.241,53	1,59	2.032.300.517,82	0,64
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	6,79	-0,34	-1,08	1,81	10.181.041,73	1,24	105.253.143,33	9,67
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II FIF MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	3,46	0,06	0,27	0,20	5.010.092,17	0,61	142.408.566,22	3,52
Sub-total Artigo 10º I			9,44	0,06	0,71	14,78	28.185.375,43	3,45		
Investimentos Estruturados			9,44	0,06	0,71	14,78	28.185.375,43	3,45		
Total			1,12	-0,04	0,59	8,87	818.031.418,07	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	584.575.929,17	71,46	30,00	55,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	28.084.551,57	3,43	0,00	12,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	104.994.860,24	12,84	3,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	717.655.340,98	87,73					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	33.244.778,27	4,06	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	33.244.778,27	4,06					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	38.945.923,39	4,76	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	38.945.923,39	4,76					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	28.185.375,43	3,45	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	28.185.375,43	3,45					15,00
Total		818.031.418,07	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	0,69 82,93	8,22 102,94	2,19 83,30	4,82 92,10	10,71 96,91	3.341.756,15	36.625.889,51
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,39 46,66	5,44 68,11	3,19 121,08	4,50 86,04	8,87 80,26	139.785,40	5.342.726,98
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,85 102,22	8,15 101,96	2,72 103,17	5,32 101,76	11,26 101,90	1.511.838,80	8.716.192,20
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,96 2,11	-2,09 -0,33	6,09 -0,30	2,36 -0,53	12,30 -0,78	-323.826,53	387.916,22
Artigo 9º III % do CDI	-0,25 -29,87	36,74 459,76	0,64 24,24	19,92 381,05	46,91 424,32	-97.278,61	10.462.081,48
Artigo 10º I % do CDI	0,71 84,90	14,78 185,02	4,84 184,09	6,99 133,64	29,78 269,36	198.235,82	2.711.963,89
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						4.770.511,03	64.246.770,28

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 150525 (6,240000%)	15.072.219,26	0,00	0,00	0,00	15.177.786,78	105.567,52	613.822,21
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	7.991.093,92	0,00	0,00	0,00	8.030.730,31	39.636,39	483.847,22
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	409.211,23	0,00	0,00	0,00	411.441,96	2.230,73	26.540,84
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	15.989.498,89	0,00	0,00	0,00	16.087.042,09	97.543,20	1.127.873,22
NTN-B 150545 (5,730000%)	28.582.516,93	0,00	0,00	0,00	28.771.171,17	188.654,24	2.141.436,20
NTN-B 150545 (6,085000%)	59.927.826,46	0,00	0,00	0,00	60.340.209,26	412.382,80	341.947,69
NTN-B 150555 (5,260000%)	23.162.709,74	0,00	0,00	0,00	23.306.943,93	144.234,19	1.659.272,26
NTN-B 150826 (6,401000%)	90.205.375,98	0,00	0,00	0,00	90.848.689,00	643.313,02	848.668,11
NTN-B 150826 (6,580000%)	40.019.777,82	0,00	0,00	0,00	40.310.852,94	291.075,12	311.304,40
NTN-B 150828 (6,415000%)	0,00	29.998.252,11	0,00	0,00	30.117.110,99	118.858,88	118.858,88
NTN-B 150828 (6,580000%)	0,00	19.997.050,21	0,00	0,00	20.035.542,74	38.492,53	38.492,53
NTN-B 150828 (6,710000%)	0,00	19.998.987,16	0,00	0,00	20.027.318,00	28.330,84	28.330,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150828 (6,840000%)	0,00	49.998.170,98	0,00	0,00	50.043.037,90	44.866,91	44.866,91
NTN-B 150830 (5,250000%)	28.214.032,03	0,00	0,00	0,00	28.389.495,60	175.463,57	2.051.133,50
NTN-B 150840 (5,270000%)	34.067.686,40	0,00	0,00	0,00	34.280.099,58	212.413,18	2.478.670,10
NTN-B 150850 (5,290000%)	28.484.811,31	0,00	0,00	0,00	28.662.875,51	178.064,20	2.075.263,59
NTN-B 150850 (6,190000%)	89.114.952,59	0,00	0,00	0,00	89.735.581,41	620.628,82	2.423.463,52
	461.241.712,56	119.992.460,46	0,00	0,00	584.575.929,17	3.341.756,15	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LONGO PRAZO	2.932.100,82	0,00	0,00	0,00	2.943.441,16	11.340,34	93.441,17
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	2.333.419,54	10.690.549,59	-10.575.223,63	0,00	2.463.740,46	14.994,96	307.143,38
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	16.418.896,44	0,00	0,00	0,00	16.534.946,50	116.050,06	829.994,84
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	16.253.008,42	0,00	-15.000.000,00	0,00	1.232.356,40	-20.652,02	186.320,87
BB PREV RF IRF M	1.016.031,67	0,00	0,00	0,00	1.019.271,11	3.239,44	691.668,56
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	76.698,22	0,00	0,00	0,00	77.002,38	304,16	3.477,64
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.799.285,10	0,00	0,00	0,00	3.813.793,56	14.508,46	381.433,92
	42.829.440,21	10.690.549,59	-25.575.223,63	0,00	28.084.551,57	139.785,40	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	34.163.487,71	6.150.000,00	0,00	0,00	40.635.527,45	322.039,74	2.122.416,49
BB PREV RF FLUXO FIC	2.645.793,26	375.123,80	-171.886,03	0,00	2.870.571,03	21.540,00	205.597,03
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	123.006.749,99	0,00	-104.992.448,45	0,00	18.820.441,06	806.139,52	3.694.720,23
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	41.459.218,76	0,00	0,00	0,00	41.812.862,43	353.643,67	2.621.231,63
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	947.441,66	414.979,11	-515.438,37	0,00	855.458,27	8.475,87	72.226,82
	202.222.691,38	6.940.102,91	-105.679.772,85	0,00	104.994.860,24	1.511.838,80	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	12.198.179,21	0,00	0,00	0,00	12.478.382,91	280.203,70	538.454,89
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	344.934,36	0,00	0,00	0,00	333.295,38	-11.638,98	-5.283,57
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	2.959.496,71	0,00	0,00	0,00	2.815.256,82	-144.239,89	-34.743,18
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	13.562.804,38	0,00	0,00	0,00	13.149.913,04	-412.891,34	-253.521,61
FIA CAIXA DIVIDENDOS	4.503.190,14	0,00	0,00	0,00	4.467.930,12	-35.260,02	143.009,69
	33.568.604,80	0,00	0,00	0,00	33.244.778,27	-323.826,53	

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 ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	7.138.415,39	0,00	0,00	0,00	7.144.622,17	6.206,78	1.672.958,56
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	31.904.786,61	0,00	0,00	0,00	31.801.301,22	-103.485,39	7.558.429,82
	39.043.202,00	0,00	0,00	0,00	38.945.923,39	-97.278,61	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12.698.522,11	0,00	0,00	0,00	12.994.241,53	295.719,42	2.520.829,99
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	10.292.163,79	0,00	0,00	0,00	10.181.041,73	-111.122,06	181.041,73
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II FIF MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	4.996.453,71	0,00	0,00	0,00	5.010.092,17	13.638,46	10.092,17
	27.987.139,61	0,00	0,00	0,00	28.185.375,43	198.235,82	

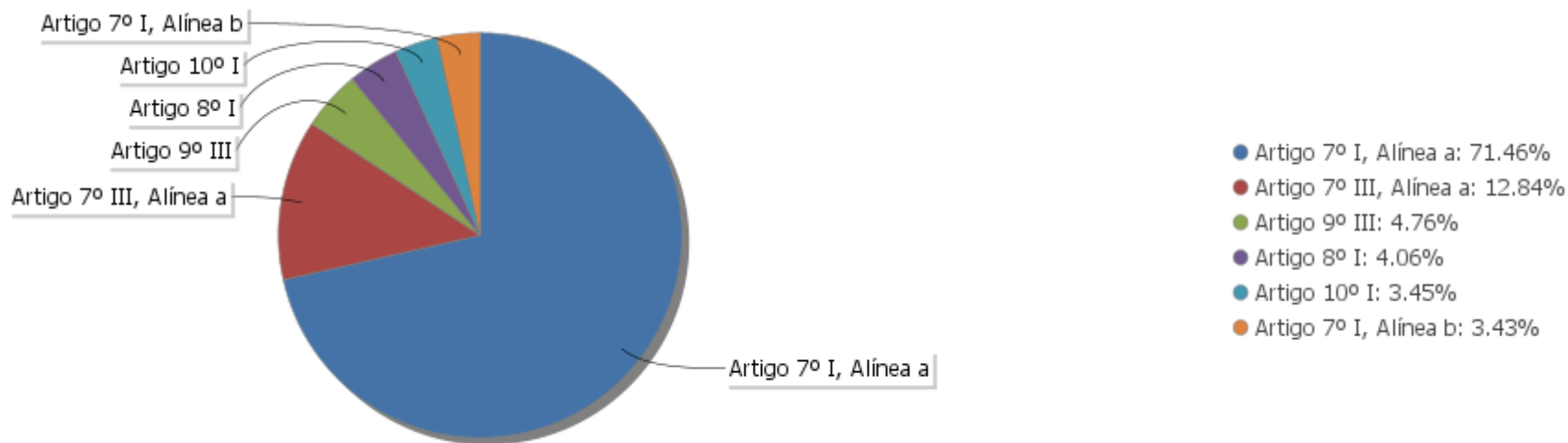
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

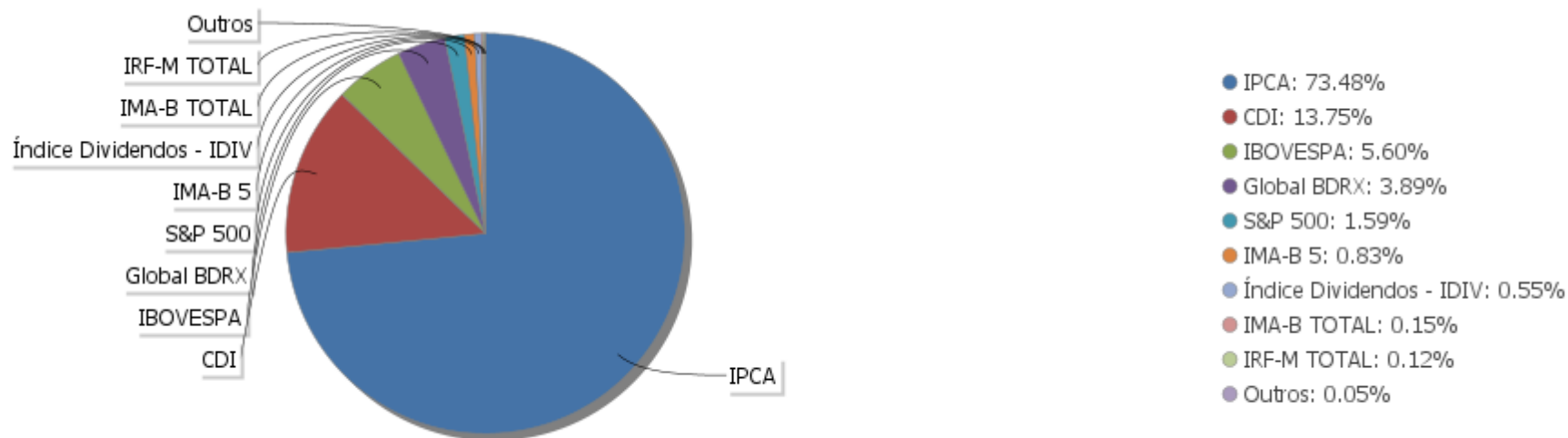
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	228.445.396,73	27,93		228.445.396,73	27,93	
de 31 dias a 365 dias	15.177.786,78	1,86		243.623.183,51	29,78	
acima de 365 dias	574.408.234,56	70,22		818.031.418,07	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

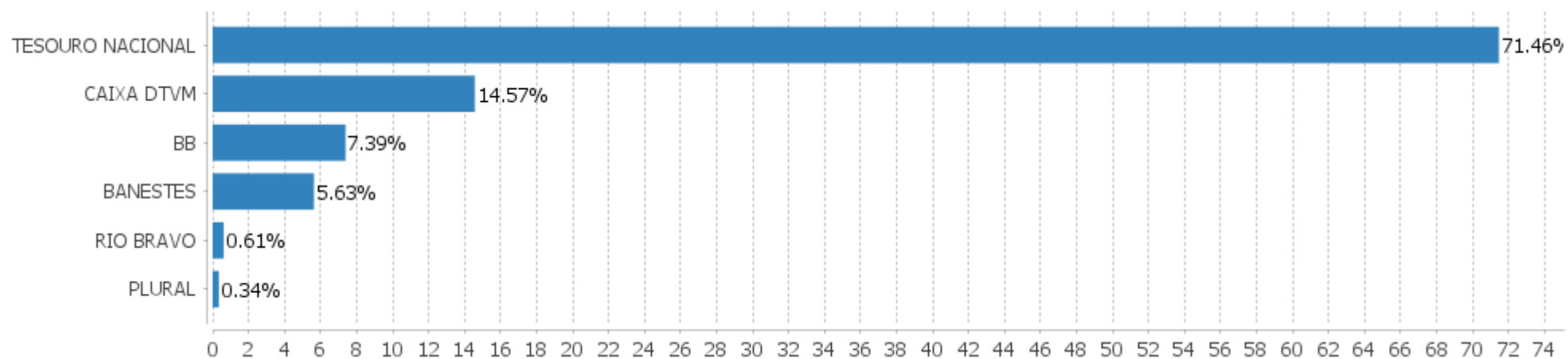


Alocação Por Estratégia



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	1,02	1,04	1,01	0,44	1,09	1,35	0,94	1,06	0,59				8,87
IPCA + 5,09%	0,86	1,21	0,56	0,82	0,88	0,61	0,84	0,41	0,86				7,25
p.p. indexador	0,17	-0,17	0,45	-0,38	0,22	0,74	0,10	0,65	-0,27				1,62
2023	1,66	0,58	1,53	0,97	1,22	1,23	0,94	0,62	0,20	0,49	1,58	1,17	12,90
IPCA + 5,09%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,33	0,54	0,69	0,66	0,66	0,68	0,96	9,88
p.p. indexador	0,69	-0,62	0,37	0,00	0,56	0,89	0,41	-0,06	-0,45	-0,17	0,91	0,22	3,02
2022	-1,78	-0,48	1,88	-0,54	0,98	-0,27	1,69	0,00	-0,58	1,41	1,38	0,26	3,95
IPCA + 4,92%	0,94	1,38	2,05	1,43	0,89	1,07	-0,28	0,08	0,11	0,97	0,79	1,04	10,97
p.p. indexador	-2,72	-1,86	-0,16	-1,97	0,09	-1,35	1,97	-0,08	-0,69	0,43	0,59	-0,78	-7,02
2021	-0,48	-1,03	1,05	1,06	0,94	0,42	0,32	0,32	-1,16	1,81	0,80	2,14	6,31
IPCA + 5,43%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,01
p.p. indexador	-1,15	-2,27	-0,37	0,33	-0,33	-0,56	-1,10	-1,02	-2,77	0,13	-0,57	0,93	-9,70
2020	0,49	-0,79	-6,98	1,89	2,02	2,02	2,94	-0,49	-1,49	-0,01	2,81	3,55	5,63
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,22	-1,45	-7,55	1,75	1,95	1,28	2,06	-1,21	-2,61	-1,35	1,46	1,69	-5,00
2019	2,66	0,46	0,52	1,25	2,07	2,43	1,16	-0,08	2,05	2,10	-0,88	2,10	16,97
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	1,83	-0,43	-0,68	0,19	1,43	1,98	0,44	-0,70	1,60	1,47	-1,85	0,46	6,38
2018								0,28	0,40	3,39	0,72	1,12	6,02
IPCA + 6,00%								0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	3,23
p.p. indexador								-0,17	-0,52	2,42	0,47	0,51	2,78

Performance Sobre a Meta Atuarial

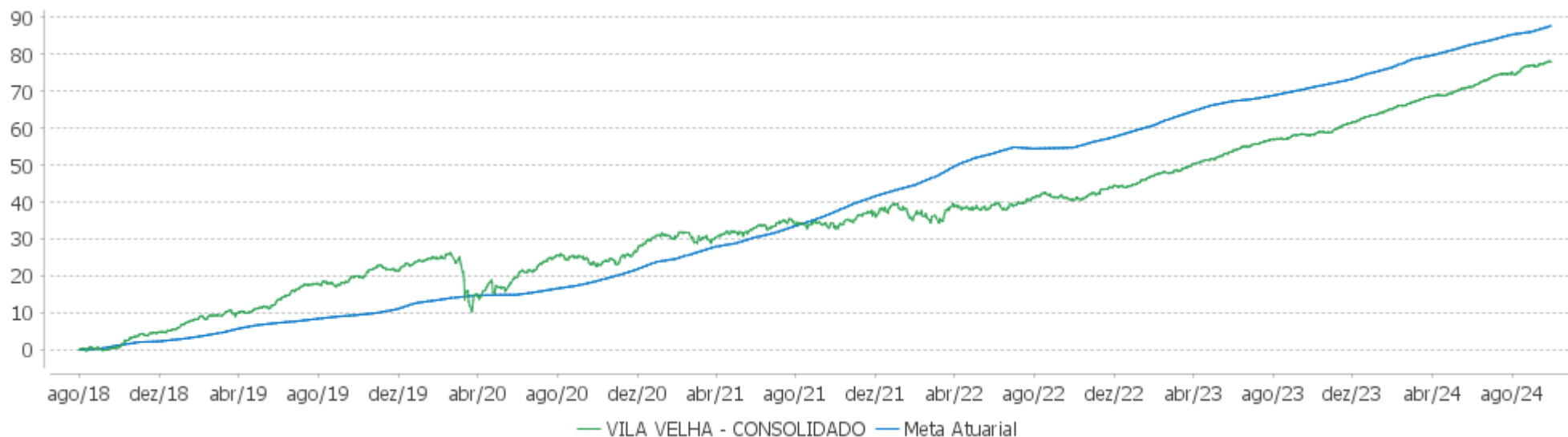
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	38	51,35
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	48,65
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,55	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03

Relatório

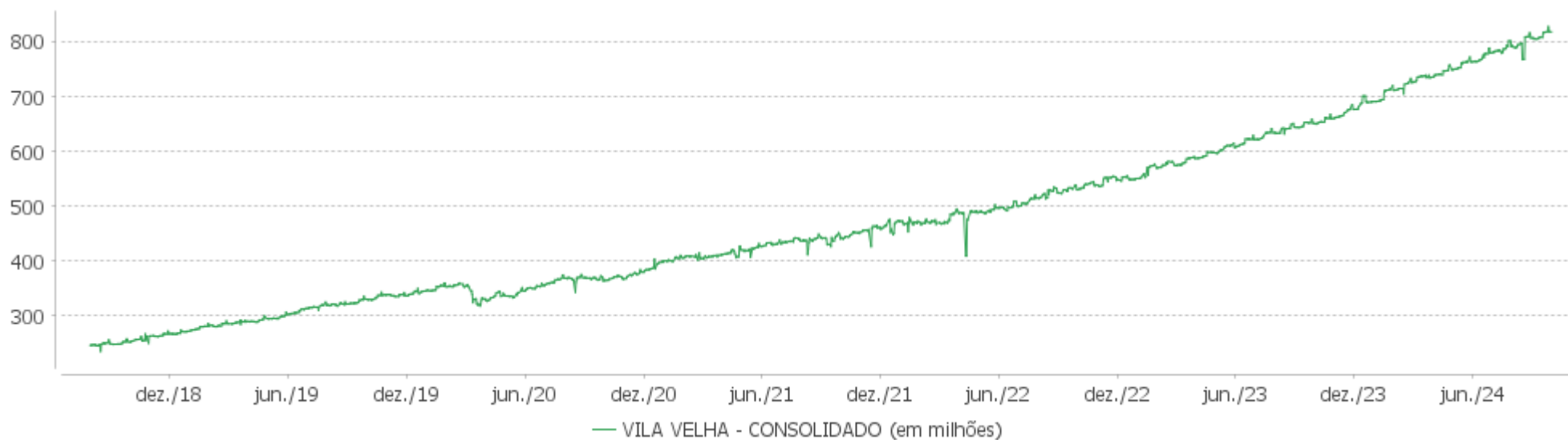
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,61	2,12	0,49	1,44
06 meses	5,59	4,49	1,11	1,20
12 meses	12,43	9,72	2,72	1,12
24 meses	26,69	21,19	5,50	1,52
36 meses	33,93	36,43	-2,50	3,08
48 meses	44,57	58,71	-14,13	3,45
60 meses	48,25	73,34	-25,09	4,94
Desde 31/07/2018	77,91	91,61	-13,70	4,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

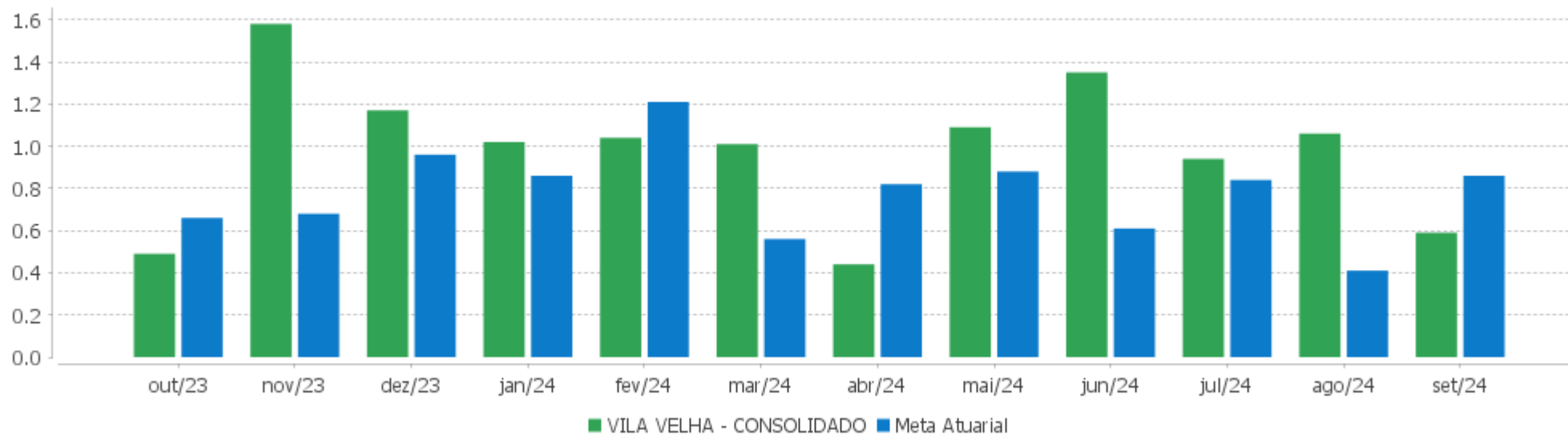


Patrimônio Líquido



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
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA % do CDI	0,60 72,36	5,73 71,76	1,89 72,01	3,75 71,76	7,96 72,01	18,84 72,49	28,21 71,03
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,38 -0,02	5,14 -0,17	1,87 -0,05	3,07 -0,11	8,21 -0,23	20,61 -0,45	31,64 -0,61
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,40 0,00	4,73 -0,28	1,72 -0,02	2,60 -0,12	7,72 -0,33	19,96 -0,44	30,11 -1,01
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,32 -0,02	3,70 -0,20	2,31 -0,05	2,06 -0,13	8,19 -0,26	22,33 -0,84	31,91 -1,12
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	6,65 3,35	2,71 1,91	4,15 2,28	9,77 5,34	24,69 14,85	35,92 18,20
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,69 -0,02	0,60 -0,22	1,84 -0,09	0,49 -0,15	5,34 -0,28	16,66 -0,62	24,76 -1,01
BANESTES IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,39 -0,02	4,92 -0,38	1,81 -0,11	2,96 -0,22	8,00 -0,43		
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IPCA p.p.	0,61 0,17	7,42 4,11	1,98 1,18	4,31 2,45	9,59 5,17	20,84 11,00	36,97 19,26
NTN-B 150828 (6,710000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	2,23 -1,07	-0,69 -1,49	1,97 0,11	4,74 0,32		
NTN-B 150850 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,19	7,56 4,25	2,02 1,22	4,41 2,55	9,78 5,36	21,26 11,42	37,70 19,99
NTN-B 150826 (6,401000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	2,13 -1,17	-0,70 -1,50	1,89 0,03	4,57 0,14		
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IPCA p.p.	0,50 0,06	6,32 3,02	1,62 0,82	3,59 1,73	8,12 3,69	17,61 7,77	31,52 13,80
NTN-B 150826 (6,580000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,29	2,24 -1,07	-0,66 -1,47	1,97 0,11	4,72 0,30		
NTN-B 150555 (5,260000%) Var. IPCA p.p.	0,62 0,18	7,54 4,23	2,02 1,22	4,39 2,53	9,76 5,33	21,20 11,36	37,59 19,88
NTN-B 150830 (5,250000%) Var. IPCA p.p.	0,62 0,18	7,53 4,23	2,02 1,21	4,39 2,53	9,75 5,32	21,18 11,34	37,56 19,84
NTN-B 150850 (6,190000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,26	4,78 1,47	2,25 1,45	4,62 2,75	7,22 2,80		
NTN-B 150828 (6,415000%)	0,64	2,09	-0,73	1,86	4,52		

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.	0,20	-1,22	-1,53	-0,00	0,10		
NTN-B 150545 (6,085000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,25	4,78 1,47	2,01 1,21	1,58 -0,29	4,10 -0,32		
NTN-B 150525 (6,240000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,26	8,21 4,91	2,27 1,47	4,87 3,01	7,57 3,14		
NTN-B 150828 (6,840000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	2,30 -1,01	-0,68 -1,48	2,02 0,16	4,84 0,42		
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IPCA p.p.	0,55 0,11	6,79 3,49	1,77 0,97	3,90 2,04	8,75 4,33	18,99 9,15	33,84 16,13
NTN-B 150840 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,62 0,18	7,55 4,24	2,02 1,22	4,40 2,54	9,76 5,34	21,22 11,38	37,63 19,92
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	7,90 4,60	2,14 1,34	4,63 2,77	10,24 5,82	22,28 12,44	35,57 17,86
NTN-B 150828 (6,580000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	2,17 -1,14	-0,71 -1,51	1,92 0,06	4,65 0,22		
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,88 104,91	8,43 105,50	2,77 105,18	5,48 104,89	11,61 105,06	24,12 92,83	38,48 96,90
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,84 100,90	8,11 101,54	2,73 103,75	5,33 101,89	11,17 101,08	26,07 100,35	40,17 101,16
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 90,22	7,19 90,04	2,38 90,26	4,70 89,93	9,96 90,07	23,52 90,51	35,60 89,66
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,85 102,25	8,08 101,11	2,70 102,71	5,24 100,20	11,26 101,82	26,47 101,86	40,76 102,64
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,75 89,83	7,17 89,73	2,36 89,66	4,69 89,61	9,94 89,96	22,88 88,05	34,20 86,12
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-3,04 0,03	-1,89 -0,13	6,27 -0,11	2,74 -0,16	12,74 -0,34	19,25 -0,54	18,32 -0,46
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,78 -0,06	3,31 -0,94	7,45 -0,47	7,59 -0,79	17,87 -1,61	32,87 -3,53	40,96 -5,27
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,30 5,38	22,74 24,51	5,59 -0,79	11,03 8,14	37,64 24,56	69,92 50,13	52,27 33,50
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-4,87 -1,79	-6,13 -4,36	2,84 -3,55	-2,02 -4,92	6,45 -6,63	16,68 -3,11	37,15 18,38
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-3,37 -0,14	-1,56 -0,29	5,79 -0,32	2,74 -0,04	12,29 -0,75	17,03 -2,81	13,48 -3,72
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,32	40,56	0,75	22,25	51,31	81,77	40,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Global BDRX p.p.	-0,12	-1,40	0,12	-0,25	-1,67	-4,63	-4,59
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	0,09 3,17	30,57 32,34	0,80 -5,58	14,89 11,99	40,17 27,08	60,67 40,88	26,62 7,84
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	2,33 4,06	24,07 -11,88	6,32 2,89	11,65 -7,94	40,19 -6,02	81,31 19,37	64,51 30,52
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II FIF MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	0,27 32,72	0,53 33,52					
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-1,08 2,00	1,36 3,13	3,49 -2,89	2,02 -0,87	13,20 0,12	13,42 -6,37	
VILA VELHA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,09% p.p.	0,59 -0,27	8,87 1,62	2,61 0,49	5,59 1,11	12,43 2,72	26,69 5,45	33,93 -2,61
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANESTES IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LONGO PRAZO						0,20
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA			D+0	D+0		3,50
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,60
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES			D+5 du	D+7 du	-	2,00
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIA CAIXA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2		
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II FIF MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA						

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	0,82	7,18	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,50	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	3,90	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	5,30	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	-2,62	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	4,99	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	5,01	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	-9,14	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	-1,23	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	-0,22	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	-13,67	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	-11,22	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72

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	-1,73	35,95	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-0,16	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	31,85	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	3,31	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	3,29	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	2,64	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	6,41	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	7,18	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	7,56	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	7,86	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	6,39	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150525 (6,240000%)	15.177.786,78	6,240000	15.239.121,65	5,566500	61.334,87
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	8.030.730,31	3,680000	5.815.742,28	6,436600	-2.214.988,03
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	411.441,96	4,290000	321.451,94	6,436600	-89.990,02
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	16.087.042,09	5,100000	13.852.040,71	6,436600	-2.235.001,38
NTN-B 150545 (5,730000%)	28.771.171,17	5,730000	26.646.673,74	6,436600	-2.124.497,43
NTN-B 150545 (6,085000%)	60.340.209,26	6,085000	58.165.882,12	6,436600	-2.174.327,14
NTN-B 150555 (5,260000%)	23.306.943,93	5,260000	19.931.689,22	6,435900	-3.375.254,71
NTN-B 150826 (6,401000%)	90.848.689,00	6,401000	90.233.059,04	6,835800	-615.629,96
NTN-B 150826 (6,580000%)	40.310.852,94	6,580000	40.158.480,28	6,835800	-152.372,66
NTN-B 150828 (6,415000%)	30.117.110,99	6,415000	29.816.953,23	6,743900	-300.157,76
NTN-B 150828 (6,580000%)	20.035.542,74	6,580000	19.943.226,21	6,743900	-92.316,53
NTN-B 150828 (6,710000%)	20.027.318,00	6,710000	20.019.832,72	6,743900	-7.485,28
NTN-B 150828 (6,840000%)	50.043.037,90	6,840000	50.236.842,13	6,743900	193.804,23
NTN-B 150830 (5,250000%)	28.389.495,60	5,250000	26.760.192,83	6,525800	-1.629.302,77
NTN-B 150840 (5,270000%)	34.280.099,58	5,270000	30.657.162,45	6,420000	-3.622.937,13
NTN-B 150850 (5,290000%)	28.662.875,51	5,290000	24.753.076,59	6,456600	-3.909.798,92
NTN-B 150850 (6,190000%)	89.735.581,41	6,190000	87.034.744,50	6,456600	-2.700.836,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2860	02/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	967.838,93	93.797,47456300	10,3183900700
2877	02/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	12.421,47	0,00	4.867,94994900	2,5516840000
2872	02/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	38.079,45	3.690,44489949	10,3183900700
2867	03/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.164,55	0,00	112,82930686	10,3213432100
2859	04/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	179,17	17,35418834	10,3243088400
2876	05/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	95.235,79	37.283,32881300	2,5543800000
2893	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	375.123,80	0,00	129.441,79142400	2,8980114990
2892	09/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	55.685,01	19.208,27700600	2,8990111910
2858	10/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.859,88	179,94084396	10,3360635600
2875	10/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	402.557,64	0,00	157.428,52204100	2,5570820000
2865	10/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	498,74	0,00	48,25241226	10,3360635600
2891	10/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.477,40	509,44203900	2,9000355020
2890	11/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	24.497,68	8.444,45605200	2,9010370650
2857	16/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	404.582,03	39.098,93854606	10,3476474100
2871	16/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	51.973,56	5.022,74168840	10,3476474100
2882	16/09/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	15.000.000,00	1.872.983,86374600	8,0086114410
2881	16/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	14.998.240,10	4.547.126,77528400	3,2983993720
2883	16/09/2024	NTN-B 150828 (6,415000%)	29.998.252,11	0,00	7.006,00000000	4.281,7944780000
2889	16/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12,01	4,13555700	2,9040826940
2855	17/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	452.699,48	0,00	43.736,67325086	10,3505695900
2863	17/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.830.434,31	0,00	176.843,82434817	10,3505695900
2873	17/09/2024	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	6.150.000,00	0,00	2.497.182,58024833	2,4627754700
2880	20/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	19.997.050,20	6.052.809,03381900	3,3037636060
2884	20/09/2024	NTN-B 150828 (6,580000%)	19.997.050,21	0,00	4.686,00000000	4.267,4029480000
2879	23/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	19.998.987,16	6.050.951,77944200	3,3050977580
2885	23/09/2024	NTN-B 150828 (6,710000%)	19.998.987,16	0,00	4.704,00000000	4.251,4853660000
2878	24/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	49.998.170,99	15.121.570,19150100	3,3064139740
2886	24/09/2024	NTN-B 150828 (6,840000%)	49.998.170,98	0,00	11.804,00000000	4.235,6973050000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2853	25/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	8.405.752,51	0,00	810.705,33320341	10,3684435800
2888	25/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	90.177,93	30.973,58836100	2,9114460020
2852	26/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	6.714.428,16	647.393,95680936	10,3714717900
2856	26/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	204.408,06	19.708,68364490	10,3714717900
2854	26/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	453.613,67	43.736,67325086	10,3714717900
2862	26/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.062.285,53	102.423,79784849	10,3714717900
2864	26/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	500,45	48,25241226	10,3714717900
2866	26/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.170,21	112,82930686	10,3714717900
2868	26/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	469,42	45,26042740	10,3714717900
2869	26/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.804,26	173,96358021	10,3714717900
2870	26/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	668.706,65	64.475,57883240	10,3714717900
2887	26/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	36,00	12,36069000	2,9124587420
2851	27/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	775,49	74,74965148	10,3744965300
2874	27/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	420.202,58	163.568,63226100	2,5689680000
2861	27/09/2024	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.548,71	245,67071685	10,3744965300
Total			137.623.112,96	131.254.996,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.355.552,27

Value-At-Risk: 0,65%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,70	0,12		-0,01	-0,19	0,70	717.655.340,98	87,73
Artigo 8º	9,76	5,03		0,15	-0,18	-0,96	33.244.778,27	4,06
Artigo 9º	18,36	9,33		0,39	-0,06	-0,25	38.945.923,39	4,76
Artigo 10º	7,65	4,05		0,12	-0,02	0,71	28.185.375,43	3,45
VILA VELHA - CONSOLIDADO		0,65		0,65			818.031.418,07	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,12%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,240000%)	0,25	0,08	0,00	0,10	-0,54	0,70	15.177.786,78	1,86
NTN-B 150826 (6,401000%)	0,30	0,20	-0,00	0,20	-0,40	0,71	90.848.689,00	11,11
NTN-B 150826 (6,580000%)	4,23	0,20	-0,00	0,20	-0,03	0,73	40.310.852,94	4,93
NTN-B 150828 (6,415000%)	0,31	0,20	-0,00	0,20	-0,61	0,64	30.117.110,99	3,68
NTN-B 150828 (6,580000%)	0,32	0,20	-0,00	0,20	-0,57	0,66	20.035.542,74	2,45
NTN-B 150828 (6,710000%)	0,32	0,20	-0,00	0,20	-0,53	0,66	20.027.318,00	2,45
NTN-B 150828 (6,840000%)	0,32	0,20	-0,00	0,20	-0,50	0,67	50.043.037,90	6,12
NTN-B 150830 (5,250000%)	0,46	0,23	0,00	0,24	-0,46	0,62	28.389.495,60	3,47
NTN-B 150840 (5,270000%)	0,80	0,31	0,00	0,32	-0,26	0,62	34.280.099,58	4,19
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	0,70	0,31	0,00	0,31	-0,49	0,50	8.030.730,31	0,98
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,79	0,31	0,00	0,32	-0,37	0,55	411.441,96	0,05
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,90	0,31	0,00	0,32	-0,25	0,61	16.087.042,09	1,97
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,98	0,32	0,00	0,32	-0,18	0,66	28.771.171,17	3,52
NTN-B 150545 (6,085000%)	1,03	0,21	-0,00	0,22	-0,14	0,69	60.340.209,26	7,38
NTN-B 150850 (5,290000%)	1,08	0,32	0,00	0,33	-0,19	0,63	28.662.875,51	3,50
NTN-B 150850 (6,190000%)	1,20	0,17	-0,00	0,18	-0,12	0,70	89.735.581,41	10,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150555 (5,260000%)	1,13	0,32	0,00	0,33	-0,19	0,62	23.306.943,93	2,85
Sub-total	0,79	0,14	-0,01		-0,18	0,69	584.575.929,17	71,46

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LONGO PRAZO	2,02	1,13	-0,00	0,15	-0,22	0,39	2.943.441,16	0,36
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,01	0,00	-0,00	0,00	-20,56	0,60	2.463.740,46	0,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,37	0,42	-0,00	0,43	-0,34	0,71	16.534.946,50	2,02
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,93	2,00	-0,00	0,04	-0,39	-0,69	1.232.356,40	0,15
BB PREV RF IRF M	2,85	1,46	-0,00	0,02	-0,18	0,32	1.019.271,11	0,12
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,94	1,22	-0,00	0,25	-0,23	0,40	77.002,38	0,01
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,03	1,01	-0,00	0,01	-0,22	0,38	3.813.793,56	0,47
Sub-total	1,44	0,61	-0,00		-0,31	0,39	28.084.551,57	3,43

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,06	0,03	0,00	0,03	0,69	0,88	40.635.527,45	4,97
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	-0,00	0,01	-4,25	0,75	2.870.571,03	0,35
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	-0,00	0,02	0,33	0,84	18.820.441,06	2,30
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,04	-0,00	0,04	0,30	0,85	41.812.862,43	5,11
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,01	0,00	-0,00	0,00	-12,17	0,75	855.458,27	0,10
Sub-total	0,02	0,02	-0,00		0,76	0,85	104.994.860,24	12,84

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,33%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	16,76	10,19	0,08	11,48	-0,04	0,09	7.144.622,17	0,87
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,83	9,23	0,31	1,21	-0,06	-0,32	31.801.301,22	3,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	18,36	9,33	0,39		-0,06	-0,25	38.945.923,39	4,76

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,03%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	14,06	6,90	0,09	8,06	0,10	2,30	12.478.382,91	1,53
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	12,02	6,36	0,00	0,35	-0,35	-3,37	333.295,38	0,04
BRASIL PLURAL DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	10,88	5,67	0,01	2,70	-0,52	-4,87	2.815.256,82	0,34
FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA	12,07	6,24	0,04	0,30	-0,32	-3,04	13.149.913,04	1,61
FIA CAIXA DIVIDENDOS	11,33	5,48	0,01	0,23	-0,14	-0,78	4.467.930,12	0,55
Sub-total	9,76	5,03	0,15		-0,18	-0,96	33.244.778,27	4,06

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,05%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,63	7,43	0,10	6,12	0,11	2,33	12.994.241,53	1,59
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	5,70	2,71	0,01	4,21	-0,34	-1,08	10.181.041,73	1,24
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II FIF MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	4,59	1,71	0,01	1,71	-0,12	0,27	5.010.092,17	0,61
Sub-total	7,65	4,05	0,12		-0,02	0,71	28.185.375,43	3,45

(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 (%)