



**LDB**  
EMPRESAS

**OUROESTE**  
JANEIRO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.01.2024.

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

96,57%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,100000%)	0,29	0,04	0,98	0,98	2.763.154,13	2,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,580000%)	0,29	0,04	1,02	1,02	6.517.055,90	6,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,040000%)	0,29	0,04	1,06	1,06	5.332.141,17	5,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,080000%)	2,98	0,05	1,14	1,14	2.804.998,71	2,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,110000%)	2,98	0,05	1,15	1,15	5.140.896,02	5,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,600000%)	0,29	0,05	1,19	1,19	642.680,72	0,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,120000%)	0,29	0,04	1,06	1,06	5.966.344,51	6,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,150000%)	0,33	0,12	0,98	0,98	2.412.204,70	2,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,671000%)	0,37	0,16	1,03	1,03	3.237.552,98	3,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,825000%)	0,39	0,17	1,04	1,04	3.141.416,66	3,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,840000%)	0,39	0,18	1,04	1,04	5.281.428,15	5,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,870000%)	0,39	0,18	1,04	1,04	4.656.781,93	4,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,127000%)	0,39	0,18	1,06	1,06	5.291.521,39	5,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,270000%)	0,44	0,22	1,08	1,08	3.168.564,45	3,30
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,32</b>	<b>0,11</b>	<b>1,06</b>	<b>1,06</b>	<b>56.356.741,42</b>	<b>58,72</b>

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,33	0,05	0,86	0,86	6.494.632,13	6,77	7.961.364.534,06	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,15	0,20	-0,47	-0,47	5.205.546,80	5,42	5.008.664.499,36	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,05	0,91	0,91	5.685.868,54	5,92	8.572.761.910,40	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,31	0,11	0,66	0,66	4.295.555,39	4,48	5.336.453.186,66	0,08
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,03</b>	<b>0,10</b>	<b>0,52</b>	<b>0,52</b>	<b>21.681.602,86</b>	<b>22,59</b>		

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 FLUXO FIC	0,05	0,04	0,88	0,88	2.618.986,68	2,73	4.198.417.498,27	0,06
BRADERCO	BRADERCO	BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,87	0,11	0,65	0,65	11.717.846,32	12,21	896.178.545,03	1,31
RJI	RJI	TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 *	14,90	0,02	-9,23	-9,23	144.260,13	0,15	40.036.004,27	0,36
GENIAL	RJI	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 *	30,14	-0,02	-20,05	-20,05	106.116,24	0,11	42.487.203,41	0,25
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>1,13</b>	<b>0,10</b>	<b>0,40</b>	<b>0,40</b>	<b>14.587.209,37</b>	<b>15,20</b>		

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				
GENIAL	RJI	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II *	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
GENIAL	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC *	2,40	-1,13	-1,13	-1,13	68.232,68	0,07	6.157.527,03	1,11
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>			<b>2,40</b>	<b>-1,13</b>	<b>-1,13</b>	<b>-1,13</b>	<b>68.232,68</b>	<b>0,07</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,50</b>	<b>0,10</b>	<b>0,82</b>	<b>0,82</b>	<b>92.693.786,33</b>	<b>96,57</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,63%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	16,00	0,82	-4,15	-4,15	1.559.713,38	1,63	627.872.691,75	0,25
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>16,00</b>	<b>0,82</b>	<b>-4,15</b>	<b>-4,15</b>	<b>1.559.713,38</b>	<b>1,63</b>		
Renda Variável			15,46	0,82	-4,15	-4,15	1.559.713,38	1,63		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,72%

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	13,40	-1,09	4,25	4,25	1.648.957,37	1,72	672.952.999,06	0,25
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>13,40</b>	<b>-1,09</b>	<b>4,25</b>	<b>4,25</b>	<b>1.648.957,37</b>	<b>1,72</b>		
Investimentos no Exterior			13,40	-1,09	4,25	4,25	1.648.957,37	1,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,08%

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	RJI	FIP MULTIESTRATÉGIA PUMA *	0,62	-0,53	-0,53	-0,53	79.234,19	0,08	3.632.126,74	2,18
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>0,62</b>	<b>-0,53</b>	<b>-0,53</b>	<b>-0,53</b>	<b>79.234,19</b>	<b>0,08</b>		
Investimentos Estruturados			0,62	-0,53	-0,53	-0,53	79.234,19	0,08		
<b>Total</b>			<b>0,68</b>	<b>0,09</b>	<b>0,79</b>	<b>0,79</b>	<b>95.981.691,27</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	56.356.741,42	58,72	0,00	57,20	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	21.681.602,86	22,59	0,00	17,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	14.587.209,37	15,20	0,00	22,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	68.232,68	0,07	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>92.693.786,33</b>	<b>96,57</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	1.559.713,38	1,63	0,00	2,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>1.559.713,38</b>	<b>1,63</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.648.957,37	1,72	0,00	1,80	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>1.648.957,37</b>	<b>1,72</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	79.234,19	0,08	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>79.234,19</b>	<b>0,08</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>95.981.691,27</b>	<b>100,00</b>					

**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	1,06 109,22	1,06 109,22	2,70 96,06	4,98 82,39	10,77 83,64	588.790,01	0,62	588.790,01
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,52 53,53	0,52 53,53	3,38 120,45	4,91 81,36	12,17 94,55	112.675,85	0,12	112.675,85
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,40 41,30	0,40 41,30	2,87 102,37	4,32 71,62	10,76 83,57	58.820,16	0,06	58.820,16
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-1,13 -116,64	-1,13 -116,64	-2,61 -93,15	-4,47 -73,99	-7,63 -59,24	-778,14	-0,00	-778,14
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,15 0,65	-4,15 0,65	11,75 -1,16	1,38 -3,39	11,37 -1,25	-67.498,79	-0,07	-67.498,79
Artigo 9º III % do CDI	4,25 439,34	4,25 439,34	13,79 491,42	11,09 183,73	19,31 150,04	67.179,74	0,07	67.179,74
Artigo 10º II % do CDI	-0,53 -54,87	-0,53 -54,87	-0,72 -25,64	-1,02 -16,92	-1,60 -12,43	-422,53	-0,00	-422,53
<b>OUROESTE (Total)</b>						<b>758.766,30</b>	0,79	<b>758.766,30</b>

**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 (6,120000%)	5.903.564,89	0,00	0,00	0,00	5.966.344,51	62.779,62	62.779,62
NTN-B 150535 (5,825000%)	3.109.128,77	0,00	0,00	0,00	3.141.416,66	32.287,89	32.287,89
NTN-B 150535 (5,840000%)	5.227.073,70	0,00	0,00	0,00	5.281.428,15	54.354,45	54.354,45
NTN-B 150535 (5,870000%)	4.608.748,17	0,00	0,00	0,00	4.656.781,93	48.033,76	48.033,76
NTN-B 150535 (6,127000%)	5.235.831,25	0,00	0,00	0,00	5.291.521,39	55.690,14	55.690,14
NTN-B 150824 (5,100000%)	2.736.393,76	0,00	0,00	0,00	2.763.154,13	26.760,37	26.760,37
NTN-B 150824 (5,580000%)	6.451.372,74	0,00	0,00	0,00	6.517.055,90	65.683,16	65.683,16
NTN-B 150824 (6,040000%)	5.276.396,15	0,00	0,00	0,00	5.332.141,17	55.745,02	55.745,02
NTN-B 150824 (7,080000%)	2.773.320,94	0,00	0,00	0,00	2.804.998,71	31.677,77	31.677,77
NTN-B 150824 (7,110000%)	5.082.697,82	0,00	0,00	0,00	5.140.896,02	58.198,20	58.198,20

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150824 (7,600000%)	635.151,38	0,00	0,00	0,00	642.680,72	7.529,34	7.529,34
NTN-B 150830 (5,150000%)	2.388.742,68	0,00	0,00	0,00	2.412.204,70	23.462,02	23.462,02
NTN-B 150832 (5,671000%)	3.204.682,61	0,00	0,00	0,00	3.237.552,98	32.870,37	32.870,37
NTN-B 150840 (6,270000%)	3.134.846,55	0,00	0,00	0,00	3.168.564,45	33.717,90	33.717,90
	55.767.951,41	0,00	0,00	0,00	56.356.741,42	588.790,01	588.790,01

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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	6.438.960,99	0,00	0,00	0,00	6.494.632,13	55.671,14	55.671,14
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.229.879,04	0,00	0,00	0,00	5.205.546,80	-24.332,24	-24.332,24
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.877.196,49	0,00	-244.709,03	0,00	5.685.868,54	53.381,08	53.381,08
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	4.267.599,52	0,00	0,00	0,00	4.295.555,39	27.955,87	27.955,87
	21.813.636,04	0,00	-244.709,03	0,00	21.681.602,86	112.675,85	112.675,85

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 FLUXO FIC	2.617.642,16	521.914,59	-544.505,51	0,00	2.618.986,68	23.935,44	23.935,44
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	11.641.669,81	0,00	0,00	0,00	11.717.846,32	76.176,51	76.176,51
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	158.937,03	0,00	0,00	0,00	144.260,13	-14.676,90	-14.676,90
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	132.731,13	0,00	0,00	0,00	106.116,24	-26.614,89	-26.614,89
	14.550.980,13	521.914,59	-544.505,51	0,00	14.587.209,37	58.820,16	58.820,16

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	69.010,82	0,00	0,00	0,00	68.232,68	-778,14	-778,14
	69.010,82	0,00	0,00	0,00	68.232,68	-778,14	-778,14

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\$)
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	1.627.212,17	0,00	0,00	0,00	1.559.713,38	-67.498,79	-67.498,79
	1.627.212,17	0,00	0,00	0,00	1.559.713,38	-67.498,79	-67.498,79

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	1.581.777,63	0,00	0,00	0,00	1.648.957,37	67.179,74	67.179,74
	1.581.777,63	0,00	0,00	0,00	1.648.957,37	67.179,74	67.179,74

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP MULTISTRATÉGIA PUMA	79.656,72	0,00	0,00	0,00	79.234,19	-422,53	-422,53
	79.656,72	0,00	0,00	0,00	79.234,19	-422,53	-422,53

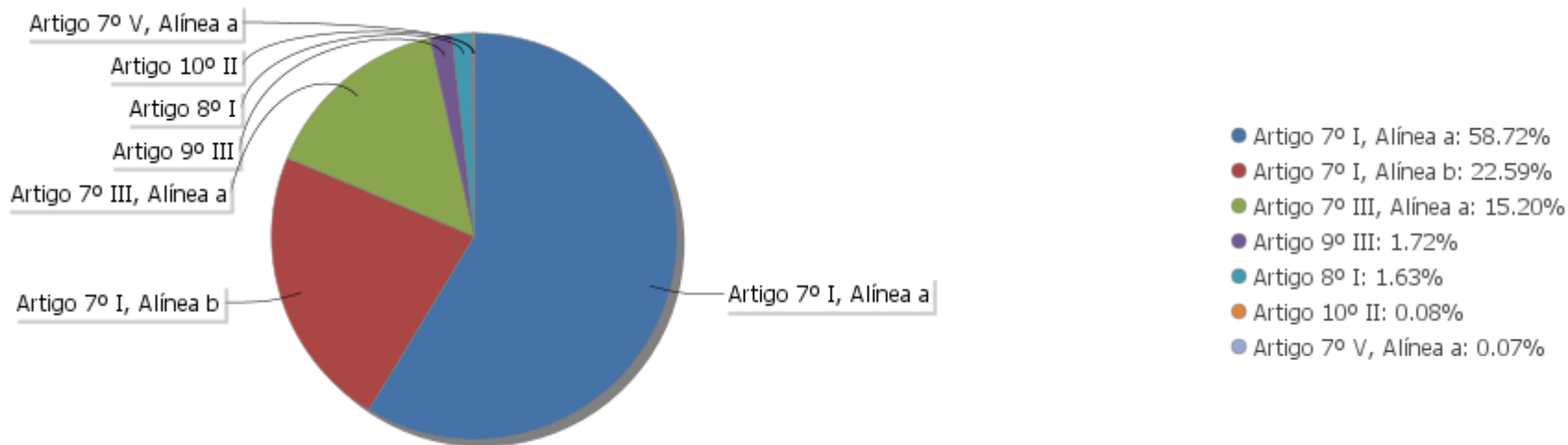
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

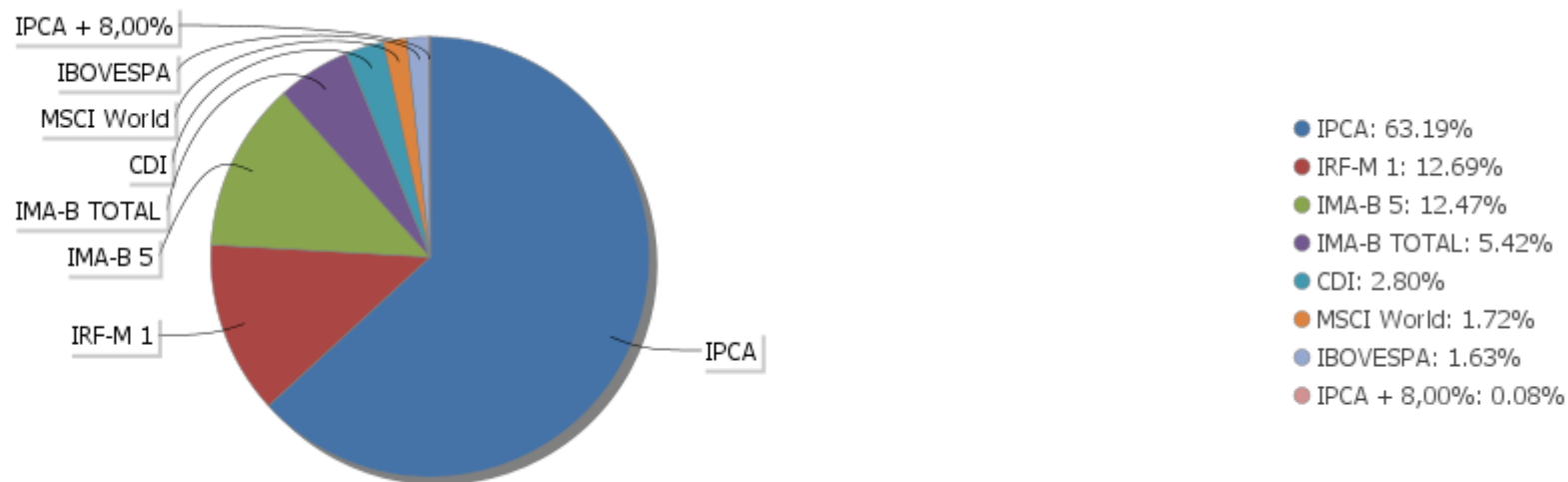
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	37.746.627,42	39,33	37.746.627,42	39,33	
de 31 dias a 365 dias	24.760.640,03	25,80	62.507.267,45	65,12	
acima de 365 dias	33.474.423,82	34,88	95.981.691,27	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

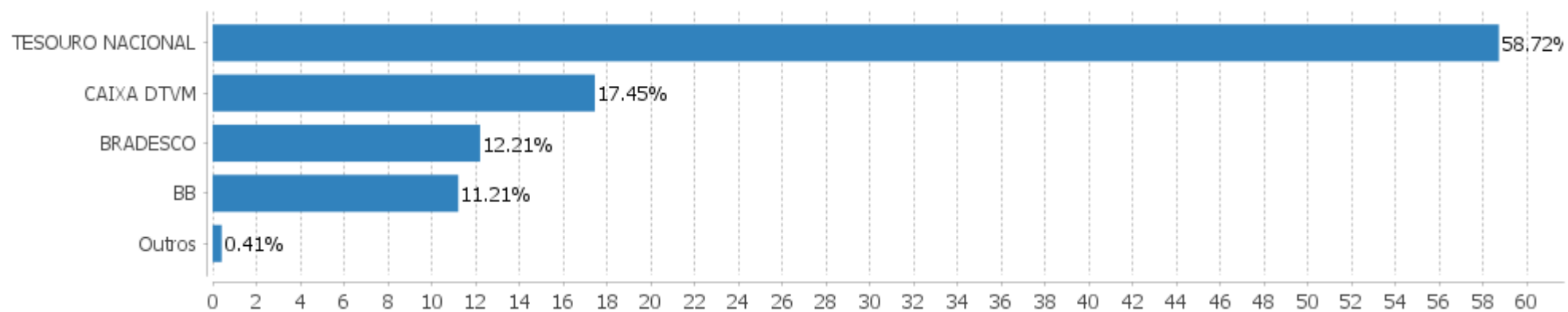


Alocação Por Estratégia



## 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	0,79												0,79
IPCA + 5,03%	0,85												0,85
p.p. indexador	-0,06												-0,06
2023	1,29	0,84	1,25	0,88	1,15	0,98	0,81	0,67	0,50	0,40	1,26	1,13	11,73
IPCA + 4,89%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52	0,67	0,64	0,64	0,66	0,94	9,67
p.p. indexador	0,34	-0,35	0,10	-0,07	0,50	0,66	0,29	0,00	-0,14	-0,24	0,60	0,19	2,06
2022	0,11	0,64	2,27	0,77	1,03	0,17	0,43	0,16	0,15	1,14	0,56	0,72	8,44
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,07	0,11	0,97	0,79	1,04	10,93
p.p. indexador	-0,83	-0,73	0,23	-0,65	0,14	-0,91	0,72	0,08	0,05	0,17	-0,23	-0,32	-2,48
2021	-0,66	-1,03	0,48	0,98	0,90	0,21	-0,40	-0,51	-0,09	-1,29	1,68	0,99	1,23
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	-1,33	-2,27	-0,94	0,24	-0,37	-0,77	-1,83	-1,85	-1,69	-2,97	0,31	-0,23	-14,78

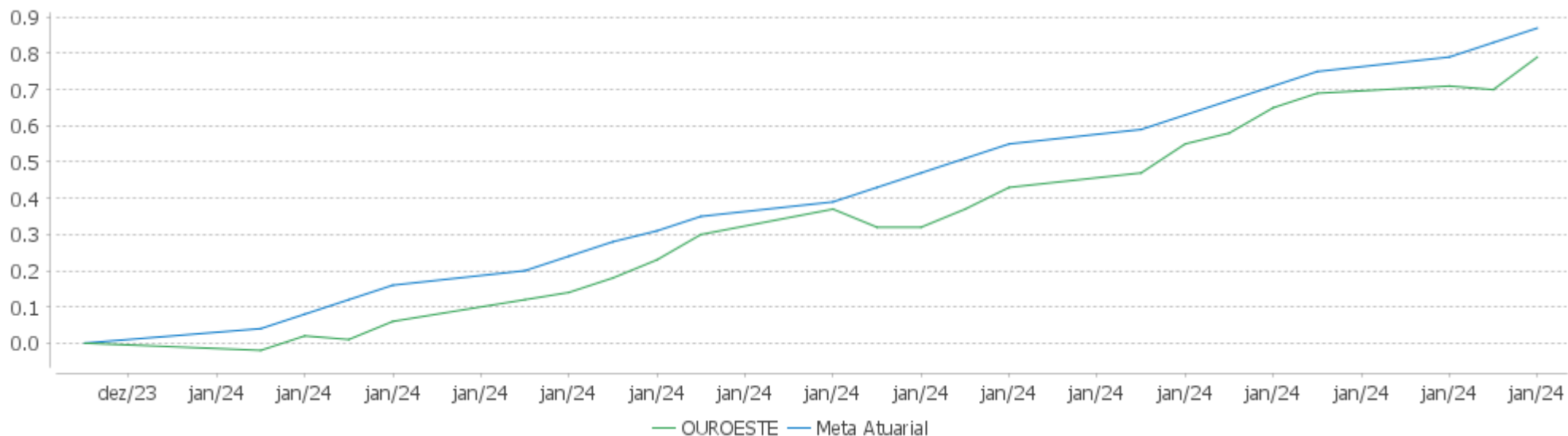
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

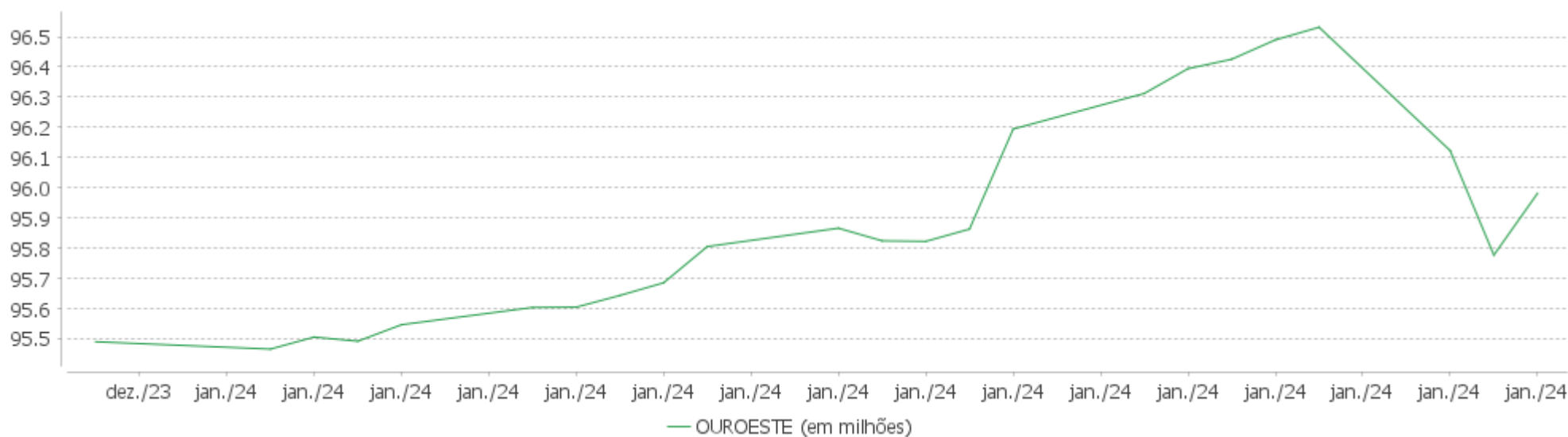
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	43,24	03 meses	3,22	2,47	0,74	0,65
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	56,76	06 meses	4,84	4,48	0,36	0,77
			12 meses	11,19	9,57	1,62	0,68
			24 meses	21,99	21,55	0,44	1,43
			36 meses	24,45	41,39	-16,94	2,26
Maior rentabilidade da Carteira	2,27	2022-03	Desde 31/12/2020	23,63	42,34	-18,71	2,31
Menor rentabilidade da Carteira	-1,29	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

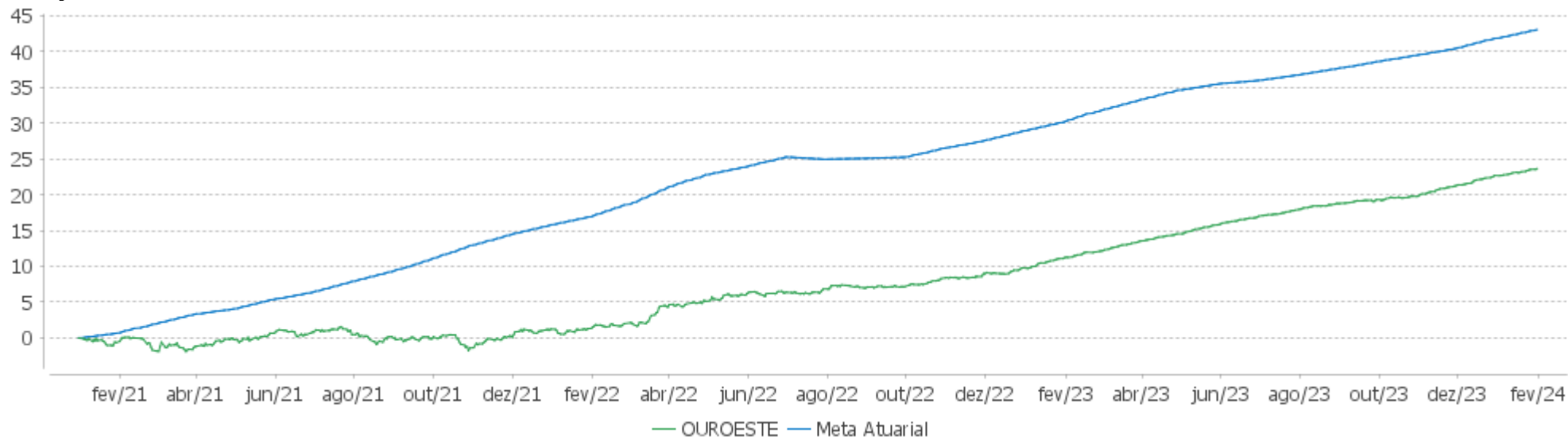


Patrimônio Líquido No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

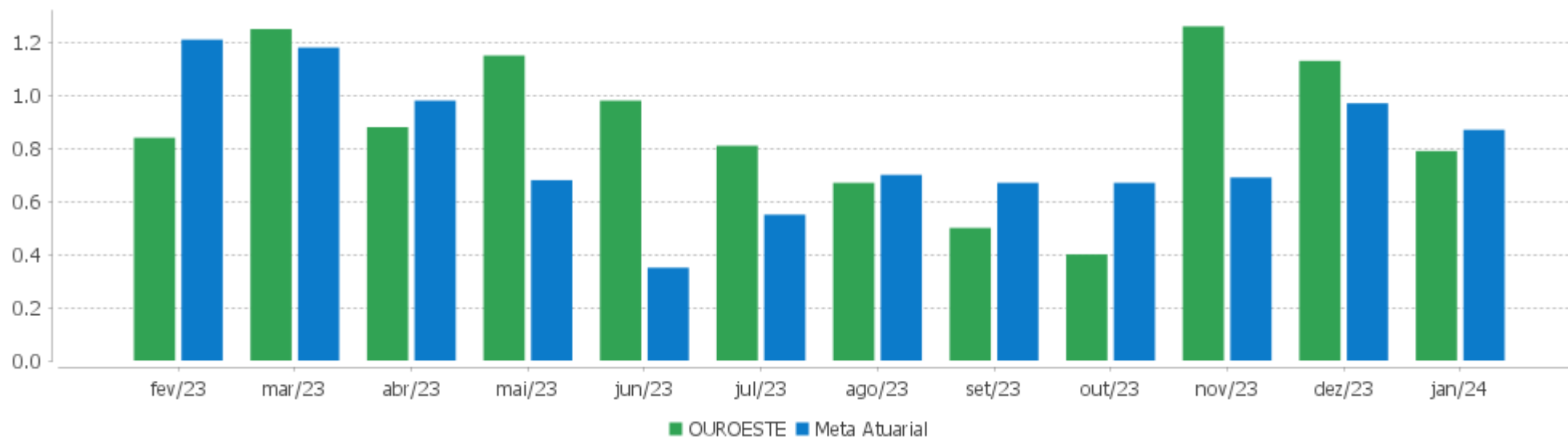


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,47 -0,02	-0,47 -0,02	4,92 -0,06	2,84 -0,07	15,36 -0,18	23,40 -0,40	21,65 -0,73
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,86 0,03	0,86 0,03	2,74 -0,03	5,80 -0,12	12,67 -0,28	26,44 -0,68	30,53 -1,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,66 0,24	0,66 0,24	3,33 2,07	4,67 2,67	13,16 8,65	25,72 15,18	26,39 4,38
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 0,08	0,91 0,08	2,80 0,03	5,87 -0,05	12,79 -0,16	26,67 -0,45	30,85 -0,76
NTN-B 150535 (5,870000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,73 1,46	4,97 2,97	10,77 6,26	24,08 13,53	36,66 14,64
NTN-B 150830 (5,150000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,56	0,98 0,56	2,50 1,24	4,56 2,55	9,97 5,46	22,34 11,80	34,17 12,15
NTN-B 150824 (6,040000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,64	1,06 0,64	2,63 1,37	4,92 2,91	10,79 6,29	20,74 10,19	33,09 11,07
NTN-B 150840 (6,270000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,66	1,08 0,66	2,87 1,60	5,21 3,21	11,23 6,72	25,06 14,52	37,94 15,92
NTN-B 150832 (5,671000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,66 1,40	4,86 2,85	10,54 6,04	20,13 9,59	32,17 10,16
NTN-B 150824 (7,110000%) Var. IPCA p.p.	1,15 0,73	1,15 0,73	2,88 1,62	5,44 3,44	8,64 4,13		
NTN-B 150535 (5,840000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,72 1,46	4,96 2,95	10,74 6,23	24,01 13,46	36,56 14,55
NTN-B 150525 (6,120000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,64	1,06 0,64	2,65 1,38	4,95 2,95	10,87 6,37		
NTN-B 150824 (7,080000%) Var. IPCA p.p.	1,14 0,72	1,14 0,72	2,91 1,65	5,43 3,42	8,61 4,11	15,95 5,41	
NTN-B 150824 (7,600000%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,77	1,19 0,77	3,00 1,73	5,68 3,68	12,40 7,90	27,97 17,43	51,73 29,71
NTN-B 150824 (5,100000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,56	0,98 0,56	2,41 1,14	4,45 2,44	9,82 5,32	22,12 11,58	33,63 11,61
NTN-B 150824 (5,580000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,60	1,02 0,60	2,52 1,26	4,69 2,68	10,32 5,81	19,73 9,19	31,51 9,49
NTN-B 150535 (6,127000%)	1,06	1,06	2,79	5,11	11,04	24,68	37,48

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.	0,64	0,64	1,53	3,10	6,53	14,14	15,46
NTN-B 150535 (5,825000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,72 1,45	4,95 2,94	10,72 6,21	23,97 13,43	36,52 14,50
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC % do CDI	-1,13 -116,64	-1,13 -116,64	-2,61 -93,15	-4,47 -73,99	-7,63 -59,24	-12,24 -44,80	-28,28 -83,92
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,65 -0,02	0,65 -0,02	3,92 -0,08	4,28 -0,16	11,06 -0,27	22,94 -0,85	27,57 -1,88
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-20,05 -20,73	-20,05 -20,73	-34,88 -38,87	-35,25 -39,70	-36,07 -47,40	-34,80 -58,59	-48,33 -77,78
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,88 91,04	0,88 91,04	2,55 91,03	5,51 91,20	11,76 91,36	24,82 90,80	29,63 87,93
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-9,23 -9,91	-9,23 -9,91	-17,62 -21,62	-14,78 -19,23	-12,64 -23,97	-8,47 -32,26	-9,68 -39,13
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-4,15 0,65	-4,15 0,65	11,76 -1,15	0,85 -3,91	8,47 -4,15	4,31 -9,61	-4,32 -15,35
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. MSCI World p.p.	4,25 0,76	4,25 0,76	13,79 0,40	11,09 1,82	19,31 7,51	0,78 3,90	13,38 4,45
FIP MULTISTRATÉGIA PUMA Var. IPCA + 8,00% p.p.	-0,53 -1,63	-0,53 -1,63	-0,72 -3,92	-1,02 -7,03	-1,60 -14,36	-3,63 -32,45	-4,78 -58,34
OUROESTE Var. IPCA + 5,23% p.p.	0,79 -0,06	0,79 -0,06	3,22 0,72	4,84 0,30	11,19 1,49	21,99 0,12	24,45 -16,84
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,60
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50
FIP MULTIESTRATÉGIA PUMA						
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	D+0	D+0				
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	Não se aplica	Não se aplica				
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

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	0,83	0,83	2,77	5,92	12,95	27,12	31,60	36,12	45,12
IRF-M 1+	0,60	0,60	5,55	6,14	18,37	28,70	23,39	30,51	48,22
IRF-M TOTAL	0,67	0,67	4,68	6,05	16,31	27,74	26,10	32,31	47,48
IMA-B 5	0,68	0,68	3,99	4,44	11,33	23,79	29,45	39,23	56,02
IMA-B 5+	-1,47	-1,47	5,89	1,54	19,03	23,38	15,40	19,65	46,36
IMA-B TOTAL	-0,45	-0,45	4,97	2,91	15,53	23,80	22,38	28,77	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,47	0,47	3,98	5,14	14,53	26,21	28,00	33,76	48,90
IDKA 2	0,81	0,81	4,15	4,81	11,43	23,53	29,55	40,17	55,62
IDKA 20	-3,34	-3,34	7,85	-0,30	28,79	24,16	6,04	6,79	36,82
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02	12,30	31,17
IBRX 100	-4,51	-4,51	13,20	5,15	11,88	12,72	10,34	12,15	33,43
IBRX 50	-4,15	-4,15	13,07	5,74	11,32	13,01	11,95	14,94	31,89
SMALL CAP	-6,55	-6,55	12,50	-6,30	6,34	-10,11	-19,32	-22,95	11,91
Índice Consumo - ICON	-8,33	-8,33	13,01	-11,48	-4,76	-28,41	-45,21	-47,39	-24,62
Índice Dividendos - IDIV	-3,51	-3,51	14,18	8,88	15,58	28,28	35,93	29,79	64,85

**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	3,94	3,94	13,17	10,31	15,47	-0,78	18,02	74,30	143,07

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,67	0,67	5,63	4,26	18,16	20,04	15,77	8,33	38,34

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,86	2,86	12,43	7,98	9,50	-5,80	2,83	51,79	101,82

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,42	0,42	1,27	2,01	4,51	10,54	22,01	27,58	32,93
INPC	0,57	0,57	1,22	1,66	3,82	9,75	21,38	28,10	33,61
IGPM	0,07	0,07	1,41	2,15	-3,32	0,35	17,32	47,48	59,00
SELIC	0,97	0,97	2,80	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,76	0,76	2,25	4,03	8,64	19,51	37,19	49,11	61,60
IPCA + 5,00%	0,85	0,85	2,49	4,53	9,67	21,80	41,17	54,89	69,49
IPCA + 5,50%	0,89	0,89	2,61	4,77	10,18	22,96	43,18	57,84	73,54
IPCA + 5,89%	0,92	0,92	2,70	4,97	10,59	23,86	44,77	60,18	76,76
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22	60,84	77,68
INPC + 4,00%	0,91	0,91	2,21	3,67	7,92	18,65	36,48	49,72	62,43
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47	61,50	78,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150525 (6,120000%)	5.966.344,51	6,120000	6.005.585,51	5,580000	39.241,00
NTN-B 150535 (5,825000%)	3.141.416,66	5,825000	3.192.302,11	5,620000	50.885,45
NTN-B 150535 (5,840000%)	5.281.428,15	5,840000	5.373.268,85	5,620000	91.840,70
NTN-B 150535 (5,870000%)	4.656.781,93	5,870000	4.748.879,18	5,620000	92.097,25
NTN-B 150535 (6,127000%)	5.291.521,39	6,127000	5.505.182,16	5,620000	213.660,77
NTN-B 150824 (5,100000%)	2.763.154,13	5,100000	2.743.015,65	6,574000	-20.138,48
NTN-B 150824 (5,580000%)	6.517.055,90	5,580000	6.485.057,41	6,574000	-31.998,49
NTN-B 150824 (6,040000%)	5.332.141,17	6,040000	5.318.091,57	6,574000	-14.049,60
NTN-B 150824 (7,080000%)	2.804.998,71	7,080000	2.811.914,00	6,574000	6.915,29
NTN-B 150824 (7,110000%)	5.140.896,02	7,110000	5.154.457,98	6,574000	13.561,96
NTN-B 150824 (7,600000%)	642.680,72	7,600000	645.922,05	6,574000	3.241,33
NTN-B 150830 (5,150000%)	2.412.204,70	5,150000	2.372.309,34	5,478300	-39.895,36
NTN-B 150832 (5,671000%)	3.237.552,98	5,671000	3.250.646,61	5,606800	13.093,63
NTN-B 150840 (6,270000%)	3.168.564,45	6,270000	3.370.129,73	5,645100	201.565,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
578	02/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.342,94	1.229,00406900	2,7200398150
573	09/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.043,04	6.986,94888500	2,7255158600
576	11/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.208,43	443,02267800	2,7276933240
579	12/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	47.660,21	0,00	17.465,70743000	2,7287878370
580	19/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	265.472,40	0,00	97.091,50007400	2,7342496490
581	22/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	87.607,48	0,00	32.027,86303100	2,7353520250
575	24/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	110,15	40,23709700	2,7375235600
582	26/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.708,03	0,00	1.718,46629000	2,7396696840
577	29/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.954,32	3.267,11392100	2,7407431200
583	29/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	175.400,91	63.997,57376800	2,7407431200
586	29/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	244.709,03	71.615,56648983	3,4169810000
584	30/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	336.445,72	122.709,42242100	2,7418083580
585	31/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	116.466,47	0,00	42.461,17066600	2,7428935230
<b>Total</b>			<b>521.914,59</b>	<b>789.214,54</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 396.856,36

Value-At-Risk: 0,41%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,62	0,32		0,29	-0,23	0,82	92.693.786,33	96,57
Artigo 8º	13,90	7,54		0,10	-0,37	-4,15	1.559.713,38	1,63
Artigo 9º	11,47	5,75		0,02	0,29	4,25	1.648.957,37	1,72
Artigo 10º	1,80	0,04		-0,00	-0,83	-0,53	79.234,19	0,08
OUROESTE		0,41		0,41			95.981.691,27	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,32%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,100000%)	0,22	0,09	0,00	0,09	0,05	0,98	2.763.154,13	2,88
NTN-B 150824 (5,580000%)	0,22	0,09	0,00	0,09	0,23	1,02	6.517.055,90	6,79
NTN-B 150824 (6,040000%)	0,22	0,09	0,00	0,09	0,40	1,06	5.332.141,17	5,56
NTN-B 150824 (7,080000%)	0,22	0,09	0,00	0,09	0,79	1,14	2.804.998,71	2,92
NTN-B 150824 (7,110000%)	0,22	0,09	0,00	0,09	0,80	1,15	5.140.896,02	5,36
NTN-B 150824 (7,600000%)	0,22	0,09	0,00	0,09	0,98	1,19	642.680,72	0,67
NTN-B 150525 (6,120000%)	0,22	0,09	0,00	0,09	0,43	1,06	5.966.344,51	6,22
NTN-B 150830 (5,150000%)	0,42	0,09	0,00	0,09	0,04	0,98	2.412.204,70	2,51
NTN-B 150832 (5,671000%)	0,60	0,09	0,00	0,10	0,10	1,03	3.237.552,98	3,37
NTN-B 150535 (5,825000%)	0,67	0,10	0,00	0,10	0,11	1,04	3.141.416,66	3,27
NTN-B 150535 (5,840000%)	0,68	0,10	0,00	0,10	0,11	1,04	5.281.428,15	5,50
NTN-B 150535 (5,870000%)	0,68	0,10	0,00	0,10	0,11	1,04	4.656.781,93	4,85
NTN-B 150535 (6,127000%)	0,70	0,10	0,00	0,10	0,14	1,06	5.291.521,39	5,51
NTN-B 150840 (6,270000%)	0,87	0,10	0,00	0,10	0,12	1,08	3.168.564,45	3,30
<b>Sub-total</b>	<b>0,37</b>	<b>0,08</b>	<b>0,01</b>		<b>0,24</b>	<b>1,06</b>	<b>56.356.741,42</b>	<b>58,72</b>

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,26	0,11	0,00	0,03	-0,39	0,86	6.494.632,13	6,77
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,67	2,16	0,11	0,03	-0,54	-0,47	5.205.546,80	5,42
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,23	0,09	0,00	0,04	-0,23	0,91	5.685.868,54	5,92
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,96	0,73	0,03	0,73	-0,32	0,66	4.295.555,39	4,48
<b>Sub-total</b>	0,91	0,69	0,14		-0,49	0,52	21.681.602,86	22,59

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	-0,00	0,01	-5,20	0,88	2.618.986,68	2,73
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,16	1,23	0,14	0,01	-0,27	0,65	11.717.846,32	12,21
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	34,29	1,01	-0,00	1,65	-0,30	-9,23	144.260,13	0,15
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	74,69	2,03	-0,00	2,45	-0,28	-20,05	106.116,24	0,11
<b>Sub-total</b>	1,14	0,99	0,14		-0,50	0,40	14.587.209,37	15,20

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	0,00	NaN	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	3,84	0,18	-0,00	0,18	-0,55	-1,13	68.232,68	0,07
<b>Sub-total</b>	3,84	0,18	-0,00		-0,55	-1,13	68.232,68	0,07

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,54%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	13,90	7,54	0,10	2,72	-0,37	-4,15	1.559.713,38	1,63
<b>Sub-total</b>	13,90	7,54	0,10		-0,37	-4,15	1.559.713,38	1,63

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,75%

Artigo 9º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	11,47	5,75	0,02	3,87	0,29	4,25	1.648.957,37	1,72
<b>Sub-total</b>	11,47	5,75	0,02		0,29	4,25	1.648.957,37	1,72

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,04%

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP MULTISTRATÉGIA PUMA	1,80	0,04	-0,00	0,07	-0,83	-0,53	79.234,19	0,08
<b>Sub-total</b>	1,80	0,04	-0,00		-0,83	-0,53	79.234,19	0,08

(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 (%)