



LDB
EMPRESAS

OSASCO - CONSOLIDADO
FEVEREIRO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.02.2024.

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 93,11%

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	6,78	0,15	0,48	-1,11	16.897.827,83	1,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,930000%)	0,52	0,06	0,95	1,92	29.375.039,84	3,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,742000%)	0,64	0,06	1,01	2,05	44.756.358,35	5,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,200000%)	0,43	0,05	0,90	1,81	28.721.763,89	3,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,729999%)	2,89	0,06	1,01	2,05	44.081.474,28	5,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730001%)	0,60	0,06	1,01	2,05	45.271.674,08	5,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,740002%)	0,60	0,06	1,01	2,05	44.023.880,78	5,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	2,94	0,06	1,02	2,07	43.341.512,09	4,92
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2029 (12,000000%)	0,32	0,04	0,86	1,87	5.312.645,02	0,60
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,72	0,06	0,96	1,84	301.782.176,16	34,27

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	0,92	0,01	0,74	1,87	30.234.437,62	3,43	2.621.054.068,08	1,15
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,72	0,10	0,44	1,16	15.280.030,35	1,74	5.893.692.124,08	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,69	0,10	0,44	1,17	4.323.374,74	0,49	5.113.275.189,23	0,08

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

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 IMA-B 5 LP FIC FI	1,76	0,10	0,58	1,24	9.182.257,59	1,04	5.237.322.277,24	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,32	0,10	0,55	1,21	33.844.778,75	3,84	5.467.928.481,27	0,62
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,05	0,04	0,80	1,76	44.701.685,85	5,08	5.563.372.662,26	0,80
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,74	0,06	0,64	1,47	137.566.564,90	15,62		

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	0,04	0,82	1,84	124.066.337,62	14,09	16.385.434.228,67	0,76
QUELUZ	RJI	BRA1 FI RENDA FIXA	0,34	-0,04	-0,05	0,15	187.051,58	0,02	3.683.771,34	5,08
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,80	1,78	68.958.179,46	7,83	17.003.081.830,78	0,41
VERITAS	RJI	TMJ IMA-B FI RF	8,92	0,02	5,24	4,68	764.260,41	0,09	46.336.501,49	1,65
GENIAL	RJI	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	30,07	-0,02	-0,40	-20,37	589.012,84	0,07	42.316.932,55	1,39
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,76	0,10	0,56	1,22	25.367.988,18	2,88	881.949.788,17	2,88
VERITAS	RJI	FI BARCELONA RENDA FIXA	6,18	-0,63	0,81	1,12	390.639,67	0,04	26.323.427,26	1,48
GENIAL	PLANNER	FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	35,78	-0,01	-0,30	-0,48	179.261,58	0,02	6.305.734,39	2,84
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,04	0,90	1,99	103.614.409,10	11,77	10.050.564.520,10	1,03
VERITAS	RJI	MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,00	-0,54	-6,07	-11,16	21.986,20	0,00	674.100,57	3,26
RJI	RJI	TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	14,87	0,02	0,25	-9,01	805.953,68	0,09	40.135.401,50	2,01
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,18	0,05	0,82	1,75	324.945.080,32	36,90		

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	3,34	0,92	0,92	2,02	20.444.755,73	2,32		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,00% a.a	2,59	0,59	0,59	0,59	10.058.911,14	1,14		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,50% a.a	3,28	1,03	1,03	1,40	10.139.573,17	1,15		

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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 6,00% a.a	2,68	0,63	0,63	0,63	10.063.457,06	1,14		
Sub-total Artigo 7º IV			2,77	0,82	0,82	1,68	50.706.697,10	5,76		

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	1,36	-0,41	-0,41	-1,05	3.220.688,12	0,37	71.264.621,42	4,52
QUELUZ	PLANNER	ILLUMINATI FIDC	10,60	0,04	0,04	0,06	942.496,98	0,11	50.275.022,77	1,87
GENIAL	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	2,60	-1,14	-1,14	-2,26	295.134,46	0,03	6.087.298,29	4,85
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			3,29	-0,36	-0,36	-0,90	4.458.319,56	0,51		

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	1,56	-0,01	-0,32	-0,56	533.225,89	0,06	21.398.532,90	2,49
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,56	-0,01	-0,32	-0,56	533.225,89	0,06		
Renda Fixa			0,40	0,10	0,85	1,73	819.992.063,93	93,11		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

3,14%

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	13,19	-0,41	0,79	-2,78	4.499.382,54	0,51	250.644.114,14	1,80
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	16,37	-1,07	0,24	-3,47	6.075.409,07	0,69	213.007.385,66	2,85
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,03	-1,06	2,43	-1,02	3.266.887,01	0,37	1.415.343.406,48	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,41	-0,25	0,38	-6,23	3.739.661,47	0,42	665.961.173,63	0,56
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,23	-0,56	2,29	-0,50	3.599.936,28	0,41	706.828.117,04	0,51
SAFRA	SAFRA	SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	16,76	-0,72	1,64	-2,22	6.464.640,84	0,73	158.916.341,28	4,07
Sub-total Artigo 8º I			15,93	-0,70	1,19	-2,79	27.645.917,21	3,14		
Renda Variável			15,93	-0,70	1,19	-2,79	27.645.917,21	3,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,97%

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	14,40	0,95	6,27	11,12	9.096.998,58	1,03	2.238.336.630,68	0,41
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,37	0,50	4,54	7,40	8.279.283,92	0,94	697.423.955,25	1,19
Sub-total Artigo 9º III			13,53	0,74	5,44	9,31	17.376.282,50	1,97		
Investimentos no Exterior			13,53	0,74	5,44	9,31	17.376.282,50	1,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,09%

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	1,20	0,44	0,44	-0,04	368.329,09	0,04	41.596.447,79	0,89
QUELUZ	RJI	FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	1,59	-0,01	-0,06	-0,19	3.241.644,37	0,37	140.605.002,19	2,31
Sub-total Artigo 10º I			5,86	0,04	-0,01	-0,18	3.609.973,46	0,41		

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	57,84	-43,79	-43,79	-43,88	4.893.324,89	0,56	68.810.369,13	7,11
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,17	-0,04	-0,04	-0,09	1.118.257,50	0,13	27.538.232,69	4,06
Sub-total Artigo 10º II			49,32	-38,81	-38,81	-38,90	6.011.582,39	0,68		
Investimentos Estruturados			33,79	-28,38	-28,39	-28,49	9.621.555,85	1,09		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,69%

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	6,32	0,03	0,03	0,17	5.669.173,69	0,64	71.641.655,95	7,91
QUELUZ	RJI	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	0,52	-0,01	-0,01	-0,22	60.179,33	0,01	141.884.440,57	0,04
VERITAS	RJI	SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	3,01	2,48	2,48	2,31	327.120,29	0,04	65.711.247,81	0,50
Sub-total Artigo 11º			5,91	0,16	0,16	0,28	6.056.473,31	0,69		
Fundos Imobiliários			5,91	0,16	0,16	0,28	6.056.473,31	0,69		
Total			0,90	-0,34	0,49	1,25	880.692.292,80	100,00		

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	322.877,88
Sub-total Disponibilidades Financeiras	322.877,88
Total	881.015.170,68

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	301.782.176,16	34,27	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	137.566.564,90	15,62	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	324.945.080,32	36,90	0,00	20,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	50.706.697,10	5,76	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	4.458.319,56	0,51	0,00	1,00	1,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	533.225,89	0,06	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	819.992.063,93	93,11					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	27.645.917,21	3,14	0,00	2,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	27.645.917,21	3,14					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	17.376.282,50	1,97	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	17.376.282,50	1,97					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.609.973,46	0,41	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	6.011.582,39	0,68	0,00	1,00	1,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	9.621.555,85	1,09					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	6.056.473,31	0,69	0,00	1,00	1,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	6.056.473,31	0,69					5,00
Total		880.692.292,80	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	0,96 119,73	1,84 103,61	3,01 111,83	4,95 87,15	10,98 86,18	2.893.103,72	5.508.837,12
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,64 80,03	1,47 82,67	2,58 95,91	4,99 87,72	11,93 93,61	787.506,12	1.768.403,29
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,82 102,76	1,75 98,44	2,68 99,75	5,60 98,52	12,69 99,60	2.940.724,31	6.256.648,31
Artigo 7º IV % do CDI	0,82 102,34	1,68 94,29				412.783,10	667.309,92
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,36 -45,11	-0,90 -50,55	-0,29 -10,81	-2,87 -50,49	-9,11 -71,48	-16.189,01	-40.392,57
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-0,32 -39,54	-0,56 -31,79	-0,79 -29,51	-2,63 -46,30	-1,93 -15,16	-1.696,41	-3.028,94
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,19 0,20	-2,79 1,06	3,03 1,71	9,62 -1,85	24,35 1,39	325.990,38	-794.078,82
Artigo 9º III % do CDI	5,44 677,95	9,31 524,19	12,10 449,96	13,40 235,77	27,41 215,13	896.064,39	1.480.231,30
Artigo 10º I % do CDI	-0,01 -0,92	-0,18 -10,05	-0,37 -13,68	-0,97 -17,12	2,56 20,09	-266,54	-6.459,11
Artigo 10º II % do CDI	-38,81 -4.839,47	-38,90 -2.189,70	-38,98 -1.449,70	-39,22 -689,86	-39,72 -311,71	-3.813.305,95	-3.827.175,50
Artigo 11º % do CDI	0,16 19,53	0,28 15,61	0,47 17,32	-2,35 -41,29	2,82 22,17	9.471,56	17.287,48
OSASCO - CONSOLIDADO (Total)						4.434.185,67	11.027.582,48

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 150545	16.816.438,19	0,00	0,00	0,00	16.897.827,83	81.389,64	-189.347,61
NTN-B 150545 (4,930000%)	29.098.848,94	0,00	0,00	0,00	29.375.039,84	276.190,90	553.946,28
NTN-B 150555 (5,742000%)	44.309.782,89	0,00	0,00	0,00	44.756.358,35	446.575,46	899.032,42
NTN-B 150840 (4,200000%)	29.161.661,02	0,00	0,00	697.405,07	28.721.763,89	257.507,94	518.237,80

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150850 (5,729999%)	44.882.376,39	0,00	0,00	1.245.366,19	44.081.474,28	444.464,08	902.298,42
NTN-B 150850 (5,730001%)	46.094.200,55	0,00	0,00	1.278.991,08	45.271.674,08	456.464,61	926.660,48
NTN-B 150850 (5,740002%)	44.825.032,96	0,00	0,00	1.245.366,19	44.023.880,78	444.214,01	901.865,59
NTN-B 150850 (5,860000%)	44.145.782,35	0,00	0,00	1.245.366,19	43.341.512,09	441.095,93	896.142,03
NTN-F 2029 (12,000000%)	5.267.443,87	0,00	0,00	0,00	5.312.645,02	45.201,15	97.182,00
	304.601.567,16	0,00	0,00	5.712.494,72	301.782.176,16	2.893.103,72	

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	15.212.358,83	0,00	0,00	0,00	15.280.030,35	67.671,52	175.192,59
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	9.129.702,06	0,00	0,00	0,00	9.182.257,59	52.555,53	112.435,92
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	10.423.348,61	20.000.000,00	-295.913,58	0,00	30.234.437,62	107.002,59	222.050,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.304.476,88	0,00	0,00	0,00	4.323.374,74	18.897,86	50.069,97
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	33.658.058,99	0,00	0,00	0,00	33.844.778,75	186.719,76	405.769,56
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	44.347.026,99	0,00	0,00	0,00	44.701.685,85	354.658,86	802.884,45
	117.074.972,36	20.000.000,00	-295.913,58	0,00	137.566.564,90	787.506,12	

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	126.819.832,59	3.651.061,07	-62.287.930,68	0,00	68.958.179,46	775.216,48	1.784.587,50
BRA1 FI RENDA FIXA	187.145,85	0,00	0,00	0,00	187.051,58	-94,27	281,85
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	97.703.187,92	5.000.000,00	0,00	0,00	103.614.409,10	911.221,18	1.961.535,99
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	25.225.925,73	0,00	0,00	0,00	25.367.988,18	142.062,45	306.053,62
FI BARCELONA RENDA FIXA	387.509,24	0,00	0,00	0,00	390.639,67	3.130,43	4.335,44
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	128.349.541,78	6.016.004,05	-11.372.670,26	0,00	124.066.337,62	1.073.462,05	2.399.782,50
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	179.802,15	0,00	0,00	0,00	179.261,58	-540,57	-856,79
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	23.406,90	0,00	0,00	0,00	21.986,20	-1.420,70	-2.762,35
TMJ IMA-B FI RF	726.199,12	0,00	0,00	0,00	764.260,41	38.061,29	34.182,56
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	803.957,70	0,00	0,00	0,00	805.953,68	1.995,98	-79.797,99

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	591.382,85	0,00	0,00	0,00	589.012,84	-2.370,01	-150.694,02
	380.997.891,83	14.667.065,12	-73.660.600,94	0,00	324.945.080,32	2.940.724,31	

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 6,00% a.a	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	10.058.911,14	58.911,14	58.911,14
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,50% a.a	10.036.026,38	0,00	0,00	0,00	10.139.573,17	103.546,79	139.573,17
LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 5,95% a.a	20.257.887,62	0,00	0,00	0,00	20.444.755,73	186.868,11	405.368,55
LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	10.063.457,06	63.457,06	63.457,06
	30.293.914,00	20.000.000,00	0,00	0,00	50.706.697,10	412.783,10	

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	942.074,19	0,00	0,00	0,00	942.496,98	422,79	569,06
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	298.539,40	0,00	0,00	0,00	295.134,46	-3.404,94	-6.809,55
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	3.233.894,98	0,00	0,00	0,00	3.220.688,12	-13.206,86	-34.152,08
	4.474.508,57	0,00	0,00	0,00	4.458.319,56	-16.189,01	

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	534.922,30	0,00	0,00	0,00	533.225,89	-1.696,41	-3.028,94
	534.922,30	0,00	0,00	0,00	533.225,89	-1.696,41	

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	3.189.387,98	0,00	0,00	0,00	3.266.887,01	77.499,03	-33.684,69
FIA CAIXA DIVIDENDOS	4.464.328,79	0,00	0,00	0,00	4.499.382,54	35.053,75	-128.657,65
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	6.061.114,75	0,00	0,00	0,00	6.075.409,07	14.294,32	-218.544,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3.725.452,53	0,00	0,00	0,00	3.739.661,47	14.208,94	-248.573,45
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	3.519.317,63	0,00	0,00	0,00	3.599.936,28	80.618,65	-18.174,93
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	6.360.325,15	0,00	0,00	0,00	6.464.640,84	104.315,69	-146.443,25
	27.319.926,83	0,00	0,00	0,00	27.645.917,21	325.990,38	

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	8.560.293,91	0,00	0,00	0,00	9.096.998,58	536.704,67	910.096,22
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	7.919.924,20	0,00	0,00	0,00	8.279.283,92	359.359,72	570.135,08
	16.480.218,11	0,00	0,00	0,00	17.376.282,50	896.064,39	

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	3.243.523,35	0,00	0,00	0,00	3.241.644,37	-1.878,98	-6.298,87
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	366.716,65	0,00	0,00	0,00	368.329,09	1.612,44	-160,24
	3.610.240,00	0,00	0,00	0,00	3.609.973,46	-266,54	

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	1.118.756,71	0,00	0,00	0,00	1.118.257,50	-499,21	-1.010,66
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	8.706.131,63	0,00	0,00	0,00	4.893.324,89	-3.812.806,74	-3.826.164,84
	9.824.888,34	0,00	0,00	0,00	6.011.582,39	-3.813.305,95	

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	5.667.613,54	0,00	0,00	0,00	0,00	5.669.173,69	1.560,15	10.023,75
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	319.204,66	0,00	0,00	0,00	0,00	327.120,29	7.915,63	7.398,40
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	60.183,55	0,00	0,00	0,00	0,00	60.179,33	-4,22	-134,67

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	6.047.001,75	0,00	0,00	0,00	0,00	6.056.473,31	9.471,56	

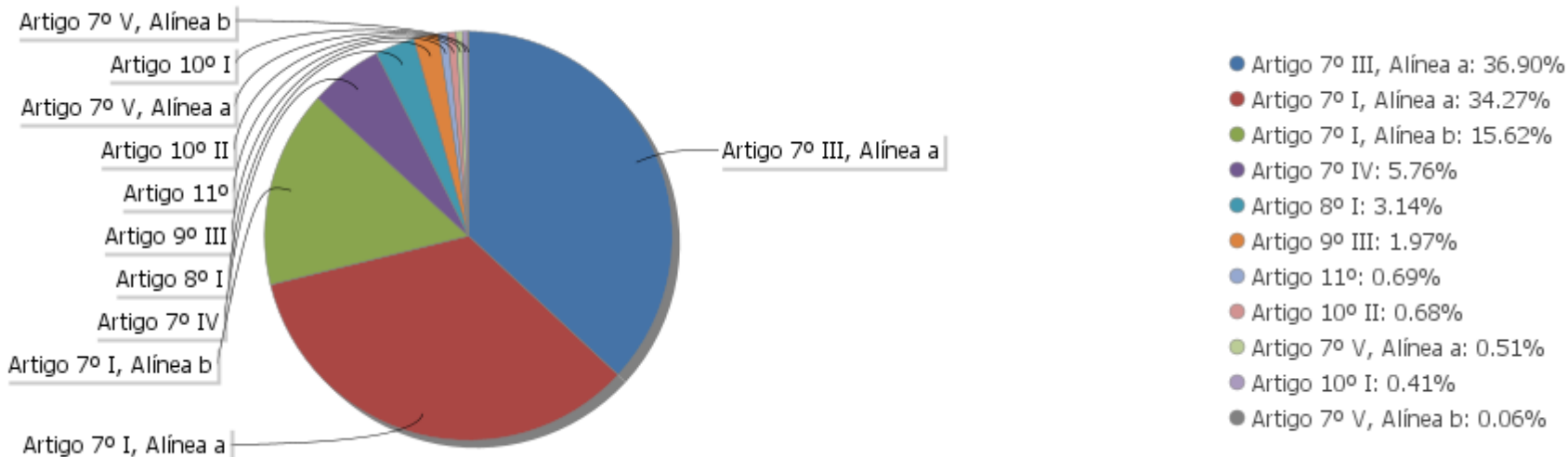
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

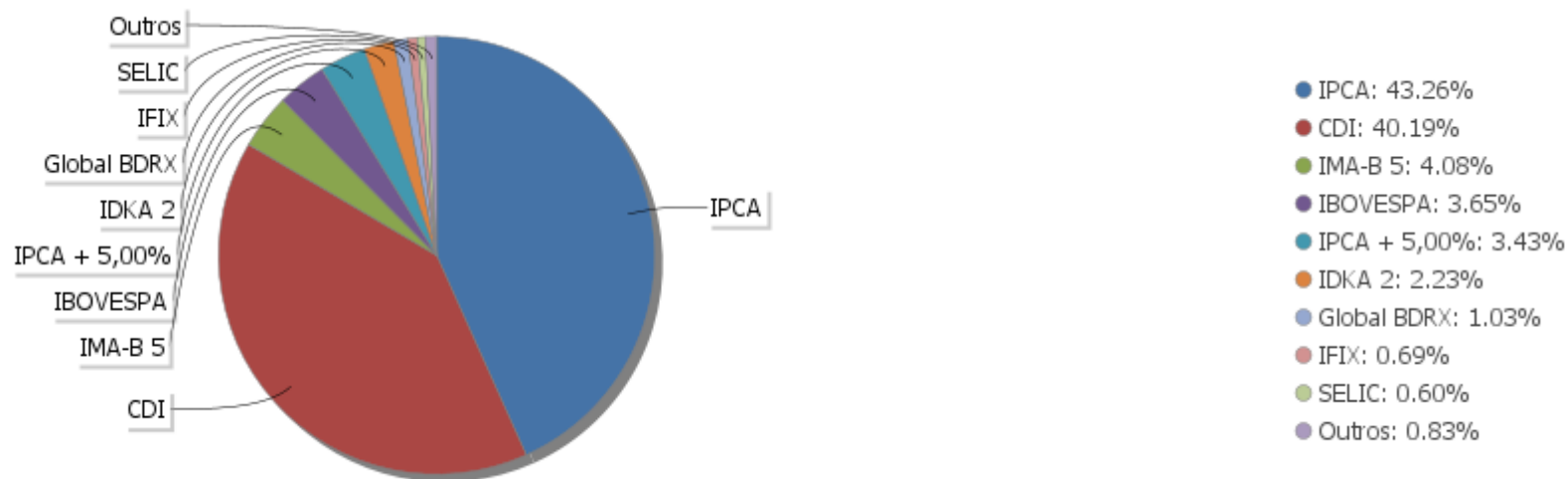
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	486.618.053,29	55,25		486.618.053,29	55,25	
de 31 dias a 365 dias	33.561.503,96	3,81		520.179.557,25	59,06	
acima de 365 dias	360.512.735,55	40,94		880.692.292,80	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

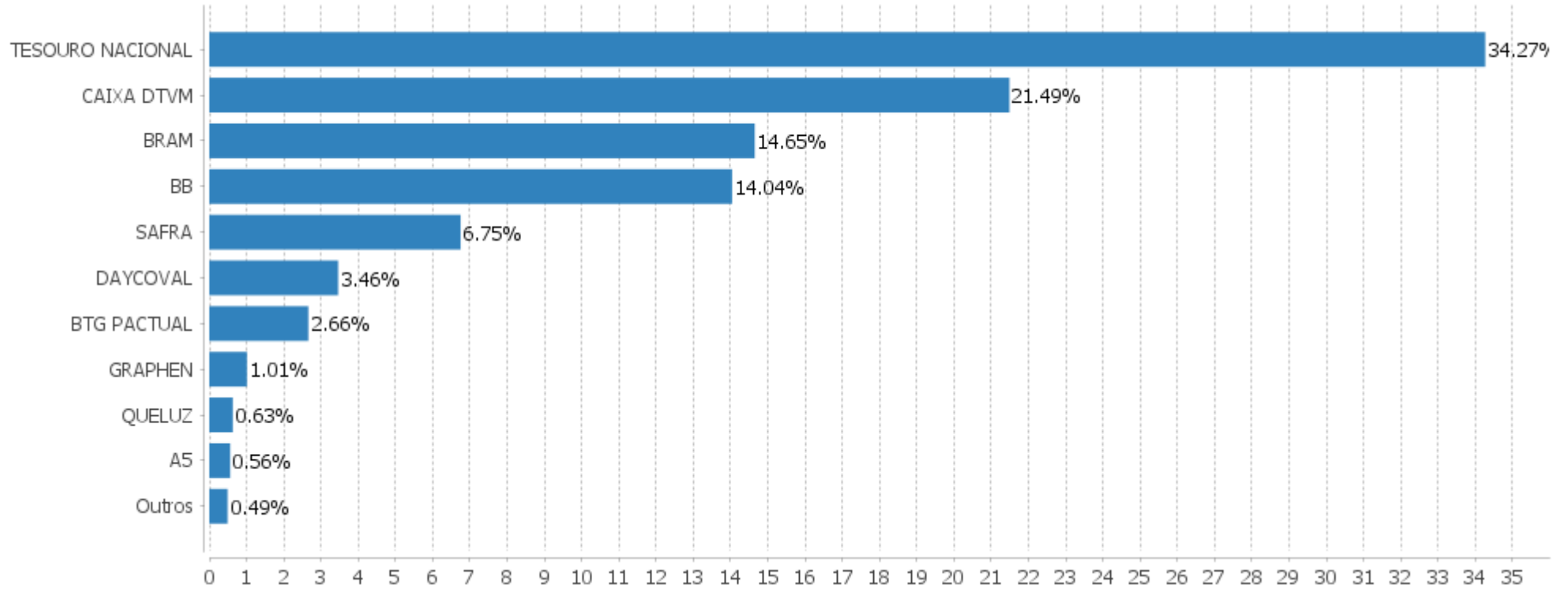


Alocação Por Estratégia



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	0,49											1,25
IPCA + 5,00%	0,85	1,20											2,06
p.p. indexador	-0,09	-0,71											-0,82
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

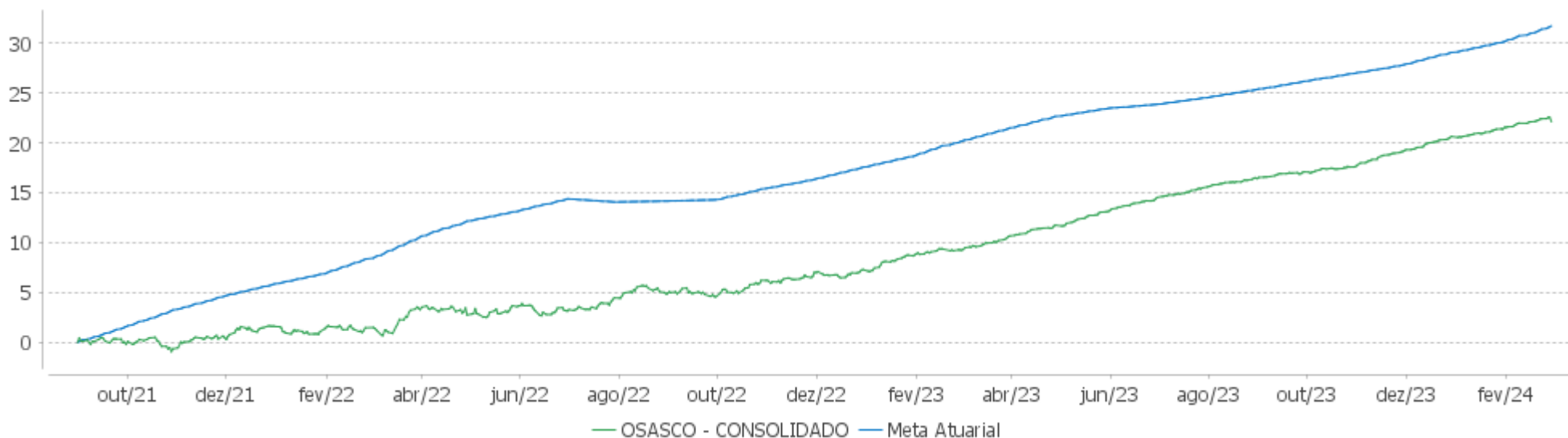
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	13	43,33	03 meses	2,45	3,03	-0,58	1,03
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	56,67	06 meses	4,92	5,07	-0,15	0,95
			12 meses	11,79	9,68	2,11	0,90
			24 meses	20,40	21,54	-1,14	2,11
Maior rentabilidade da Carteira	1,80	2022-03	Desde 31/08/2021	22,14	31,85	-9,71	2,31
Menor rentabilidade da Carteira	-0,53	2022-04					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

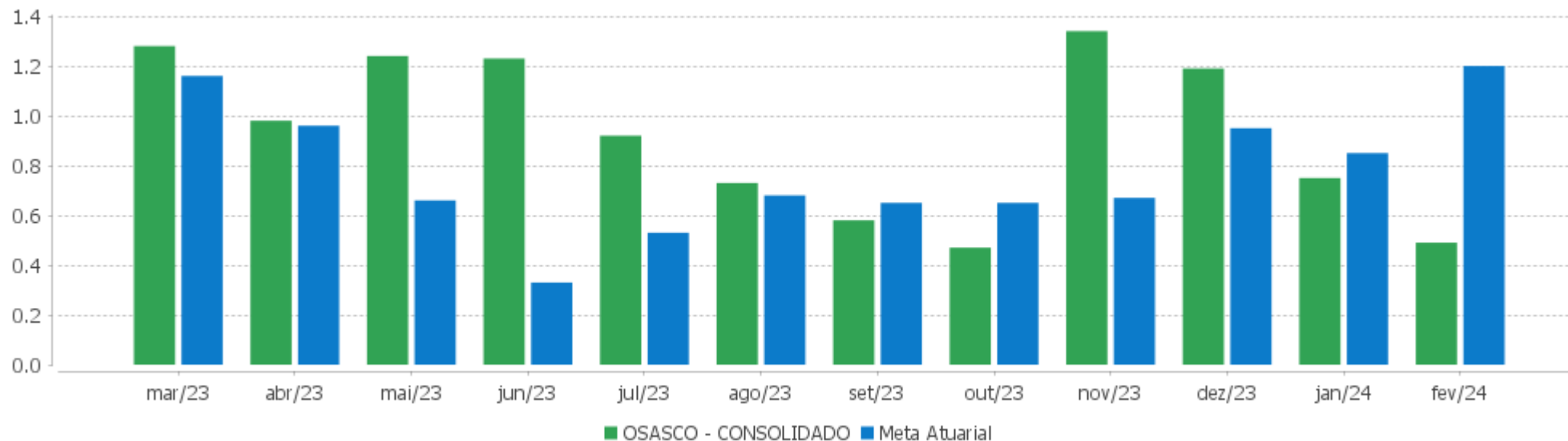


Patrimônio Líquido



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.	0,92 0,09	2,02 0,77					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,59 0,02	0,59 0,02					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,50% a.a Var. IPCA p.p.	1,03 0,20	1,40 0,41					
LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,63 0,02	0,63 0,02					
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO % do CDI	-0,32 -39,54	-0,56 -31,79	-0,79 -29,51	-2,63 -46,30	-1,93 -15,16	-59,35 -216,63	-62,56 -180,86
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	0,48 -0,35	-1,11 -2,36	2,75 0,93	3,47 0,85	20,50 16,00	24,34 13,99	17,41 -4,57
NTN-B 150555 (5,742000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,05 0,80	3,13 1,31	5,30 2,68	10,81 6,31	20,34 10,00	33,05 11,07
NTN-B 150545 (4,930000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,12	1,92 0,67	2,87 1,05	4,84 2,23	9,90 5,40	21,81 11,46	37,79 15,81
NTN-F 2029 (12,000000%) Var. SELIC p.p.	0,86 0,06	1,87 0,09	2,93 0,24	5,79 0,11	12,06 -0,68	25,45 -1,94	33,40 -1,19
NTN-B 150850 (5,729999%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,05 0,79	3,11 1,29	5,28 2,66	7,71 3,22		
NTN-B 150840 (4,200000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,07	1,81 0,55	2,65 0,83	4,44 1,82	9,09 4,59	20,07 9,73	35,10 13,12
NTN-B 150850 (5,730001%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,05 0,79	3,11 1,29	5,28 2,66	10,78 6,28	23,72 13,37	36,76 14,78
NTN-B 150850 (5,740002%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,05 0,80	3,11 1,29	5,28 2,66	10,79 6,29	23,74 13,40	36,79 14,81
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,81	3,14 1,32	5,34 2,72	7,80 3,30		
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,44 0,02	1,16 -0,07	2,59 -0,11	4,30 -0,16	9,78 -0,33	22,13 -0,38	29,78 -0,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,55 -0,28	1,21 -0,04	2,44 0,62	4,59 1,98	12,70 8,20	25,41 15,07	27,74 5,76
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,44	1,17	2,59	4,43	9,98	22,02	29,71

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IDKA 2 p.p.	0,02	-0,06	-0,11	-0,03	-0,13	-0,48	-1,01
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,02	1,24 -0,04	2,70 -0,05	4,31 -0,11	10,24 -0,20	22,71 -0,50	30,07 -0,93
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,74 -0,46	1,87 -0,19	2,82 -0,22	5,24 0,17			
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	0,80 99,72	1,76 98,97	2,66 98,80	5,60 98,44	12,55 98,48	27,01 98,57	34,20 98,86
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,41 -50,92	-1,05 -59,07	-1,49 -55,27	-2,70 -47,42	-4,53 -35,55	-2,00 -7,29	0,73 2,11
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC % do CDI	-1,14 -142,21	-2,26 -126,95	-3,35 -124,69	-4,99 -87,86	-8,18 -64,23	-13,19 -48,15	-29,10 -84,12
ILLUMINATI FIDC Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,04 -1,23	0,06 -2,16	4,31 1,05	-2,64 -8,19	-19,52 -30,23	-29,87 -53,76	-30,83 -76,04
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,07 -6,62	-11,16 -11,26	-15,75 -18,60	-26,88 -30,75	-40,93 -55,63	-53,91 -77,72	-70,09 -95,04
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,30 -0,85	-0,48 -0,57	47,64 44,79	5,82 1,96	6,39 -8,30	12,39 -11,42	13,84 -11,10
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,56 -0,03	1,22 -0,05	2,68 -0,08	4,26 -0,16	10,16 -0,28	22,36 -0,85	29,31 -1,69
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,90 111,72	1,99 112,16	2,95 109,68	6,17 108,45	13,60 106,72	28,88 105,41	36,98 106,89
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 100,14	1,78 100,07	2,70 100,27	5,67 99,81	12,75 100,03	27,44 100,14	35,09 101,45
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,40 -0,99	-20,37 -21,65	-35,02 -37,77	-35,38 -39,81	-36,15 -46,59	-34,85 -58,06	-48,49 -79,49
FI BARCELONA RENDA FIXA % do CDI	0,81 100,73	1,12 63,18	1,31 48,55	1,94 34,15	10,77 84,54	-43,81 -159,93	-41,57 -120,18
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,82 102,83	1,84 103,36	2,78 103,30	5,90 103,82	13,25 103,95	27,96 102,05	35,67 103,12
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,25 -0,35	-9,01 -10,28	-17,74 -20,50	-17,44 -21,86	-12,72 -23,16	-8,74 -31,95	-9,01 -40,01
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,05 -0,60	0,15 0,05	0,31 -2,54	0,72 -3,15	4,03 -10,67	11,86 -11,95	11,98 -12,97
TMJ IMA-B FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,24 4,69	4,68 4,58	5,90 3,05	1,87 -1,99	5,19 -9,50	5,48 -18,32	-8,18 -33,12
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	2,43	-1,02	3,76	12,36	16,89	6,29	-23,05

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

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.	1,44	2,83	2,43	0,89	-6,07	-7,75	-40,30
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	2,29	-0,50	6,12	13,69	30,84	29,10	42,83
Var. IBOVESPA p.p.	1,30	3,35	4,79	2,22	7,89	15,06	25,58
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	0,24	-3,47	1,09	9,05	31,48	28,06	35,05
Var. IBOVESPA p.p.	-0,76	0,38	-0,23	-2,42	8,53	14,02	17,80
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	0,38	-6,23	0,26	1,15	18,13	-6,20	-19,00
Var. SMALL CAP p.p.	-0,09	-0,12	-0,24	-0,55	-1,27	-1,46	-1,58
FIA CAIXA DIVIDENDOS	0,79	-2,78	3,74	12,32	24,33	29,35	39,45
Var. IBOVESPA p.p.	-0,21	1,07	2,41	0,85	1,38	15,32	22,19
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	1,64	-2,22	4,02	10,11	22,41	5,73	-8,24
Var. IBOVESPA p.p.	0,65	1,63	2,69	-1,36	-0,54	-8,31	-25,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6,27	11,12	13,99	15,34	32,07	18,33	18,18
Var. Global BDRX p.p.	-0,03	-0,26	-0,55	-0,54	-1,21	-2,16	-4,51
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4,54	7,40	10,09	11,35	22,66	7,22	8,44
Var. IBOVESPA p.p.	3,55	11,24	8,76	-0,12	-0,30	-6,81	-8,82
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	-0,06	-0,19	-0,39	-0,98	-3,11	-17,68	-21,87
% do CDI	-7,22	-10,92	-14,54	-17,23	-24,40	-64,55	-63,22
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	0,44	-0,04	-0,16	-0,92	-2,48	10,13	-24,09
Var. IPCA + 7,00% p.p.	-0,91	-2,42	-3,67	-6,95	-14,23	-16,10	-73,43
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-43,79	-43,88	-43,96	-44,20	-44,69	-49,33	-50,08
% do CDI	-5.460,64	-2.470,13	-1.634,96	-777,42	-350,75	-180,06	-144,78
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	-0,04	-0,09	-0,14	-0,30	-0,59	-1,22	-2,37
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,32	-2,31	-3,41	-5,85	-11,30	-25,12	-47,58
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	2,48	2,31	2,13	1,38	0,67	4,91	1,31
Var. IFIX p.p.	1,69	0,85	-3,64	-3,20	-18,97	-17,66	-15,10
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	0,03	0,17	0,38	-2,58	3,00	7,48	9,39
Var. IFIX p.p.	-0,77	-1,30	-5,40	-7,16	-16,64	-15,10	-7,01
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	-0,01	-0,22	-0,33	-0,75	-1,71	13,28	-35,15
Var. IFIX p.p.	-0,80	-1,69	-6,10	-5,33	-21,35	-9,30	-51,55
OSASCO - CONSOLIDADO	0,49	1,25	2,45	4,92	11,79	20,40	
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,71	-0,82	-0,58	-0,15	2,11	-1,19	
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21

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: 29/02/2024

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	0,76	1,61	2,53	5,52	12,71	27,14	32,56	36,64	45,55
IRF-M 1+	0,34	0,94	2,69	5,87	17,85	28,53	26,35	29,91	48,38
IRF-M TOTAL	0,46	1,13	2,63	5,74	15,85	27,58	28,20	32,06	47,72
IMA-B 5	0,59	1,28	2,76	4,42	10,44	23,21	31,00	39,16	56,09
IMA-B 5+	0,51	-0,96	2,94	3,37	18,26	24,00	18,75	19,88	46,30
IMA-B TOTAL	0,55	0,10	2,85	3,87	14,70	23,81	24,95	28,90	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,64	1,11	2,75	5,15	14,09	26,08	29,72	34,01	49,13
IDKA 2	0,42	1,23	2,70	4,46	10,12	22,51	30,72	39,80	55,45
IDKA 20	0,22	-3,13	3,25	3,06	28,07	25,16	9,21	7,12	36,25
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59	37,78	45,48

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25	23,85	34,98
IBRX 100	0,96	-3,59	1,70	11,76	22,23	12,17	15,38	23,37	37,13
IBRX 50	0,91	-3,27	1,87	12,03	21,50	12,09	17,44	26,99	35,38
SMALL CAP	0,47	-6,11	0,51	1,70	19,40	-4,74	-17,42	-15,61	14,52
Índice Consumo - ICON	0,09	-8,26	-2,77	-1,10	5,65	-26,51	-42,10	-41,50	-21,16
Índice Dividendos - IDIV	0,91	-2,64	4,09	13,07	26,16	32,52	44,70	39,59	69,79

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	5,80	9,98	12,65	14,47	22,83	12,70	20,50	91,09	143,96

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,79	1,47	5,77	4,58	19,64	22,58	16,40	13,37	38,01

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,79	7,79	10,70	12,33	15,81	5,67	4,39	64,46	101,55

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,83	1,25	1,82	2,62	4,50	10,34	21,98	28,32	33,45
INPC	0,81	1,38	1,94	2,28	3,86	9,54	21,37	28,92	33,97
IGPM	-0,52	-0,45	0,29	1,76	-3,76	-1,97	13,83	46,78	56,79
SELIC	0,80	1,78	2,69	5,68	12,74	27,39	34,59	37,78	45,47

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,13	1,90	2,79	4,58	8,64	19,29	37,17	49,99	62,22
IPCA + 5,00%	1,20	2,06	3,03	5,07	9,68	21,58	41,15	55,82	70,13
IPCA + 5,50%	1,24	2,14	3,15	5,31	10,20	22,74	43,17	58,79	74,20
IPCA + 5,89%	1,27	2,20	3,24	5,50	10,60	23,64	44,76	61,14	77,43
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21	61,81	78,34
INPC + 4,00%	1,11	2,03	2,91	4,24	7,98	18,43	36,48	50,70	62,84
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49	62,57	79,03

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%)	29.375.039,84	4,930000	26.680.780,82	5,743100	-2.694.259,02
NTN-B 150555 (5,742000%)	44.756.358,35	5,742000	44.773.653,31	5,739200	17.294,96
NTN-B 150840 (4,200000%)	28.721.763,89	4,200000	24.577.809,91	5,685800	-4.143.953,98
NTN-B 150850 (5,729999%)	44.081.474,28	5,729999	43.995.126,33	5,745000	-86.347,95
NTN-B 150850 (5,730001%)	45.271.674,08	5,730001	45.182.994,74	5,745000	-88.679,34
NTN-B 150850 (5,740002%)	44.023.880,78	5,740002	43.995.126,33	5,745000	-28.754,45
NTN-B 150850 (5,860000%)	43.341.512,09	5,860000	43.995.126,33	5,745000	653.614,24
NTN-F 2029 (12,000000%)	5.312.645,02	12,000000	5.603.604,40	10,467500	290.959,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4170	01/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	54.040,40	17.465,39192100	3,0941418460
4171	02/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	169.740,76	0,00	54.836,50495400	3,0953971290
4172	02/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	245.324,70	0,00	79.254,67711449	3,0953971290
4173	05/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	120.973,57	39.065,98003600	3,0966475150
4174	05/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.277.970,27	0,00	735.624,65826800	3,0966475150
4175	05/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	48.073,32	0,00	15.524,31129702	3,0966475150
4176	06/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000.000,00	1.613.953,84832700	3,0979820180
4177	06/02/2024	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.000.000,00	0,00	298.272,23000000	16,7632099000
4178	07/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000.000,00	3.226.540,39900300	3,0992948370
4179	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	303.509,35	0,00	60.043,19613800	5,0548500000
4180	07/02/2024	LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a	10.000.000,00	0,00	200,00000000	50.000,0000000000
4181	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	412.447,62	133.023,29776127	3,1005667950
4182	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.095.125,89	353.201,83773000	3,1005667950
4183	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000.000,00	3.225.216,76234300	3,1005667950
4184	08/02/2024	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,00% a.a	10.000.000,00	0,00	200,00000000	50.000,0000000000
4185	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.661.833,41	3.116.150,70689035	3,1005667950
4186	15/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	193.844,45	62.441,38404942	3,1044226990
4187	15/02/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,00	295.913,58	274.592,09884100	1,0776478320
4188	16/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	43.149,40	13.893,56947876	3,1057101680
4189	16/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	295.913,58	0,00	95.280,48787300	3,1057101680
4190	16/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.712.494,70	0,00	1.127.774,71334200	5,0652800000
4191	20/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	359.176,14	0,00	115.550,47092274	3,1083918320
4192	21/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	90.816,54	29.204,36840253	3,1096902610
4193	21/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000.000,00	6.431.508,71031400	3,1096902610
4194	21/02/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	20.000.000,00	0,00	18.529.706,06875700	1,0793479360
4195	22/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	179.380,95	0,00	57.660,23801100	3,1109991250
4196	22/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	137.735,55	44.273,73472823	3,1109991250
4197	27/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.514.072,69	486.064,74199500	3,1149609490

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4198	27/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	73.065,96	23.456,46099463	3,1149609490
4199	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.572.670,26	2.080.828,78627400	5,0809900000
4200	27/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	281.945,21	90.513,24065300	3,1149609490
4201	28/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	204.332,72	65.569,61361200	3,1162715280
4202	28/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.250.000,00	1.042.912,97173500	3,1162715280
4203	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	800.000,00	157.379,35050600	5,0832590000
4204	28/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	154.547,27	49.593,64696285	3,1162715280
4205	29/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	61.592,06	0,00	19.755,96137615	3,1176442810
4206	29/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.889,29	0,00	4.455,05925200	3,1176442810
Total			54.667.065,12	73.956.514,52		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 2.938.689,33 Value-At-Risk: 0,33%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,70	0,16		0,11	0,05	0,84	819.992.063,93	93,11
Artigo 8º	13,86	7,08		0,20	0,03	1,19	27.645.917,21	3,14
Artigo 9º	15,40	5,56		0,03	0,30	5,44	17.376.282,50	1,97
Artigo 10º	111,86	1,36		-0,00	-0,22	-24,25	9.621.555,85	1,09
Artigo 11º	0,57	0,03		0,00	-1,13	0,16	6.056.473,31	0,69
OSASCO - CONSOLIDADO		0,33		0,33			880.692.292,80	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,16%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545	2,82	2,65	0,04	2,65	-0,11	0,48	16.897.827,83	1,92
NTN-B 150545 (4,930000%)	1,03	0,11	0,00	0,13	0,14	0,95	29.375.039,84	3,34
NTN-B 150555 (5,742000%)	1,35	0,11	0,00	0,14	0,15	1,01	44.756.358,35	5,08
NTN-B 150840 (4,200000%)	0,78	0,11	0,00	0,13	0,12	0,90	28.721.763,89	3,26
NTN-B 150850 (5,729999%)	1,26	0,11	0,00	0,14	0,16	1,01	44.081.474,28	5,01
NTN-B 150850 (5,730001%)	1,26	0,11	0,00	0,14	0,16	1,01	45.271.674,08	5,14
NTN-B 150850 (5,740002%)	1,26	0,11	0,00	0,14	0,16	1,01	44.023.880,78	5,00
NTN-B 150850 (5,860000%)	1,28	0,11	0,00	0,14	0,17	1,02	43.341.512,09	4,92
NTN-F 2029 (12,000000%)	0,77	0,01	0,00	0,01	0,07	0,86	5.312.645,02	0,60
Sub-total	1,08	0,18	0,04		0,15	0,96	301.782.176,16	34,27

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,53	0,37	0,00	0,38	-0,11	0,74	30.234.437,62	3,43
BB PREV RF IDKA2	1,01	0,74	0,01	0,10	-0,35	0,44	15.280.030,35	1,74

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,01	0,71	0,00	0,10	-0,36	0,44	4.323.374,74	0,49
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,86	0,95	0,01	0,01	-0,26	0,58	9.182.257,59	1,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,88	0,61	0,02	0,63	-0,28	0,55	33.844.778,75	3,84
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,01	0,01	0,00	0,01	-0,18	0,80	44.701.685,85	5,08
Sub-total	0,43	0,35	0,04		-0,38	0,64	137.566.564,90	15,62

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	0,04	0,02	0,00	0,01	0,52	0,82	124.066.337,62	14,09
BRA1 FI RENDA FIXA	0,20	0,16	-0,00	1,82	-4,24	-0,05	187.051,58	0,02
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	0,00	0,01	0,07	0,80	68.958.179,46	7,83
TMJ IMA-B FI RF	10,94	2,84	0,00	3,19	0,41	5,24	764.260,41	0,09
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,20	2,04	0,00	2,31	-5,95	-0,40	589.012,84	0,07
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,89	0,94	0,02	0,02	-0,27	0,56	25.367.988,18	2,88
FI BARCELONA RENDA FIXA	3,78	0,37	-0,00	0,37	0,00	0,81	390.639,67	0,04
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	0,03	0,55	0,00	1,86	-42,15	-0,30	179.261,58	0,02
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,06	0,00	0,06	0,86	0,90	103.614.409,10	11,77
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,95	0,31	-0,00	1,85	-7,25	-6,07	21.986,20	0,00
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,22	1,00	0,00	1,43	-2,48	0,25	805.953,68	0,09
Sub-total	0,09	0,08	0,02		0,25	0,82	324.945.080,32	36,90

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	3,34	0,54	0,00	0,55	0,04	0,92	20.444.755,73	2,32
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,00% a.a	2,59	0,99	0,00	0,99	0,02	0,59	10.058.911,14	1,14
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,50% a.a	3,74	0,99	0,00	1,00	0,06	1,03	10.139.573,17	1,15
LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a	2,68	0,94	0,00	0,94	0,02	0,63	10.063.457,06	1,14
Sub-total	2,98	0,68	0,00		0,01	0,82	50.706.697,10	5,76

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

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	1,49	0,10	-0,00	0,10	-0,81	-0,41	3.220.688,12	0,37
ILLUMINATI FIDC	0,16	0,09	0,00	0,13	-4,63	0,04	942.496,98	0,11
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	4,18	0,20	-0,00	0,20	-0,46	-1,14	295.134,46	0,03
Sub-total	1,32	0,09	-0,00		-0,88	-0,36	4.458.319,56	0,51

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	0,16	0,74	-0,00	0,75	-7,11	-0,32	533.225,89	0,06
Sub-total	0,16	0,74	-0,00		-7,11	-0,32	533.225,89	0,06

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,08%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS	12,61	5,81	0,02	2,38	-0,00	0,79	4.499.382,54	0,51
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	15,21	8,10	0,05	3,56	-0,04	0,24	6.075.409,07	0,69
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	13,02	7,01	0,02	3,97	0,13	2,43	3.266.887,01	0,37
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	17,97	9,96	0,04	0,13	-0,02	0,38	3.739.661,47	0,42
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	14,54	7,37	0,03	3,19	0,10	2,29	3.599.936,28	0,41
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	15,43	6,70	0,04	1,90	0,05	1,64	6.464.640,84	0,73
Sub-total	13,86	7,08	0,20		0,03	1,19	27.645.917,21	3,14

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,56%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,21	5,75	0,02	0,48	0,30	6,27	9.096.998,58	1,03
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	12,78	5,77	0,01	9,22	0,29	4,54	8.279.283,92	0,94
Sub-total	15,40	5,56	0,03		0,30	5,44	17.376.282,50	1,97

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,36%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	1,60	0,03	-0,00	0,09	-0,23	0,44	368.329,09	0,04
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	0,17	0,03	-0,00	0,04	-4,97	-0,06	3.241.644,37	0,37
Sub-total	0,21	0,03	-0,00		-3,88	-0,01	3.609.973,46	0,41

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	209,83	2,67	-0,00	2,66	-0,21	-43,79	4.893.324,89	0,56
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,16	0,01	-0,00	0,09	-5,21	-0,04	1.118.257,50	0,13
Sub-total	178,90	2,17	-0,00		-0,22	-38,81	6.011.582,39	0,68

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,03%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	0,10	0,03	0,00	1,87	-7,73	0,03	5.669.173,69	0,64
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	0,03	0,03	-0,00	1,87	-31,65	-0,01	60.179,33	0,01
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	8,92	0,08	-0,00	1,85	0,19	2,48	327.120,29	0,04
Sub-total	0,57	0,03	0,00		-1,13	0,16	6.056.473,31	0,69

(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 (%)