



LDB
CONSULTORIA

RELATÓRIO MACROECONÔMICO

JULHO/2024

[Handwritten signatures and initials]

Prezados(as) Senhores(as),

Este documento tem por objetivo apresentar as principais informações macroeconômicas para o mês de julho de 2024, na intenção de ajudá-los na tomada de decisão e acompanhamento da carteira de investimentos.

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.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o último dia útil do mês de referência, sendo disponibilizado em 10.07.2024.

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.

[Handwritten signatures and initials in blue ink]

“Motivação é aquilo que te faz começar. Hábito é aquilo que te faz continuar.”

-Jim Ryun-

1. COMENTÁRIO DO MÊS:

MERCADOS INTERNACIONAIS

Em junho, observamos uma acomodação dos dados de inflação e atividade nos EUA. No entanto, o FED manteve cautela quanto à evolução das taxas de juros no país. Além disso, uma série de eventos políticos impactou o mercado. As bolsas globais subiram, os juros futuros diminuíram e o dólar se valorizou em relação às outras moedas.

Nos EUA, a inflação ao consumidor tem avançado de maneira favorável, com variações abaixo do esperado e uma composição benigna entre os diferentes grupos. Além disso, a atividade econômica tem mostrado uma moderação gradual, o que é positivo considerando a dinâmica inflacionária. A combinação de uma atividade econômica moderada e maior confiança na desinflação torna mais provável o cenário de corte nas taxas de juros no segundo semestre.

Ainda nos EUA, o FED mantém um tom mais cauteloso em relação à trajetória dos juros. Nas previsões dos diretores sobre a taxa básica de juros, avaliam que os cortes de juros provavelmente serão adiados para os próximos anos, devido à resiliência da inflação e da atividade econômica observada ao longo deste segundo trimestre.

Com relação aos eventos políticos mencionados. Na França, a decisão inesperada de convocar novas eleições parlamentares gerou aversão ao risco na Europa. Movimentos populistas de esquerda e direita devem dominar a nova assembleia, dificultando a redução do déficit fiscal e aumentando o risco de deterioração das relações entre a França e a União Europeia.

Nos EUA, o desempenho do presidente no primeiro debate eleitoral gerou discussões sobre sua substituição na corrida presidencial. Sem um substituto claro e com a resistência à renúncia, a perspectiva de conflito interno entre os democratas aumenta a chance de vitória do Trump.

Assim, no mês de junho de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +2,10% e +3,47%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos de +17,45% e +22,70%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +8,28% e +9,73%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +35,48% e +41,53% nos últimos 12 meses.

BRASIL

Localmente, mesmo com o bom comportamento dos juros americanos, houve o aumento da incerteza em relação à condução da política fiscal, assim, gerando impacto negativo o mercado de renda fixa, com alta substancial das curvas de juros.

A resistência do governo em implementar reformas para cortar gastos mantém dúvidas sobre a viabilidade da meta de resultado primário e do atual arcabouço fiscal. Declarações do presidente aumentaram essas preocupações, levando à depreciação do Real e dificultando a política monetária. Com a crescente desconfiança sobre o compromisso do governo em equilibrar as contas e as pressões fiscais sobre a política monetária, a curva de juros subiu em junho.

As expectativas de inflação continuam a preocupar devido à tendência de alta nas projeções. As leituras do IPCA, por sua vez, trazem sinais benignos, ainda que a inflação de serviços prossiga acima do desejado pelo Copom. Por fim, a atividade econômica mantém uma trajetória sólida, sem sinais claros que justifiquem a queda de juros.

Neste contexto, o Copom interrompeu o ciclo de afrouxamento monetário e manteve a taxa Selic estável em 10,50% ao ano. Além disso, reforçou em sua ata a mensagem de preocupação em relação à crescente desancoragem das expectativas de inflação.

Aqui, somente a título de exemplo da “Estrutura a Termo das Taxas de Juros - ETTJ” para o IPCA, estimada e divulgada pela ANBIMA para o fechamento de 05.07.2024, e apresentada no item 3 deste relatório como “Taxa de Juros Real”, a taxa de juros real com vencimento para 10 anos apresentava taxa de retorno estimada em 6,29% a.a., continuando acima da taxa máxima pré-fixada de 5,10% limitada pela SPREV para o ano de 2024.

O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo na mesma direção observada nos índices globais. Apresentando a performance de +1,48% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -7,66% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +4,93%.

Mediante a todo esse cenário exposto acima e em linha com o último relatório disponibilizado, tentando elucidar muitos questionamentos recebidos acerca dos prêmios trazidos pelas NTN-Bs atualmente, a estratégia de compra direta de NTN-Bs, respaldada por um estudo de ALM, pode auxiliar na “ancoragem de rentabilidade” ainda acima da meta atuarial dos RPPS. Tal estratégia, em especial para carregamento até o vencimento, pode contribuir proporcionalmente para a redução da volatilidade global da carteira de investimentos do RPPS, devido ao benefício da “marcação na curva” do preço desse ativo.

2. EXPECTATIVAS DE MERCADO

2.1. BOLETIM FOCUS

Mediana - Agregado	2024							2025						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***
IPCA (variação %)	3,90	4,00	4,02	▲ (9)	153	4,04	48	3,78	3,87	3,88	▲ (10)	148	3,90	47
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,09	2,09	2,10	▲ (1)	115	2,16	28	2,00	1,98	1,97	▼ (2)	107	2,00	26
Câmbio (R\$/US\$)	5,05	5,20	5,20	= (1)	122	5,27	36	5,09	5,19	5,20	▲ (5)	116	5,19	35
Selic (% a.a)	10,25	10,50	10,50	= (3)	148	10,50	41	9,25	9,50	9,50	= (3)	145	9,50	40
IGP-M (variação %)	2,96	3,39	3,40	▲ (10)	77	3,46	21	3,80	3,90	3,90	= (1)	68	3,90	20
IPCA Administrados (variação %)	4,00	3,98	3,96	▼ (1)	97	3,94	32	3,85	3,90	3,90	= (1)	89	3,81	29
Conta corrente (US\$ bilhões)	-33,55	-39,90	-39,90	= (1)	25	-34,50	5	-41,00	-43,55	-43,60	▼ (2)	25	-43,50	5
Balança comercial (US\$ bilhões)	82,51	81,55	82,00	▲ (1)	25	82,87	7	78,00	76,02	76,02	= (1)	21	80,00	5
Investimento direto no país (US\$ bilhões)	70,00	70,00	70,00	= (7)	23	69,50	6	72,50	74,00	74,00	= (1)	23	74,00	6
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	63,65	63,70	63,85	▲ (2)	26	63,85	10	66,50	66,40	66,40	= (1)	25	66,00	10
Resultado primário (% do PIB)	-0,70	-0,70	-0,70	= (2)	46	-0,70	13	-0,67	-0,64	-0,61	▲ (1)	44	-0,64	13
Resultado nominal (% do PIB)	-7,04	-7,20	-7,25	▼ (1)	24	-7,50	7	-6,39	-6,50	-6,50	= (1)	23	-6,50	7

Relatório Focus de 05.07.2024. Fonte: <https://www.bcb.gov.br/publicacoes/focus>

2.2. DINÂMICA DAS EXPECTATIVAS DE MERCADO

Como destaques para o final de 2024, o último Boletim Focus apresentou expectativas estáveis para a taxa Selic e Câmbio, e, elevadas para o PIB e inflação.

Inflação (IPCA): Para o final de 2024 a expectativa foi elevada para 4,02%. Seguindo na mesma direção, para o final de 2025, a expectativa foi elevada para 3,88%.

SELIC: Para o final de 2024 as expectativas, em relação à taxa Selic, ficaram estáveis em 10,50%. Já para o final de 2025 houve estabilidade das expectativas em 9,50%.

PIB: A expectativa para o final de 2024, em relação ao PIB, foi elevada para 2,10%. Já para o final de 2025 a expectativa foi reduzida para 1,97%.

Câmbio (Dólar/ Real): Para o final de 2024 a expectativa foi mantida em R\$ 5,20. Já para o final de 2025, em relação ao último relatório, a expectativa elevou para R\$ 5,20.

3. CURVA DE JUROS E INFLAÇÃO

Taxa de Juros Real: A curva de juros real calculada pela ANBIMA, projetada em 05.07.2024, estima uma taxa real de juros de 6,29% a.a. para 10 anos.

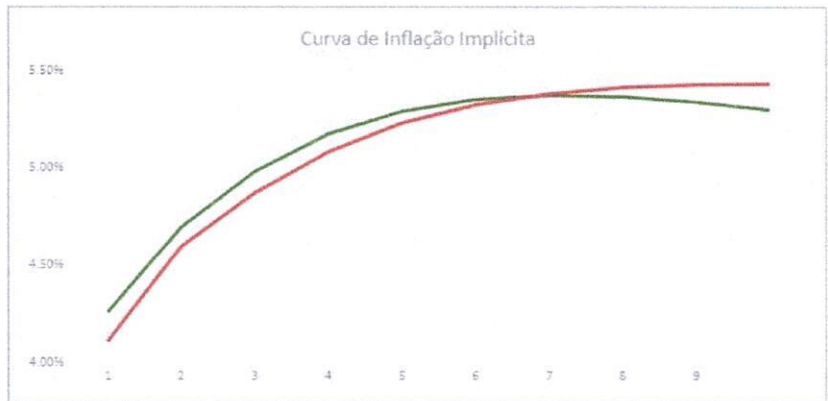
Ano	Curva de Juros Real	
	Taxa*	
	Jun/24	Jul/24
1	6.16%	6.35%
2	6.11%	6.41%
3	6.17%	6.41%
4	6.20%	6.40%
5	6.21%	6.38%
6	6.20%	6.33%
7	6.20%	6.33%
8	6.20%	6.31%
9	6.19%	6.30%
10	6.19%	6.29%



* FONTE: ANBIMA; Referência jun/24 divulgada em 04.06.2024 e referência jul/24 divulgada em 05.07.2024.

Taxa de Inflação Implícita: A curva de inflação implícita calculada pela ANBIMA, projetada em 05.07.2024, estima uma taxa de inflação máxima de 5,30% a.a. para 10 anos.

Ano	Curva de Inflação Implícita	
	Taxa*	
	Jun/24	Jul/24
1	4.10%	4.25%
2	4.59%	4.69%
3	4.87%	4.98%
4	5.08%	5.17%
5	5.23%	5.29%
6	5.32%	5.35%
7	5.38%	5.37%
8	5.41%	5.36%
9	5.42%	5.34%
10	5.43%	5.30%



* FONTE: ANBIMA; Referência jun/24 divulgada em 04.06.2024 e referência jul/24 divulgada em 05.07.2024.

Taxa de Juros Prefixados: A curva de juros prefixada calculada pela ANBIMA, projetada em 05.07.2024, estima uma taxa prefixada de juros de 11,92% a.a. para 10 anos.

Ano	Curva de Juros Pré	
	Taxa*	
	Jun/24	Jul/24
1	10.52%	10.87%
2	10.98%	11.40%
3	11.34%	11.71%
4	11.60%	11.90%
5	11.76%	12.00%
6	11.86%	12.04%
7	11.91%	12.04%
8	11.94%	12.02%
9	11.95%	11.97%
10	11.95%	11.92%



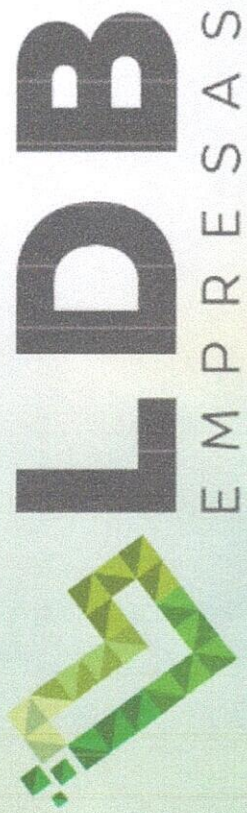
* FONTE: ANBIMA; Referência jun/24 divulgada em 04.06.2024 e referência jul/24 divulgada em 05.07.2024.

Handwritten signatures and initials on the right side of the page.

4. INDICADORES

Indicadores	Índices Financeiros													No ano (2024)	Acumulado 12 meses
	2023						2024								
	julho	agosto	setembro	outubro	novembro	dezembro	janeiro	fevereiro	março	abril	maio	junho			
Renda Fixa															
iMA-S	1.06%	1.18%	1.00%	0.96%	0.91%	0.92%	0.99%	0.82%	0.86%	0.90%	0.83%	0.81%	5.32%	11.85%	
CDI	1.07%	1.14%	0.97%	1.00%	0.92%	0.90%	0.97%	0.80%	0.83%	0.89%	0.83%	0.79%	5.22%	11.69%	
IRF-M 1	1.07%	1.15%	0.93%	0.96%	1.00%	0.91%	0.83%	0.76%	0.84%	0.58%	0.78%	0.63%	4.51%	10.95%	
IDKa IPCA 2A	0.98%	0.77%	0.29%	-0.41%	1.83%	1.45%	0.81%	0.42%	0.99%	-0.29%	1.07%	0.18%	3.21%	8.37%	
IMA-GERAL	0.98%	0.63%	0.18%	0.30%	1.84%	1.63%	0.47%	0.64%	0.52%	-0.22%	0.95%	0.05%	2.42%	8.23%	
IMA-B5	0.97%	0.61%	0.13%	-0.31%	1.80%	1.46%	0.68%	0.59%	0.77%	-0.20%	1.05%	0.39%	3.32%	8.23%	
IRF-M	0.89%	0.76%	0.17%	0.37%	2.47%	1.48%	0.67%	0.46%	0.54%	-0.52%	0.66%	-0.29%	1.51%	7.89%	
IRF-M 1+	0.82%	0.59%	-0.15%	0.12%	3.14%	1.73%	0.60%	0.34%	0.43%	-1.02%	0.60%	-0.72%	0.22%	6.61%	
IMA-B	0.81%	-0.38%	-0.95%	-0.66%	2.62%	2.75%	-0.45%	0.55%	0.08%	-1.61%	1.33%	-0.97%	-1.10%	3.07%	
IMA-B5+	0.73%	-1.27%	-1.92%	-0.98%	3.39%	3.94%	-1.47%	0.51%	-0.55%	-2.91%	1.59%	-2.25%	-5.04%	-1.43%	
IDKa IPCA 20A	0.76%	-3.05%	-3.53%	-1.16%	4.68%	6.58%	-3.34%	0.22%	-1.51%	-4.90%	2.01%	-5.03%	-12.09%	-8.64%	
Renda Variável															
IDIV	2.84%	-2.83%	1.32%	-3.15%	10.70%	6.90%	-3.51%	0.91%	-1.20%	-0.56%	-0.99%	1.99%	-3.41%	12.09%	
IBRX - 50	3.70%	-4.76%	1.21%	-2.99%	12.01%	5.31%	-4.15%	0.91%	-0.81%	-0.62%	-3.11%	1.63%	-6.12%	7.39%	
IFIX	1.33%	0.49%	0.20%	-1.97%	0.66%	4.25%	0.67%	0.79%	1.43%	-0.77%	0.02%	-1.04%	1.08%	6.09%	
IBrX - 100	3.32%	-5.01%	0.84%	-3.03%	12.38%	5.48%	-4.51%	0.96%	-0.73%	-1.34%	-3.18%	1.51%	-7.20%	5.59%	
Ibovespa	3.27%	-5.09%	0.71%	-2.94%	12.54%	5.38%	-4.79%	0.99%	-0.71%	-1.70%	-3.04%	1.48%	-7.66%	4.93%	
IVBX-2	3.03%	-6.92%	-0.83%	-5.46%	14.44%	5.31%	-4.91%	2.30%	1.50%	-5.81%	-3.66%	2.23%	-8.40%	-0.76%	
ISE	1.27%	-7.55%	-1.84%	-6.61%	15.06%	6.04%	-4.96%	1.99%	1.21%	-6.02%	-3.61%	1.10%	-10.14%	-5.90%	
SMLL	3.12%	-7.43%	-2.84%	-7.40%	12.46%	7.05%	-6.55%	0.47%	2.15%	-7.76%	-3.38%	-0.39%	-14.85%	-11.96%	
Investimentos no Exterior															
Global BDRX	2.13%	3.26%	-3.46%	-1.57%	6.46%	2.84%	4.78%	6.30%	4.04%	0.57%	7.32%	12.79%	41.07%	54.78%	
S&P 500	1.45%	1.97%	-3.22%	-1.22%	6.29%	2.43%	3.94%	5.80%	3.37%	-0.79%	6.22%	9.73%	31.45%	41.53%	
MSCI ACWI	1.88%	0.73%	-2.61%	-2.10%	6.44%	2.70%	2.86%	4.79%	3.14%	0.00%	5.22%	8.28%	26.67%	35.48%	
S&P 500 (M. Orig.)	3.11%	-1.77%	-4.87%	-2.20%	8.92%	4.42%	1.59%	5.17%	3.10%	-4.16%	4.80%	3.47%	14.48%	22.70%	
MSCI ACWI (M.Orig.)	3.55%	-2.96%	-4.27%	-3.07%	9.07%	4.70%	0.53%	4.17%	2.88%	-3.39%	3.82%	2.10%	10.32%	17.45%	
Índices Econômicos															
DÓLAR	-1.61%	3.80%	1.74%	1.00%	-2.41%	-1.91%	2.32%	0.60%	0.26%	3.51%	1.35%	6.05%	14.82%	15.35%	
SELIC	1.07%	1.14%	0.97%	1.00%	0.92%	0.90%	0.97%	0.80%	0.83%	0.89%	0.83%	0.79%	5.22%	11.69%	
IPCA	0.12%	0.23%	0.26%	0.24%	0.28%	0.56%	0.42%	0.83%	0.16%	0.38%	0.46%	0.21%	2.48%	4.23%	
INPC	-0.09%	0.20%	0.11%	0.12%	0.10%	0.55%	0.57%	0.81%	0.19%	0.37%	0.46%	0.25%	2.68%	3.70%	
IGP-M	-0.72%	-0.14%	0.37%	0.50%	0.59%	0.74%	0.07%	-0.52%	-0.47%	0.31%	0.89%	0.81%	1.10%	2.45%	
Meta Atuarial															
IPCA + 6% a.a.	0.61%	0.76%	0.72%	0.73%	0.74%	1.03%	0.93%	1.27%	0.62%	0.89%	0.95%	0.67%	5.46%	10.40%	
INPC + 6% a.a.	0.40%	0.73%	0.57%	0.61%	0.56%	1.02%	1.08%	1.25%	0.65%	0.88%	0.95%	0.71%	5.66%	9.84%	
IPCA + 5% a.a.	0.53%	0.68%	0.65%	0.65%	0.67%	0.95%	0.85%	1.20%	0.55%	0.81%	0.87%	0.60%	4.97%	9.38%	
INPC + 5% a.a.	0.32%	0.65%	0.50%	0.53%	0.49%	0.94%	1.00%	1.18%	0.58%	0.80%	0.87%	0.64%	5.17%	8.82%	
IPCA + 4% a.a.	0.45%	0.59%	0.57%	0.57%	0.59%	0.87%	0.76%	1.13%	0.47%	0.72%	0.79%	0.52%	4.48%	8.35%	
INPC + 4% a.a.	0.24%	0.56%	0.42%	0.45%	0.41%	0.86%	0.91%	1.11%	0.50%	0.71%	0.79%	0.56%	4.68%	7.80%	

Handwritten signatures and initials on the right margin of the table.



CAMPO ALEGRE - CONSOLIDADO
JUNHO 2024

[Handwritten signatures and initials in blue ink]



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.

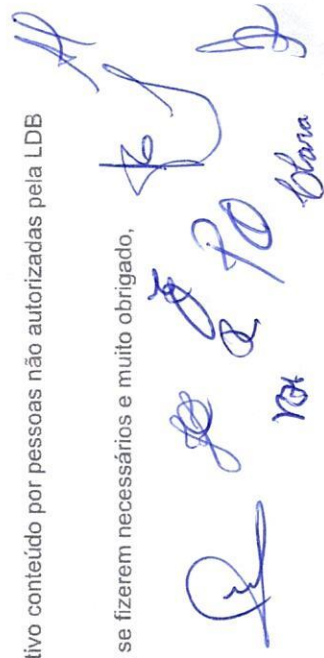
As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos 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 28.06.2024.

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.

Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom right of the page. There are several distinct signatures, including one that appears to be 'A' and another that looks like 'D'. There are also some initials and a signature that includes the word 'Barra'.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

89,32%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)			Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
		Dia	Mês	Ano	Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,7100000%)	0,22	0,04	0,90	6,13	6,576.224,01	9,89		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,8300000%)	0,22	0,04	0,91	6,19	2.673.927,55	4,02		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,0100000%)	4,14	0,04	0,85	1,16	432.795,24	0,65		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,0200000%)	0,26	0,04	0,85	5,79	14.841.163,77	22,31		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,4000000%)	0,41	0,04	0,81	5,49	1.821.824,75	2,74		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,5000000%)	0,78	0,04	0,81	5,54	3.589.596,35	5,40		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,0900000%)	4,17	0,04	0,86	1,16	98.868,77	0,15		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,4100000%)	4,54	0,04	0,81	5,49	2.067.750,77	3,11		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,8000000%)	2,91	0,04	0,84	5,68	610.280,90	0,92		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,0900000%)	4,18	0,04	0,86	1,89	1.525.528,93	2,29		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,3900000%)	0,55	0,04	0,80	5,48	3.099.258,34	4,66		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,0700000%)	2,96	0,04	0,86	1,88	1.485.439,98	2,23		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,1000000%)	4,18	0,04	0,86	1,17	128.647,27	0,19		
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a								38.951.306,63	58,55

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

Handwritten signatures and initials:
 - Top right: *Handwritten signature*
 - Middle right: *Handwritten signature*
 - Bottom right: *Handwritten signature*
 - Far right: *Handwritten signature*
 - Far right: *Handwritten signature*

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,81	-0,51	-0,99	-1,23	8.922.125,96	13,41	4.649.802.742,18	0,19
BB	BB	BB PREV RF IPCA	0,06	0,04	0,77	5,10	576.256,46	0,87	45.636.780,90	1,26
BB	BB	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,06	0,03	0,58	3,89	4.889.453,03	7,35	158.930.296.035,76	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,06	0,04	0,78	5,10	3.266.789,53	4,91	11.531.124.110,68	0,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,59	-0,24	-0,18	1,79	17.654.624,98	26,54		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,04	0,79	5,24	1.238.471,44	1,86	17.821.452.916,03	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,04	0,82	5,36	485.487,92	0,73	16.508.104.382,05	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,08	0,04	0,80	5,26	1.723.959,36	2,59		

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				
PETRA	FINAXIS	FIDC PREMIUM	5,46	-0,51	-0,51	-0,68	104.828,02	0,16	81.898.860,94	0,13
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			5,46	-0,51	-0,51	-0,68	104.828,02	0,16		

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	1,89	-0,20	0,28	2,87	980.886,00	1,47	190.076.554,55	0,52
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,89	-0,20	0,28	2,87	980.886,00	1,47		
Renda Fixa			0,55	-0,05	0,54	4,55	59.415.604,99	89,32		

[Handwritten signatures and initials]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

4,63%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI	13,58	-0,30	1,45	-7,98	3.078.163,03	4,63	202.308.056,66	1,52
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	13,73	0,00	-0,89	-9,44	0,00	0,00	715.959.885,20	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	13,42	0,00	-0,24	-9,26	0,00	0,00	295.695.816,81	0,00
Sub-total Artigo 8º I			13,51	-0,30	1,43	-7,83	3.078.163,03	4,63		
Renda Variável			13,51	-0,30	1,43	-7,83	3.078.163,03	4,63		

Handwritten signatures and initials:
 A, J, FOP, Clara, RH, R

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,44%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatild. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,96	0,88	7,75	7,75	3.618.417,91	5,44	2.736.870.167,13	0,13
Sub-total Artigo 9º III			13,96	0,88	7,75	7,75	3.618.417,91	5,44		
Investimentos no Exterior			18,25	0,88	7,75	7,75	3.618.417,91	5,44		

J FLP
g
Clara
R
RH

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,62%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatiliid. a.a. (%)			Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
			Dia	Mês	Ano	Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA RIO BRAVO FI DE FII - CXR11	25,46	4,13	4,61	6,11	410.000,00	0,62	139.530.841,87	0,29		
		Sub-total Artigo 11º	25,46	4,13	4,61	6,11	410.000,00	0,62				
		Fundos Imobiliários	25,46	4,13	4,61	6,11	410.000,00	0,62				
		Total	1,71	0,01	0,95	3,39	66.522.185,93	100,00				

JRP
Clara
R
R
R

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Pró-Gestão Nivel 1 Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	33.951.306,63	58,55	0,00	65,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	17.654.624,98	26,54	0,00	12,85	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	1.723.959,36	2,59	0,00	5,00	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	104.828,02	0,16	0,00	0,15	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	980.886,00	1,47	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	59.415.604,99	89,32					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	3.078.163,03	4,63	0,00	5,00	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	3.078.163,03	4,63					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nivel I	3.618.417,91	5,44	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	3.618.417,91	5,44					10,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	410.000,00	0,62	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	410.000,00	0,62					5,00
Total		66.522.185,93	100,00					

J. P. P.
Blara
roy
Blara
roy

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 7° I, Alínea a % do CDI	0,85 108,24	5,79 110,99	2,52 99,60	5,79 110,99	10,41 89,07	329.546,51	2.027.459,74
Artigo 7° I, Alínea b % do CDI	-0,18 -22,83	1,79 34,25	0,39 15,49	1,79 34,25	8,33 71,22	-30.044,12	268.299,10
Artigo 7° III, Alínea a % do CDI	0,80 101,15	5,26 100,77	2,52 99,45	5,26 100,77	11,89 101,70	13.626,78	224.030,29
Artigo 7° V, Alínea a % do CDI	-0,51 -64,53	-0,68 -13,09	0,75 29,54	-0,68 -13,09	-7,59 -64,90	-536,01	-721,25
Artigo 7° V, Alínea b % do CDI	0,28 35,04	2,87 54,95	0,84 33,16	2,87 54,95	8,28 70,80	2.702,00	27.355,20
Artigo 8° I Var. IBOVESPA p.p.	1,43 -0,05	-7,83 -0,17	-3,42 -0,14	-7,83 -0,17	4,36 -0,57	31.778,87	-658.104,19
Artigo 9° III % do CDI	7,75 1.311,44	7,75 1.311,44				260.140,20	260.140,20
Artigo 11° % do CDI	4,61 584,17	6,11 117,03	3,69 145,70	6,11 117,03	12,81 109,60	18.050,00	24.100,00
CAMPO ALEGRE - CONSOLIDADO (Total)						625.264,23	2.172.559,09

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150527 (6,0100000%)	429.141,47	0,00	0,00	0,00	432.795,24	3.653,77	4.945,32
NTN-B 150527 (6,0200000%)	14.715.736,37	0,00	0,00	0,00	14.841.163,77	125.427,40	830.692,77
NTN-B 150545 (5,5000000%)	3.560.649,91	0,00	0,00	0,00	3.589.596,35	28.946,44	192.261,03
NTN-B 150545 (6,0900000%)	98.028,14	0,00	0,00	0,00	98.868,77	840,63	1.137,63
NTN-B 150555 (5,3900000%)	3.074.523,79	0,00	0,00	0,00	3.099.258,34	24.734,55	164.363,39
NTN-B 150555 (6,0700000%)	1.472.833,06	0,00	0,00	0,00	1.485.439,98	12.606,92	27.675,04
NTN-B 150555 (6,1000000%)	127.552,51	0,00	0,00	0,00	128.647,27	1.094,76	1.481,60
NTN-B 150824 (6,7100000%)	6.517.300,27	0,00	0,00	0,00	6.576.224,01	58.923,74	382.737,30
NTN-B 150824 (6,8300000%)	2.649.729,24	0,00	0,00	0,00	2.673.927,55	24.198,31	157.027,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,40000000%)	1.807.269,46	0,00	0,00	0,00	1.821.824,75	14.555,29	95.441,93
NTN-B 150850 (5,41000000%)	2.051.215,08	0,00	0,00	0,00	2.067.750,77	16.535,69	108.404,09
NTN-B 150850 (5,80000000%)	605.223,62	0,00	0,00	0,00	610.280,90	5.057,28	33.064,42
NTN-B 150850 (6,09000000%)	1.512.557,20	0,00	0,00	0,00	1.525.528,93	12.971,73	28.227,77
	38.621.760,12	0,00	0,00	0,00	38.951.306,63	329.546,51	

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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	8.745.092,41	262.491,99	0,00	0,00	8.922.125,96	-85.458,44	-100.567,56
BB PREV RF IPCA	571.877,12	0,00	0,00	0,00	576.256,46	4.379,34	27.942,23
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	4.475.801,20	1.086.937,50	-698.592,03	0,00	4.889.453,03	25.306,26	168.650,05
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	3.361.327,25	4.733,56	-125.000,00	0,00	3.266.789,53	25.728,72	172.274,38
	17.154.097,98	1.354.163,15	-823.592,03	0,00	17.654.624,98	-30.044,12	

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	1.228.774,94	0,00	0,00	0,00	1.238.471,44	9.696,50	101.633,28
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	432.943,80	2.950,00	-4.336,16	0,00	485.487,92	3.930,28	56.079,98
	1.711.718,74	2.950,00	-4.336,16	0,00	1.723.959,36	13.626,78	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC PREMIUM	105.364,03	0,00	0,00	0,00	104.828,02	-536,01	-721,25
	105.364,03	0,00	0,00	0,00	104.828,02	-536,01	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	978.184,00	0,00	0,00	0,00	980.886,00	2.702,00	27.355,20

A
Diana
R
J
R
R
R
R
8 de 25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
Artigo 8º I (Fundos de Ações)							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI	3.034.080,12	0,00	0,00	0,00	3.078.163,03	44.082,91	-266.996,86
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	457.807,22	0,00	-463.652,75	0,00	0,00	-4.154,47	-48.359,39
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	3.356.427,28	0,00	-3.358.277,71	0,00	0,00	-8.149,57	-342.747,94
	6.858.314,62	0,00	-3.821.930,46	0,00	3.078.163,03	31.778,87	

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	0,00	3.358.277,71	0,00	0,00	3.618.417,91	260.140,20	260.140,20
	0,00	3.358.277,71	0,00	0,00	3.618.417,91	260.140,20	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA RIO BRAVO FIDE FII - CXRI11	391.950,00	0,00	0,00	0,00	0,00	410.000,00	18.050,00	24.100,00
	391.950,00	0,00	0,00	0,00	0,00	410.000,00	18.050,00	

Handwritten signatures and initials in blue ink, including names like "Blara" and "RMS".

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

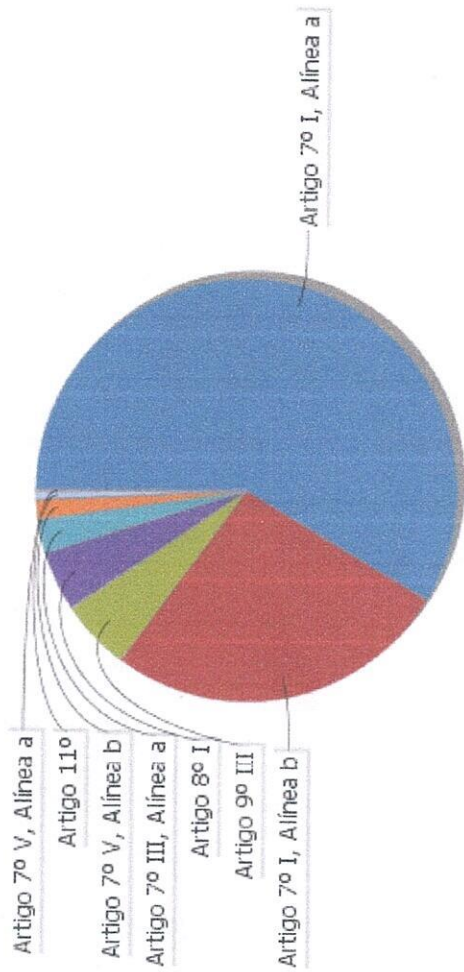
Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	27.570.879,30	41,45		27.570.879,30	41,45	
de 31 dias a 365 dias	9.250.151,56	13,91		36.821.030,86	55,35	
acima de 365 dias	29.701.155,07	44,65		66.522.185,93	100,00	

Handwritten signatures and initials in blue ink, including the name "Clara" and various initials such as "A", "J", "R", "R.A.", and "R".

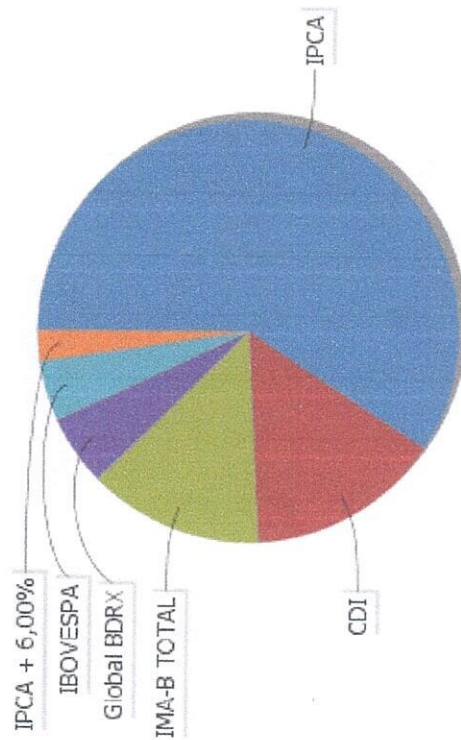
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



- Artigo 7º I, Alínea a: 58.55%
- Artigo 7º I, Alínea b: 26.54%
- Artigo 9º III: 5.44%
- Artigo 8º I: 4.63%
- Artigo 7º III, Alínea a: 2.59%
- Artigo 7º V, Alínea b: 1.47%
- Artigo 11º: 0.62%
- Artigo 7º V, Alínea a: 0.16%

Alocação Por Estratégia

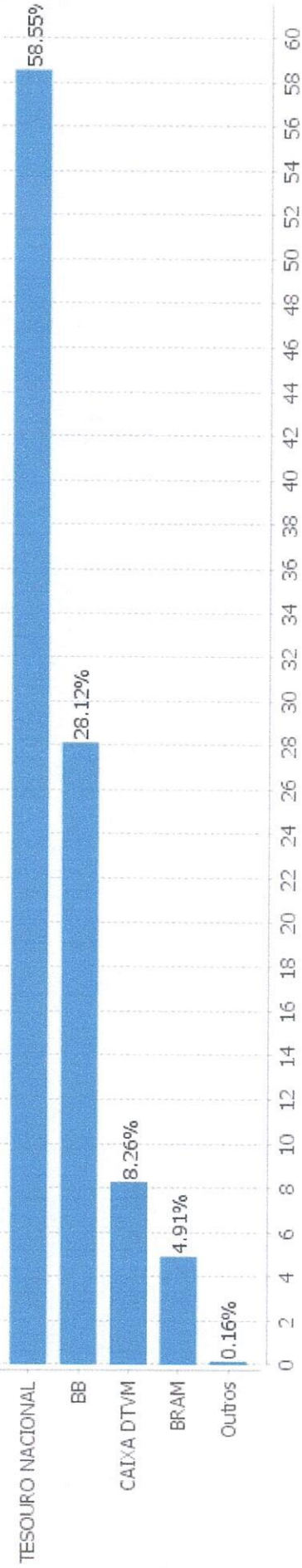


- IPCA: 59.17%
- CDI: 15.01%
- IMA-B TOTAL: 13.41%
- Global BDRX: 5.44%
- IBOVESPA: 4.63%
- IPCA + 6,00%: 2.34%

Handwritten signatures and notes in blue ink:
 F. J. P. O. Blava
 R. M. R.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Handwritten notes and signatures:
Para
JFO
RFE
28/06/2024

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	0,28	0,92	0,57	0,14	0,49	0,95							3,39
IPCA + 5,02%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60							4,98
p.p. indexador	-0,57	-0,28	0,02	-0,67	-0,38	0,35							-1,59
2023	1,38	0,04	0,82	1,05	1,42	1,74	1,07	0,23	0,84	0,12	2,19	1,52	13,11
IPCA + 5,03%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68	0,65	0,65	0,67	0,95	9,82
p.p. indexador	0,42	-1,16	-0,35	0,09	0,76	1,41	0,54	-0,45	0,19	-0,53	1,52	0,57	3,29

Performance Sobre a Meta Atuarial

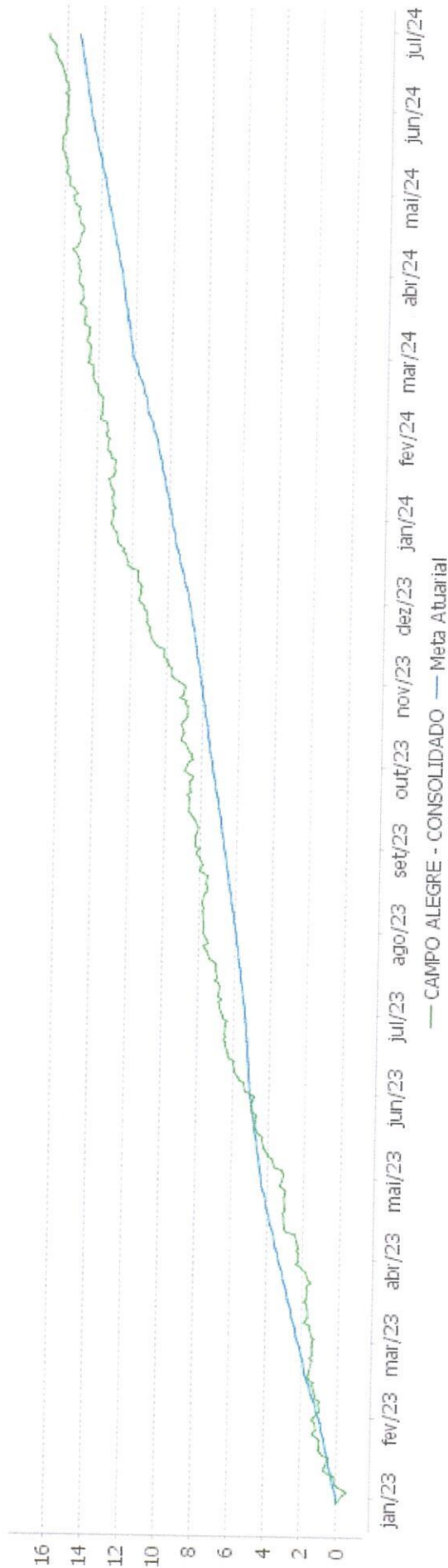
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	55,56	03 meses	1,59	2,30	-0,71	1,40
Meses abaixo - Meta Atuarial	8	44,44	06 meses	3,39	4,98	-1,59	1,46
			12 meses	9,70	9,40	0,30	1,71
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,19	2023-11	Desde 30/12/2022	16,95	15,29	1,66	1,84
Menor rentabilidade da Carteira	0,04	2023-02					

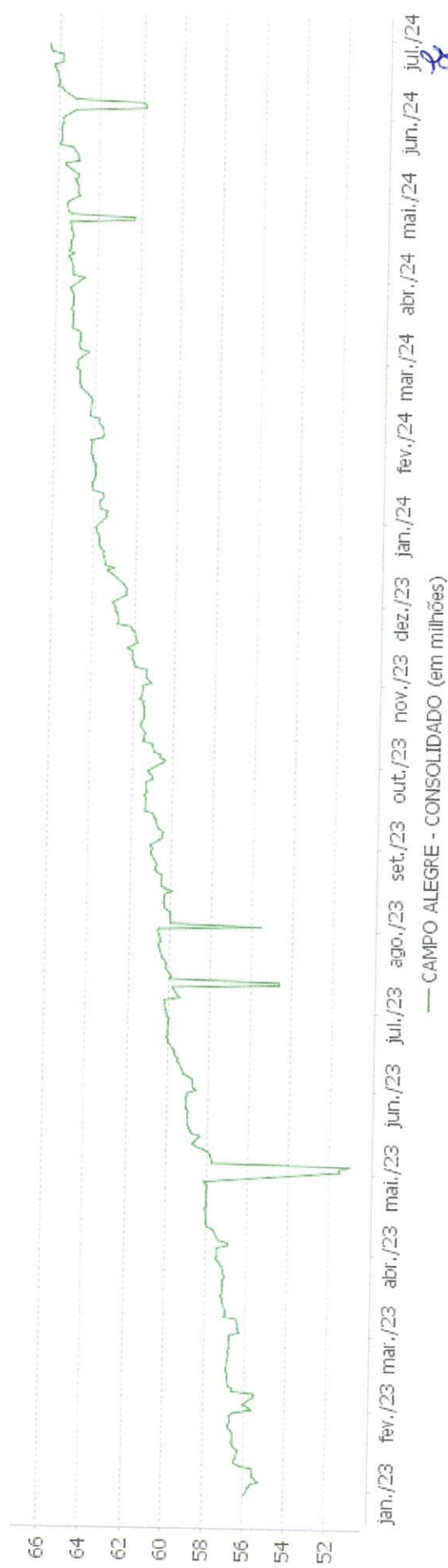
Handwritten signatures and initials in blue ink.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido

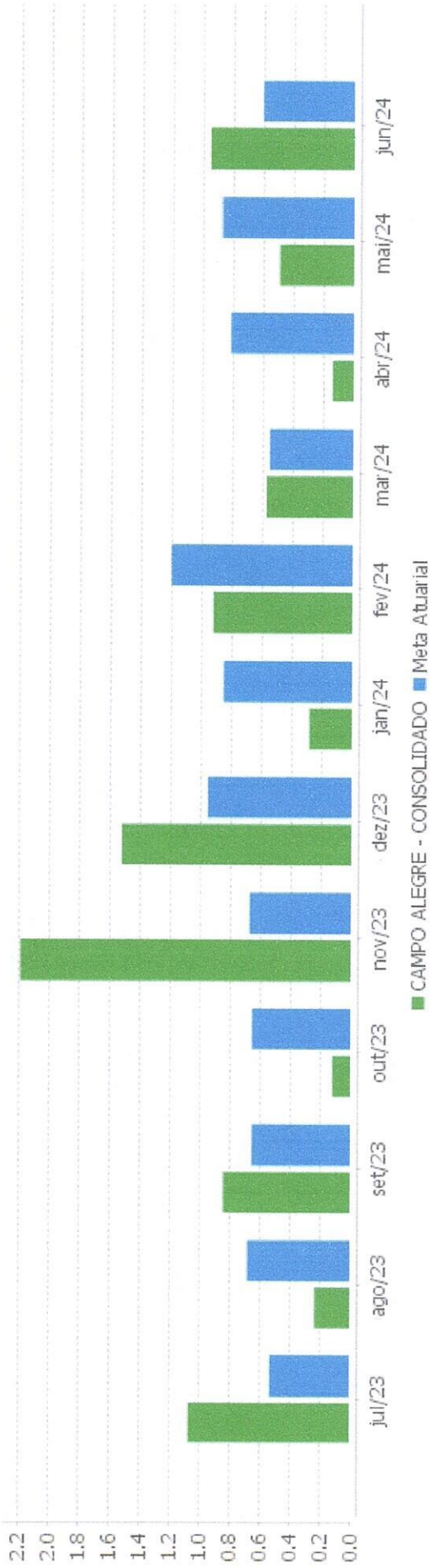


Handwritten signature

Handwritten signature

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Handwritten signatures and initials:
 - Top right: *EA*
 - Middle right: *JPO*
 - Below *JPO*: *Alana*
 - Bottom right: *R* and *15/23*

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	0,28	2,87	0,84	2,87	8,28	19,62	29,01
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,40	-2,60	-1,70	-2,60	-2,13	-1,08	-14,14
NTN-B 150824 (6,7100000%)	0,90	6,13	2,68	6,13	11,01	15,60	
Var. IPCA p.p.	0,69	3,65	1,63	3,65	6,78	8,07	
NTN-B 150545 (6,0900000%)	0,86	2,71	-0,43	2,71	4,09		
Var. IPCA p.p.	0,65	0,22	-1,48	0,22	-0,14		
NTN-B 150545 (5,5000000%)	0,81	5,54	2,39	5,54	9,97	13,69	
Var. IPCA p.p.	0,60	3,05	1,34	3,05	5,74	6,17	
NTN-B 150850 (5,4100000%)	0,81	5,49	2,37	5,49	6,99	10,62	
Var. IPCA p.p.	0,60	3,01	1,32	3,01	2,76	3,10	
NTN-B 150555 (5,3900000%)	0,80	5,48	2,36	5,48	9,90	13,66	
Var. IPCA p.p.	0,59	3,00	1,31	3,00	5,67	6,14	
NTN-B 150555 (6,1000000%)	0,86	2,71	-0,43	2,71	4,08		
Var. IPCA p.p.	0,65	0,22	-1,49	0,22	-0,15		
NTN-B 150840 (5,4000000%)	0,81	5,49	2,37	5,49	9,83	13,46	
Var. IPCA p.p.	0,60	3,00	1,31	3,00	5,61	5,94	
NTN-B 150850 (6,0900000%)	0,86	2,71	2,53	2,71	4,08		
Var. IPCA p.p.	0,65	0,22	1,48	0,22	-0,15		
NTN-B 150527 (6,0200000%)	0,85	5,79	2,52	5,79	10,37	17,64	
Var. IPCA p.p.	0,64	3,31	1,46	3,31	6,14	10,11	
NTN-B 150824 (6,8300000%)	0,91	6,19	2,71	6,19	11,13	19,30	
Var. IPCA p.p.	0,70	3,70	1,66	3,70	6,90	11,78	
NTN-B 150555 (6,0700000%)	0,86	5,76	2,53	5,76	7,17		
Var. IPCA p.p.	0,65	3,27	1,48	3,27	2,94		
NTN-B 150850 (5,8000000%)	0,84	5,68	2,46	5,68	7,24	10,97	
Var. IPCA p.p.	0,63	3,20	1,41	3,20	3,01	3,45	
NTN-B 150527 (6,0100000%)	0,85	2,69	-0,43	2,69	4,05		
Var. IPCA p.p.	0,64	0,21	-1,48	0,21	-0,18		
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,58	3,89	1,87	3,89	8,86	20,43	
% do CDI	74,06	74,58	74,01	74,58	75,81	76,17	
BB PREV RF IPCA	0,77	5,10	2,47	5,10	11,43	23,98	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,09	-0,37	-0,07	-0,37	1,03	3,28	
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,78	5,10	2,47	5,10	11,39	26,18	
							36,76
							-6,39
							36,89

Handwritten signatures and initials: R, P, J, R, 13/14, 16 de 25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI		99,07	97,66	97,79	97,66	97,39	97,63	97,60
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		-0,99	-1,23	-1,33	-1,23	2,76	16,42	20,47
Var. IMA-B TOTAL p.p.		-0,02	-0,13	-0,06	-0,13	-0,30	-0,59	-0,95
FIDC PREMIUM		-0,51	-0,68	0,75	-0,68	-7,59	-6,82	-62,53
% do CDI		-64,53	-13,09	29,54	-13,09	-64,90	-25,43	-165,44
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,79	5,24	2,53	5,24	11,71	26,83	38,23
% do CDI		100,10	100,37	99,91	100,37	100,14	100,06	101,15
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,82	5,36	2,57	5,36	12,19	27,40	39,10
% do CDI		103,84	102,72	101,69	102,72	104,28	102,16	103,45
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA		1,49	-7,68	-3,32	-7,68	4,72	25,22	-2,51
Var. IBOVESPA p.p.		0,01	-0,02	-0,04	-0,02	-0,20	-0,52	-0,23
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI		1,45	-7,98	-3,46	-7,98	4,14	24,07	-4,46
Var. IBOVESPA p.p.		-0,03	-0,32	-0,18	-0,32	-0,79	-1,67	-2,17
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		1,13	-7,60	-3,48	-7,60	3,60	13,77	-5,18
Var. IBOVESPA p.p.		-0,35	0,06	-0,20	0,06	-1,33	-11,97	-2,90
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,73	39,52	21,34	39,52	52,18	72,57	50,01
Var. Global BDRX p.p.		-0,06	-1,55	-0,40	-1,55	-2,61	-4,56	-5,70
CAIXA RIO BRAVO FI DE FII - CXRI11		4,61	6,11	3,69	6,11	12,81	55,51	27,95
Var. IPCA p.p.		4,40	3,63	2,63	3,63	8,59	47,99	7,65
CAMPO ALEGRE - CONSOLIDADO		0,95	3,39	1,59	3,39	9,70	19,90	42,24
Var. IPCA + 5,02% p.p.		0,35	-1,59	-0,71	-1,59	0,31	20,70	43,15
CDI		0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA		1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%		0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IFCA + 6,00%		0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

Handwritten signatures and initials in blue ink, including a large signature and several smaller initials.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
CAIXA RIO BRAVO FI DE FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	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
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIDC PREMIUM	Não se aplica	Não se aplica				



 R. Blana

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	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IOVESP	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBOVESPA	1,51	-7,20	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 100	1,63	-6,12	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
IBRX 50	-0,39	-14,85	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
SMALL CAP	0,69	-14,03	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Consumo - ICON	1,99	-3,41	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43
Índice Dividendos - IDIV									

[Handwritten signatures and initials in blue ink]

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	9,73	31,45	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	26,67	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFCA	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	2,68	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	1,10	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,37
IFCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IFCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,34
IFCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IFCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

Handwritten signatures and initials in blue ink.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150527 (6,010000%)	432.795,24	6,010000	427.022,62	6,546600	-5.772,62
NTN-B 150527 (6,020000%)	14.841.163,77	6,020000	14.646.875,99	6,546600	-194.287,78
NTN-B 150545 (5,500000%)	3.589.596,35	5,500000	3.202.793,91	6,496800	-386.802,44
NTN-B 150545 (6,090000%)	98.866,77	6,090000	94.441,36	6,496800	-4.427,41
NTN-B 150555 (5,390000%)	3.099.256,34	5,390000	2.671.576,99	6,477700	-427.681,35
NTN-B 150555 (6,070000%)	1.485.439,98	6,070000	1.407.166,51	6,477700	-78.273,47
NTN-B 150555 (6,100000%)	128.647,27	6,100000	122.362,30	6,477700	-6.284,97
NTN-B 150824 (6,710000%)	6.576.224,01	6,710000	6.565.572,71	7,999900	-10.651,30
NTN-B 150824 (6,830000%)	2.673.927,55	6,830000	2.669.999,57	7,999900	-3.927,98
NTN-B 150840 (5,400000%)	1.821.824,75	5,400000	1.645.517,03	6,439600	-176.307,72
NTN-B 150850 (5,410000%)	2.067.750,77	5,410000	1.802.002,85	6,504300	-265.747,92
NTN-B 150850 (5,800000%)	610.280,90	5,800000	559.242,26	6,504300	-51.038,64
NTN-B 150850 (6,090000%)	1.525.526,93	6,090000	1.449.887,35	6,504300	-75.641,58

Handwritten signatures and initials in blue ink, including "RJ", "Rbana", and "RJA".

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
422	03/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	25.392,85	20.097.82298958	1,2634627150
432	03/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	609.386,33	482.314,45436837	1,2634627150
415	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.336,16	830,52813780	5,2209670000
438	04/06/2024	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	0,00	3.358.277,71	1.222,558,49265688	2,7469260000
430	05/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	49.083,04	0,00	38,825,35469438	1,2642006850
433	05/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	50.499,83	39,946,05492561	1,2642006850
421	07/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	20.390,90	0,00	16,120,10709492	1,2649357650
414	07/06/2024	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3.358.277,71	0,00	424,105,83747541	7,9184897100
423	10/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	7.609,19	6,013,73659943	1,2653015100
434	10/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	550.843,79	0,00	435,345,87262130	1,2653015100
420	12/06/2024	B3 PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	262.491,99	0,00	33,673,64227724	7,7951766500
424	13/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	1.547,49	1,221,94412086	1,2664163390
435	13/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	24,00	0,00	18,95111367	1,2664163390
418	13/06/2024	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,00	125.000,00	7,468,44150295	16,7370930000
425	17/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	370,17	292,12807249	1,2671497020
419	17/06/2024	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	4.733,56	0,00	282,59677901	16,7502263000
416	17/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.950,00	0,00	562,70562599	5,2425280000
426	19/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	59,59	46,99938292	1,267889870
431	21/06/2024	B3 AÇÕES VALOR FIC FIA	0,00	463.652,75	300,329,02023064	1,5438160110
427	21/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	1.464,68	1,154,53890241	1,2686276720
428	25/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	2.094,56	1,650,08302607	1,2693664300
436	25/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	463.652,75	0,00	365,263,12579418	1,2693664300
429	28/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	167,34	131,71502060	1,2704701350
437	28/06/2024	B3 RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	2.943,12	0,00	2,316,55976707	1,2704701350
Total			4.715.390,86	4.649.858,65		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,76	0,35	5,00	0,20	-0,34	0,53	59.415.604,99	89,32
Artigo 8º	12,14	5,81	20,00	0,17	0,05	1,43	3.078.163,03	4,63
Artigo 9º	18,25	6,46	20,00	0,12	0,39	7,75	3.618.417,91	5,44
Artigo 11º	20,66	10,04	20,00	0,00	0,18	4,61	410.000,00	0,62
CAMPO ALEGRE - CONSOLIDADO		0,49		0,49			66.522.185,93	100,00

Renda Fixa

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º I, Alinea a								
Ativo								Value-At-Risk: 0,35%
NTN-B 150824 (6,7100000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,68	0,90	6.576.224,01	9,89
NTN-B 150824 (6,8300000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,74	0,91	2.673.927,55	4,02
NTN-B 150527 (6,0100000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,37	0,85	432.795,24	0,65
NTN-B 150527 (6,0200000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,38	0,85	14.841.163,77	22,31
NTN-B 150840 (5,4000000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,10	0,81	1.821.824,75	2,74
NTN-B 150545 (5,5000000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,15	0,81	3.589.596,35	5,40
NTN-B 150545 (6,0900000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,41	0,86	98.868,77	0,15
NTN-B 150850 (5,4100000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,10	0,81	2.067.750,77	3,11
NTN-B 150850 (5,8000000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,28	0,84	610.280,90	0,92
NTN-B 150850 (6,0900000%)	0,17	0,22	-0,00	0,26	0,41	0,86	1.525.528,93	2,29
NTN-B 150555 (5,3900000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,10	0,80	3.099.258,34	4,66
NTN-B 150555 (6,0700000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,40	0,86	1.485.439,96	2,23
NTN-B 150555 (6,1000000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,41	0,86	128.647,27	0,19
Sub-total	0,17	0,07	0,00	0,38	0,85		38.951.306,63	58,55

Artigo 7º I, Alinea b

Handwritten signatures and initials:
 - Top right: RFX
 - Middle right: A
 - Large signature in center: [Signature]
 - Bottom right: Diana
 - Far right: [Signature]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,99	2,16	0,18	0,01	-0,44	-0,99	8.922.125,96	13,41
BB PREV RF IPCA	0,00	0,01	0,00	0,11	-11,56	0,77	576.256,46	0,87
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	0,01	0,00	0,00	-70,41	0,58	4.889.453,03	7,35
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,02	0,01	-0,00	0,01	-0,49	0,78	3.266.789,53	4,91
Sub-total	2,06	1,09	0,18		-0,47	-0,18	17.654.624,98	26,54

Artigo 7º III, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,04	0,02	0,00	0,02	0,02	0,79	1.238.471,44	1,86
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,81	0,82	485.487,92	0,73
Sub-total	0,04	0,02	0,00		0,25	0,80	1.723.959,36	2,59

Artigo 7º V, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC PREMIUM	1,81	0,00	-0,00	0,01	-0,72	-0,51	104.828,02	0,16
Sub-total	1,81	0,00	-0,00		-0,72	-0,51	104.828,02	0,16

Artigo 7º V, Alinea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	1,88	0,97	0,01	0,96	-0,27	0,28	980.886,00	1,47
Sub-total	1,88	0,97	0,01		-0,27	0,28	980.886,00	1,47

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,46%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,32	6,46	0,12	0,94	0,69	12,73	3.618.417,91	5,44
Sub-total	18,25	6,46	0,12		0,39	7,75	3.618.417,91	5,44

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,81%

Handwritten signatures and initials:
 - Top right: Signature of R. P. P.
 - Middle right: Signature of R. P. P.
 - Bottom right: Signature of R. P. P.
 - Far right: Signature of R. P. P.
 - Date: 24 de 25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI	12,24	5,81	0,17	0,14	0,05	1,45	3.078.163,03	4,63
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	11,30	NaN	0,00	NaN	0,03	1,13	0,00	0,00
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	12,10	NaN	0,00	NaN	0,06	1,49	0,00	0,00
Sub-total	12,14	5,81	0,17		0,05	1,43	3.078.163,03	4,63

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 10,04%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA RIO BRAVO FI DE FII - CXRI11	20,66	10,04	0,00	10,03	0,18	4,61	410.000,00	0,62
Sub-total	20,66	10,04	0,00		0,18	4,61	410.000,00	0,62

- (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 (%)

