



LDB
EMPRESAS

OSASCO - CONSOLIDADO
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

92,98%

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

| Emissor | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira |
|--|--------------------------|---------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|
| | | | Dia | Mês | Ano | | |
| TESOURO NACIONAL | LTN 01012024 (6,030000%) | 0,10 | 0,00 | 0,02 | 0,02 | 0,00 | 0,00 |
| TESOURO NACIONAL | LTN 01012024 (6,100000%) | 0,10 | 0,00 | 0,02 | 0,02 | 0,00 | 0,00 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 | 7,20 | 0,32 | -1,58 | -1,58 | 16.816.438,19 | 1,87 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (4,930000%) | 0,44 | 0,21 | 0,96 | 0,96 | 29.098.848,94 | 3,23 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,742000%) | 0,53 | 0,28 | 1,03 | 1,03 | 44.309.782,89 | 4,92 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (4,200000%) | 0,38 | 0,16 | 0,90 | 0,90 | 29.161.661,02 | 3,24 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,729999%) | 4,02 | 0,26 | 1,03 | 1,03 | 44.882.376,39 | 4,98 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,730001%) | 0,50 | 0,26 | 1,03 | 1,03 | 46.094.200,55 | 5,11 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,740002%) | 0,50 | 0,26 | 1,03 | 1,03 | 44.825.032,96 | 4,97 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,860000%) | 4,09 | 0,26 | 1,04 | 1,04 | 44.145.782,35 | 4,90 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-F 2029 (12,000000%) | 0,24 | 0,19 | 1,00 | 1,00 | 5.267.443,87 | 0,58 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 0,68 | 0,25 | 0,87 | 0,87 | 304.601.567,16 | 33,80 |

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 | 0,95 | 0,02 | 1,12 | 1,12 | 10.423.348,61 | 1,16 | 2.636.302.220,38 | 0,40 |

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

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 IDKA2 | 1,89 | 0,09 | 0,71 | 0,71 | 15.212.358,83 | 1,69 | 5.834.557.206,92 | 0,26 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,87 | 0,08 | 0,73 | 0,73 | 4.304.476,88 | 0,48 | 5.245.527.378,78 | 0,08 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 1,87 | 0,11 | 0,66 | 0,66 | 9.129.702,06 | 1,01 | 5.294.436.148,21 | 0,17 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 1,31 | 0,11 | 0,66 | 0,66 | 33.658.058,99 | 3,73 | 5.336.453.186,66 | 0,63 |
| SAFRA | SAFRA | SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI | 0,05 | 0,04 | 0,95 | 0,95 | 44.347.026,99 | 4,92 | 5.578.840.271,53 | 0,79 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 0,78 | 0,07 | 0,82 | 0,82 | 117.074.972,36 | 12,99 | | |

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 | 1,00 | 1,00 | 128.349.541,78 | 14,24 | 15.073.540.268,85 | 0,85 |
| QUELUZ | RJI | BRA1 FI RENDA FIXA | 0,38 | 0,02 | 0,20 | 0,20 | 187.145,85 | 0,02 | 3.685.627,84 | 5,08 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,09 | 0,04 | 0,97 | 0,97 | 126.819.832,59 | 14,07 | 16.400.080.186,89 | 0,77 |
| VERITAS | RJI | TMJ IMA-B FI RF | 8,36 | 0,03 | -0,53 | -0,53 | 726.199,12 | 0,08 | 44.028.874,95 | 1,65 |
| GENIAL | RJI | TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 | 30,14 | -0,02 | -20,05 | -20,05 | 591.382,85 | 0,07 | 42.487.203,41 | 1,39 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 1,87 | 0,11 | 0,65 | 0,65 | 25.225.925,73 | 2,80 | 896.178.545,03 | 2,81 |
| VERITAS | RJI | FI BARCELONA RENDA FIXA | 6,15 | -0,67 | 0,31 | 0,31 | 387.509,24 | 0,04 | 26.112.481,77 | 1,48 |
| GENIAL | PLANNER | FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B | 35,85 | -0,01 | -0,18 | -0,18 | 179.802,15 | 0,02 | 6.324.749,99 | 2,84 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,09 | 0,05 | 1,09 | 1,09 | 97.703.187,92 | 10,84 | 9.205.921.475,18 | 1,06 |
| VERITAS | RJI | MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA | 0,83 | -0,26 | -5,42 | -5,42 | 23.406,90 | 0,00 | 717.659,30 | 3,26 |
| RJI | RJI | TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 | 14,90 | 0,02 | -9,23 | -9,23 | 803.957,70 | 0,09 | 40.036.004,27 | 2,01 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 0,19 | 0,05 | 0,92 | 0,92 | 380.997.891,83 | 42,27 | | |

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|----------|----------|---|---------------------|-------------------|------|------|---------------|------------|-------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| DAYCOVAL | DAYCOVAL | LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 5,95% a.a | 3,41 | 1,09 | 1,09 | 1,09 | 20.257.887,62 | 2,25 | | |

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-------------------------------|-------------|--|---------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|-------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,50% a.a | 2,02 | 0,36 | 0,36 | 0,36 | 10.036.026,38 | 1,11 | | |
| Sub-total Artigo 7º IV | | | 2,67 | 0,85 | 0,85 | 0,85 | 30.293.914,00 | 3,36 | | |

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 | 1,34 | -0,64 | -0,64 | -0,64 | 3.233.894,98 | 0,36 | 72.020.308,77 | 4,49 |
| QUELUZ | PLANNER | ILLUMINATI FIDC | 11,06 | 0,00 | 0,01 | 0,01 | 942.074,19 | 0,10 | 50.275.022,77 | 1,87 |
| GENIAL | RJI | INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC | 2,40 | -1,13 | -1,13 | -1,13 | 298.539,40 | 0,03 | 6.157.527,03 | 4,85 |
| Sub-total Artigo 7º V, Alínea a | | | 3,47 | -0,54 | -0,54 | -0,54 | 4.474.508,57 | 0,50 | | |

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 | 1,60 | -0,01 | -0,25 | -0,25 | 534.922,30 | 0,06 | 21.466.611,27 | 2,49 |
| Sub-total Artigo 7º V, Alínea b | | | 1,60 | -0,01 | -0,25 | -0,25 | 534.922,30 | 0,06 | | |
| Renda Fixa | | | 0,40 | 0,15 | 0,88 | 0,88 | 837.977.776,22 | 92,98 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

3,03%

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 | 13,80 | 0,29 | -3,54 | -3,54 | 4.464.328,79 | 0,50 | 250.783.572,35 | 1,78 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA INFRAESTRUTURA | 16,78 | 0,79 | -3,70 | -3,70 | 6.061.114,75 | 0,67 | 213.557.551,44 | 2,84 |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 17,33 | 0,43 | -3,37 | -3,37 | 3.189.387,98 | 0,35 | 1.385.702.652,77 | 0,23 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 21,62 | 1,54 | -6,59 | -6,59 | 3.725.452,53 | 0,41 | 662.400.867,22 | 0,56 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE | 16,43 | 1,04 | -2,73 | -2,73 | 3.519.317,63 | 0,39 | 700.942.861,26 | 0,50 |
| SAFRA | SAFRA | SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES | 17,09 | 0,86 | -3,79 | -3,79 | 6.360.325,15 | 0,71 | 155.759.690,25 | 4,08 |
| Sub-total Artigo 8º I | | | 16,28 | 0,82 | -3,94 | -3,94 | 27.319.926,83 | 3,03 | | |
| Renda Variável | | | 16,28 | 0,82 | -3,94 | -3,94 | 27.319.926,83 | 3,03 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,83%

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 | 14,62 | -1,12 | 4,56 | 4,56 | 8.560.293,91 | 0,95 | 2.108.221.544,73 | 0,41 |
| SAFRA | SAFRA | SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB | 13,44 | -1,88 | 2,73 | 2,73 | 7.919.924,20 | 0,88 | 670.212.192,72 | 1,18 |
| Sub-total Artigo 9º III | | | 13,65 | -1,48 | 3,67 | 3,67 | 16.480.218,11 | 1,83 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 13,65 | -1,48 | 3,67 | 3,67 | 16.480.218,11 | 1,83 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,49%

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 | 1,15 | -0,48 | -0,48 | -0,48 | 366.716,65 | 0,04 | 41.414.350,29 | 0,89 |
| QUELUZ | RJI | FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO | 1,62 | -0,01 | -0,14 | -0,14 | 3.243.523,35 | 0,36 | 140.686.502,11 | 2,31 |
| Sub-total Artigo 10º I | | | 6,81 | -0,06 | -0,17 | -0,17 | 3.610.240,00 | 0,40 | | |

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 | 0,58 | -0,15 | -0,15 | -0,15 | 8.706.131,63 | 0,97 | 122.614.237,57 | 7,10 |
| QUELUZ | BNY MELLON | BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP | 0,17 | -0,05 | -0,05 | -0,05 | 1.118.756,71 | 0,12 | 27.538.232,69 | 4,06 |
| Sub-total Artigo 10º II | | | 0,53 | -0,14 | -0,14 | -0,14 | 9.824.888,34 | 1,09 | | |
| Investimentos Estruturados | | | 5,05 | -0,12 | -0,15 | -0,15 | 13.435.128,34 | 1,49 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,67%

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 | 6,34 | 0,00 | 0,14 | 0,14 | 5.667.613,54 | 0,63 | 71.621.940,12 | 7,91 |
| QUELUZ | RJI | ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII | 0,89 | -0,22 | -0,22 | -0,22 | 60.183,55 | 0,01 | 141.894.400,24 | 0,04 |
| VERITAS | RJI | SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII | 1,82 | -0,16 | -0,16 | -0,16 | 319.204,66 | 0,04 | 64.121.173,27 | 0,50 |
| Sub-total Artigo 11º | | | 5,92 | -0,01 | 0,12 | 0,12 | 6.047.001,75 | 0,67 | | |
| Fundos Imobiliários | | | 5,92 | -0,01 | 0,12 | 0,12 | 6.047.001,75 | 0,67 | | |
| Total | | | 0,89 | 0,14 | 0,75 | 0,75 | 901.260.051,25 | 100,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

| Ativo | Valor (R\$) |
|---|-----------------------|
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | 291.315,05 |
| Sub-total Disponibilidades Financeiras | 291.315,05 |
| Total | 901.551.366,30 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | ALM | Limite Legal |
|-----------------------------------|---|-----------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | | |
| Renda Fixa | | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea a | Títulos do Tesouro Nacional | 304.601.567,16 | 33,80 | 0,00 | 50,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 117.074.972,36 | 12,99 | 0,00 | 10,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 380.997.891,83 | 42,27 | 0,00 | 20,00 | 60,00 | 0,00 | 60,00 |
| Artigo 7º IV | Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira) | 30.293.914,00 | 3,36 | 0,00 | 5,00 | 20,00 | 0,00 | 20,00 |
| Artigo 7º V, Alínea a | FIDC Cota Sênior | 4.474.508,57 | 0,50 | 0,00 | 1,00 | 1,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 7º V, Alínea b | FI RF - Crédito Privado | 534.922,30 | 0,06 | 0,00 | 0,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Renda Fixa | 837.977.776,22 | 92,98 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 27.319.926,83 | 3,03 | 0,00 | 2,00 | 30,00 | 0,00 | 30,00 |
| | Total Renda Variável | 27.319.926,83 | 3,03 | | | | | 30,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º III | Fundos de Ações - BDR Nível I | 16.480.218,11 | 1,83 | 0,00 | 2,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 16.480.218,11 | 1,83 | | | | | 10,00 |
| Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 3.610.240,00 | 0,40 | 0,00 | 3,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º II | Fundo de Participação | 9.824.888,34 | 1,09 | 0,00 | 1,00 | 1,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Investimentos Estruturados | 13.435.128,34 | 1,49 | | | | | 15,00 |
| Fundos Imobiliários | | | | | | | | |
| Artigo 11º | Fundo de Investimento Imobiliário | 6.047.001,75 | 0,67 | 0,00 | 1,00 | 1,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Fundos Imobiliários | 6.047.001,75 | 0,67 | | | | | 5,00 |
| Total | | 901.260.051,25 | 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 | 0,87 90,21 | 0,87 90,21 | 2,88 102,57 | 4,50 74,60 | 10,92 84,82 | 2.615.733,40 | 2.615.733,40 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 0,82 84,98 | 0,82 84,98 | 3,17 113,06 | 5,24 86,72 | 12,38 96,17 | 980.897,17 | 980.897,17 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 0,92 94,87 | 0,92 94,87 | 2,85 101,63 | 5,96 98,65 | 12,76 99,12 | 3.315.924,00 | 3.315.924,00 |
| Artigo 7º IV % do CDI | 0,85 87,65 | 0,85 87,65 | | | | 254.526,82 | 254.526,82 |
| Artigo 7º V, Alínea a % do CDI | -0,54 -55,67 | -0,54 -55,67 | -0,66 -23,53 | -3,75 -62,08 | -9,84 -76,41 | -24.203,56 | -24.203,56 |
| Artigo 7º V, Alínea b % do CDI | -0,25 -25,70 | -0,25 -25,70 | -1,04 -37,17 | -1,77 -29,30 | -1,94 -15,08 | -1.332,53 | -1.332,53 |
| Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p. | -3,94 0,86 | -3,94 0,86 | 13,84 0,93 | 3,30 -1,46 | 13,56 0,94 | -1.120.069,20 | -1.120.069,20 |
| Artigo 9º III % do CDI | 3,67 380,15 | 3,67 380,15 | 13,05 464,94 | 11,13 184,25 | 21,44 166,54 | 584.166,91 | 584.166,91 |
| Artigo 10º I % do CDI | -0,17 -17,71 | -0,17 -17,71 | -0,58 -20,50 | -1,22 -20,20 | 0,55 4,30 | -6.192,57 | -6.192,57 |
| Artigo 10º II % do CDI | -0,14 -14,58 | -0,14 -14,58 | -0,40 -14,23 | -0,81 -13,35 | -1,60 -12,41 | -13.869,55 | -13.869,55 |
| Artigo 11º % do CDI | 0,12 12,46 | 0,12 12,46 | 0,43 15,22 | -2,51 -41,56 | 2,72 21,16 | 7.815,92 | 7.815,92 |
| OSASCO - CONSOLIDADO (Total) | | | | | | 6.593.396,81 | 6.593.396,81 |

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\$) |
|--------------------------|----------------|------------|---------------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| LTN 01012024 (6,030000%) | 6.028.599,10 | 0,00 | -6.030.000,00 | 0,00 | 0,00 | 1.400,90 | 1.400,90 |
| LTN 01012024 (6,100000%) | 6.037.581,19 | 0,00 | -6.039.000,00 | 0,00 | 0,00 | 1.418,81 | 1.418,81 |
| NTN-B 150545 | 17.087.175,44 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 16.816.438,19 | -270.737,25 | -270.737,25 |
| NTN-B 150545 (4,930000%) | 28.821.093,56 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 29.098.848,94 | 277.755,38 | 277.755,38 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------|----------------|------------|----------------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| NTN-B 150555 (5,742000%) | 43.857.325,93 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 44.309.782,89 | 452.456,96 | 452.456,96 |
| NTN-B 150840 (4,200000%) | 28.900.931,16 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 29.161.661,02 | 260.729,86 | 260.729,86 |
| NTN-B 150850 (5,729999%) | 44.424.542,05 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 44.882.376,39 | 457.834,34 | 457.834,34 |
| NTN-B 150850 (5,730001%) | 45.624.004,68 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 46.094.200,55 | 470.195,87 | 470.195,87 |
| NTN-B 150850 (5,740002%) | 44.367.381,38 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 44.825.032,96 | 457.651,58 | 457.651,58 |
| NTN-B 150850 (5,860000%) | 43.690.736,25 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 44.145.782,35 | 455.046,10 | 455.046,10 |
| NTN-F 2029 (12,000000%) | 5.488.792,58 | 0,00 | 0,00 | 273.329,56 | 5.267.443,87 | 51.980,85 | 51.980,85 |
| | 314.328.163,32 | 0,00 | -12.069.000,00 | 273.329,56 | 304.601.567,16 | 2.615.733,40 | |

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 IDKA2 | 15.104.837,76 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15.212.358,83 | 107.521,07 | 107.521,07 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 9.069.821,67 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.129.702,06 | 59.880,39 | 59.880,39 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI | 10.308.300,40 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.423.348,61 | 115.048,21 | 115.048,21 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4.273.304,77 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.304.476,88 | 31.172,11 | 31.172,11 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 33.439.009,19 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 33.658.058,99 | 219.049,80 | 219.049,80 |
| SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI | 53.898.801,40 | 0,00 | -10.000.000,00 | 0,00 | 44.347.026,99 | 448.225,59 | 448.225,59 |
| | 126.094.075,19 | 0,00 | -10.000.000,00 | 0,00 | 117.074.972,36 | 980.897,17 | |

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 REF DI LP PERFIL FIC FI | 106.822.968,46 | 40.181.569,78 | -21.194.076,67 | 0,00 | 126.819.832,59 | 1.009.371,02 | 1.009.371,02 |
| BRA1 FI RENDA FIXA | 186.769,73 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 187.145,85 | 376,12 | 376,12 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 96.652.873,11 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 97.703.187,92 | 1.050.314,81 | 1.050.314,81 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 25.061.934,56 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 25.225.925,73 | 163.991,17 | 163.991,17 |
| FI BARCELONA RENDA FIXA | 386.304,23 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 387.509,24 | 1.205,01 | 1.205,01 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 124.378.023,92 | 12.645.197,41 | -10.000.000,00 | 0,00 | 128.349.541,78 | 1.326.320,45 | 1.326.320,45 |
| FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B | 180.118,37 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 179.802,15 | -316,22 | -316,22 |
| MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA | 24.748,55 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 23.406,90 | -1.341,65 | -1.341,65 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------------|----------------|---------------|----------------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| TMJ IMA-B FI RF | 730.077,85 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 726.199,12 | -3.878,73 | -3.878,73 |
| TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 | 885.751,67 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 803.957,70 | -81.793,97 | -81.793,97 |
| TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 | 739.706,86 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 591.382,85 | -148.324,01 | -148.324,01 |
| | 356.049.277,31 | 52.826.767,19 | -31.194.076,67 | 0,00 | 380.997.891,83 | 3.315.924,00 | |

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|---------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,50% a.a | 0,00 | 10.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 10.036.026,38 | 36.026,38 | 36.026,38 |
| LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 5,95% a.a | 20.039.387,18 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20.257.887,62 | 218.500,44 | 218.500,44 |
| | 20.039.387,18 | 10.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 30.293.914,00 | 254.526,82 | |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|-----------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| ILLUMINATI FIDC | 1.138.681,27 | 0,00 | 0,00 | 196.753,35 | 942.074,19 | 146,27 | 146,27 |
| INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC | 301.944,01 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 298.539,40 | -3.404,61 | -3.404,61 |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC | 3.254.840,20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.233.894,98 | -20.945,22 | -20.945,22 |
| | 4.695.465,48 | 0,00 | 0,00 | 196.753,35 | 4.474.508,57 | -24.203,56 | |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------------------------|-----------------------------|
| PIATÁ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 538.746,70 | 0,00 | 0,00 | 2.491,87 | 534.922,30 | -1.332,53 | -1.332,53 |
| | 538.746,70 | 0,00 | 0,00 | 2.491,87 | 534.922,30 | -1.332,53 | |

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 3.300.571,70 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.189.387,98 | -111.183,72 | -111.183,72 |
| FIA CAIXA DIVIDENDOS | 4.628.040,19 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.464.328,79 | -163.711,40 | -163.711,40 |
| FIA CAIXA INFRAESTRUTURA | 6.293.953,92 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.061.114,75 | -232.839,17 | -232.839,17 |

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 3.988.234,92 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.725.452,53 | -262.782,39 | -262.782,39 |
| FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE | 3.618.111,21 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.519.317,63 | -98.793,58 | -98.793,58 |
| SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES | 6.611.084,09 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.360.325,15 | -250.758,94 | -250.758,94 |
| | 28.439.996,03 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 27.319.926,83 | -1.120.069,20 | |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 8.186.902,36 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.560.293,91 | 373.391,55 | 373.391,55 |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB | 7.709.148,84 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.919.924,20 | 210.775,36 | 210.775,36 |
| | 15.896.051,20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 16.480.218,11 | 584.166,91 | |

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO | 3.247.943,24 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.243.523,35 | -4.419,89 | -4.419,89 |
| WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP | 368.489,33 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 366.716,65 | -1.772,68 | -1.772,68 |
| | 3.616.432,57 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.610.240,00 | -6.192,57 | |

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|-----------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP | 1.119.268,16 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.118.756,71 | -511,45 | -511,45 |
| W7 FIP MULTISTRATÉGIA | 8.719.489,73 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.706.131,63 | -13.358,10 | -13.358,10 |
| | 9.838.757,89 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.824.888,34 | -13.869,55 | |

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Proventos | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|------------|--------------|-----------------------------|-----------------------------|
| HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO | 6.070.861,77 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 411.711,83 | 5.667.613,54 | 8.463,60 | 8.463,60 |
| SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII | 319.721,89 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 319.204,66 | -517,23 | -517,23 |
| ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII | 60.314,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 60.183,55 | -130,45 | -130,45 |

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Proventos | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|-------|----------------|------------|----------|-------------|------------|--------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 6.450.897,66 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 411.711,83 | 6.047.001,75 | 7.815,92 | |

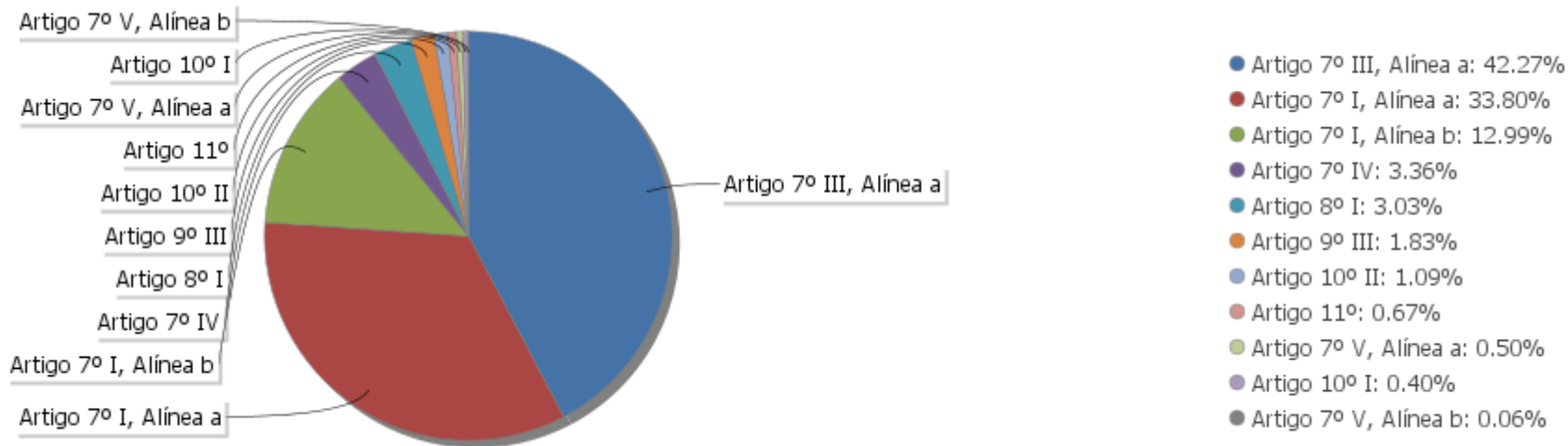
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

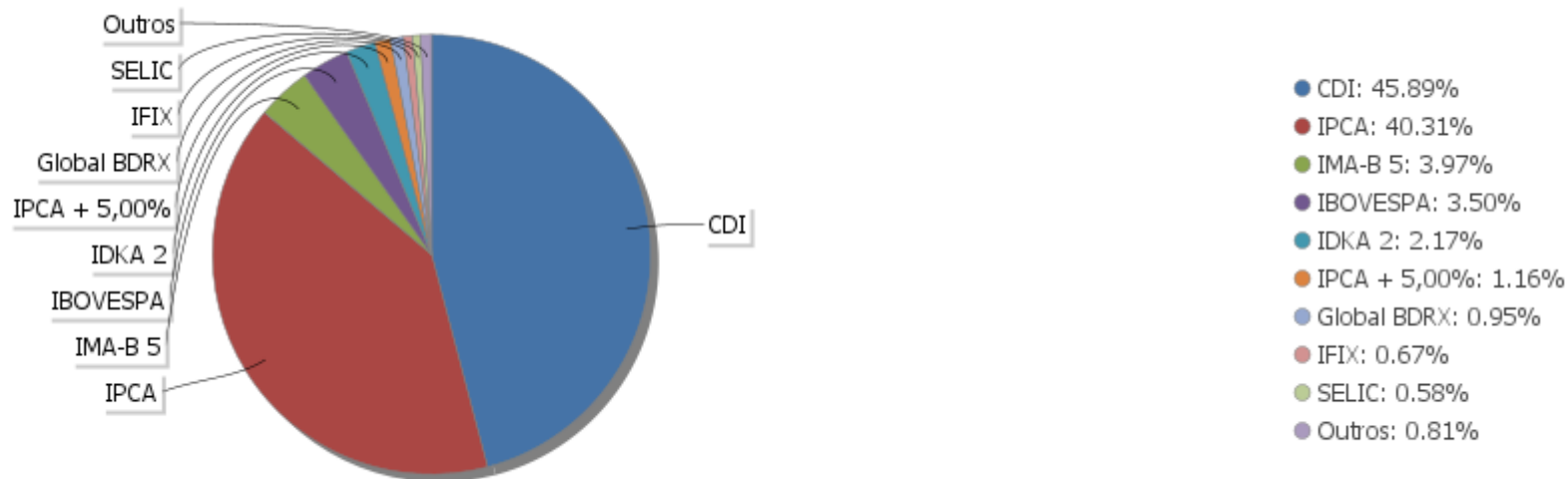
| Período | Valor (R\$) | (%) | (%) Limite Mínimo P.I. | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo Acum. |
|-----------------------|----------------|-------|------------------------|-----------------------|-----------|-------------------------|
| de 0 a 30 dias | 544.705.009,65 | 60,44 | | 544.705.009,65 | 60,44 | |
| de 31 dias a 365 dias | 13.672.920,14 | 1,52 | | 558.377.929,79 | 61,96 | |
| acima de 365 dias | 342.882.121,46 | 38,04 | | 901.260.051,25 | 100,00 | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

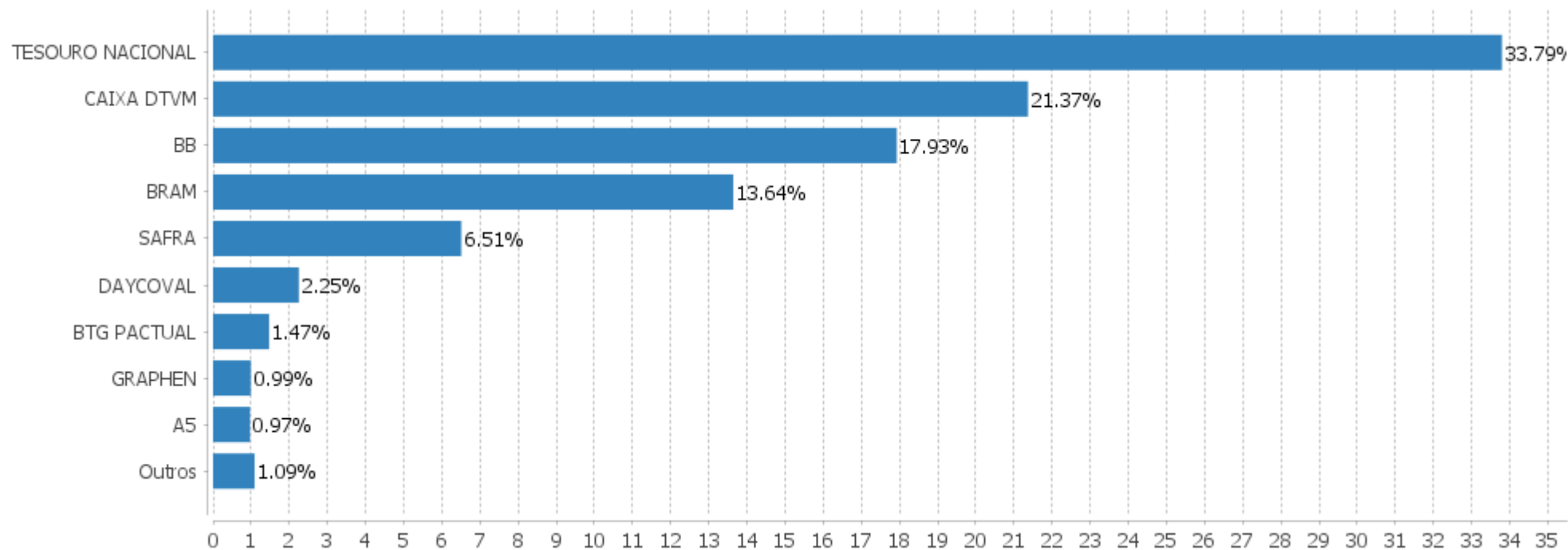


Alocação Por Estratégia



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 | 0,75 | | | | | | | | | | | | 0,75 |
| IPCA + 5,00% | 0,85 | | | | | | | | | | | | 0,85 |
| p.p. indexador | -0,09 | | | | | | | | | | | | -0,09 |
| 2023 | 1,37 | 0,47 | 1,28 | 0,98 | 1,24 | 1,23 | 0,92 | 0,73 | 0,58 | 0,47 | 1,34 | 1,19 | 12,44 |
| IPCA + 5,00% | 0,96 | 1,19 | 1,16 | 0,96 | 0,66 | 0,33 | 0,53 | 0,68 | 0,65 | 0,65 | 0,67 | 0,95 | 9,79 |
| p.p. indexador | 0,41 | -0,73 | 0,12 | 0,01 | 0,58 | 0,91 | 0,39 | 0,05 | -0,07 | -0,18 | 0,67 | 0,24 | 2,66 |
| 2022 | -0,24 | 0,09 | 1,80 | -0,53 | 0,90 | -0,52 | 1,28 | 0,41 | -0,30 | 1,57 | 0,78 | 0,25 | 5,61 |
| IPCA + 4,95% | 0,95 | 1,38 | 2,05 | 1,43 | 0,89 | 1,08 | -0,28 | 0,08 | 0,11 | 0,98 | 0,80 | 1,05 | 11,00 |
| p.p. indexador | -1,18 | -1,28 | -0,25 | -1,96 | 0,01 | -1,59 | 1,56 | 0,33 | -0,42 | 0,59 | -0,02 | -0,80 | -5,40 |
| 2021 | | | | | | | | | -0,22 | -0,44 | 1,12 | 1,14 | 1,59 |
| IPCA + 5,45% | | | | | | | | | 1,61 | 1,68 | 1,38 | 1,22 | 6,01 |
| p.p. indexador | | | | | | | | | -1,83 | -2,12 | -0,26 | -0,08 | -4,42 |

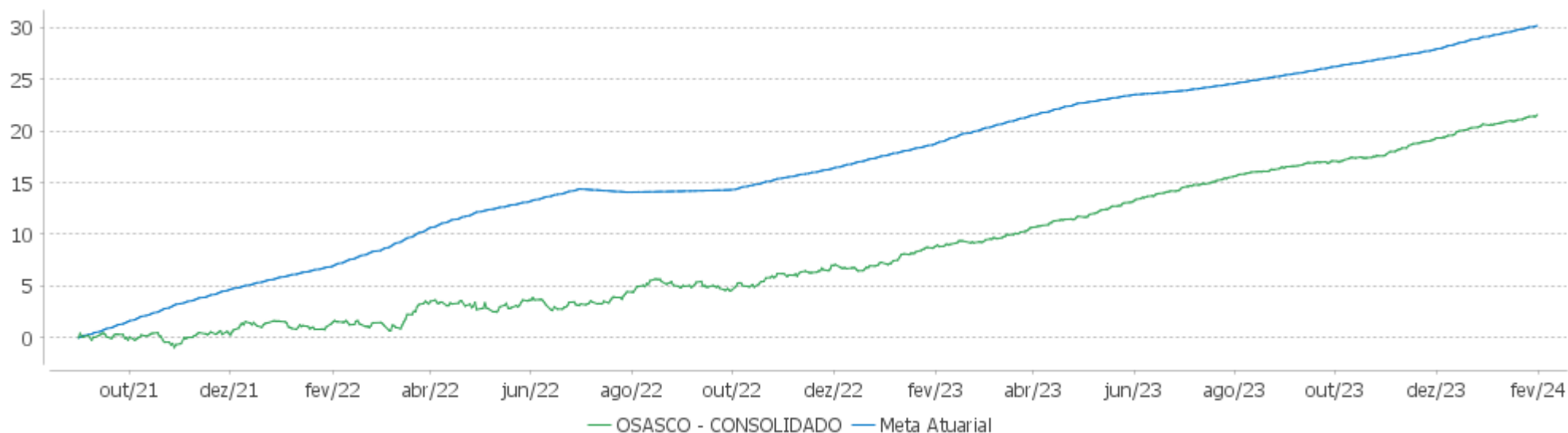
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

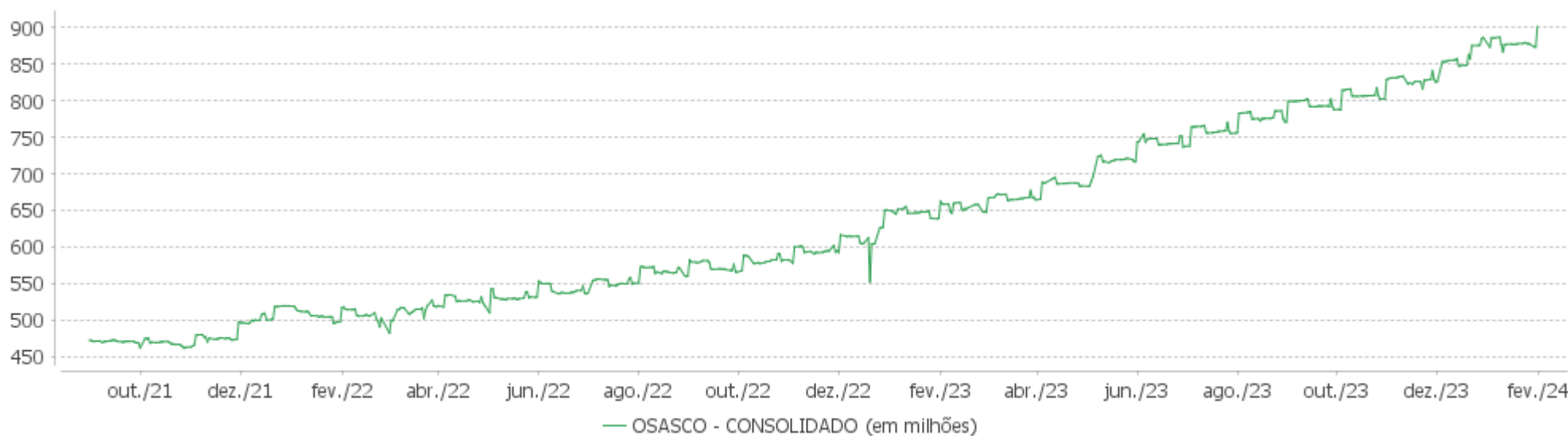
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 13 | 44,83 | 03 meses | 3,32 | 2,49 | 0,83 | 0,76 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 16 | 55,17 | 06 meses | 5,17 | 4,53 | 0,64 | 0,79 |
| | | | 12 meses | 11,76 | 9,67 | 2,10 | 0,89 |
| | | | 24 meses | 19,92 | 21,75 | -1,82 | 2,15 |
| Maior rentabilidade da Carteira | 1,80 | 2022-03 | Desde 31/08/2021 | 21,55 | 30,29 | -8,74 | 2,33 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -0,53 | 2022-04 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

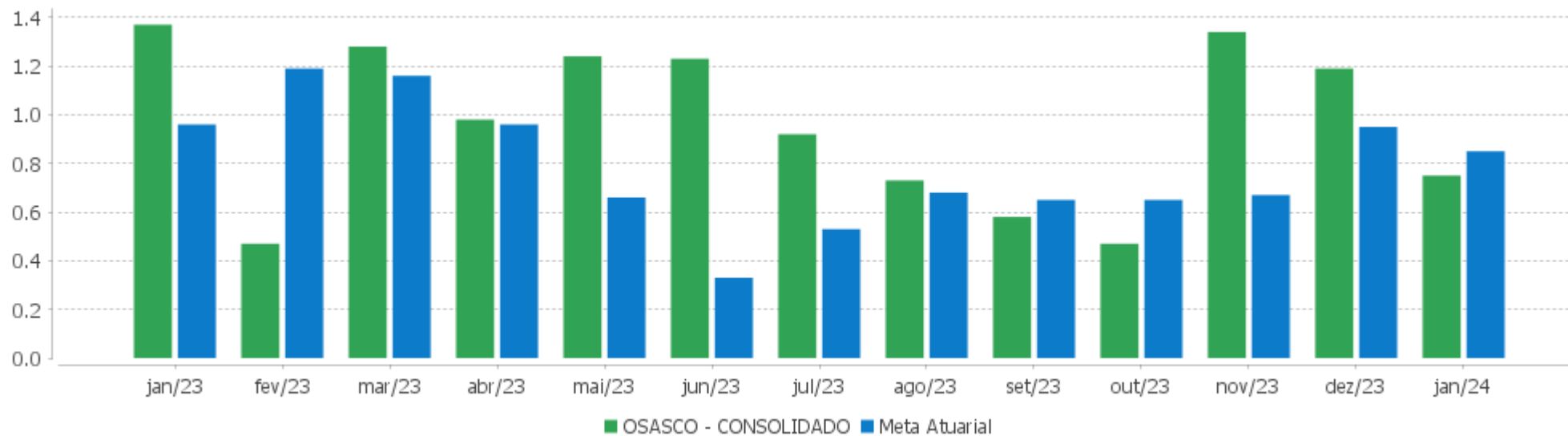


Patrimônio Líquido



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 |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|-------------------|
| LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 5,95% a.a Var. IPCA p.p. | 1,09 0,67 | 1,09 0,67 | | | | | |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,50% a.a Var. IPCA p.p. | 0,36 0,21 | 0,36 0,21 | | | | | |
| PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO % do CDI | -0,25 -25,70 | -0,25 -25,70 | -1,04 -37,17 | -1,77 -29,30 | -1,94 -15,08 | -61,81 -226,15 | -62,48 -185,39 |
| NTN-B 150545 Var. IPCA p.p. | -1,58 -2,00 | -1,58 -2,00 | 5,82 4,55 | 1,37 -0,64 | 21,15 16,64 | 23,95 13,41 | 14,66 -7,36 |
| NTN-B 150555 (5,742000%) Var. IPCA p.p. | 1,03 0,61 | 1,03 0,61 | 2,80 1,54 | 5,02 3,01 | 10,75 6,24 | 20,48 9,94 | 32,73 10,71 |
| NTN-B 150545 (4,930000%) Var. IPCA p.p. | 0,96 0,54 | 0,96 0,54 | 2,54 1,28 | 4,55 2,54 | 9,84 5,33 | 21,94 11,40 | 37,46 15,44 |
| LTN 01012024 (6,030000%) Var. IMA-GERAL TOTAL p.p. | 0,02 -0,44 | 0,02 -0,44 | 0,96 -3,03 | 2,47 -2,67 | 5,44 -9,09 | 11,80 -14,41 | 18,54 -9,46 |
| NTN-F 2029 (12,000000%) Var. SELIC p.p. | 1,00 0,03 | 1,00 0,03 | 2,98 0,17 | 5,98 -0,05 | 12,01 -0,86 | 25,45 -1,88 | 33,34 -0,36 |
| NTN-B 150840 (4,200000%) Var. IPCA p.p. | 0,90 0,48 | 0,90 0,48 | 2,32 1,05 | 4,13 2,13 | 9,03 4,53 | 20,21 9,66 | 31,63 9,62 |
| NTN-B 150850 (5,729999%) Var. IPCA p.p. | 1,03 0,61 | 1,03 0,61 | 2,78 1,52 | 2,09 0,08 | 4,67 0,17 | | |
| LTN 01012024 (6,100000%) Var. IMA-GERAL TOTAL p.p. | 0,02 -0,44 | 0,02 -0,44 | 0,97 -3,01 | 2,50 -2,64 | 5,50 -9,03 | 11,94 -14,27 | 18,77 -9,23 |
| NTN-B 150850 (5,730001%) Var. IPCA p.p. | 1,03 0,61 | 1,03 0,61 | 2,78 1,52 | 4,99 2,99 | 10,72 6,21 | 20,43 9,89 | 32,66 10,64 |
| NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p. | 1,04 0,62 | 1,04 0,62 | 2,82 1,55 | 2,10 0,10 | 4,70 0,20 | | |
| NTN-B 150850 (5,740002%) Var. IPCA p.p. | 1,03 0,61 | 1,03 0,61 | 2,78 1,52 | 5,00 2,99 | 10,73 6,22 | 20,45 9,91 | 32,68 10,67 |
| BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p. | 0,71 -0,09 | 0,71 -0,09 | 3,96 -0,19 | 4,60 -0,21 | 10,93 -0,50 | 23,00 -0,53 | 28,50 -1,05 |
| 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 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 0,66 | 0,66 | 3,94 | 4,32 | 11,14 | 23,30 | 28,53 |

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|-------------------|
| Var. IMA-B 5 p.p. | -0,02 | -0,02 | -0,05 | -0,12 | -0,19 | -0,49 | -0,91 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 0,73 -0,08 | 0,73 -0,08 | 3,91 -0,24 | 4,78 -0,03 | 11,15 -0,28 | 22,88 -0,64 | 28,46 -1,08 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p. | 1,12 0,27 | 1,12 0,27 | 2,87 0,38 | 5,42 0,90 | | | |
| SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI | 0,95 98,36 | 0,95 98,36 | 2,75 97,95 | 5,94 98,45 | 12,67 98,40 | 26,98 98,70 | 33,23 98,62 |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI | -0,64 -66,57 | -0,64 -66,57 | -1,41 -50,26 | -2,67 -44,16 | -4,41 -34,30 | -1,24 -4,52 | -1,58 -4,69 |
| 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 |
| ILLUMINATI FIDC Var. IPCA + 6,00% p.p. | 0,01 -0,92 | 0,01 -0,92 | 2,18 -0,55 | -6,43 -11,45 | -22,06 -32,76 | -31,32 -55,43 | -22,14 -67,36 |
| MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p. | -5,42 -4,97 | -5,42 -4,97 | -14,72 -19,69 | -25,25 -28,16 | -38,76 -54,29 | -51,68 -75,48 | -93,01 -115,39 |
| FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,18 0,27 | -0,18 0,27 | 33,63 28,65 | 6,13 3,22 | 6,93 -8,60 | 14,51 -9,29 | 10,93 -11,44 |
| BRDESCO 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 |
| BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI | 1,09 112,41 | 1,09 112,41 | 3,04 108,45 | 6,56 108,57 | 13,58 105,49 | 28,79 105,35 | 35,99 106,81 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,97 100,00 | 0,97 100,00 | 2,81 100,09 | 6,04 100,08 | 12,80 99,46 | 27,43 100,36 | 34,15 101,32 |
| FI BARCELONA RENDA FIXA % do CDI | 0,31 32,27 | 0,31 32,27 | 0,70 25,09 | 2,90 48,05 | 10,03 77,91 | -43,92 -160,70 | -42,06 -124,81 |
| 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 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | 1,00 103,77 | 1,00 103,77 | 2,92 104,11 | 6,34 104,91 | 13,22 102,68 | 27,95 102,27 | 34,67 102,87 |
| 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 |
| BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,20 0,65 | 0,20 0,65 | 0,27 -4,70 | 1,39 -1,52 | 4,54 -11,00 | 12,61 -11,19 | 11,27 -11,11 |
| TMJ IMA-B FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,53 -0,08 | -0,53 -0,08 | 0,73 -4,25 | -4,28 -7,19 | 0,33 -15,20 | 0,60 -23,20 | -12,24 -34,62 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | -3,37 | -3,37 | 13,39 | 1,81 | 6,94 | 1,60 | -26,78 |

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Var. IBOVESPA p.p. | 1,43 | 1,43 | 0,48 | -2,95 | -5,69 | -12,32 | -37,80 |
| FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE | -2,73 | -2,73 | 18,05 | 7,36 | 20,43 | 25,72 | 39,62 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 2,06 | 2,06 | 5,14 | 2,60 | 7,81 | 11,81 | 28,59 |
| FIA CAIXA INFRAESTRUTURA | -3,70 | -3,70 | 12,67 | 4,98 | 21,24 | 27,93 | 27,69 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 1,09 | 1,09 | -0,24 | 0,21 | 8,62 | 14,01 | 16,67 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | -6,59 | -6,59 | 12,09 | -6,54 | 5,31 | -11,42 | -20,92 |
| Var. SMALL CAP p.p. | -0,04 | -0,04 | -0,42 | -0,25 | -1,03 | -1,31 | -1,59 |
| FIA CAIXA DIVIDENDOS | -3,54 | -3,54 | 13,62 | 8,29 | 14,09 | 25,29 | 29,83 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 1,26 | 1,26 | 0,71 | 3,53 | 1,46 | 11,37 | 18,81 |
| SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES | -3,79 | -3,79 | 14,14 | 3,36 | 11,54 | 1,81 | -10,84 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 1,00 | 1,00 | 1,22 | -1,41 | -1,08 | -12,11 | -21,86 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 4,56 | 4,56 | 14,15 | 11,69 | 25,21 | 3,42 | 15,15 |
| Var. Global BDRX p.p. | -0,22 | -0,22 | -0,56 | -0,89 | -1,61 | -2,20 | -4,80 |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB | 2,73 | 2,73 | 11,88 | 10,53 | 17,61 | -4,90 | 8,37 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 7,53 | 7,53 | -1,03 | 5,76 | 4,98 | -18,81 | -2,66 |
| FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO | -0,14 | -0,14 | -0,57 | -1,13 | -3,36 | -18,04 | -19,81 |
| % do CDI | -14,08 | -14,08 | -20,47 | -18,74 | -26,07 | -66,00 | -58,79 |
| WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP | -0,48 | -0,48 | -0,58 | -1,99 | -3,43 | 7,62 | -24,51 |
| Var. IPCA + 7,00% p.p. | -1,50 | -1,50 | -3,55 | -7,51 | -15,17 | -18,83 | -73,87 |
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | -0,15 | -0,15 | -0,43 | -0,88 | -1,73 | -9,95 | -11,28 |
| % do CDI | -15,85 | -15,85 | -15,39 | -14,49 | -13,41 | -36,41 | -33,46 |
| BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP | -0,05 | -0,05 | -0,15 | -0,26 | -0,59 | -1,22 | -2,42 |
| Var. IPCA + 6,00% p.p. | -0,98 | -0,98 | -2,87 | -5,29 | -11,29 | -25,34 | -47,64 |
| SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII | -0,16 | -0,16 | -0,60 | -1,30 | -2,31 | -3,64 | -1,24 |
| Var. IFIX p.p. | -0,83 | -0,83 | -6,24 | -5,56 | -20,47 | -23,69 | -17,01 |
| HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO | 0,14 | 0,14 | 0,49 | -2,60 | 3,08 | 7,56 | 9,46 |
| Var. IFIX p.p. | -0,53 | -0,53 | -5,14 | -6,86 | -15,08 | -12,48 | -6,31 |
| ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII | -0,22 | -0,22 | -0,47 | -0,90 | -2,41 | 12,23 | -35,30 |
| Var. IFIX p.p. | -0,88 | -0,88 | -6,11 | -5,16 | -20,57 | -7,81 | -51,07 |
| OSASCO - CONSOLIDADO | 0,75 | 0,75 | 3,32 | 5,17 | 11,76 | 19,92 | |
| Var. IPCA + 5,00% p.p. | -0,09 | -0,09 | 0,83 | 0,64 | 2,10 | -1,88 | |
| 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 PREV RF IDKA2 | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 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 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,10 |
| BRA1 FI RENDA FIXA | D+0 | D+0 | D+1440 | D+1445 | | 1,30 |
| BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| BRANCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | D+1 du | D+0 | D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate) | D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate) | | 3,00 |
| FI BARCELONA RENDA FIXA | D+0 | D+0 | D+0 ou D+1260 (isento de taxa de resgate) | D+1 du ou D+1261 (isento de taxa de resgate) | | 0,00 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A 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 DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B | D+0 | D+0 | D+30 ou D+1440 (isento de taxa de resgate) | D+31 ou D+1441 (isento de taxa de resgate) | Adicionalmente à remuneração prevista no caput deste Artigo, o FUNDO, com base em seu resultado, pagará a GESTORA, a título de performance ("Prêmio"), o equivalente a 20% (vinte por cento) da valorização da cota do FUNDO que, em cada | 1,70 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|---|---------------|---------------|---|---|--|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO | D+1 du | D+0 | D+90 ou D+1440 (isento de taxa de resgate) | D+91 ou D+1441 (isento de taxa de resgate) | semestre civil, exceder o índiceIMA-B. | 1,50 |
| FIA CAIXA DIVIDENDOS | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 1,50 |
| FIA CAIXA INFRAESTRUTURA | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 2,00 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 0,70 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 1,50 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,40 |
| FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE | D+1 du | D+0 | D+13 du | D+15 du | | 2,00 |
| HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| ILLUMINATI FIDC | D+0 | D+0 | | | | |
| INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC | D+0 | D+0 | | | | |
| MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA | D+0 | D+0 | D+1370 | D+1371 | | 1,50 |
| PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | D+0 | D+0 | D+0 ou D+1080 (isento de taxa de resgate) | D+1 du ou D+1081 (isento de taxa de resgate) | | 1,40 |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+4 du | | 1,50 |
| SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES | | | D+1 du | D+3 du | | 2,00 |
| SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI | | | D+0 | D+0 | | 0,10 |
| SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| TMJ IMA-B FI RF | D+0 | D+0 | D+30 ou D+1460 du (isento de taxa de resgate) | D+31 ou D+1461 du (isento de taxa de resgate) | | 0,80 |
| 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 |
| W7 FIP MULTISTRATÉGIA | Não se aplica | Não se aplica | | | | |
| WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP | D+0 | D+0 | D+1460 | D+1520 | | 1,00 |

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|------------------------------|---------------|---------------|-----------|------------|-------------|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII | 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 | 0,83 | 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 150545 (4,930000%) | 29.098.848,94 | 4,930000 | 26.552.270,85 | 5,698500 | -2.546.578,09 |
| NTN-B 150555 (5,742000%) | 44.309.782,89 | 5,742000 | 44.625.970,53 | 5,690800 | 316.187,64 |
| NTN-B 150840 (4,200000%) | 29.161.661,02 | 4,200000 | 25.130.128,51 | 5,645100 | -4.031.532,51 |
| NTN-B 150850 (5,729999%) | 44.882.376,39 | 5,729999 | 45.040.659,40 | 5,702500 | 158.283,01 |
| NTN-B 150850 (5,730001%) | 46.094.200,55 | 5,730001 | 46.256.757,20 | 5,702500 | 162.556,65 |
| NTN-B 150850 (5,740002%) | 44.825.032,96 | 5,740002 | 45.040.659,40 | 5,702500 | 215.626,44 |
| NTN-B 150850 (5,860000%) | 44.145.782,35 | 5,860000 | 45.040.659,40 | 5,702500 | 894.877,05 |
| NTN-F 2029 (12,000000%) | 5.267.443,87 | 12,000000 | 5.599.345,89 | 10,279600 | 331.902,02 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------|------------|--|---------------|---------------|--------------------|-------------------|
| 4130 | 02/01/2024 | LTN 01012024 (6,030000%) | 0,00 | 6.030.000,00 | 6.030,00000000 | 1.000,0000000000 |
| 4131 | 02/01/2024 | LTN 01012024 (6,100000%) | 0,00 | 6.039.000,00 | 6.039,00000000 | 1.000,0000000000 |
| 4132 | 03/01/2024 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 12.342.329,56 | 0,00 | 2.469.327,21333201 | 4,9982560000 |
| 4133 | 04/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 112.792,42 | 36.773,06410100 | 3,0672565030 |
| 4134 | 05/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 2.491,87 | 0,00 | 812,05908600 | 3,0685821300 |
| 4135 | 05/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 46.107,75 | 15.025,75067100 | 3,0685821300 |
| 4136 | 08/01/2024 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 302.867,85 | 0,00 | 60.514,26601930 | 5,0049000000 |
| 4137 | 08/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 108.541,70 | 35.356,65930900 | 3,0699082470 |
| 4138 | 09/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.067.230,44 | 347.491,64671500 | 3,0712405610 |
| 4139 | 09/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.207.685,29 | 393.223,93215800 | 3,0712405610 |
| 4140 | 09/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 411.711,83 | 0,00 | 134.053,91789400 | 3,0712405610 |
| 4141 | 09/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 9.554.660,34 | 3.111.010,07890100 | 3,0712405610 |
| 4142 | 09/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.207.685,29 | 393.223,93215800 | 3,0712405610 |
| 4143 | 09/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 2.415.370,58 | 0,00 | 786.447,86431600 | 3,0712405610 |
| 4144 | 10/01/2024 | SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI | 0,00 | 10.000.000,00 | 15.740,14697139 | 635,3180830000 |
| 4145 | 11/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 25.099,54 | 8.165,25659800 | 3,0739438130 |
| 4146 | 11/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 10.000.000,00 | 0,00 | 3.253.149,89744000 | 3,0739438130 |
| 4147 | 11/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 30.047,25 | 9.774,82082600 | 3,0739438130 |
| 4148 | 11/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 148.322,43 | 48.251,50979400 | 3,0739438130 |
| 4149 | 11/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 140.467,61 | 45.696,21910700 | 3,0739438130 |
| 4150 | 12/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 196.753,35 | 0,00 | 63.978,08460400 | 3,0753241710 |
| 4151 | 15/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 333.913,10 | 108.529,47259400 | 3,0767043460 |
| 4152 | 16/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 22.990,17 | 7.469,17743200 | 3,0780056050 |
| 4153 | 16/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 60.089,77 | 19.522,30688000 | 3,0780056050 |
| 4154 | 18/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 90.498,00 | 29.375,25259800 | 3,0807564870 |
| 4155 | 19/01/2024 | LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,50% a.a | 10.000.000,00 | 0,00 | 200,00000000 | 50.000,0000000000 |
| 4156 | 19/01/2024 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 10.000.000,00 | 1.989.805,82678820 | 5,0256160000 |
| 4157 | 22/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 355.363,62 | 0,00 | 115.246,81710100 | 3,0835005160 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|------------------------------------|----------------------|----------------------|--------------------|--------------|
| 4158 | 22/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 357.601,46 | 115.972,56369600 | 3,0835005160 |
| 4159 | 22/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 85.022,20 | 0,00 | 27.573,27250500 | 3,0835005160 |
| 4160 | 25/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.584.825,59 | 513.302,47255000 | 3,0875081940 |
| 4161 | 25/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 374.629,91 | 121.337,30065200 | 3,0875081940 |
| 4162 | 25/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 283.227,60 | 91.733,39217400 | 3,0875081940 |
| 4163 | 29/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 228.345,68 | 73.894,96521600 | 3,0901385410 |
| 4164 | 29/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 4.002.762,62 | 1.295.334,35698500 | 3,0901385410 |
| 4165 | 29/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 206.552,71 | 66.842,54031300 | 3,0901385410 |
| 4166 | 29/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 22.751,06 | 0,00 | 7.362,47249000 | 3,0901385410 |
| 4167 | 31/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 12.544.473,82 | 0,00 | 4.056.017,86319700 | 3,0928053680 |
| 4168 | 31/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 11.874.414,58 | 0,00 | 3.839.366,90709900 | 3,0928053680 |
| 4169 | 31/01/2024 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 2.273.216,87 | 0,00 | 735.001,59225000 | 3,0928053680 |
| Total | | | 62.826.767,19 | 53.263.076,67 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 3.436.786,68 Value-At-Risk: 0,38%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | Limite ⁽⁵⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-----------------------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|-----------------------|---------------|
| Artigo 7º | 0,67 | 0,19 | | 0,14 | -0,13 | 0,88 | 837.977.776,22 | 92,98 |
| Artigo 8º | 13,71 | 7,56 | | 0,21 | -0,36 | -3,94 | 27.319.926,83 | 3,03 |
| Artigo 9º | 12,24 | 5,68 | | 0,03 | 0,22 | 3,67 | 16.480.218,11 | 1,83 |
| Artigo 10º | 0,40 | 0,03 | | -0,00 | -2,81 | -0,15 | 13.435.128,34 | 1,49 |
| Artigo 11º | 0,45 | 0,11 | | -0,00 | -1,89 | 0,12 | 6.047.001,75 | 0,67 |
| OSASCO - CONSOLIDADO | | 0,38 | | 0,38 | | | 901.260.051,25 | 100,00 |

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,19%

Artigo 7º I, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------|-------------|-----------------------|--------------|
| LTN 01012024 (6,030000%) | | NaN | 0,00 | NaN | | | 0,00 | 0,00 |
| LTN 01012024 (6,100000%) | | NaN | 0,00 | NaN | | | 0,00 | 0,00 |
| NTN-B 150545 | | 3,44 | 0,05 | 3,43 | | | 16.816.438,19 | 1,87 |
| NTN-B 150545 (4,930000%) | | 0,10 | 0,00 | 0,10 | | | 29.098.848,94 | 3,23 |
| NTN-B 150555 (5,742000%) | | 0,10 | 0,00 | 0,10 | | | 44.309.782,89 | 4,92 |
| NTN-B 150840 (4,200000%) | | 0,09 | 0,00 | 0,10 | | | 29.161.661,02 | 3,24 |
| NTN-B 150850 (5,729999%) | | 0,10 | 0,00 | 0,10 | | | 44.882.376,39 | 4,98 |
| NTN-B 150850 (5,730001%) | | 0,10 | 0,00 | 0,10 | | | 46.094.200,55 | 5,11 |
| NTN-B 150850 (5,740002%) | | 0,10 | 0,00 | 0,10 | | | 44.825.032,96 | 4,97 |
| NTN-B 150850 (5,860000%) | | 0,10 | 0,00 | 0,10 | | | 44.145.782,35 | 4,90 |
| NTN-F 2029 (12,000000%) | | 0,01 | 0,00 | 0,01 | | | 5.267.443,87 | 0,58 |
| Sub-total | 1,03 | 0,21 | 0,06 | | -0,09 | 0,87 | 304.601.567,16 | 33,80 |

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|------------|------------|
|-------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|------------|------------|

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI | | 0,37 | 0,00 | 0,37 | | | 10.423.348,61 | 1,16 |
| BB PREV RF IDKA2 | | 1,17 | 0,02 | 0,17 | | | 15.212.358,83 | 1,69 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 1,00 | 0,00 | 0,29 | | | 4.304.476,88 | 0,48 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | | 1,23 | 0,01 | 0,01 | | | 9.129.702,06 | 1,01 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | | 0,73 | 0,02 | 0,73 | | | 33.658.058,99 | 3,73 |
| SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI | | 0,01 | -0,00 | 0,01 | | | 44.347.026,99 | 4,92 |
| Sub-total | 0,58 | 0,51 | 0,05 | | -0,25 | 0,82 | 117.074.972,36 | 12,99 |

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 | 0,00 | 0,03 | | | 128.349.541,78 | 14,24 |
| BRA1 FI RENDA FIXA | | 0,15 | -0,00 | 2,21 | | | 187.145,85 | 0,02 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | | 0,01 | 0,00 | 0,01 | | | 126.819.832,59 | 14,07 |
| TMJ IMA-B FI RF | | 2,39 | -0,00 | 3,34 | | | 726.199,12 | 0,08 |
| TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 | | 2,03 | -0,00 | 2,45 | | | 591.382,85 | 0,07 |
| BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | | 1,23 | 0,03 | 0,01 | | | 25.225.925,73 | 2,80 |
| FI BARCELONA RENDA FIXA | | 0,34 | -0,00 | 0,34 | | | 387.509,24 | 0,04 |
| FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B | | 0,56 | 0,00 | 2,24 | | | 179.802,15 | 0,02 |
| BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | | 0,04 | 0,00 | 0,04 | | | 97.703.187,92 | 10,84 |
| MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA | | 0,14 | -0,00 | 2,21 | | | 23.406,90 | 0,00 |
| TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 | | 1,01 | -0,00 | 1,65 | | | 803.957,70 | 0,09 |
| Sub-total | 0,22 | 0,08 | 0,03 | | -0,22 | 0,92 | 380.997.891,83 | 42,27 |

Artigo 7º IV

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 5,95% a.a | | 0,49 | 0,00 | 0,49 | | | 20.257.887,62 | 2,25 |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,50% a.a | | 0,92 | 0,00 | 0,91 | | | 10.036.026,38 | 1,11 |
| Sub-total | 2,86 | 0,63 | 0,01 | | -0,04 | 0,85 | 30.293.914,00 | 3,36 |

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC | | 0,11 | -0,00 | 0,11 | | | 3.233.894,98 | 0,36 |
| ILLUMINATI FIDC | | 0,12 | -0,00 | 0,13 | | | 942.074,19 | 0,10 |
| INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC | | 0,18 | -0,00 | 0,18 | | | 298.539,40 | 0,03 |
| Sub-total | 1,84 | 0,10 | -0,00 | | -0,82 | -0,54 | 4.474.508,57 | 0,50 |

Artigo 7º V, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|------------|------------|
| PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | | 0,74 | -0,00 | 0,74 | | | 534.922,30 | 0,06 |
| Sub-total | 0,75 | 0,74 | -0,00 | | -1,61 | -0,25 | 534.922,30 | 0,06 |

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,56%

Artigo 8º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA DIVIDENDOS | | 5,66 | 0,02 | 1,93 | | | 4.464.328,79 | 0,50 |
| FIA CAIXA INFRAESTRUTURA | | 8,25 | 0,05 | 3,44 | | | 6.061.114,75 | 0,67 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | | 7,54 | 0,02 | 3,43 | | | 3.189.387,98 | 0,35 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | | 10,80 | 0,04 | 0,10 | | | 3.725.452,53 | 0,41 |
| FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE | | 8,00 | 0,03 | 3,24 | | | 3.519.317,63 | 0,39 |
| SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES | | 7,45 | 0,05 | 2,08 | | | 6.360.325,15 | 0,71 |
| Sub-total | 13,71 | 7,56 | 0,21 | | -0,36 | -3,94 | 27.319.926,83 | 3,03 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,68%

Artigo 9º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | | 5,80 | 0,02 | 0,61 | | | 8.560.293,91 | 0,95 |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB | | 5,99 | 0,01 | 8,37 | | | 7.919.924,20 | 0,88 |
| Sub-total | 12,24 | 5,68 | 0,03 | | 0,22 | 3,67 | 16.480.218,11 | 1,83 |

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,03%

Artigo 10º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP | | 0,06 | -0,00 | 0,08 | | | 366.716,65 | 0,04 |
| FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO | | 0,03 | -0,00 | 0,03 | | | 3.243.523,35 | 0,36 |
| Sub-total | 0,18 | 0,03 | -0,00 | | -6,40 | -0,17 | 3.610.240,00 | 0,40 |

Artigo 10º II

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-----------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| W7 FIP MULTIESTRATÉGIA | | 0,03 | -0,00 | 0,03 | | | 8.706.131,63 | 0,97 |
| BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP | | 0,01 | -0,00 | 0,05 | | | 1.118.756,71 | 0,12 |
| Sub-total | 0,48 | 0,03 | -0,00 | | -2,32 | -0,14 | 9.824.888,34 | 1,09 |

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,11%

Artigo 11º

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO | | 0,12 | -0,00 | 2,38 | | | 5.667.613,54 | 0,63 |
| ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII | | 0,03 | -0,00 | 2,36 | | | 60.183,55 | 0,01 |
| SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII | | 0,05 | -0,00 | 2,35 | | | 319.204,66 | 0,04 |
| Sub-total | 0,45 | 0,11 | -0,00 | | -1,89 | 0,12 | 6.047.001,75 | 0,67 |

(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 (%)