



LDB
EMPRESAS

OSASCO - CONSOLIDADO
1º TRIMESTRE 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 28.03.2024.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 93,20%

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	6,67	-0,07	-0,70	-1,80	16.779.648,11	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (4,930000%)	0,51	0,03	0,94	2,88	29.650.199,04	3,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,742000%)	0,63	0,03	1,00	3,07	45.203.285,58	5,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,200000%)	0,42	0,03	0,88	2,70	28.974.758,32	3,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,729999%)	2,91	0,03	1,00	3,07	44.521.232,24	4,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730001%)	0,60	0,03	1,00	3,07	45.723.305,51	5,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,740002%)	0,60	0,03	1,00	3,07	44.463.405,89	4,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,860000%)	2,96	0,03	1,01	3,10	43.778.163,60	4,85
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2029 (12,000000%)	0,32	0,04	0,90	2,79	5.360.644,30	0,59
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,71	0,03	0,89	2,74	304.454.642,59	33,74

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	0,88	0,04	0,93	2,81	30.514.262,03	3,38	2.697.458.581,89	1,13
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,61	0,09	0,88	2,05	2.337.689,84	0,26	5.882.975.676,66	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,58	0,10	0,90	2,08	4.362.200,62	0,48	5.081.326.495,59	0,09

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

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 IMA-B 5 LP FIC FI	1,70	0,08	0,75	2,00	2.216.343,01	0,25	5.297.621.800,71	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,36	0,03	0,58	1,80	34.040.341,35	3,77	5.431.217.487,91	0,63
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,06	0,04	0,81	2,58	45.064.759,13	4,99	5.407.441.796,74	0,83
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,73	0,04	0,78	2,26	118.535.595,98	13,14		

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	0,87	2,72	116.169.420,73	12,87	16.216.695.874,70	0,72
QUELUZ	RJI	BRA1 FI RENDA FIXA	0,33	-0,01	-0,05	0,10	186.962,24	0,02	3.682.011,91	5,08
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,85	2,65	102.748.189,65	11,39	16.860.564.075,44	0,61
VERITAS	RJI	TMJ IMA-B FI RF	23,92	0,10	-19,07	-15,28	618.499,39	0,07	37.499.126,52	1,65
GENIAL	RJI	TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	55,31	-0,07	-37,41	-50,16	368.672,65	0,04	26.486.852,70	1,39
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,70	0,08	0,74	1,97	5.447.979,74	0,60	850.459.230,83	0,64
VERITAS	RJI	FI BARCELONA RENDA FIXA	3,29	-0,57	0,24	1,37	391.577,71	0,04	26.386.637,34	1,48
GENIAL	PLANNER	FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	36,18	-0,02	-3,98	-4,44	172.123,65	0,02	6.054.649,72	2,84
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	0,91	2,92	124.703.300,14	13,82	10.645.688.775,75	1,17
VERITAS	RJI	MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,03	-0,34	-6,34	-16,79	20.592,82	0,00	631.379,34	3,26
RJI	RJI	TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	16,25	0,01	6,64	-2,97	859.435,95	0,10	42.798.746,49	2,01
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,19	0,04	0,78	2,54	351.686.754,67	38,98		

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	2,80	0,22	1,15	3,19	20.679.458,78	2,29		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - DAYC LF0024007JP - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a	3,84	0,94	0,94	0,94	10.094.160,91	1,12		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,00% a.a	1,65	0,20	1,18	1,78	10.177.634,91	1,13		

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,50% a.a	2,50	0,21	1,13	2,54	10.254.119,35	1,14		
DAYCOVAL	DAYCOVAL	LETRA FINANCEIRA - DAYC LF0024004PL - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a	1,74	0,18	1,17	1,81	10.181.190,53	1,13		
Sub-total Artigo 7º IV			2,37	0,33	1,16	2,86	61.386.564,48	6,80		

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	1,41	-0,41	-0,41	-1,45	3.207.607,53	0,36	70.975.185,62	4,52
QUELUZ	PLANNER	ILLUMINATI FIDC	10,80	-2,11	-2,11	-2,06	922.595,09	0,10	50.297.585,13	1,83
GENIAL	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	2,66	-0,91	-0,91	-3,14	292.452,04	0,03	6.031.972,10	4,85
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			3,37	-0,80	-0,80	-1,69	4.422.654,66	0,49		

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	1,58	-0,01	-0,69	-1,25	529.543,64	0,06	21.250.763,41	2,49
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,58	-0,01	-0,69	-1,25	529.543,64	0,06		
Renda Fixa			0,39	0,05	0,84	2,59	841.015.756,02	93,20		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

3,07%

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	12,78	0,20	-1,24	-3,98	4.443.782,71	0,49	237.993.746,59	1,87
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	15,44	0,17	-0,73	-4,18	6.031.105,95	0,67	208.788.421,90	2,89
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	16,21	0,24	0,22	-0,80	3.274.051,99	0,36	1.424.304.935,88	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	20,62	0,29	2,09	-4,27	3.817.981,22	0,42	686.836.540,62	0,56
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,75	1,04	1,36	0,85	3.648.783,17	0,40	716.419.031,98	0,51
SAFRA	SAFRA	SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	16,09	0,76	0,69	-1,54	6.509.512,69	0,72	159.758.478,12	4,07
Sub-total Artigo 8º I			15,26	0,45	0,29	-2,51	27.725.217,73	3,07		
Renda Variável			15,26	0,45	0,29	-2,51	27.725.217,73	3,07		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,99%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,00	0,35	3,48	14,98	9.413.381,71	1,04	2.280.222.056,45	0,41
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	12,80	0,71	2,71	10,30	8.503.347,63	0,94	710.413.926,44	1,20
Sub-total Artigo 9º III			13,05	0,52	3,11	12,71	17.916.729,34	1,99		
Investimentos no Exterior			13,05	0,52	3,11	12,71	17.916.729,34	1,99		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,07%

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	1,20	-0,10	-0,10	-0,14	367.972,96	0,04	41.556.229,01	0,89
QUELUZ	RJI	FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	1,57	-0,01	-0,07	-0,26	3.239.511,77	0,36	140.512.501,42	2,31
Sub-total Artigo 10º I			3,43	-0,01	-0,07	-0,25	3.607.484,73	0,40		

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	58,19	-0,13	-0,13	-43,95	4.886.956,05	0,54	68.720.809,22	7,11
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,17	-0,05	-0,05	-0,14	1.117.747,63	0,12	27.538.232,69	4,06
Sub-total Artigo 10º II			49,61	-0,11	-0,11	-38,97	6.004.703,68	0,67		
Investimentos Estruturados			33,80	-0,08	-0,10	-28,56	9.612.188,41	1,07		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,67%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
GRAPHEN	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	6,36	0,01	0,01	0,18	5.669.762,30	0,63	71.649.094,13	7,91
QUELUZ	RJI	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	0,50	-0,09	-0,09	-0,31	60.127,28	0,01	141.761.721,17	0,04
VERITAS	RJI	SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	3,11	0,68	0,68	3,01	329.353,49	0,04	66.159.848,00	0,50
Sub-total Artigo 11º			5,95	0,05	0,05	0,32	6.059.243,07	0,67		
Fundos Imobiliários			5,95	0,05	0,05	0,32	6.059.243,07	0,67		
Total			0,86	0,07	0,85	2,10	902.329.134,57	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	344.119,36
Sub-total Disponibilidades Financeiras	344.119,36
Total	902.673.253,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	304.454.642,59	33,74	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	118.535.595,98	13,14	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	351.686.754,67	38,98	0,00	20,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	61.386.564,48	6,80	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	4.422.654,66	0,49	0,00	1,00	1,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	529.543,64	0,06	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	841.015.756,02	93,20					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	27.725.217,73	3,07	0,00	2,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	27.725.217,73	3,07					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	17.916.729,34	1,99	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	17.916.729,34	1,99					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.607.484,73	0,40	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	6.004.703,68	0,67	0,00	1,00	1,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	9.612.188,41	1,07					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	6.059.243,07	0,67	0,00	1,00	1,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	6.059.243,07	0,67					5,00
Total		902.329.134,57	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	0,89 106,25	2,74 104,49	2,74 104,49	5,40 97,45	10,25 82,90	2.672.466,43	8.181.303,55
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,78 94,05	2,26 86,25	2,26 86,25	5,12 92,49	11,43 92,43	969.031,08	2.737.434,37
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,78 93,80	2,54 96,93	2,54 96,93	5,44 98,29	12,24 99,04	2.780.171,38	9.036.819,69
Artigo 7º IV % do CDI	1,16 139,73	2,86 108,93	2,86 108,93			679.867,38	1.347.177,30
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,80 -95,98	-1,69 -64,42	-1,69 -64,42	-2,20 -39,75	-9,36 -75,73	-35.664,90	-76.057,47
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-0,69 -82,85	-1,25 -47,68	-1,25 -47,68	-2,88 -52,08	-2,35 -19,01	-3.682,25	-6.711,19
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,29 1,00	-2,51 2,02	-2,51 2,02	10,04 0,14	27,25 1,51	79.300,52	-714.778,30
Artigo 9º III % do CDI	3,11 373,16	12,71 484,31	12,71 484,31	20,79 375,49	28,01 226,54	540.446,84	2.020.678,14
Artigo 10º I % do CDI	-0,07 -8,27	-0,25 -9,43	-0,25 -9,43	-0,91 -16,39	-0,88 -7,12	-2.488,73	-8.947,84
Artigo 10º II % do CDI	-0,11 -13,73	-38,97 -1.484,68	-38,97 -1.484,68	-39,21 -708,10	-39,70 -321,12	-6.878,71	-3.834.054,21
Artigo 11º % do CDI	0,05 5,49	0,32 12,31	0,32 12,31	0,79 14,29	2,87 23,23	2.769,76	20.057,24
OSASCO - CONSOLIDADO (Total)						7.675.338,80	18.702.921,28

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\$)
NTN-B 150545	16.897.827,83	0,00	0,00	0,00	16.779.648,11	-118.179,72	-307.527,33
NTN-B 150545 (4,930000%)	29.375.039,84	0,00	0,00	0,00	29.650.199,04	275.159,20	829.105,48
NTN-B 150555 (5,742000%)	44.756.358,35	0,00	0,00	0,00	45.203.285,58	446.927,23	1.345.959,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150840 (4,200000%)	28.721.763,89	0,00	0,00	0,00	28.974.758,32	252.994,43	771.232,23
NTN-B 150850 (5,729999%)	44.081.474,28	0,00	0,00	0,00	44.521.232,24	439.757,96	1.342.056,38
NTN-B 150850 (5,730001%)	45.271.674,08	0,00	0,00	0,00	45.723.305,51	451.631,43	1.378.291,91
NTN-B 150850 (5,740002%)	44.023.880,78	0,00	0,00	0,00	44.463.405,89	439.525,11	1.341.390,70
NTN-B 150850 (5,860000%)	43.341.512,09	0,00	0,00	0,00	43.778.163,60	436.651,51	1.332.793,54
NTN-F 2029 (12,000000%)	5.312.645,02	0,00	0,00	0,00	5.360.644,30	47.999,28	145.181,28
	301.782.176,16	0,00	0,00	0,00	304.454.642,59	2.672.466,43	

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 IMA-B 5 LP FIC FI	9.182.257,59	0,00	-7.000.000,00	0,00	2.216.343,01	34.085,42	146.521,34
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	15.280.030,35	0,00	-13.000.000,00	0,00	2.337.689,84	57.659,49	232.852,08
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	30.234.437,62	0,00	0,00	0,00	30.514.262,03	279.824,41	501.875,21
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.323.374,74	0,00	0,00	0,00	4.362.200,62	38.825,88	88.895,85
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	33.844.778,75	0,00	0,00	0,00	34.040.341,35	195.562,60	601.332,16
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	44.701.685,85	0,00	0,00	0,00	45.064.759,13	363.073,28	1.165.957,73
	137.566.564,90	0,00	-20.000.000,00	0,00	118.535.595,98	969.031,08	

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	68.958.179,46	48.817.252,76	-15.903.932,27	0,00	102.748.189,65	876.689,70	2.661.277,20
BRA1 FI RENDA FIXA	187.051,58	0,00	0,00	0,00	186.962,24	-89,34	192,51
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	103.614.409,10	20.000.000,00	0,00	0,00	124.703.300,14	1.088.891,04	3.050.427,03
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	25.367.988,18	0,00	-20.000.000,00	0,00	5.447.979,74	79.991,56	386.045,18
FI BARCELONA RENDA FIXA	390.639,67	0,00	0,00	0,00	391.577,71	938,04	5.273,48
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	124.066.337,62	11.687.520,72	-20.639.338,24	0,00	116.169.420,73	1.054.900,63	3.454.683,13
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	179.261,58	0,00	0,00	0,00	172.123,65	-7.137,93	-7.994,72

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	21.986,20	0,00	0,00	0,00	20.592,82	-1.393,38	-4.155,73
TMJ IMA-B FI RF	764.260,41	0,00	0,00	0,00	618.499,39	-145.761,02	-111.578,46
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	805.953,68	0,00	0,00	0,00	859.435,95	53.482,27	-26.315,72
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	589.012,84	0,00	0,00	0,00	368.672,65	-220.340,19	-371.034,21
	324.945.080,32	80.504.773,48	-56.543.270,51	0,00	351.686.754,67	2.780.171,38	

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 - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,00% a.a	10.058.911,14	0,00	0,00	0,00	10.177.634,91	118.723,77	177.634,91
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,50% a.a	10.139.573,17	0,00	0,00	0,00	10.254.119,35	114.546,18	254.119,35
LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 5,95% a.a	20.444.755,73	0,00	0,00	0,00	20.679.458,78	234.703,05	640.071,60
LETRA FINANCEIRA - DAYC LF0024004PL - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a	10.063.457,06	0,00	0,00	0,00	10.181.190,53	117.733,47	181.190,53
LETRA FINANCEIRA - DAYC LF0024007JP - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	10.094.160,91	94.160,91	94.160,91
	50.706.697,10	10.000.000,00	0,00	0,00	61.386.564,48	679.867,38	

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	942.496,98	0,00	0,00	0,00	922.595,09	-19.901,89	-19.332,83
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	295.134,46	0,00	0,00	0,00	292.452,04	-2.682,42	-9.491,97
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	3.220.688,12	0,00	0,00	0,00	3.207.607,53	-13.080,59	-47.232,67
	4.458.319,56	0,00	0,00	0,00	4.422.654,66	-35.664,90	

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	533.225,89	0,00	0,00	0,00	529.543,64	-3.682,25	-6.711,19

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
	533.225,89	0,00	0,00	0,00	529.543,64	-3.682,25	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	3.266.887,01	0,00	0,00	0,00	3.274.051,99	7.164,98	-26.519,71
FIA CAIXA DIVIDENDOS	4.499.382,54	0,00	0,00	0,00	4.443.782,71	-55.599,83	-184.257,48
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	6.075.409,07	0,00	0,00	0,00	6.031.105,95	-44.303,12	-262.847,97
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3.739.661,47	0,00	0,00	0,00	3.817.981,22	78.319,75	-170.253,70
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	3.599.936,28	0,00	0,00	0,00	3.648.783,17	48.846,89	30.671,96
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	6.464.640,84	0,00	0,00	0,00	6.509.512,69	44.871,85	-101.571,40
	27.645.917,21	0,00	0,00	0,00	27.725.217,73	79.300,52	

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	9.096.998,58	0,00	0,00	0,00	9.413.381,71	316.383,13	1.226.479,35
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	8.279.283,92	0,00	0,00	0,00	8.503.347,63	224.063,71	794.198,79
	17.376.282,50	0,00	0,00	0,00	17.916.729,34	540.446,84	

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	3.241.644,37	0,00	0,00	0,00	3.239.511,77	-2.132,60	-8.431,47
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	368.329,09	0,00	0,00	0,00	367.972,96	-356,13	-516,37
	3.609.973,46	0,00	0,00	0,00	3.607.484,73	-2.488,73	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	1.118.257,50	0,00	0,00	0,00	1.117.747,63	-509,87	-1.520,53
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	4.893.324,89	0,00	0,00	0,00	4.886.956,05	-6.368,84	-3.832.533,68
	6.011.582,39	0,00	0,00	0,00	6.004.703,68	-6.878,71	

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	5.669.173,69	0,00	0,00	0,00	0,00	5.669.762,30	588,61	10.612,36
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	327.120,29	0,00	0,00	0,00	0,00	329.353,49	2.233,20	9.631,60
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	60.179,33	0,00	0,00	0,00	0,00	60.127,28	-52,05	-186,72
	6.056.473,31	0,00	0,00	0,00	0,00	6.059.243,07	2.769,76	

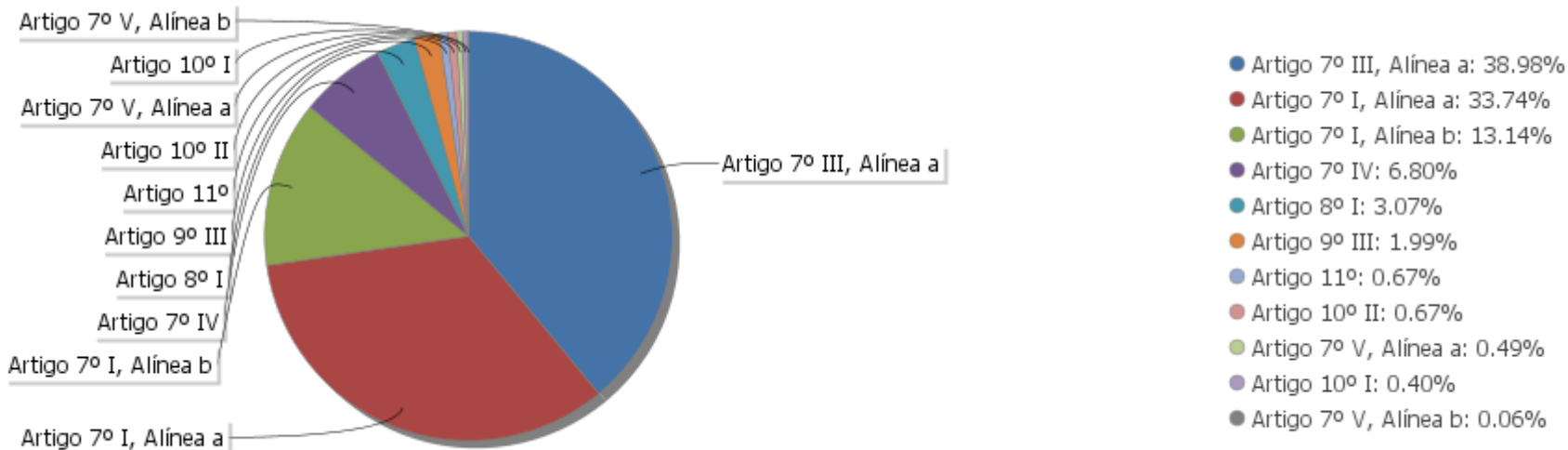
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

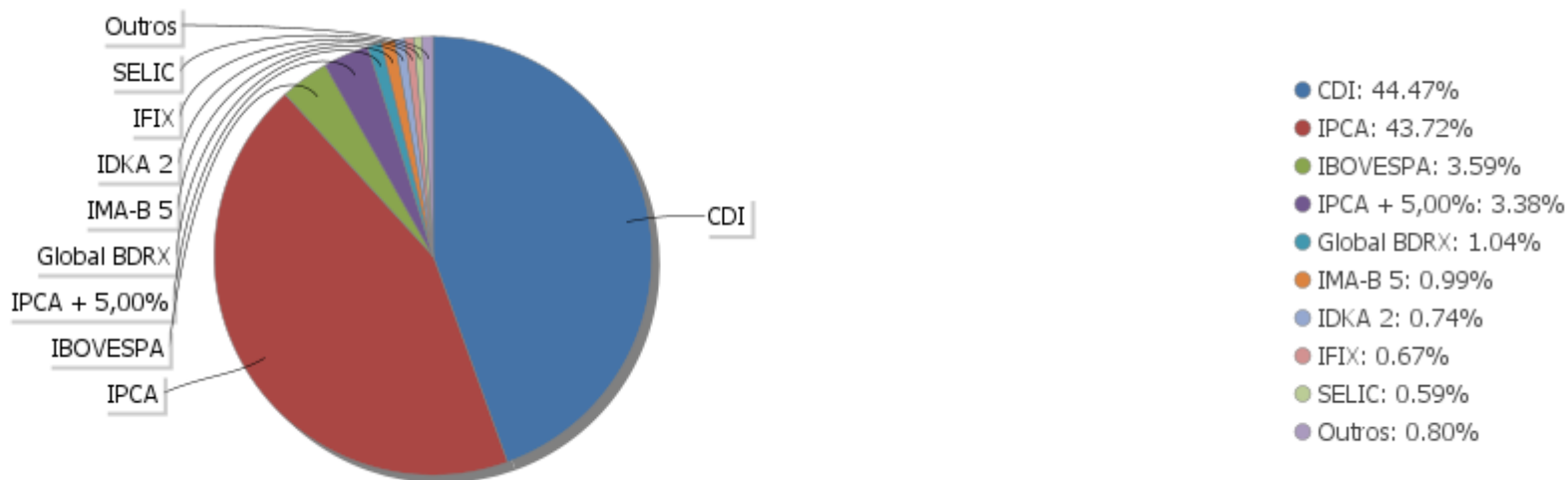
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	494.961.998,33	54,85		494.961.998,33	54,85	
de 31 dias a 365 dias	33.848.441,30	3,75		528.810.439,63	58,61	
acima de 365 dias	373.518.694,94	41,39		902.329.134,57	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

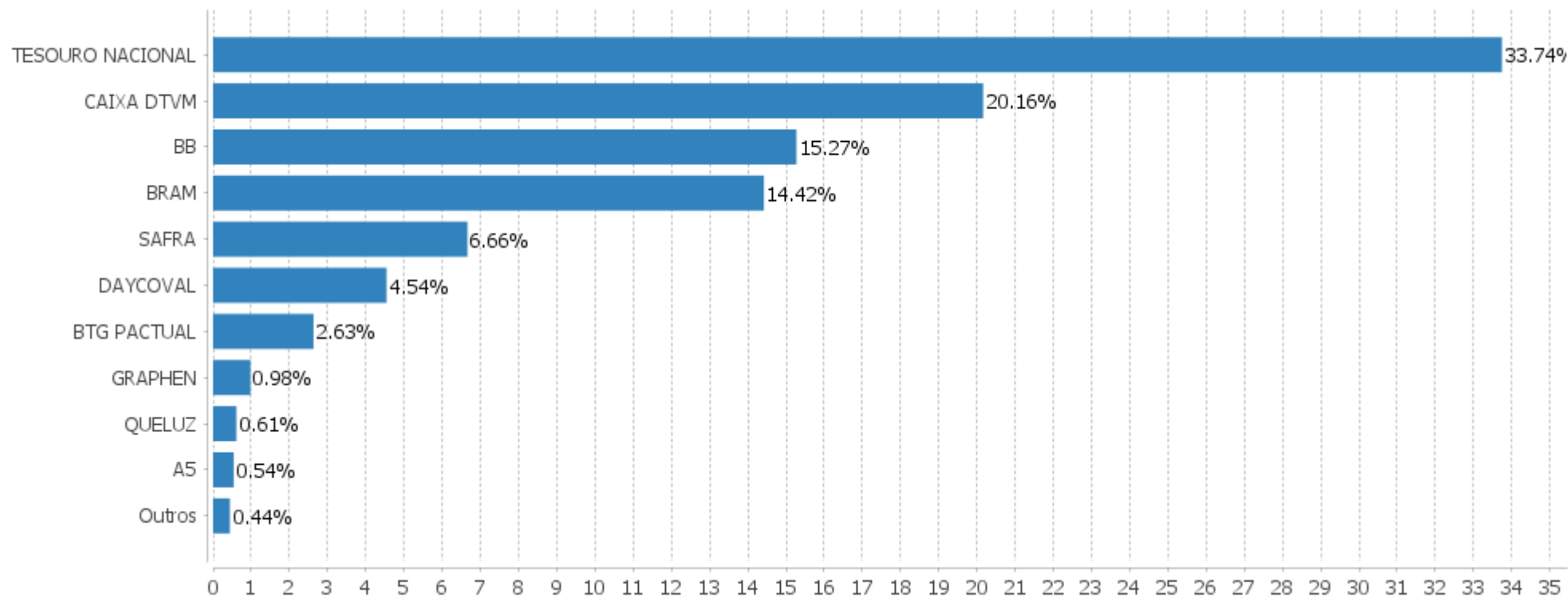


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,75	0,49	0,85										2,10
IPCA + 5,00%	0,85	1,20	0,55										2,62
p.p. indexador	-0,09	-0,71	0,30										-0,52
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

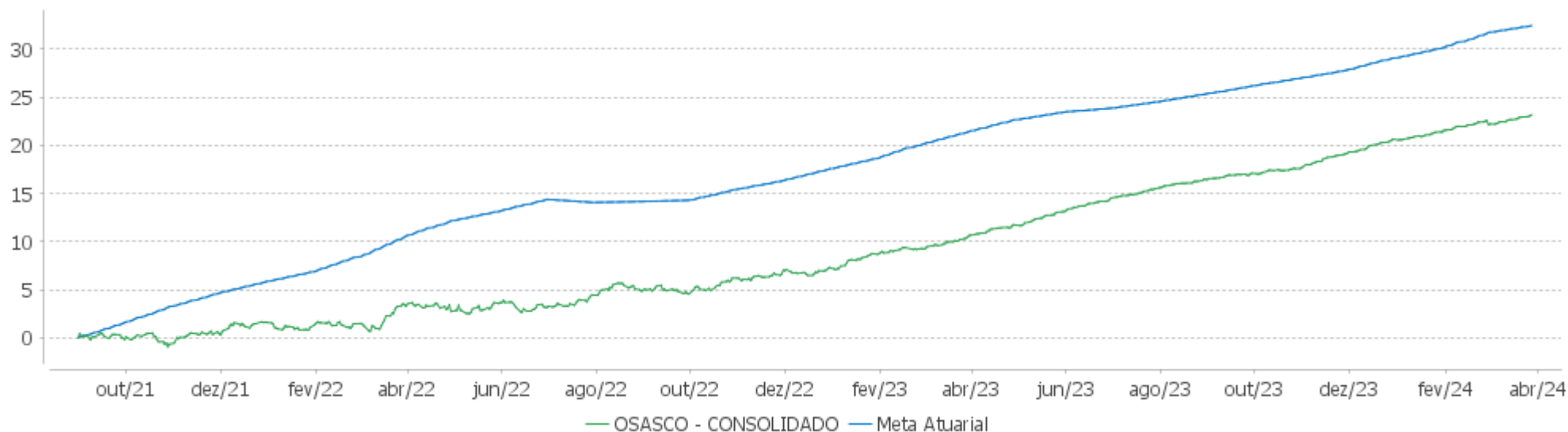
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	45,16	03 meses	2,10	2,62	-0,52	0,99
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	54,84	06 meses	5,20	4,96	0,23	0,92
			12 meses	11,31	9,02	2,29	0,86
			24 meses	19,27	19,75	-0,48	1,94
Maior rentabilidade da Carteira	1,80	2022-03	Desde 31/08/2021	23,18	32,58	-9,40	2,28
Menor rentabilidade da Carteira	-0,53	2022-04					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

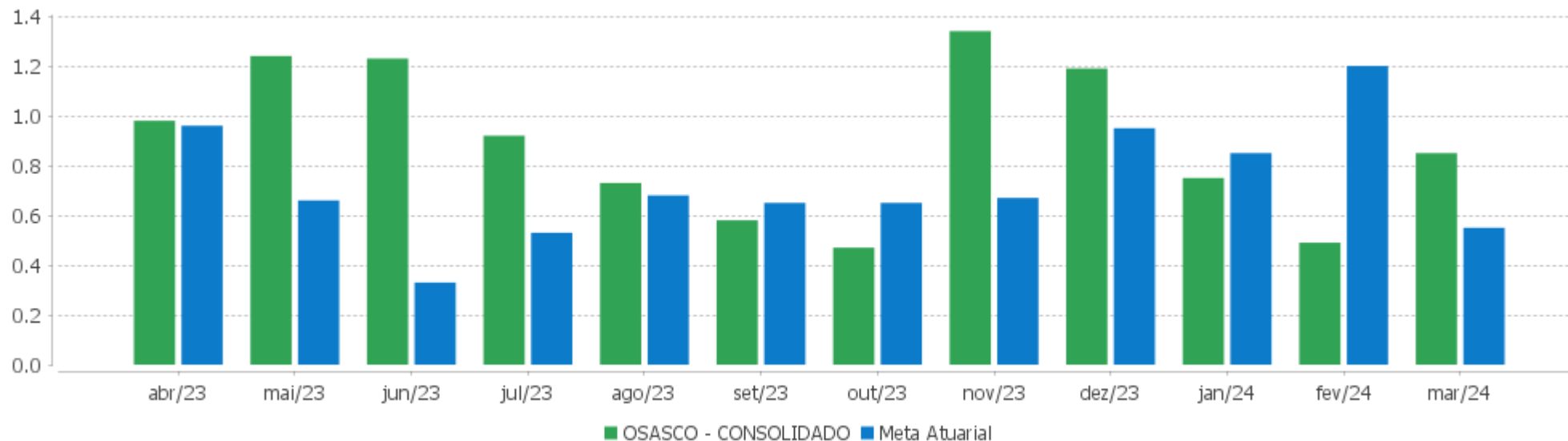


Patrimônio Líquido



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.	1,15 0,99	3,19 1,78	3,19 1,78				
LETRA FINANCEIRA - DAYC LF0024007JP - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,94 0,82	0,94 0,82					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,00% a.a Var. IPCA p.p.	1,18 1,02	1,78 1,05					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,50% a.a Var. IPCA p.p.	1,13 0,97	2,54 1,40					
LETRA FINANCEIRA - DAYC LF0024004PL - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a Var. IPCA p.p.	1,17 1,01	1,81 1,04					
PIATÁ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO % do CDI	-0,69 -82,85	-1,25 -47,68	-1,25 -47,68	-2,88 -52,08	-2,35 -19,01	-59,40 -217,73	-62,75 -177,05
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	-0,70 -0,86	-1,80 -3,22	-1,80 -3,22	4,80 2,28	15,07 11,14	19,48 10,72	17,89 -3,16
NTN-B 150555 (5,742000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,07 1,65	3,07 1,65	5,62 3,10	10,29 6,37	19,45 10,69	32,15 11,10
NTN-B 150545 (4,930000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,78	2,88 1,46	2,88 1,46	5,16 2,65	9,40 5,47	20,91 12,15	36,86 15,82
NTN-F 2029 (12,000000%) Var. SELIC p.p.	0,90 0,07	2,79 0,16	2,79 0,16	5,79 0,26	11,91 -0,45	25,34 -1,94	33,22 -2,22
NTN-B 150840 (4,200000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,72	2,70 1,29	2,70 1,29	4,75 2,24	8,60 4,67	19,19 10,43	34,21 13,16
NTN-B 150850 (5,729999%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,07 1,65	3,07 1,65	5,59 3,08	7,21 3,28		
NTN-B 150850 (5,730001%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,07 1,65	3,07 1,65	5,59 3,08	10,26 6,34	22,80 14,04	35,83 14,78
NTN-B 150850 (5,860000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,10 1,68	3,10 1,68	5,66 3,15	7,29 3,37		
NTN-B 150850 (5,740002%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,07 1,65	3,07 1,65	5,60 3,08	10,27 6,35	22,82 14,06	35,86 14,81
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,88 -0,12	2,05 -0,19	2,05 -0,19	4,99 -0,20	9,24 -0,24	20,06 -0,61	30,43 -1,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,58	1,80	1,80	4,77	11,99	25,10	28,10

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,42	0,38	0,38	2,26	8,07	16,35	7,05
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,02	2,00 -0,06	2,00 -0,06	4,98 -0,11	9,44 -0,18	20,53 -0,48	30,63 -0,93
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,90 -0,10	2,08 -0,16	2,08 -0,16	5,00 -0,20	9,45 -0,03	19,97 -0,69	30,39 -1,24
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,93 0,38	2,81 0,19	2,81 0,19	5,06 0,09			
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	0,81 97,45	2,58 98,47	2,58 98,47	5,44 98,17	12,16 98,37	26,87 98,50	35,04 98,87
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,41 -48,73	-1,45 -55,29	-1,45 -55,29	-2,65 -47,85	-4,71 -38,13	-2,97 -10,89	0,24 0,68
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC % do CDI	-0,91 -109,05	-3,14 -119,77	-3,14 -119,77	-5,23 -94,46	-8,33 -67,40	-13,80 -50,58	-29,74 -83,92
ILLUMINATI FIDC Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,11 -2,74	-2,06 -4,91	-2,06 -4,91	-0,11 -5,55	-20,30 -30,34	-30,46 -52,52	-37,02 -81,03
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,34 -6,42	-16,79 -16,97	-16,79 -16,97	-28,42 -33,35	-43,24 -55,05	-56,15 -76,36	-71,70 -97,32
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,98 -4,06	-4,44 -4,61	-4,44 -4,61	3,98 -0,96	1,27 -10,54	7,03 -13,18	9,77 -15,85
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,74 -0,03	1,97 -0,09	1,97 -0,09	4,93 -0,16	9,33 -0,29	20,22 -0,78	30,15 -1,41
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,91 109,23	2,92 111,29	2,92 111,29	6,02 108,71	13,31 107,68	28,84 105,71	37,92 106,99
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,85 102,32	2,65 100,79	2,65 100,79	5,55 100,26	12,40 100,31	27,30 100,05	35,92 101,34
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-37,41 -38,18	-50,16 -52,22	-50,16 -52,22	-59,45 -64,54	-59,99 -69,62	-59,15 -80,16	-67,95 -99,51
FI BARCELONA RENDA FIXA % do CDI	0,24 28,81	1,37 52,01	1,37 52,01	1,97 35,62	5,13 41,47	-30,71 -112,55	-41,54 -117,19
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,87 104,20	2,72 103,65	2,72 103,65	5,74 103,60	12,93 104,59	27,88 102,20	36,71 103,58
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	6,64 5,87	-2,97 -5,03	-2,97 -5,03	-12,35 -17,44	-7,33 -16,95	-3,67 -24,68	-2,94 -34,50
BRA1 FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,05 -0,13	0,10 -0,07	0,10 -0,07	0,41 -4,53	3,30 -8,51	10,11 -10,11	12,07 -13,55
TMJ IMA-B FI RF	-19,07	-15,28	-15,28	-15,36	-15,49	-15,57	-27,11

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

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 TOTAL p.p.	-19,15	-15,46	-15,46	-20,29	-27,30	-35,78	-52,73
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,22 0,93	-0,80 3,73	-0,80 3,73	11,91 2,01	23,98 -1,76	-0,33 -7,09	-24,19 -34,03
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	1,36 2,07	0,85 5,38	0,85 5,38	15,38 5,47	36,06 10,32	22,66 15,91	34,78 24,94
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA Var. IBOVESPA p.p.	-0,73 -0,02	-4,18 0,35	-4,18 0,35	7,27 -2,63	28,96 3,22	17,62 10,87	26,24 16,40
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	2,09 -0,06	-4,27 -0,18	-4,27 -0,18	6,32 -0,61	22,85 -1,28	-11,79 -1,22	-21,04 -1,71
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-1,24 -0,53	-3,98 0,55	-3,98 0,55	9,56 -0,35	25,38 -0,36	16,39 9,64	28,09 18,26
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	0,69 1,40	-1,54 2,99	-1,54 2,99	11,50 1,60	26,73 0,99	0,96 -5,80	-9,54 -19,38
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	3,48 -0,57	14,98 -0,90	14,98 -0,90	23,77 -1,11	32,44 -2,21	27,69 -2,86	18,24 -5,60
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	2,71 3,41	10,30 14,83	10,30 14,83	17,65 7,75	23,43 -2,31	15,35 8,59	8,10 -1,74
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO % do CDI	-0,07 -7,89	-0,26 -9,89	-0,26 -9,89	-0,92 -16,69	-2,87 -23,25	-17,56 -64,37	-21,75 -61,37
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP Var. IPCA + 7,00% p.p.	-0,10 -0,80	-0,14 -3,23	-0,14 -3,23	-0,76 -6,69	-2,44 -13,49	11,26 -13,09	-23,35 -71,44
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,13 -15,62	-43,95 -1.674,59	-43,95 -1.674,59	-44,19 -798,08	-44,68 -361,40	-49,33 -180,82	-50,08 -141,28
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,05 -0,67	-0,14 -2,99	-0,14 -2,99	-0,29 -5,74	-0,57 -10,61	-1,21 -23,27	-2,31 -46,31
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	0,68 -0,75	3,01 0,09	3,01 0,09	2,14 -3,73	1,26 -22,18	5,72 -16,88	3,39 -16,33
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO Var. IFIX p.p.	0,01 -1,42	0,18 -2,74	0,18 -2,74	0,73 -5,14	3,02 -20,43	7,27 -15,32	9,24 -10,48
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,09 -1,52	-0,31 -3,23	-0,31 -3,23	-0,70 -6,57	-1,63 -25,07	15,11 -7,48	-34,79 -54,51
OSASCO - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,85 0,30	2,10 -0,52	2,10 -0,52	5,20 0,23	11,31 2,29	19,27 -0,52	
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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 RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		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
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO 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	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)	que, em cada 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 MULTIESTRATÉGIA	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: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	Não se aplica	Não se aplica				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

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	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150545 (4,930000%)	29.650.199,04	4,930000	26.494.181,24	5,891100	-3.156.017,80
NTN-B 150555 (5,742000%)	45.203.285,58	5,742000	44.392.611,13	5,874700	-810.674,45
NTN-B 150840 (4,200000%)	28.974.758,32	4,200000	24.396.074,47	5,857500	-4.578.683,85
NTN-B 150850 (5,729999%)	44.521.232,24	5,729999	43.643.589,77	5,883900	-877.642,47
NTN-B 150850 (5,730001%)	45.723.305,51	5,730001	44.821.966,69	5,883900	-901.338,82
NTN-B 150850 (5,740002%)	44.463.405,89	5,740002	43.643.589,77	5,883900	-819.816,12
NTN-B 150850 (5,860000%)	43.778.163,60	5,860000	43.643.589,77	5,883900	-134.573,83
NTN-F 2029 (12,000000%)	5.360.644,30	12,000000	5.611.233,04	10,657600	250.588,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4158	22/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	357.601,46	115.972,56369600	3,0835005160
4159	22/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	85.022,20	0,00	27.573,27250500	3,0835005160
4160	25/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.584.825,59	513.302,47255000	3,0875081940
4161	25/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	374.629,91	121.337,30065200	3,0875081940
4162	25/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	283.227,60	91.733,39217400	3,0875081940
4163	29/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	228.345,68	73.894,96521600	3,0901385410
4164	29/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.002.762,62	1.295.334,35698500	3,0901385410
4165	29/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	206.552,71	66.842,54031300	3,0901385410
4166	29/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.751,06	0,00	7.362,47249000	3,0901385410
4167	31/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.544.473,82	0,00	4.056.017,86319700	3,0928053680
4168	31/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.874.414,58	0,00	3.839.366,90709900	3,0928053680
4169	31/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.273.216,87	0,00	735.001,59225000	3,0928053680
4170	01/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	54.040,40	17.465,39192100	3,0941418460
4171	02/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	169.740,76	0,00	54.836,50495400	3,0953971290
4172	02/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	245.324,70	0,00	79.254,67711449	3,0953971290
4173	05/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	120.973,57	39.065,98003600	3,0966475150
4174	05/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.277.970,27	0,00	735.624,65826800	3,0966475150
4175	05/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	48.073,32	0,00	15.524,31129702	3,0966475150
4176	06/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000.000,00	1.613.953,84832700	3,0979820180
4177	06/02/2024	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.000.000,00	0,00	298.272,23000000	16,7632099000
4178	07/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000.000,00	3.226.540,39900300	3,0992948370
4179	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	303.509,35	0,00	60.043,19613800	5,0548500000
4180	07/02/2024	LETRA FINANCEIRA - DAYC LF0024004PL - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a	10.000.000,00	0,00	200,00000000	50.000,0000000000
4181	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	412.447,62	133.023,29776127	3,1005667950
4182	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.095.125,89	353.201,83773000	3,1005667950
4183	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000.000,00	3.225.216,76234300	3,1005667950
4184	08/02/2024	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,00% a.a	10.000.000,00	0,00	200,00000000	50.000,0000000000
4185	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.661.833,41	3.116.150,70689035	3,1005667950
4186	15/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	193.844,45	62.441,38404942	3,1044226990
4187	15/02/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,00	295.913,58	274.592,09884100	1,0776478320

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4188	16/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	43.149,40	13.893,56947876	3,1057101680
4189	16/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	295.913,58	0,00	95.280,48787300	3,1057101680
4190	16/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.712.494,70	0,00	1.127.774,71334200	5,0652800000
4191	20/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	359.176,14	0,00	115.550,47092274	3,1083918320
4192	21/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	90.816,54	29.204,36840253	3,1096902610
4193	21/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000.000,00	6.431.508,71031400	3,1096902610
4194	21/02/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	20.000.000,00	0,00	18.529.706,06875700	1,0793479360
4195	22/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	179.380,95	0,00	57.660,23801100	3,1109991250
4196	22/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	137.735,55	44.273,73472823	3,1109991250
4197	27/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.514.072,69	486.064,74199500	3,1149609490
4198	27/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	73.065,96	23.456,46099463	3,1149609490
4199	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.572.670,26	2.080.828,78627400	5,0809900000
4200	27/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	281.945,21	90.513,24065300	3,1149609490
4201	28/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	204.332,72	65.569,61361200	3,1162715280
4202	28/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.250.000,00	1.042.912,97173500	3,1162715280
4203	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	800.000,00	157.379,35050600	5,0832590000
4204	28/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	154.547,27	49.593,64696285	3,1162715280
4205	29/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	61.592,06	0,00	19.755,96137615	3,1176442810
4206	29/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.889,29	0,00	4.455,05925200	3,1176442810
4207	01/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.149.981,02	0,00	368.691,08927600	3,1190908960
4208	01/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.969.298,51	0,00	631.369,38796000	3,1190908960
4209	01/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.269.374,86	0,00	727.575,73782400	3,1190908960
4210	04/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	168.017,36	0,00	53.844,40958800	3,1204234810
4211	04/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.621.580,09	0,00	3.724.359,90203300	3,1204234810
4212	04/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	252.063,60	0,00	80.778,65121000	3,1204234810
4213	04/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.908.339,83	0,00	3.175.318,95601000	3,1204234810
4214	04/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	75.101,62	24.067,76530700	3,1204234810
4215	06/03/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	20.000.000,00	0,00	1.182.470,08671426	16,9137471000
4216	06/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	100.671,85	32.234,98611900	3,1230616830
4217	06/03/2024	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	20.000.000,00	7.585.456,03971030	2,6366246000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4218	07/03/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	13.000.000,00	3.467.535,25373300	3,7490606580
4219	07/03/2024	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	7.000.000,00	261.368,55904700	26,7821042650
4220	07/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	20.000.000,00	0,00	6.401.330,13290000	3,1243506560
4221	07/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.000.000,00	1.962.003,83375549	5,0968300000
4222	07/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	314.850,46	0,00	61.773,78095797	5,0968300000
4223	07/03/2024	LETRA FINANCEIRA - DAYC LF0024007JP - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a	10.000.000,00	0,00	200,00000000	50.000,0000000000
4224	07/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	99.154,84	31.736,14325600	3,1243506560
4225	11/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	122.754,79	39.256,16187500	3,1270196610
4226	14/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.104.356,38	352.721,56659000	3,1309579130
4227	14/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.761.076,62	3.117.600,71238000	3,1309579130
4228	14/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	856.140,16	0,00	273.443,52233000	3,1309579130
4229	14/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.372.670,26	0,00	2.226.466,85898145	5,1079450000
4230	14/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	78.123,75	24.952,02815600	3,1309579130
4231	14/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	281.783,89	89.999,25832000	3,1309579130
4232	18/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	189.220,50	60.384,99888300	3,1335679970
4233	20/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.521,15	4.311,23410200	3,1362597530
4234	20/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	70.557,84	0,00	22.497,44777400	3,1362597530
4235	20/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	69.532,29	0,00	22.170,44998600	3,1362597530
4236	21/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	137.829,25	43.928,43284600	3,1375863210
4237	25/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	201.902,41	64.297,67946000	3,1401197010
4238	26/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.653.706,59	526.385,14053100	3,1416285580
4239	26/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.639.338,24	2.075.750,93887723	5,1255370000
4240	26/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	292.721,19	93.174,98380100	3,1416285580
4241	27/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.837,16	19.356,91795800	3,1429156300
4242	27/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	170.177,54	0,00	54.146,39145100	3,1429156300
4243	27/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.702.237,99	541.611,09950000	3,1429156300
4244	27/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	251.271,99	0,00	79.948,69082700	3,1429156300
4245	27/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	28.932,29	9.205,55732500	3,1429156300
4246	27/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	60.917,67	0,00	19.382,53429900	3,1429156300
Total			207.998.605,79	203.762.861,70		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 2.461.172,90 Value-At-Risk: 0,27%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,39	0,10		0,06	0,01	0,84	841.015.756,02	93,20
Artigo 8º	10,00	6,40		0,17	-0,05	0,29	27.725.217,73	3,07
Artigo 9º	11,30	5,24		0,04	0,20	3,11	17.916.729,34	1,99
Artigo 10º	0,30	1,36		-0,00	-3,07	-0,10	9.612.188,41	1,07
Artigo 11º	0,16	0,02		0,00	-4,85	0,05	6.059.243,07	0,67
OSASCO - CONSOLIDADO		0,27		0,27			902.329.134,57	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,10%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545	3,62	2,25	0,03	2,25	-0,42	-0,70	16.779.648,11	1,86
NTN-B 150545 (4,930000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,40	0,94	29.650.199,04	3,29
NTN-B 150555 (5,742000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,65	1,00	45.203.285,58	5,01
NTN-B 150840 (4,200000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,19	0,88	28.974.758,32	3,21
NTN-B 150850 (5,729999%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,64	1,00	44.521.232,24	4,93
NTN-B 150850 (5,730001%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,64	1,00	45.723.305,51	5,07
NTN-B 150850 (5,740002%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,65	1,00	44.463.405,89	4,93
NTN-B 150850 (5,860000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,68	1,01	43.778.163,60	4,85
NTN-F 2029 (12,000000%)	0,00	0,01	0,00	0,01	0,00	0,90	5.360.644,30	0,59
Sub-total	0,31	0,18	0,03		0,17	0,89	304.454.642,59	33,74

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	0,42	0,34	0,00	0,35	0,22	0,93	30.514.262,03	3,38
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS	1,00	0,55	0,00	0,11	0,04	0,88	2.337.689,84	0,26

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÚBLICOS FI								
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,10	0,53	0,00	0,12	0,06	0,90	4.362.200,62	0,48
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,93	0,54	0,00	0,01	-0,09	0,75	2.216.343,01	0,25
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,17	0,40	0,01	0,41	-0,22	0,58	34.040.341,35	3,77
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,02	0,01	0,00	0,01	-0,99	0,81	45.064.759,13	4,99
Sub-total	0,40	0,18	0,01		-0,12	0,78	118.535.595,98	13,14

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	0,02	0,00	0,01	1,21	0,87	116.169.420,73	12,87
BRA1 FI RENDA FIXA	0,18	0,18	0,00	1,23	-4,77	-0,05	186.962,24	0,02
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,03	0,01	0,00	0,01	0,64	0,85	102.748.189,65	11,39
TMJ IMA-B FI RF	78,01	3,75	0,00	3,95	-0,26	-19,07	618.499,39	0,07
TOWER RENDA FIXA FI IMA-B 5	163,23	4,14	0,00	4,22	-0,23	-37,41	368.672,65	0,04
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,93	0,54	0,00	0,01	-0,10	0,74	5.447.979,74	0,60
FI BARCELONA RENDA FIXA	2,18	0,19	-0,00	0,19	-0,27	0,24	391.577,71	0,04
FI DE RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	13,33	1,26	-0,00	1,75	-0,36	-3,98	172.123,65	0,02
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	0,00	0,06	1,32	0,91	124.703.300,14	13,82
MZL IMA B FUNDO INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,17	0,26	-0,00	1,25	-6,10	-6,34	20.592,82	0,00
TOWER II RENDA FIXA FI IMA-B 5	22,10	0,69	-0,00	0,91	0,26	6,64	859.435,95	0,10
Sub-total	0,31	0,03	0,01		-0,17	0,78	351.686.754,67	38,98

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	0,69	0,59	0,00	0,60	0,45	1,15	20.679.458,78	2,29
LETRA FINANCEIRA - DAYC LF0024007JP - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a	3,84	1,20	0,00	1,21	0,08	0,94	10.094.160,91	1,12
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,00% a.a	0,57	0,37	0,00	0,39	0,61	1,18	10.177.634,91	1,13
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,50% a.a	0,64	0,56	0,00	0,57	0,46	1,13	10.254.119,35	1,14

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - DAYC LF0024004PL - BCO DAYCOVAL SA 6,00% a.a	0,53	0,33	0,00	0,35	0,63	1,17	10.181.190,53	1,13
Sub-total	1,03	0,59	0,01		0,32	1,16	61.386.564,48	6,80

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,44	0,10	-0,00	0,10	-0,86	-0,41	3.207.607,53	0,36
ILLUMINATI FIDC	7,58	0,00	0,00	0,10	-0,39	-2,11	922.595,09	0,10
INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC	3,24	0,22	-0,00	0,22	-0,54	-0,91	292.452,04	0,03
Sub-total	2,85	0,09	-0,00		-0,57	-0,80	4.422.654,66	0,49

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,11	0,55	0,00	0,55	-1,38	-0,69	529.543,64	0,06
Sub-total	1,11	0,55	0,00		-1,38	-0,69	529.543,64	0,06

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,40%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS	9,21	5,61	0,02	2,02	-0,22	-1,24	4.443.782,71	0,49
FIA CAIXA INFRAESTRUTURA	10,01	6,21	0,03	2,79	-0,16	-0,73	6.031.105,95	0,67
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10,69	6,93	0,02	3,77	-0,06	0,22	3.274.051,99	0,36
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	13,23	9,03	0,03	0,17	0,10	2,09	3.817.981,22	0,42
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	11,54	6,88	0,02	3,25	0,05	1,36	3.648.783,17	0,40
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC FI EM AÇÕES	11,05	6,55	0,04	1,99	-0,01	0,69	6.509.512,69	0,72
Sub-total	10,00	6,40	0,17		-0,05	0,29	27.725.217,73	3,07

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,24%

Artigo 9º III

Carteira: OSASCO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,38	5,51	0,02	0,56	0,21	3,48	9.413.381,71	1,04
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	10,75	5,41	0,02	7,63	0,17	2,71	8.503.347,63	0,94
Sub-total	11,30	5,24	0,04		0,20	3,11	17.916.729,34	1,99

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,36%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WNG FIC DE FI MULTIMERCADO CP	0,34	0,01	-0,00	0,10	-2,71	-0,10	367.972,96	0,04
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	0,14	0,05	-0,00	0,05	-6,49	-0,07	3.239.511,77	0,36
Sub-total	0,13	0,04	-0,00		-6,88	-0,07	3.607.484,73	0,40

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	0,46	2,67	-0,00	2,67	-2,08	-0,13	4.886.956,05	0,54
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,16	0,01	-0,00	0,10	-5,43	-0,05	1.117.747,63	0,12
Sub-total	0,41	2,17	-0,00		-2,33	-0,11	6.004.703,68	0,67

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,02%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	0,04	0,02	0,00	1,90	-22,34	0,01	5.669.762,30	0,63
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	0,31	0,03	-0,00	1,91	-3,00	-0,09	60.127,28	0,01
SAO DOMINGOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	2,42	0,12	-0,00	1,89	-0,06	0,68	329.353,49	0,04
Sub-total	0,16	0,02	0,00		-4,85	0,05	6.059.243,07	0,67

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

(5) Limite Política de Investimentos (%)