

Relatório Mensal | Demonstrativo de Investimentos

Data de referência: 31/01/2024



Plano: ITAUBANCO CD - CONSERVADOR

Alocação por Segmento

| Carteira Administrada       |   |             |              |
|-----------------------------|---|-------------|--------------|
| Segmento                    |   | Valor (R\$) | % (PL Total) |
| Renda Fixa                  |   | 10.017,26   | 0,0%         |
| Val. a Pagar / Receber      | - | 612.698,10  | 0,0%         |
| Total Carteira Administrada | - | 602.680,84  | 0,0%         |

| Fundos de Investimentos       |   |                  |              |
|-------------------------------|---|------------------|--------------|
| Segmento                      |   | Valor (R\$)      | % (PL Total) |
| Renda Fixa                    |   | 3.575.884.081,98 | 89,2%        |
| Renda Variável                |   | 292.387.919,84   | 7,3%         |
| Investimento Estruturado      |   | 147.370.751,61   | 3,7%         |
| Val. a Pagar / Receber        | - | 5.868.051,07     | -0,1%        |
| Tesouraria                    |   | 1.231.526,00     | 0,0%         |
| Total Fundos de Investimentos |   | 4.011.006.228,37 | 100,0%       |

Detalhamento dos Investimentos

|                                |            |            |             |              |
|--------------------------------|------------|------------|-------------|--------------|
| Alocação Carteira Administrada |            |            | -602.680,84 | 0,0%         |
| Renda Fixa                     |            |            | 10.017,26   | 0,0%         |
| Ativo                          | Vencimento | Quantidade | Valor (R\$) | % (PL Total) |
| Depósitos                      | -          | -          | 10.017,26   | 0,0%         |
| Valores a Pagar / Receber      |            |            | -612.698,10 | 0,0%         |

|                                                |  |                  |        |
|------------------------------------------------|--|------------------|--------|
| Alocação Em Fundos de Investimentos (1º Nível) |  | 4.011.006.228,37 | 100,0% |
|------------------------------------------------|--|------------------|--------|

|                     |                    |            |                  |              |
|---------------------|--------------------|------------|------------------|--------------|
| Fundo               | CNPJ               | Quantidade | Valor (R\$)      | % (PL Total) |
| RT DRAGON MM CP IE  | 29.232.970/0001-02 | 30.066.612 | 463.764.143,14   | 11,6%        |
| RT ENDURANCE MCPFI  | 10.264.179/0001-48 | 335.783    | 1.462.770.757,16 | 36,5%        |
| RT GUARD FIM        | 29.232.902/0001-35 | 618.570    | 13.582.744,04    | 0,3%         |
| RT INTREPID         | 11.419.544/0001-09 | 5.777.928  | 200.585.766,59   | 5,0%         |
| RT QUANTUM MM FICFI | 17.412.182/0001-00 | 8.461.083  | 252.816.081,22   | 6,3%         |
| RT REPUBLIC FI      | 11.419.524/0001-38 | 37.868.029 | 1.315.289.086,41 | 32,8%        |
| CONSTELLATION FIA   | 13.412.410/0001-91 | 11.859.353 | 302.197.649,81   | 7,5%         |

| Composição da alocação em Fundos de Investimentos |            |            | 4.011.006.228,37 | 100,0%       |
|---------------------------------------------------|------------|------------|------------------|--------------|
| Renda Fixa                                        |            |            | 3.575.884.081,98 | 89,2%        |
| Ativo                                             | Vencimento | Quantidade | Valor (R\$)      | % (PL Total) |
| NTN-B                                             | 15/08/2024 | -          | 4.139.905,74     | 0,1%         |
| NTN-B                                             | 15/05/2025 | -          | 9.402.173,22     | 0,2%         |
| NTN-B                                             | 15/08/2026 | -          | 4.304.798,07     | 0,1%         |
| NTN-B                                             | 15/08/2028 | -          | 67.078.143,91    | 1,7%         |
| NTN-B                                             | 15/08/2032 | -          | 9.742.943,07     | 0,2%         |
| NTN-B                                             | 15/05/2035 | -          | 147.802,87       | 0,0%         |
| NTN-B                                             | 15/05/2045 | -          | 1.036.410,76     | 0,0%         |

|                                 |                    |            |                       |              |
|---------------------------------|--------------------|------------|-----------------------|--------------|
| NTN-B                           | 15/08/2050         | -          | 25.925.688,94         | 0,6%         |
| NTN-B                           | 15/08/2060         | -          | 17.867.450,59         | 0,4%         |
| CDB                             | -                  | -          | 22.893.998,18         | 0,6%         |
| COMPROMISSADA                   | -                  | -          | 1.646.663.659,49      | 41,1%        |
| DEBENTURES                      | -                  | -          | 671.894.068,07        | 16,8%        |
| LFS                             | -                  | -          | 753.224.333,40        | 18,8%        |
| LFT                             | -                  | -          | 9.683.704,18          | 0,2%         |
| CÉD. CRÉD. BANC. PÓS            | -                  | 8          | 15.517.342,19         | 0,4%         |
| NOTA COMERCIAL                  | -                  | 24.373     | 116.061.234,09        | 2,9%         |
| ABS VERTEX FIC FIM              | 21.470.989/0001-77 | 6.285.632  | 19.586.629,32         | 0,5%         |
| LEGACY CAPITAL FICFI            | 29.993.554/0001-19 | 16.951.047 | 31.814.671,27         | 0,8%         |
| SOBERANO                        | 06.175.696/0001-73 | 156.600    | 10.219.022,16         | 0,3%         |
| FIDC CIELO EM II SEN            | 40.906.116/0001-09 | 30.495     | 31.348.886,01         | 0,8%         |
| FIDC ANGA S C XI SEN            | 37.676.161/0001-00 | 2.998      | 726.538,72            | 0,0%         |
| CRED UNI FIDC SEN25             | 08.417.544/0001-65 | 5.199.124  | 1.411.173,51          | 0,0%         |
| FIDC FACTA CONS SENI            | 35.946.113/0001-69 | 5.178      | 2.840.339,60          | 0,1%         |
| FIDC CRE AUTO VII SN            | 42.860.938/0001-21 | 7.406      | 1.941.562,97          | 0,0%         |
| DRIVE BR F BV FIDC SN           | 42.461.361/0001-85 | 254        | 312.920,90            | 0,0%         |
| CRED UNI FIDC SEN 27            | 08.417.544/0001-65 | 3.534.598  | 2.668.524,76          | 0,1%         |
| CRED UNI FIDC SEN 28            | 08.417.544/0001-65 | 908.897    | 762.559,60            | 0,0%         |
| FIDC BEC STONE IV SN            | 43.616.756/0001-72 | 13.556     | 13.710.244,37         | 0,3%         |
| BR ELETRO FIDC SEM              | 35.818.950/0001-02 | 16.443     | 4.712.662,23          | 0,1%         |
| TALO 1 FIDC SENIOR              | 43.616.659/0001-80 | 6.244      | 5.428.251,64          | 0,1%         |
| IU OPTIM EXTREME FIM            | 40.635.100/0001-09 | 114.701    | 2.049.084,53          | 0,1%         |
| OPEA AGRO SU FID SEN            | 43.866.348/0001-79 | 3.447.590  | 3.547.857,55          | 0,1%         |
| FS FORTALEC FIDC SEN            | 45.953.215/0001-65 | 437        | 437.629,84            | 0,0%         |
| ACR II FIDC SEN                 | 43.911.620/0001-95 | 10.172     | 10.303.060,51         | 0,3%         |
| SPX HORNET EH A FICF            | 48.262.900/0001-33 | 13.281.528 | 16.841.440,20         | 0,4%         |
| ACE CAP W A FICFIM              | 41.559.567/0001-80 | 14.319.991 | 18.782.062,10         | 0,5%         |
| CRED UNI FIDC SEN32             | 08.417.544/0001-65 | 1.093.599  | 1.101.079,02          | 0,0%         |
| ITAU INST FIM                   | 52.223.638/0001-95 | 10.119.278 | 10.608.099,40         | 0,3%         |
| NEO PROV II A FICFIM            | 52.306.384/0001-79 | 8.507.149  | 8.781.357,61          | 0,2%         |
| SOM CONS II FIDC S2             | 36.113.876/0001-91 | 358.082    | 364.767,39            | 0,0%         |
| <b>Renda Variável</b>           |                    |            | <b>292.387.919,84</b> | <b>7,3%</b>  |
| SINGULARITY AÇÕES               | 13.945.105/0001-65 | 24.239.319 | 90.063.153,78         | 2,2%         |
| INDEX IBOVESPA ACOES            | 03.370.003/0001-05 | 463.534    | 62.426.976,49         | 1,6%         |
| EQUINOX AÇÕES                   | 14.097.532/0001-01 | 5.229.497  | 133.207.794,21        | 3,3%         |
| INST SMART B50 FICFA            | 48.107.091/0001-95 | 5.333.904  | 6.689.995,37          | 0,2%         |
| <b>Investimento Estruturado</b> |                    |            | <b>147.370.751,61</b> | <b>3,7%</b>  |
| GENOA CAP RADAR                 | 37.052.449/0001-03 | 21.522.245 | 32.854.200,47         | 0,8%         |
| FIP M KINEA P EQ II             | 15.039.162/0001-00 | 4.663      | 1.068.908,63          | 0,0%         |
| CRE GROWTH                      | 28.770.726/0001-22 | 524        | 8.946.906,89          | 0,2%         |
| IT DISTRIB OPEX FIM             | 40.616.164/0001-62 | 1.335.167  | 23.746.157,33         | 0,6%         |
| GROWLER FICFIM                  | 18.489.908/0001-76 | 12.500.460 | 37.584.865,88         | 0,9%         |
| CAPSTONE MACRO A FIM            | 36.248.791/0001-10 | 11.277.860 | 24.187.095,43         | 0,6%         |
| VERTICE JANEIRO FICF            | 52.187.039/0001-63 | 17.938.540 | 18.982.616,98         | 0,5%         |
| <b>Contas à Pagar/Receber</b>   |                    |            | <b>-5.868.051,07</b>  | <b>-0,1%</b> |
| <b>Tesouraria</b>               |                    |            | <b>1.231.526,00</b>   | <b>0,0%</b>  |

Para mais detalhes sobre a carteira de ativos financeiros e valores mobiliários dos fundos de investimentos:

[https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg\\_sistema=fundosreg](https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg)