



LDB
EMPRESAS

OSASCO - CONSOLIDADO
4º TRIMESTRE 2023



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 29.12.2023.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **92,75%**

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	7,83	0,10	3,91	6,72	17.087.175,44	1,93
TESOURO NACIONAL	LTN 01012024 (6,030000%)	0,00	0,02	0,47	1,43	6.028.599,10	0,68
TESOURO NACIONAL	LTN 01012024 (6,100000%)	0,00	0,02	0,47	1,44	6.037.581,19	0,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,930000%)	0,39	0,27	0,93	2,22	28.821.093,56	3,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,742000%)	0,43	0,34	1,06	2,47	43.857.325,93	4,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,200000%)	0,37	0,22	0,83	2,00	28.900.931,16	3,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,729999%)	4,01	0,32	1,04	1,37	44.424.542,05	5,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730001%)	0,42	0,32	1,04	2,45	45.624.004,68	5,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,740002%)	0,42	0,32	1,04	2,46	44.367.381,38	5,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	4,08	0,32	1,05	2,08	43.690.736,25	4,93
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2029 (12,000000%)	0,14	0,18	1,04	2,92	5.488.792,58	0,62
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,68	0,28	1,14	2,58	314.328.163,32	35,48

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	Trim.				
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,98	0,10	0,93	2,18	10.308.300,40	1,16	2.604.177.083,80	0,40

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,99	0,09	1,41	2,88	15.104.837,76	1,70	5.798.399.930,42	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,98	0,09	1,40	2,86	4.273.304,77	0,48	5.218.373.540,00	0,08
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,97	0,10	1,44	2,92	9.069.821,67	1,02	5.230.672.087,91	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,08	1,21	2,92	33.439.009,19	3,77	5.290.529.627,75	0,63
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,04	0,04	0,88	2,78	53.898.801,40	6,08	5.390.177.797,31	1,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,84	0,07	1,09	2,79	126.094.075,19	14,23		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,04	0,92	2,94	124.378.023,92	14,04	13.988.008.512,08	0,89
QUELUZ	RJI	BRA1 FI RENDA FIXA	0,45	0,05	0,16	0,31	186.769,73	0,02	3.678.220,56	5,08
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	0,90	2,83	106.822.968,46	12,06	16.475.113.370,57	0,65
VERITAS	RJI	TMJ IMA-B FI RF	15,95	0,46	1,17	-0,09	730.077,85	0,08	44.264.039,22	1,65
GENIAL	RJI	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	20,47	0,18	-18,39	-18,64	739.706,86	0,08	53.143.365,94	1,39
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,97	0,10	1,44	2,90	25.061.934,56	2,83	887.568.400,13	2,82
VERITAS	RJI	FI BARCELONA RENDA FIXA	6,17	-0,66	0,18	0,60	386.304,23	0,04	26.031.281,35	1,48
GENIAL	PLANNER	FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	35,93	-0,14	48,34	8,81	180.118,37	0,02	6.335.873,59	2,84
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,04	0,94	3,01	96.652.873,11	10,91	10.327.922.782,38	0,94
VERITAS	RJI	MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,47	-0,28	-5,17	-13,97	24.748,55	0,00	758.794,56	3,26
RJI	RJI	TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	10,90	0,02	-9,60	-9,67	885.751,67	0,10	44.109.233,70	2,01
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,21	0,05	0,92	2,83	356.049.277,31	40,19		

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	Trim.				
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 5,95% a.a	1,56	0,20	0,20	0,20	20.039.387,18	2,26		

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
Sub-total Artigo 7º IV			1,56	0,20	0,20	0,20	20.039.387,18	2,26		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,26	-0,44	-0,44	-1,22	3.254.840,20	0,37	72.020.308,77	4,52
QUELUZ	PLANNER	ILLUMINATI FIDC	11,12	4,25	4,25	1,99	1.138.681,27	0,13	60.767.216,37	1,87
GENIAL	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	2,14	-1,12	-1,12	-2,15	301.944,01	0,03	6.227.748,67	4,85
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			3,44	0,61	0,61	-0,52	4.695.465,48	0,53		

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	Trim.				
GENIAL	GENIAL	PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,59	-0,01	-0,23	-1,65	538.746,70	0,06	21.620.085,27	2,49
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,59	-0,01	-0,23	-1,65	538.746,70	0,06		
Renda Fixa			0,42	0,15	1,03	2,72	821.745.115,18	92,75		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

3,21%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	14,53	-0,01	6,71	14,10	4.628.040,19	0,52	260.031.743,25	1,78
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	17,89	-0,01	4,73	11,95	6.293.953,92	0,71	224.155.330,01	2,81
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,45	-0,01	4,83	12,81	3.300.571,70	0,37	1.435.426.948,17	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,12	-0,01	6,93	11,06	3.988.234,92	0,45	702.099.612,74	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,78	-0,01	6,66	14,41	3.618.111,21	0,41	720.619.712,53	0,50
SAFRA	SAFRA	SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	17,79	-0,01	6,37	13,24	6.611.084,09	0,75	161.877.526,58	4,08
Sub-total Artigo 8º I			16,92	-0,01	5,99	12,87	28.439.996,03	3,21		
Renda Variável			16,92	-0,01	5,99	12,87	28.439.996,03	3,21		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,79%

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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,18	-0,00	2,59	7,65	8.186.902,36	0,92	1.995.875.754,00	0,41
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,81	0,01	2,51	6,67	7.709.148,84	0,87	658.947.271,35	1,17
Sub-total Artigo 9º III			14,13	0,00	2,55	7,17	15.896.051,20	1,79		
Investimentos no Exterior			14,13	0,00	2,55	7,17	15.896.051,20	1,79		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,52%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
ARENA CAPITAL	REAG	WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	1,05	-0,12	-0,12	-0,62	368.489,33	0,04	41.614.544,54	0,89
QUELUZ	RJI	FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	15,25	-0,01	-0,20	-0,67	3.247.943,24	0,37	140.878.213,15	2,31
Sub-total Artigo 10º I			7,50	-0,02	-0,19	-0,66	3.616.432,57	0,41		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
A5	PLANNER	W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	0,58	-0,14	-0,14	-0,42	8.719.489,73	0,98	122.614.237,57	7,11
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,18	-0,05	-0,05	-0,16	1.119.268,16	0,13	27.538.232,69	4,06
Sub-total Artigo 10º II			0,53	-0,13	-0,13	-0,39	9.838.757,89	1,11		
Investimentos Estruturados			5,70	-0,10	-0,15	-0,47	13.455.190,46	1,52		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,73%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
GRAPHEN	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	6,34	0,21	0,21	0,55	6.070.861,77	0,69	76.717.810,00	7,91
QUELUZ	RJI	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	0,88	-0,10	-0,10	-0,40	60.314,00	0,01	142.201.961,38	0,04
VERITAS	RJI	SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	1,83	-0,94	-0,18	-0,85	319.721,89	0,04	64.225.072,21	0,50
Sub-total Artigo 11º			5,93	0,15	0,19	0,47	6.450.897,66	0,73		
Fundos Imobiliários			5,93	0,15	0,19	0,47	6.450.897,66	0,73		
Total			0,98	0,14	1,19	3,03	885.987.250,53	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	289.251,93
Sub-total Disponibilidades Financeiras	289.251,93
Total	886.276.502,46

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	314.328.163,32	35,48	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	126.094.075,19	14,23	0,00	8,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	356.049.277,31	40,19	0,00	17,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	20.039.387,18	2,26	0,00	10,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	4.695.465,48	0,53	0,00	1,00	1,40	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	538.746,70	0,06	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	821.745.115,18	92,75					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	28.439.996,03	3,21	0,00	3,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	28.439.996,03	3,21					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	15.896.051,20	1,79	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.896.051,20	1,79					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.616.432,57	0,41	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	9.838.757,89	1,11	0,00	1,50	2,40	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	13.455.190,46	1,52					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	6.450.897,66	0,73	0,00	1,00	1,45	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	6.450.897,66	0,73					5,00
Total		885.987.250,53	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,14 127,74	2,58 91,01	2,58 91,01	4,12 67,07	10,94 83,82	3.558.270,27	7.327.130,31
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,09 122,06	2,79 98,45	2,79 98,45	5,40 87,89	12,81 98,20	1.364.550,85	3.427.492,48
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,92 102,33	2,83 99,59	2,83 99,59	6,14 99,88	12,99 99,59	3.165.044,50	9.987.447,54
Artigo 7º IV % do CDI	0,20 112,49	0,20 112,49				39.387,18	39.387,18
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,61 68,36	-0,52 -18,28	-0,52 -18,28	-4,55 -74,05	-9,46 -72,51	28.596,98	-24.492,03
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-0,23 -25,66	-1,65 -58,24	-1,65 -58,24	-1,01 -16,37	-1,82 -13,99	-1.241,92	-9.055,34
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,99 0,61	12,87 -2,24	12,87 -2,24	10,32 -3,31	23,09 0,81	1.607.529,97	3.243.787,52
Artigo 9º III % do CDI	2,55 284,36	7,17 252,60	7,17 252,60	9,16 148,95	21,16 162,15	395.087,93	1.063.344,45
Artigo 10º I % do CDI	-0,19 -21,16	-0,66 -23,32	-0,66 -23,32	-1,20 -19,58	4,33 33,19	-6.871,96	-24.096,18
Artigo 10º II % do CDI	-0,13 -14,43	-0,39 -13,89	-0,39 -13,89	-0,80 -13,03	-1,60 -12,26	-12.745,88	-38.952,52
Artigo 11º % do CDI	0,19 20,94	0,47 16,43	0,47 16,43	-2,53 -41,22	2,75 21,05	12.088,57	29.959,93
OSASCO - CONSOLIDADO (Total)						10.149.696,49	25.021.953,34

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
LTN 01012024 (6,030000%)	6.000.649,34	0,00	0,00	0,00	6.028.599,10	27.949,76	84.842,32
LTN 01012024 (6,100000%)	6.009.275,02	0,00	0,00	0,00	6.037.581,19	28.306,17	85.919,62
NTN-B 150545	16.444.882,09	0,00	0,00	0,00	17.087.175,44	642.293,35	1.084.702,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150545 (4,930000%)	28.554.395,10	0,00	0,00	0,00	28.821.093,56	266.698,46	632.552,75
NTN-B 150555 (5,742000%)	43.397.982,77	0,00	0,00	0,00	43.857.325,93	459.343,16	1.071.273,74
NTN-B 150840 (4,200000%)	28.663.126,47	0,00	0,00	0,00	28.900.931,16	237.804,69	566.022,26
NTN-B 150850 (5,729999%)	43.967.293,17	0,00	0,00	0,00	44.424.542,05	457.248,88	601.195,31
NTN-B 150850 (5,730001%)	45.154.367,30	0,00	0,00	0,00	45.624.004,68	469.637,38	1.092.404,74
NTN-B 150850 (5,740002%)	43.910.303,81	0,00	0,00	0,00	44.367.381,38	457.077,57	1.063.364,11
NTN-B 150850 (5,860000%)	43.235.471,43	0,00	0,00	0,00	43.690.736,25	455.264,82	888.964,98
NTN-F 2029 (12,000000%)	5.432.146,55	0,00	0,00	0,00	5.488.792,58	56.646,03	155.888,36
	310.769.893,05	0,00	0,00	0,00	314.328.163,32	3.558.270,27	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF IDKA2	14.894.147,65	0,00	0,00	0,00	15.104.837,76	210.690,11	423.516,51
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	8.940.671,39	0,00	0,00	0,00	9.069.821,67	129.150,28	257.562,43
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	10.213.187,93	0,00	0,00	0,00	10.308.300,40	95.112,47	220.400,60
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.214.228,39	0,00	0,00	0,00	4.273.304,77	59.076,38	118.652,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	33.040.078,32	0,00	0,00	0,00	33.439.009,19	398.930,87	949.684,69
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	53.427.210,66	0,00	0,00	0,00	53.898.801,40	471.590,74	1.457.675,75
	124.729.524,34	0,00	0,00	0,00	126.094.075,19	1.364.550,85	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	75.531.057,95	68.925.888,23	-38.509.655,85	0,00	106.822.968,46	875.678,13	3.193.287,07
BRA1 FI RENDA FIXA	186.467,46	0,00	0,00	0,00	186.769,73	302,27	577,31
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	95.754.962,71	0,00	0,00	0,00	96.652.873,11	897.910,40	2.824.927,62
BRANCO INST FIC FI RF IMA-B 5	24.706.957,28	0,00	0,00	0,00	25.061.934,56	354.977,28	707.111,52
FI BARCELONA RENDA FIXA	385.606,28	0,00	0,00	0,00	386.304,23	697,95	2.300,13

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	122.766.726,43	473.336,18	0,00	0,00	124.378.023,92	1.137.961,31	3.491.094,91
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	311.799,15	0,00	0,00	282.801,00	180.118,37	151.120,22	37.845,79
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	26.096,66	0,00	0,00	0,00	24.748,55	-1.348,11	-4.018,49
TMJ IMA-B FI RF	787.575,12	0,00	0,00	65.974,81	730.077,85	8.477,54	-1.380,09
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	979.766,81	0,00	0,00	0,00	885.751,67	-94.015,14	-94.826,01
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	906.424,21	0,00	0,00	0,00	739.706,86	-166.717,35	-169.472,22
	322.343.440,06	69.399.224,41	-38.509.655,85	348.775,81	356.049.277,31	3.165.044,50	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 5,95% a.a	0,00	20.000.000,00	0,00	0,00	20.039.387,18	39.387,18	39.387,18
	0,00	20.000.000,00	0,00	0,00	20.039.387,18	39.387,18	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
ILLUMINATI FIDC	1.092.228,12	0,00	0,00	0,00	1.138.681,27	46.453,15	22.227,25
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	305.371,88	0,00	0,00	0,00	301.944,01	-3.427,87	-6.648,26
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	3.269.268,50	0,00	0,00	0,00	3.254.840,20	-14.428,30	-40.071,02
	4.666.868,50	0,00	0,00	0,00	4.695.465,48	28.596,98	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
PIATÁ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	539.988,62	0,00	0,00	0,00	538.746,70	-1.241,92	-9.055,34
	539.988,62	0,00	0,00	0,00	538.746,70	-1.241,92	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	3.148.465,75	0,00	0,00	0,00	3.300.571,70	152.105,95	374.917,22
FIA CAIXA DIVIDENDOS	4.337.215,17	0,00	0,00	0,00	4.628.040,19	290.825,02	571.847,41
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	6.009.740,99	0,00	0,00	0,00	6.293.953,92	284.212,93	671.612,46
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3.729.831,66	0,00	0,00	0,00	3.988.234,92	258.403,26	397.064,55
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	3.392.306,99	0,00	0,00	0,00	3.618.111,21	225.804,22	455.577,73
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	6.214.905,50	0,00	0,00	0,00	6.611.084,09	396.178,59	772.768,15
	26.832.466,06	0,00	0,00	0,00	28.439.996,03	1.607.529,97	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	7.980.333,09	0,00	0,00	0,00	8.186.902,36	206.569,27	581.626,66
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	7.520.630,18	0,00	0,00	0,00	7.709.148,84	188.518,66	481.717,79
	15.500.963,27	0,00	0,00	0,00	15.896.051,20	395.087,93	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	3.254.369,26	0,00	0,00	0,00	3.247.943,24	-6.426,02	-21.785,73
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	368.935,27	0,00	0,00	0,00	368.489,33	-445,94	-2.310,45
	3.623.304,53	0,00	0,00	0,00	3.616.432,57	-6.871,96	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	1.119.822,47	0,00	0,00	0,00	1.119.268,16	-554,31	-1.742,68
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	8.731.681,30	0,00	0,00	0,00	8.719.489,73	-12.191,57	-37.209,84
	9.851.503,77	0,00	0,00	0,00	9.838.757,89	-12.745,88	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	6.058.153,59	0,00	0,00	0,00	0,00	6.070.861,77	12.708,18	33.066,73
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	322.767,33	0,00	0,00	0,00	2.489,07	319.721,89	-556,37	-2.866,71
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	60.377,24	0,00	0,00	0,00	0,00	60.314,00	-63,24	-240,09
	6.441.298,16	0,00	0,00	0,00	2.489,07	6.450.897,66	12.088,57	

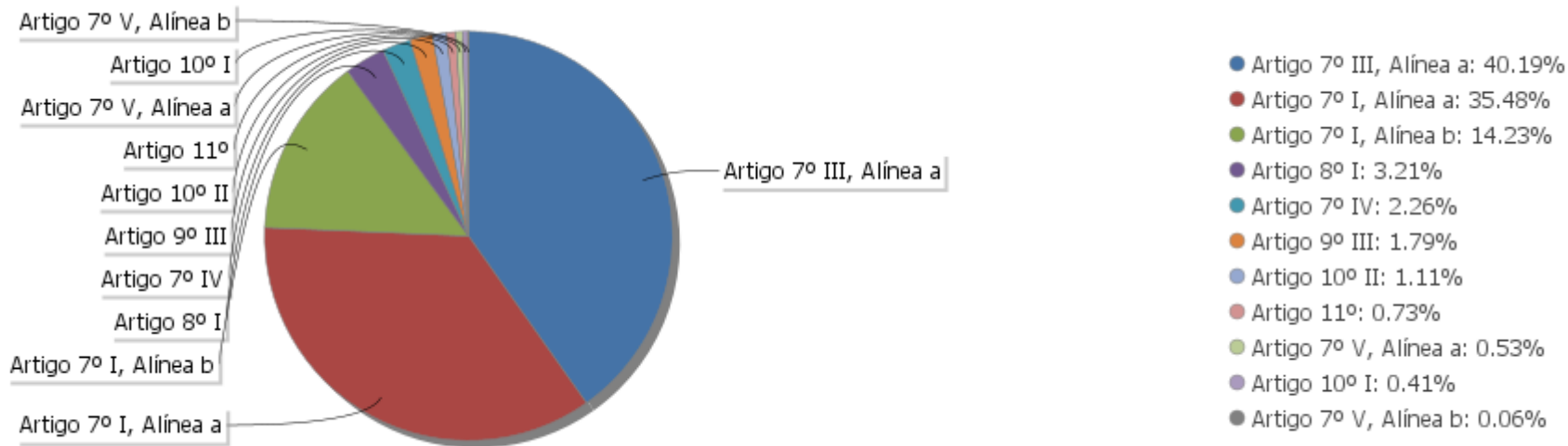
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

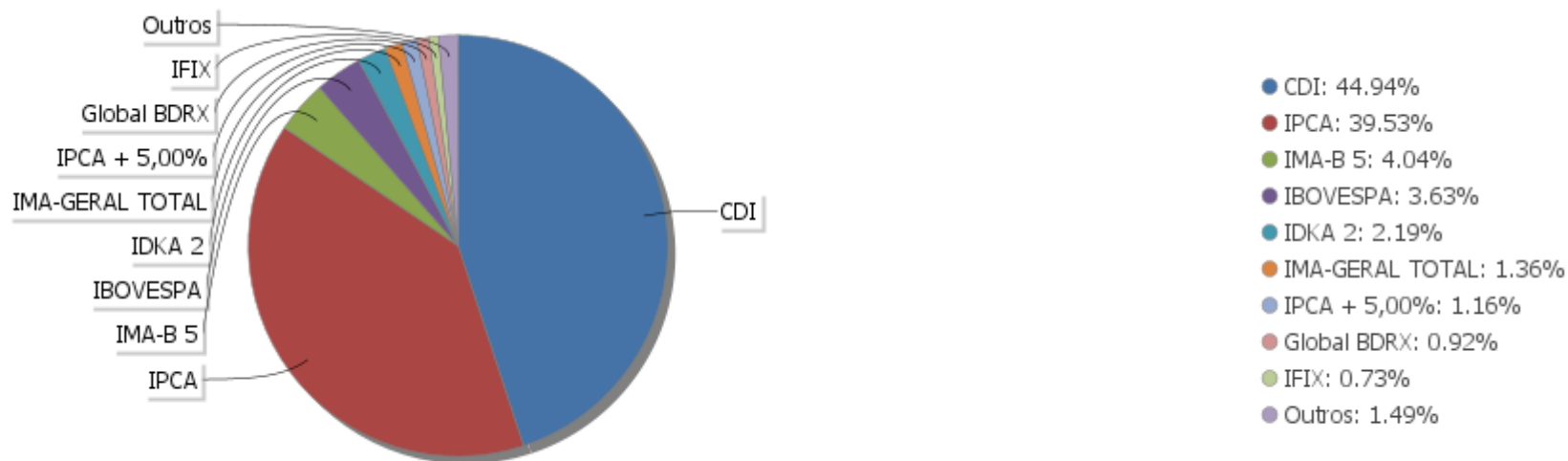
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	541.589.356,42	61,13	541.589.356,42	61,13	
de 31 dias a 365 dias	13.608.872,10	1,54	555.198.228,52	62,66	
acima de 365 dias	330.789.022,01	37,34	885.987.250,53	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

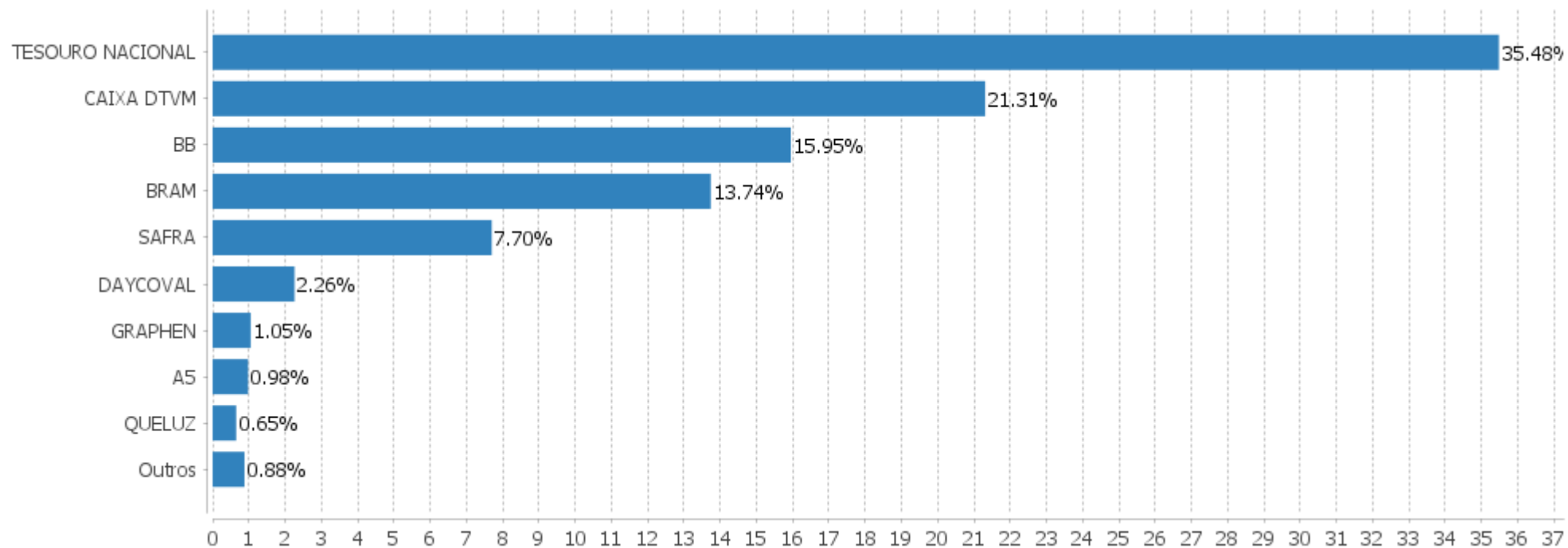


Alocação Por Estratégia



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
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

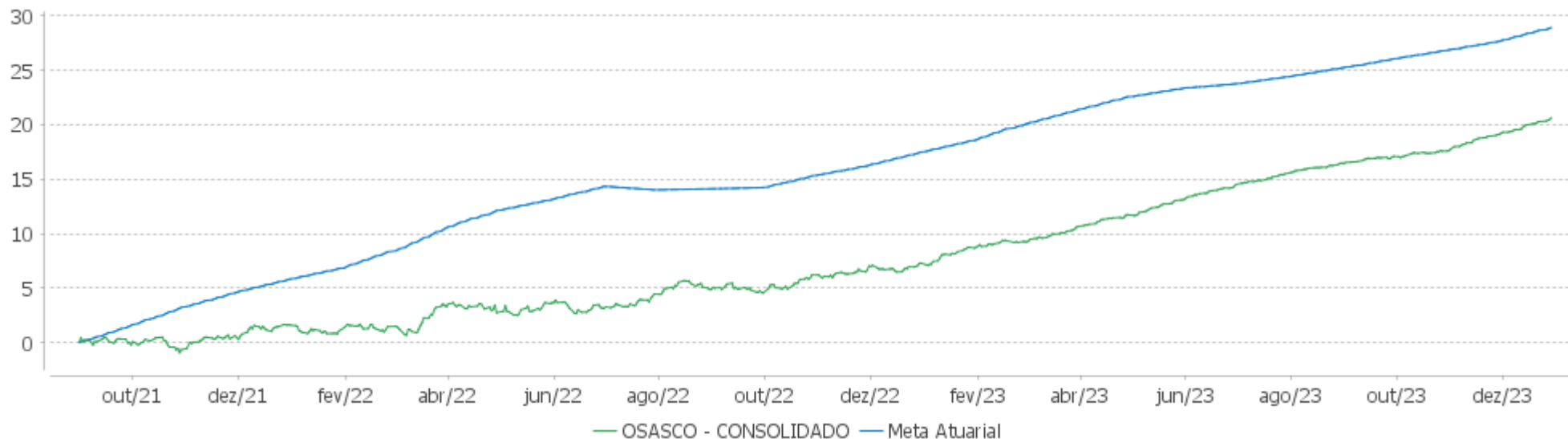
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	13	46,43	03 meses	3,03	2,28	0,75	0,85
Meses abaixo - Meta Atuarial	15	53,57	06 meses	5,34	4,19	1,15	0,78
			12 meses	12,44	9,79	2,66	0,98
			24 meses	18,75	21,87	-3,12	2,22
Maior rentabilidade da Carteira	1,80	2022-03	Desde 31/08/2021	20,64	29,19	-8,55	2,37
Menor rentabilidade da Carteira	-0,53	2022-04					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

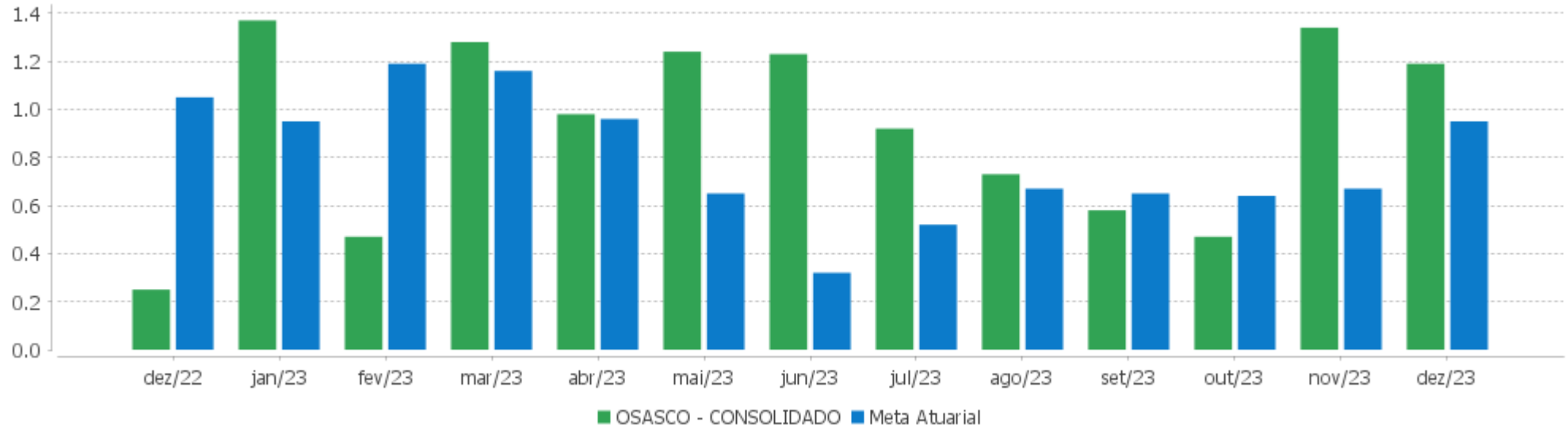


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 5,95% a.a Var. IPCA p.p.	0,20 0,09	0,20 0,09					
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO % do CDI	-0,23 -25,66	-1,65 -58,24	-1,65 -58,24	-1,01 -16,37	-1,82 -13,99	-61,77 -228,47	-62,12 -190,44
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	3,91 3,35	6,72 5,63	6,72 5,63	4,12 2,42	20,61 15,99	24,11 13,44	14,69 -7,12
NTN-B 150555 (5,742000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,50	2,47 1,39	2,47 1,39	4,43 2,73	10,91 6,29	20,60 9,93	33,09 11,28
NTN-B 150545 (4,930000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,37	2,22 1,14	2,22 1,14	3,97 2,27	10,00 5,38	22,08 11,40	37,84 16,03
LTN 01012024 (6,030000%) Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,47 -1,16	1,43 -2,38	1,43 -2,38	2,95 -2,73	5,96 -8,84	12,32 -13,57	19,06 -8,03
NTN-F 2029 (12,000000%) Var. SELIC p.p.	1,04 0,15	2,92 0,09	2,92 0,09	5,93 -0,22	12,00 -1,04	25,39 -1,65	26,40 -6,22
NTN-B 150850 (5,729999%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,48	2,45 1,37	2,45 1,37	1,52 -0,18	4,82 0,20		
NTN-B 150840 (4,200000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,27	2,00 0,91	2,00 0,91	3,56 1,86	9,19 4,57	20,34 9,67	32,00 10,19
LTN 01012024 (6,100000%) Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,47 -1,16	1,44 -2,36	1,44 -2,36	2,98 -2,69	6,03 -8,77	12,47 -13,42	19,30 -7,80
NTN-B 150850 (5,730001%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,48	2,45 1,37	2,45 1,37	4,41 2,71	10,88 6,25	20,56 9,88	33,02 11,21
NTN-B 150850 (5,740002%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,48	2,46 1,37	2,46 1,37	4,41 2,71	10,89 6,27	20,58 9,90	33,04 11,23
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,49	2,49 1,40	2,49 1,40	1,53 -0,17	4,85 0,23		
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,41 -0,04	2,88 -0,01	2,88 -0,01	4,84 -0,16	11,72 -0,40	22,14 -0,46	27,81 -0,89
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,21 0,65	2,92 1,84	2,92 1,84	4,92 3,22	13,59 8,97	25,74 15,07	25,60 3,79
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,40 -0,05	2,86 -0,04	2,86 -0,04	4,97 -0,03	11,90 -0,23	22,02 -0,59	27,70 -0,99
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,44	2,92	2,92	4,62	11,93	22,58	27,81

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,05	-0,05	-0,13	-0,19	-0,51	-0,90
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,93 -0,02	2,18 -0,10	2,18 -0,10	5,37 1,18			
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	0,88 98,48	2,78 97,94	2,78 97,94	6,04 98,26	12,84 98,44	26,73 98,88	32,18 98,67
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,44 -49,24	-1,22 -42,85	-1,22 -42,85	-2,34 -38,11	-3,37 -25,85	-0,10 -0,37	-0,91 -2,80
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC % do CDI	-1,12 -125,24	-2,15 -75,91	-2,15 -75,91	-3,75 -61,01	-6,79 -52,06	-11,79 -43,61	-27,46 -84,20
ILLUMINATI FIDC Var. IPCA + 6,00% p.p.	4,25 3,23	1,99 -0,53	1,99 -0,53	-10,54 -15,22	-23,06 -33,88	-32,55 -56,79	-23,27 -68,18
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-5,17 -7,92	-13,97 -18,72	-13,97 -18,72	-24,01 -28,22	-37,48 -53,54	-49,69 -73,14	-92,62 -114,50
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B Var. IMA-B TOTAL p.p.	48,34 45,59	8,81 4,06	8,81 4,06	5,57 1,36	7,44 -8,62	14,26 -9,19	9,66 -12,22
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 -0,03	2,90 -0,07	2,90 -0,07	4,58 -0,16	11,84 -0,28	22,24 -0,86	26,72 -2,00
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,94 104,62	3,01 106,08	3,01 106,08	6,66 108,27	13,63 104,43	28,40 105,03	34,74 106,51
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,90 100,65	2,83 99,76	2,83 99,76	6,15 99,95	12,98 99,47	27,20 100,61	33,08 101,42
FI BARCELONA RENDA FIXA % do CDI	0,18 20,19	0,60 21,11	0,60 21,11	2,88 46,83	10,00 76,66	-43,66 -161,50	-42,25 -129,54
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-18,39 -19,85	-18,64 -21,61	-18,64 -21,61	-19,20 -23,95	-20,12 -32,25	-18,53 -41,62	-35,43 -64,14
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,92 103,12	2,94 103,46	2,94 103,46	6,48 105,39	13,32 102,09	27,68 102,38	33,54 102,84
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,16 -2,59	0,31 -4,45	0,31 -4,45	1,66 -2,55	5,21 -10,84	12,17 -11,28	10,71 -11,18
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-9,60 -11,06	-9,67 -12,64	-9,67 -12,64	-5,70 -10,45	-3,19 -15,32	0,76 -22,33	-0,62 -29,33
TMJ IMA-B FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,17 -1,59	-0,09 -4,84	-0,09 -4,84	-3,54 -7,75	2,68 -13,37	0,02 -23,43	-11,39 -33,28
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,83 -0,55	12,81 -2,30	12,81 -2,30	8,59 -5,04	15,82 -6,46	10,40 -17,61	-24,69 -37,43
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	6,66	14,41	14,41	12,47	27,90	31,07	38,42

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	1,27	-0,71	-0,71	-1,16	5,62	3,06	25,68
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA Var. IBOVESPA p.p.	4,73 -0,65	11,95 -3,17	11,95 -3,17	10,36 -3,27	30,95 8,67	38,43 10,42	27,13 14,39
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	6,93 -0,12	11,06 -0,43	11,06 -0,43	3,02 -0,38	16,46 -0,66	-1,39 -0,87	-18,28 -1,65
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	6,71 1,32	14,10 -1,02	14,10 -1,02	15,25 1,62	24,99 2,71	39,28 11,27	26,25 13,51
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	6,37 0,99	13,24 -1,88	13,24 -1,88	11,43 -2,20	20,35 -1,93	12,60 -15,41	-8,33 -21,08
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,59 -0,25	7,65 -0,12	7,65 -0,12	9,07 -0,65	24,92 -1,41	-10,73 -1,62	16,51 -4,97
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	2,51 -2,88	6,67 -8,45	6,67 -8,45	9,25 -4,38	17,40 -4,88	-18,28 -46,29	9,44 -3,31
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO % do CDI	-0,20 -22,03	-0,67 -23,48	-0,67 -23,48	-1,15 -18,71	-16,97 -130,04	-18,08 -66,88	-19,73 -60,50
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP Var. IPCA + 7,00% p.p.	-0,12 -1,22	-0,62 -3,38	-0,62 -3,38	-1,67 -6,84	-3,28 -15,14	7,23 -19,34	-24,32 -73,35
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,14 -15,58	-0,42 -14,97	-0,42 -14,97	-0,87 -14,12	-1,73 -13,23	-9,92 -36,70	-11,24 -34,47
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,05 -1,08	-0,16 -2,67	-0,16 -2,67	-0,27 -4,96	-0,60 -11,42	-1,24 -25,47	-2,53 -47,44
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,18 -4,43	-0,85 -3,71	-0,85 -3,71	-1,21 -6,16	-1,92 -17,42	-3,52 -21,58	-1,15 -16,52
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO Var. IFIX p.p.	0,21 -4,04	0,55 -2,31	0,55 -2,31	-2,63 -7,58	3,08 -12,41	7,55 -10,51	8,80 -6,57
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,10 -4,35	-0,40 -3,26	-0,40 -3,26	-0,83 -5,78	-2,36 -17,86	11,48 -6,58	-35,26 -50,63
OSASCO - CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,95% p.p.	1,19 0,24	3,03 0,75	3,03 0,75	5,34 1,15	12,44 2,66	18,75 -3,18	
CDI	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	15,12	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	2,20	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	2,52	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

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: 29/12/2023

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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,91	2,89	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	5,05	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	4,38	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	2,97	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	6,42	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	4,76	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	3,81	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	2,89	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	10,28	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	15,12	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	14,95	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	14,43	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	11,48	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	12,32	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	14,61	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	2,43	7,54	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	2,86	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	7,01	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	1,08	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	0,77	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	1,84	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	2,05	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	2,28	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	2,40	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	2,49	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	2,52	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	1,73	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	2,20	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
LTN 01012024 (6,030000%)	6.028.599,10	6,030000	6.027.302,70	11,935000	-1.296,40
LTN 01012024 (6,100000%)	6.037.581,19	6,100000	6.036.298,66	11,935000	-1.282,53
NTN-B 150545 (4,930000%)	28.821.093,56	4,930000	26.979.750,73	5,477000	-1.841.342,83
NTN-B 150555 (5,742000%)	43.857.325,93	5,742000	45.556.130,89	5,472400	1.698.804,96
NTN-B 150840 (4,200000%)	28.900.931,16	4,200000	25.547.962,60	5,381900	-3.352.968,56
NTN-B 150850 (5,729999%)	44.424.542,05	5,729999	45.939.613,31	5,471800	1.515.071,26
NTN-B 150850 (5,730001%)	45.624.004,68	5,730001	47.179.982,87	5,471800	1.555.978,19
NTN-B 150850 (5,740002%)	44.367.381,38	5,740002	45.939.613,31	5,471800	1.572.231,93
NTN-B 150850 (5,860000%)	43.690.736,25	5,860000	45.939.613,31	5,471800	2.248.877,06
NTN-F 2029 (12,000000%)	5.488.792,58	12,000000	5.857.524,80	10,120500	368.732,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4020	02/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	162.071,48	0,00	54.382,06542286	2,9802376710
4021	02/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	248.521,67	0,00	83.389,88276600	2,9802376710
4022	02/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	102.543,33	34.407,76921800	2,9802376710
4023	02/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	23.244,59	0,00	7.799,57592800	2,9802376710
4024	03/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.868,89	0,00	10.017,67718800	2,9816183370
4025	04/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.489.035,53	0,00	4.186.643,95241700	2,9830660720
4026	04/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.233.045,51	0,00	4.100.829,55413600	2,9830660720
4027	04/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.480.769,73	0,00	496.391,86469800	2,9830660720
4028	05/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	85.264,55	28.569,04169300	2,9845085780
4029	09/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.753,84	0,00	2.260,79503200	2,9873738680
4030	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	303.561,57	0,00	62.393,87895200	4,8652460000
4031	09/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	102.116,93	34.182,84235992	2,9873738680
4032	10/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.066.725,32	356.912,03395000	2,9887625480
4033	10/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.276.873,35	3.103.917,82586000	2,9887625480
4034	10/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	215.307,99	72.039,17559261	2,9887625480
4035	16/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	108.463,27	36.241,01370954	2,9928321230
4036	18/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	42.801.771,27	14.288.344,12831980	2,9955725370
4037	18/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	759.448,64	0,00	253.523,70227000	2,9955725370
4038	18/10/2023	NTN-B 150850 (5,860000%)	42.801.771,27	0,00	10.000,00000000	4,280,1771270000
4039	18/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.815,31	0,00	5.279,56168801	2,9955725370
4040	18/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	105.284,50	0,00	35.146,70357655	2,9955725370
4041	19/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	275.337,58	91.872,66914994	2,9969476510
4042	20/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	347.406,38	0,00	115.864,93770597	2,9983736830
4043	23/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	133.729,86	44.578,51503267	2,9998724700
4044	25/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.960.071,30	0,00	3.317.110,84135800	3,0026344540
4045	26/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.444.983,41	481.007,21617500	3,0040784450
4046	26/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.093.351,10	3.359.882,66777800	3,0040784450
4047	26/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	282.319,73	93.978,81419200	3,0040784450

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4048	27/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	192.377,38	64.009,28099400	3,0054607240
4049	27/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.803.910,14	1.265.666,22868300	3,0054607240
4050	27/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	96.120,57	31.981,97508700	3,0054607240
4051	27/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	23.677,17	0,00	7.878,05004700	3,0054607240
4052	30/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	161.807,75	0,00	53.812,83032873	3,0068619140
4053	30/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	247.769,33	0,00	82.401,29978912	3,0068619140
4054	30/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	43.309,72	14.403,62784800	3,0068619140
4055	31/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.424.298,72	0,00	4.462.427,93170100	3,0082947950
4056	31/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.544.337,38	0,00	4.169.916,25981921	3,0082947950
4057	01/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	807.656,09	268.346,07075570	3,0097556030
4058	01/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	50.090,55	0,00	16.642,73004400	3,0097556030
4059	01/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.778,08	4.577,80691100	3,0097556030
4060	01/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	807.656,09	268.346,07075570	3,0097556030
4061	01/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	87.120,39	0,00	28.946,00143386	3,0097556030
4062	01/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	83.162,26	27.630,90129880	3,0097556030
4063	01/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.478.101,25	0,00	491.103,41335500	3,0097556030
4064	07/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	56.040,83	18.593,91349800	3,0139341030
4065	08/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	304.100,97	0,00	61.893,71574200	4,9132770000
4066	09/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	184.650,20	61.210,99405771	3,0166182210
4067	13/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.084.997,10	359.351,94018400	3,0193161040
4068	13/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.504.581,10	3.147.925,15013800	3,0193161040
4069	13/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	314.364,80	104.117,88271640	3,0193161040
4070	16/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	95.488,91	31.597,21787500	3,0220670180
4071	17/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	43.823.346,74	14.494.545,39360800	3,0234371310
4072	17/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.435.017,28	0,00	494.192,97540600	4,9272600000
4073	17/11/2023	NTN-B 150850 (5,729999%)	43.823.346,74	0,00	10.000,00000000	4,382,3346740000
4074	17/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	349.562,38	0,00	115.617,54548000	3,0234371310
4075	17/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	48.590,25	16.071,19576000	3,0234371310
4076	21/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.181.538,71	390.436,34587300	3,0262006150
4077	21/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	167.060,31	55.204,63817600	3,0262006150

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4078	22/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	9.324.875,54	1.889.839,72980500	4,9342150000
4079	23/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.258.285,34	0,00	745.579,91511100	3,0288977670
4080	23/11/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.324.875,54	0,00	1.888.983,33053700	4,9364520000
4081	23/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	316.785,25	104.587,63364396	3,0288977670
4082	27/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	755.212,81	0,00	249.109,26139766	3,0316528810
4083	27/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.686,18	0,00	5.174,13457798	3,0316528810
4084	28/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.054.245,33	0,00	3.644.641,64404100	3,0330129570
4085	29/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.451.887,86	478.474,67118500	3,0344090240
4086	29/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.224.162,10	3.369.408,01953000	3,0344090240
4087	29/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	225.952,35	74.463,37926500	3,0344090240
4088	30/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	195.605,24	64.432,76381700	3,0358039670
4089	30/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.948.184,52	1.300.540,00947300	3,0358039670
4090	30/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	121.819,88	40.127,71619100	3,0358039670
4091	30/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	23.559,65	0,00	7.760,59661826	3,0358039670
4092	04/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.577.308,49	0,00	4.139.190,94929900	3,0385910300
4093	04/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.381.833,53	0,00	454.761,27466800	3,0385910300
4094	04/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.086.605,86	0,00	4.306.800,66214700	3,0385910300
4095	04/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	65.974,81	0,00	21.712,30328400	3,0385910300
4096	06/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	49.365,79	16.230,99298900	3,0414522410
4097	06/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	133.351,31	43.844,61745030	3,0414522410
4098	06/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.384,14	2.756,62392000	3,0414522410
4099	06/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.489,07	0,00	818,38207600	3,0414522410
4100	07/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	121.941,17	0,00	40.074,32716600	3,0428750430
4101	07/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	519.410,49	170.697,27894200	3,0428750430
4102	07/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	76.569,16	0,00	25.163,42568000	3,0428750430
4103	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	473.336,18	0,00	95.430,62373100	4,9600030000
4104	08/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	239.401,00	0,00	78.639,79825300	3,0442728150
4105	08/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	170.997,82	0,00	56.170,33373500	3,0442728150
4106	11/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	29.041,98	9.535,53497400	3,0456581700
4107	14/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	243.779,81	0,00	79.931,78309800	3,0498482650

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4108	14/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.570.253,16	3.137.944,03145496	3,0498482650
4109	14/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	324.963,43	106.550,68769462	3,0498482650
4110	14/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	171.053,30	0,00	56.085,83940400	3,0498482650
4111	14/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.076.503,52	352.969,53371500	3,0498482650
4112	18/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	188.644,71	61.799,32570600	3,0525367040
4113	20/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	351.661,51	0,00	115.103,40864028	3,0551789400
4114	20/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.665.255,70	0,00	545.059,95645545	3,0551789400
4115	20/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.391.112,17	0,00	455.329,19587355	3,0551789400
4116	20/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.687.752,58	0,00	3.498.241,11447900	3,0551789400
4117	21/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.948.763,28	1.946.259,06362030	3,0565115360
4118	21/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	183.469,02	60.025,62654800	3,0565115360
4119	21/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.985,31	0,00	7.520,11230000	3,0565115360
4120	21/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	307.469,83	100.595,01702500	3,0565115360
4121	22/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.890.128,39	0,00	3.888.398,30357300	3,0578473350
4122	22/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	144.075,22	47.116,55102952	3,0578473350
4123	22/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000.000,00	6.540.548,89237955	3,0578473350
4124	22/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.005.726,87	0,00	1.964.037,51137500	3,0578473350
4125	22/12/2023	LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 5,95% a.a	20.000.000,00	0,00	400,00000000	50.000,0000000000
4126	28/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	930.773,99	0,00	303.989,87312067	3,0618585430
4127	28/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	25.959,97	8.478,50076500	3,0618585430
4128	28/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.559.736,69	0,00	2.469.002,59559100	3,0618585430
4129	29/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	282.801,00	0,00	92.322,31165600	3,0631923630
Total			268.726.989,38	192.616.345,56		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.452.895,07

Value-At-Risk: 0,39%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
OSASCO - CONSOLIDADO		0,39		0,39			885.987.250,53	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,19%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545		4,06	0,06	4,05			17.087.175,44	1,93
LTN 01012024 (6,030000%)		0,00	0,00	1,03			6.028.599,10	0,68
LTN 01012024 (6,100000%)		0,00	0,00	1,03			6.037.581,19	0,68
NTN-B 150545 (4,930000%)		0,08	0,00	0,09			28.821.093,56	3,25
NTN-B 150555 (5,742000%)		0,08	0,00	0,09			43.857.325,93	4,95
NTN-B 150840 (4,200000%)		0,08	0,00	0,08			28.900.931,16	3,26
NTN-B 150850 (5,729999%)		0,15	0,00	0,15			44.424.542,05	5,01
NTN-B 150850 (5,730001%)		0,08	0,00	0,09			45.624.004,68	5,15
NTN-B 150850 (5,740002%)		0,08	0,00	0,09			44.367.381,38	5,01
NTN-B 150850 (5,860000%)		0,15	0,00	0,16			43.690.736,25	4,93
NTN-F 2029 (12,000000%)		0,01	0,00	0,02			5.488.792,58	0,62
Sub-total	0,89	0,23	0,07		0,28	1,14	314.328.163,32	35,48

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		0,36	0,00	0,36			10.308.300,40	1,16
BB PREV RF IDKA2		1,15	0,02	0,16			15.104.837,76	1,70
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,98	0,00	0,31			4.273.304,77	0,48
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,26	0,01	0,02			9.069.821,67	1,02
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,72	0,02	0,71			33.439.009,19	3,77

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	-0,00	0,01			53.898.801,40	6,08
Sub-total	0,39	0,46	0,05		0,51	1,09	126.094.075,19	14,23

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	-0,00	0,02			124.378.023,92	14,04
BRA1 FI RENDA FIXA		0,14	-0,00	2,24			186.769,73	0,02
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,01			106.822.968,46	12,06
TMJ IMA-B FI RF		2,14	-0,00	3,28			730.077,85	0,08
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5		1,01	0,00	1,63			739.706,86	0,08
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,23	0,03	0,02			25.061.934,56	2,83
FI BARCELONA RENDA FIXA		0,34	-0,00	0,34			386.304,23	0,04
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B		0,49	0,00	2,26			180.118,37	0,02
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,02			96.652.873,11	10,91
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA		0,25	-0,00	2,28			24.748,55	0,00
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5		0,43	-0,00	1,31			885.751,67	0,10
Sub-total	0,31	0,09	0,03		0,07	0,92	356.049.277,31	40,19

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 5,95% a.a		0,51	-0,00	0,51			20.039.387,18	2,26
Sub-total	1,56	0,51	-0,00		0,01	0,20	20.039.387,18	2,26

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,09	-0,00	0,09			3.254.840,20	0,37
ILLUMINATI FIDC		0,31	0,00	0,30			1.138.681,27	0,13
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC		0,16	-0,00	0,16			301.944,01	0,03
Sub-total	2,17	0,12	-0,00		-0,13	0,61	4.695.465,48	0,53

Artigo 7º V, Alínea b

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÁ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO		0,78	-0,00	0,78			538.746,70	0,06
Sub-total	2,06	0,78	-0,00		-0,55	-0,23	538.746,70	0,06

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,55%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS		5,80	0,03	2,49			4.628.040,19	0,52
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA		8,18	0,05	3,10			6.293.953,92	0,71
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,35	0,03	3,61			3.300.571,70	0,37
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,77	0,04	0,41			3.988.234,92	0,45
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE		8,31	0,03	3,27			3.618.111,21	0,41
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES		6,76	0,05	1,75			6.611.084,09	0,75
Sub-total	12,25	7,55	0,22		0,42	5,99	28.439.996,03	3,21

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,93%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,24	0,01	0,59			8.186.902,36	0,92
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		6,00	0,01	9,02			7.709.148,84	0,87
Sub-total	9,24	5,93	0,02		0,18	2,55	15.896.051,20	1,79

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,03%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP		0,07	0,00	0,09			368.489,33	0,04
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO		0,08	-0,00	0,08			3.247.943,24	0,37
Sub-total	0,06	0,07	-0,00		-17,03	-0,19	3.616.432,57	0,41

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA		0,03	0,00	0,04			8.719.489,73	0,98
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP		0,01	-0,00	0,06			1.119.268,16	0,13
Sub-total	0,46	0,03	0,00		-2,23	-0,13	9.838.757,89	1,11

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,12%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO		0,13	-0,00	2,42			6.070.861,77	0,69
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII		0,03	-0,00	2,39			60.314,00	0,01
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		0,05	-0,00	2,38			319.721,89	0,04
Sub-total	0,54	0,12	-0,00		-1,31	0,19	6.450.897,66	0,73

(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 (%)