

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

92,12%

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 150545	8,61	-1,06	-1,56	15,28	16.798.847,36	2,18
TESOURO NACIONAL	LTN 01012024 (6,030000%)	0,00	0,02	0,54	3,98	5.916.200,36	0,77
TESOURO NACIONAL	LTN 01012024 (6,100000%)	0,00	0,02	0,54	4,03	5.923.758,22	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,930000%)	0,41	0,03	0,66	6,93	28.744.806,24	3,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,742000%)	0,41	0,03	0,74	7,48	43.712.753,61	5,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,200000%)	0,41	0,03	0,60	6,44	28.172.602,37	3,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730001%)	0,41	0,03	0,73	7,48	44.225.331,65	5,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,740002%)	0,41	0,03	0,74	7,48	43.005.858,85	5,58
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2029 (12,000000%)	0,00	0,04	1,04	7,85	5.285.153,35	0,69
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,68	-0,05	0,53	7,64	221.785.312,01	28,78

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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	1,14	-0,01	0,91	2,72	9.977.490,46	1,29	2.413.618.165,51	0,41
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,38	-0,19	0,74	8,36	14.650.306,39	1,90	6.160.923.946,07	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	-0,17	0,77	8,41	4.139.919,81	0,54	5.504.316.744,32	0,08

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,26	-0,24	0,58	8,63	8.802.475,15	1,14	5.437.581.646,17	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,45	-0,19	0,63	9,92	32.358.650,56	4,20	5.643.739.686,42	0,57
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,02	0,05	1,13	8,74	51.939.768,16	6,74	5.478.324.181,39	0,95
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,37	-0,08	0,88	9,03	121.868.610,53	15,81		

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	0,07	0,05	1,24	8,97	115.875.878,45	15,04	14.797.589.893,96	0,78
QUELUZ	RJI	BRA1 FI RENDA FIXA	0,59	0,00	0,62	4,62	185.722,13	0,02	3.657.589,15	5,08
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	1,16	8,81	124.097.007,89	16,10	14.734.335.445,36	0,84
VERITAS	RJI	TMJ IMA-B FI RF	19,76	0,41	-1,12	5,52	818.732,43	0,11	49.639.096,52	1,65
GENIAL	RJI	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,40	-0,00	-0,20	-1,57	911.533,46	0,12	65.488.045,80	1,39
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,25	-0,24	0,58	8,58	24.330.384,83	3,16	980.045.918,76	2,48
VERITAS	RJI	FI BARCELONA RENDA FIXA	6,20	-0,86	1,76	9,12	383.200,89	0,05	25.822.161,30	1,48
GENIAL	PLANNER	FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	2,62	-0,00	-0,01	1,04	435.005,08	0,06	15.301.809,80	2,84
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,05	1,27	9,16	92.853.543,86	12,05	9.013.672.474,30	1,03
VERITAS	RJI	MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,39	-0,17	-3,97	-24,04	30.070,26	0,00	921.959,02	3,26
RJI	RJI	TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2,89	0,03	3,47	6,69	976.155,87	0,13	48.611.239,85	2,01
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,31	0,03	1,16	8,87	360.897.235,15	46,83		

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	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,05	-0,38	-0,38	-1,74	3.309.923,24	0,43	73.239.138,77	4,52
QUELUZ	PLANNER	ILLUMINATI FIDC	9,82	-3,85	-3,85	-20,93	1.170.245,83	0,15	141.463.694,26	0,83
GENIAL	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	1,79	-0,59	-0,59	-4,11	310.650,34	0,04	6.407.321,24	4,85
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			3,20	-1,26	-1,26	-7,62	4.790.819,41	0,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GENIAL	GENIAL	PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	64,87	0,57	0,57	0,26	567.706,64	0,07	22.782.256,47	2,49
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			64,87	0,57	0,57	0,26	567.706,64	0,07		
Renda Fixa			0,55	-0,02	0,90	8,37	709.909.683,74	92,12		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

3,27%

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	FIA CAIXA DIVIDENDOS	18,32	-1,52	-2,83	8,19	4.005.945,32	0,52	231.629.258,56	1,73
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	22,51	-1,78	-3,51	15,91	5.571.083,13	0,72	208.725.144,51	2,67
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,26	-1,34	-7,18	2,03	2.907.523,93	0,38	1.370.470.559,17	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,28	-2,49	-7,25	7,96	3.697.175,21	0,48	684.787.474,06	0,54
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	19,48	-2,15	-3,40	11,93	3.166.367,47	0,41	639.741.562,95	0,49
SAFRA	SAFRA	SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	21,06	-1,30	-4,59	6,88	5.871.066,03	0,76	154.469.648,35	3,80
Sub-total Artigo 8º I			20,40	-1,73	-4,64	9,15	25.219.161,09	3,27		
Renda Variável			20,40	-1,73	-4,64	9,15	25.219.161,09	3,27		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,99%

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				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,55	1,65	2,90	20,35	7.887.235,31	1,02	2.114.296.555,90	0,37
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	20,95	1,49	3,77	13,23	7.435.280,20	0,96	732.547.750,88	1,01
Sub-total Artigo 9º III			21,44	1,57	3,32	16,78	15.322.515,51	1,99		
Investimentos no Exterior			21,44	1,57	3,32	16,78	15.322.515,51	1,99		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,76%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ARENA CAPITAL	REAG	WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	1,01	-0,64	-0,64	-2,43	371.753,24	0,05	41.983.146,45	0,89
QUELUZ	RJI	FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	15,19	-0,01	-0,21	-16,31	3.273.706,72	0,42	141.995.693,60	2,31
Sub-total Artigo 10º I			12,64	-0,07	-0,26	5,17	3.645.459,96	0,47		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
A5	PLANNER	W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	7,23	-0,16	-0,16	-1,17	8.768.938,62	1,14	123.309.593,08	7,11
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,17	-0,01	-0,01	-0,39	1.121.621,09	0,15	27.614.114,87	4,06
Sub-total Artigo 10º II			6,47	-0,14	-0,14	-1,08	9.890.559,71	1,28		
Investimentos Estruturados			10,35	-0,12	-0,17	3,74	13.536.019,67	1,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,86%

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	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	5,37	0,00	0,00	5,99	6.248.841,46	0,81	78.966.948,98	7,91
QUELUZ	RJI	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	0,88	-0,15	-0,15	-1,84	60.635,94	0,01	142.961.004,61	0,04
VERITAS	RJI	SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	2,33	-0,23	-0,23	-1,02	355.160,45	0,05	71.343.896,64	0,50
Sub-total Artigo 11º			4,98	-0,01	-0,01	5,51	6.664.637,85	0,86		
Fundos Imobiliários			4,98	-0,01	-0,01	5,51	6.664.637,85	0,86		
Total			1,64	-0,05	0,73	8,51	770.652.017,86	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	339.362,55
Sub-total Disponibilidades Financeiras	339.362,55
Total	770.991.380,41

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	221.785.312,01	28,78	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	121.868.610,53	15,81	0,00	8,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	360.897.235,15	46,83	0,00	17,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	4.790.819,41	0,62	0,00	1,00	1,40	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	567.706,64	0,07	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	709.909.683,74	92,12					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	25.219.161,09	3,27	0,00	3,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	25.219.161,09	3,27					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	15.322.515,51	1,99	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.322.515,51	1,99					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.645.459,96	0,47	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	9.890.559,71	1,28	0,00	1,50	2,40	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	13.536.019,67	1,76					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	6.664.637,85	0,86	0,00	1,00	1,45	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	6.664.637,85	0,86					5,00
Total		770.652.017,86	100,00					