



LDB
EMPRESAS

PARAIBUNA
OUTUBRO 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 31.10.2023.

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 73,00%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,25	0,04	0,85	12,67	15.979.227,72	16,64	6.082.622.569,66	0,26
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,16	-0,08	-0,67	9,82	1.717.482,34	1,79	5.052.854.726,15	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,31	-0,02	-0,32	8,44	5.347.393,77	5,57	7.787.487.970,57	0,07
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,36	-0,01	-0,33	8,23	997.482,69	1,04	5.824.441.376,72	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,41	-0,01	-0,29	8,48	14.511.691,97	15,11	5.184.421.071,28	0,28
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,33	-0,02	-0,32	8,40	1.141.313,02	1,19	5.252.934.178,04	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,50	0,01	0,26	10,64	15.943.915,52	16,61	5.136.324.306,86	0,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,92	0,01	0,17	10,25	55.638.507,03	57,95		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,18	-0,08	-0,68	9,83	1.669.349,11	1,74	906.861.937,86	0,18
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,03	0,04	0,90	10,10	215.819,37	0,22	3.689.670.141,46	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,04	0,91	9,76	396.811,44	0,41	790.012.856,98	0,05
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,32	-0,02	-0,33	8,33	3.396.225,75	3,54	918.763.261,01	0,37
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	3,03	0,02	0,29	11,50	3.184.388,77	3,32	719.918.838,80	0,44
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	1,05	11,47	5.172.386,42	5,39	8.965.211.424,43	0,06
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,84	0,01	0,32	10,49	14.034.980,86	14,62		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PETRA	FINAXIS	FIDC PREMIUM	13,62	-0,88	-0,42	-9,63	415.624,65	0,43	31.149.868,62	1,33
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	13,62	-0,88	-0,42	-9,63	415.624,65	0,43		
		Renda Fixa	1,88	0,00	0,20	10,15	70.089.112,54	73,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

14,43%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	18,61	0,31	-2,90	1,40	2.182.174,24	2,27	1.302.352.358,50	0,17
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	17,31	0,42	-3,06	1,42	3.630.410,70	3,78	493.814.734,05	0,74
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	17,79	0,47	-6,28	7,38	1.071.362,44	1,12	465.759.490,78	0,23
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	18,52	0,39	-3,79	-1,85	2.566.630,34	2,67	763.608.202,26	0,34
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	18,38	0,50	-5,07	-4,56	979.709,58	1,02	406.505.009,85	0,24
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	19,73	0,45	-3,33	-0,10	787.921,62	0,82	785.462.483,47	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	18,46	0,50	-5,29	0,47	1.876.325,54	1,95	586.219.451,06	0,32
ITAU	ITAU	ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	22,60	0,85	-7,69	-4,20	757.957,33	0,79	362.501.624,36	0,21
Sub-total Artigo 8º I			17,98	0,44	-4,15	0,25	13.852.491,79	14,43		
Renda Variável			17,98	0,44	-4,15	0,25	13.852.491,79	14,43		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,23%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20,25	0,45	-1,40	14,42	1.739.794,33	1,81	1.935.277.303,73	0,09
BB	BB	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	18,60	0,43	-1,58	7,72	1.359.408,36	1,42	1.202.637.787,52	0,11
Sub-total Artigo 9º III			19,33	0,44	-1,48	11,38	3.099.202,69	3,23		
Investimentos no Exterior			19,33	0,44	-1,48	11,38	3.099.202,69	3,23		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,34%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,41	0,08	-0,41	7,92	2.450.914,13	2,55	1.436.932.092,12	0,17
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,71	0,69	-1,77	15,81	1.393.263,23	1,45	1.452.300.441,47	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	3,96	0,16	-0,36	7,00	1.727.081,82	1,80	241.709.615,05	0,71
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	15,67	0,68	-1,75	15,73	1.392.633,09	1,45	1.128.762.122,57	0,12
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	0,38	0,05	0,96	11,13	2.005.156,34	2,09	86.299.580,69	2,32
Sub-total Artigo 10º I			5,25	0,27	-0,52	10,78	8.969.048,61	9,34		
Investimentos Estruturados			5,25	0,27	-0,52	10,78	8.969.048,61	9,34		
Total			3,87	0,11	-0,57	8,69	96.009.855,63	100,00		

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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	55.638.507,03	57,95	0,00	24,02	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	14.034.980,86	14,62	0,00	19,98	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	415.624,65	0,43	0,00	0,51	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	70.089.112,54	73,00					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	13.852.491,79	14,43	0,00	0,49	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	13.852.491,79	14,43					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	3.099.202,69	3,23	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	3.099.202,69	3,23					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	8.969.048,61	9,34	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	8.969.048,61	9,34					15,00
Total		96.009.855,63	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,17 17,11	10,25 93,01	1,36 43,19	5,20 79,40	11,11 82,81	94.587,55	5.007.210,66
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,32 32,38	10,49 95,12	1,45 46,02	5,42 82,73	11,37 84,77	49.042,75	1.348.339,31
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,42 -41,93	-9,63 -87,36	-1,32 -41,95	-8,77 -133,92	0,99 7,35	-1.745,65	-44.291,34
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,15 -1,22	0,25 -2,86	-9,25 -2,03	5,95 -2,39	-7,08 -4,59	-600.319,68	34.072,80
Artigo 9º III % do CDI	-1,48 -148,08	11,38 103,27	-2,14 -68,20	5,53 84,40	13,13 97,89	-46.466,92	316.768,67
Artigo 10º I % do CDI	-0,52 -52,29	10,78 97,82	-1,72 -54,86	5,22 79,67	11,59 86,39	-47.033,76	873.080,41
PARAIBUNA (Total)						-551.935,71	7.535.180,51

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	15.391.125,14	455.949,41	0,00	0,00	15.979.227,72	132.153,17	1.517.920,31
BB PREV RF IDKA2	1.000.782,66	0,00	0,00	0,00	997.482,69	-3.299,97	75.883,06
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.729.135,16	0,00	0,00	0,00	1.717.482,34	-11.652,82	153.564,42
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1.145.022,71	0,00	0,00	0,00	1.141.313,02	-3.709,69	88.459,63
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.554.151,98	0,00	0,00	0,00	14.511.691,97	-42.460,01	1.133.882,04
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.364.651,83	0,00	0,00	0,00	5.347.393,77	-17.258,06	416.127,69
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	15.903.100,59	0,00	0,00	0,00	15.943.915,52	40.814,93	1.593.003,10
	55.087.970,07	455.949,41	0,00	0,00	55.638.507,03	94.587,55	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	384.574,38	732.315,92	-905.660,82	0,00	215.819,37	4.589,89	47.902,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B	1.680.750,37	0,00	0,00	0,00	1.669.349,11	-11.401,26	149.343,33
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.118.419,15	0,00	0,00	0,00	5.172.386,42	53.967,27	532.127,88
BRADERCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	3.175.197,77	0,00	0,00	0,00	3.184.388,77	9.191,00	328.481,14
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	3.407.406,89	0,00	0,00	0,00	3.396.225,75	-11.181,14	261.128,08
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	433.704,91	142.231,47	-183.001,93	0,00	396.811,44	3.876,99	57.726,67
	14.200.053,47	874.547,39	-1.088.662,75	0,00	14.034.980,86	49.042,75	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC PREMIUM	417.370,30	0,00	0,00	0,00	415.624,65	-1.745,65	-44.291,34
	417.370,30	0,00	0,00	0,00	415.624,65	-1.745,65	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	1.143.180,72	0,00	0,00	0,00	1.071.362,44	-71.818,28	73.665,90
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	815.095,41	0,00	0,00	0,00	787.921,62	-27.173,79	-775,65
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	2.247.410,52	0,00	0,00	0,00	2.182.174,24	-65.236,28	30.099,71
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	2.667.839,00	0,00	0,00	0,00	2.566.630,34	-101.208,66	-48.342,95
BRADERCO F I A SELECTION	1.032.015,65	0,00	0,00	0,00	979.709,58	-52.306,07	-46.831,08
BRADERCO FIA DIVIDENDOS	3.745.121,73	0,00	0,00	0,00	3.630.410,70	-114.711,03	50.732,81
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	1.981.062,16	0,00	0,00	0,00	1.876.325,54	-104.736,62	8.724,91
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	821.086,28	0,00	0,00	0,00	757.957,33	-63.128,95	-33.200,85
	14.452.811,47	0,00	0,00	0,00	13.852.491,79	-600.319,68	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	1.381.187,49	0,00	0,00	0,00	1.359.408,36	-21.779,13	97.465,99
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.764.482,12	0,00	0,00	0,00	1.739.794,33	-24.687,79	219.302,68
	3.145.669,61	0,00	0,00	0,00	3.099.202,69	-46.466,92	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.418.392,24	0,00	0,00	0,00	1.393.263,23	-25.129,01	190.239,66
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	2.460.928,81	0,00	0,00	0,00	2.450.914,13	-10.014,68	179.784,11
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	1.733.343,23	0,00	0,00	0,00	1.727.081,82	-6.261,41	113.052,05
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	1.417.400,83	0,00	0,00	0,00	1.392.633,09	-24.767,74	189.250,44
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	1.986.017,26	0,00	0,00	0,00	2.005.156,34	19.139,08	200.754,15
	9.016.082,37	0,00	0,00	0,00	8.969.048,61	-47.033,76	

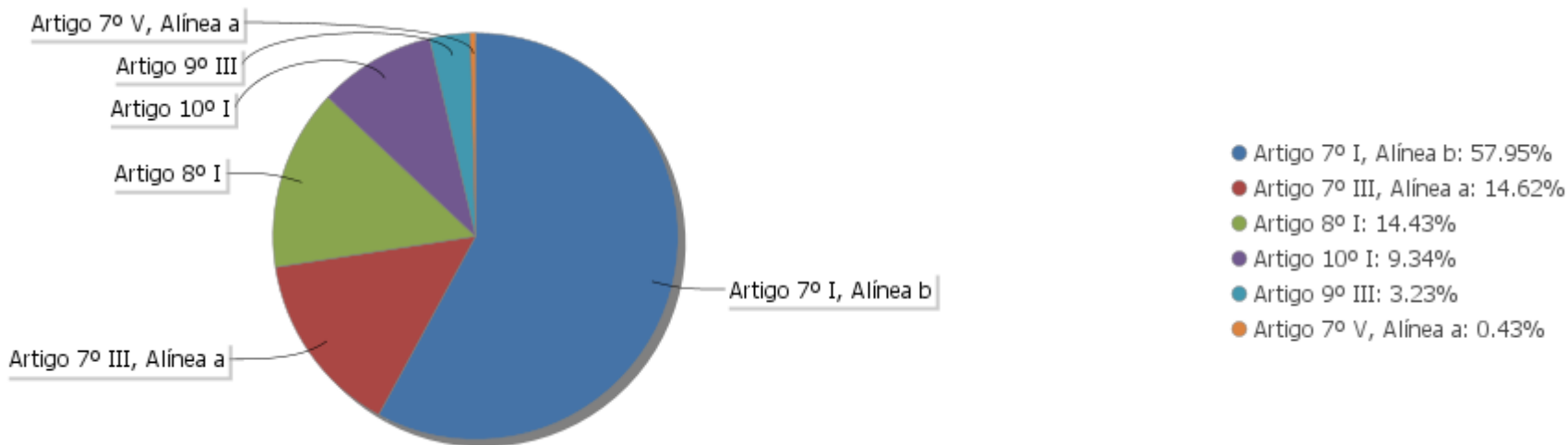
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

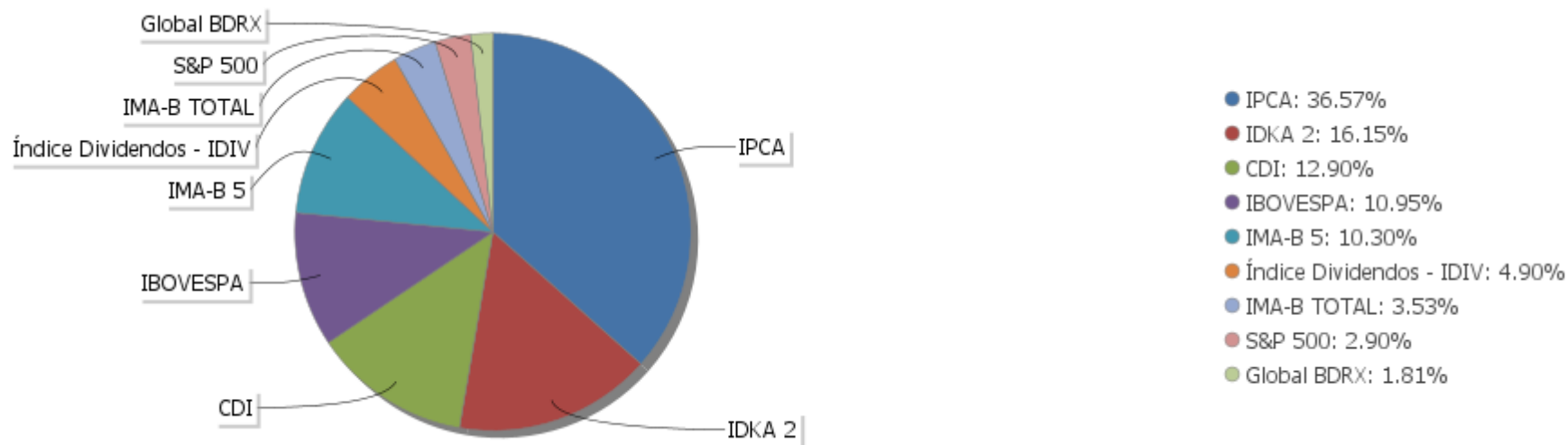
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	91.566.899,75	95,37	91.566.899,75	95,37	
de 31 dias a 365 dias	4.442.955,88	4,63	96.009.855,63	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	96.009.855,63	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

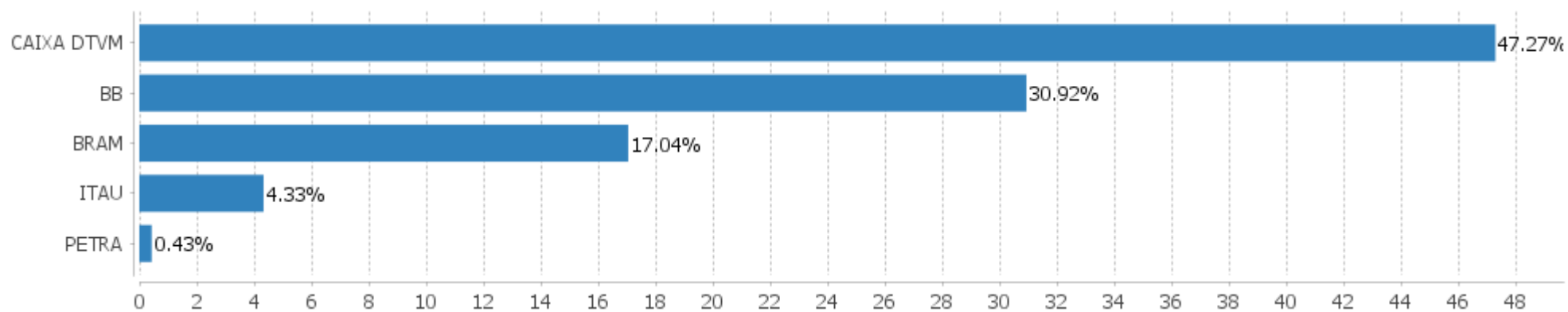


Alocação Por Estratégia



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	1,70	-0,41	0,81	1,07	1,83	2,74	1,40	-0,24	0,09	-0,57			8,69
IPCA + 4,96%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,65	0,32	0,52	0,67	0,65	0,65			8,00
p.p. indexador	0,75	-1,60	-0,35	0,11	1,17	2,42	0,87	-0,91	-0,55	-1,22			0,69
2022	0,51	0,18	2,34	-1,22	0,34	-1,95	1,55	1,46	0,09	2,29	-0,61	0,08	5,10
IPCA + 4,83%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,88	1,07	-0,29	0,07	0,10	0,97	0,79	1,04	10,87
p.p. indexador	-0,43	-1,19	0,30	-2,64	-0,54	-3,01	1,84	1,39	-0,01	1,32	-1,39	-0,96	-5,77

Performance Sobre a Meta Atuarial

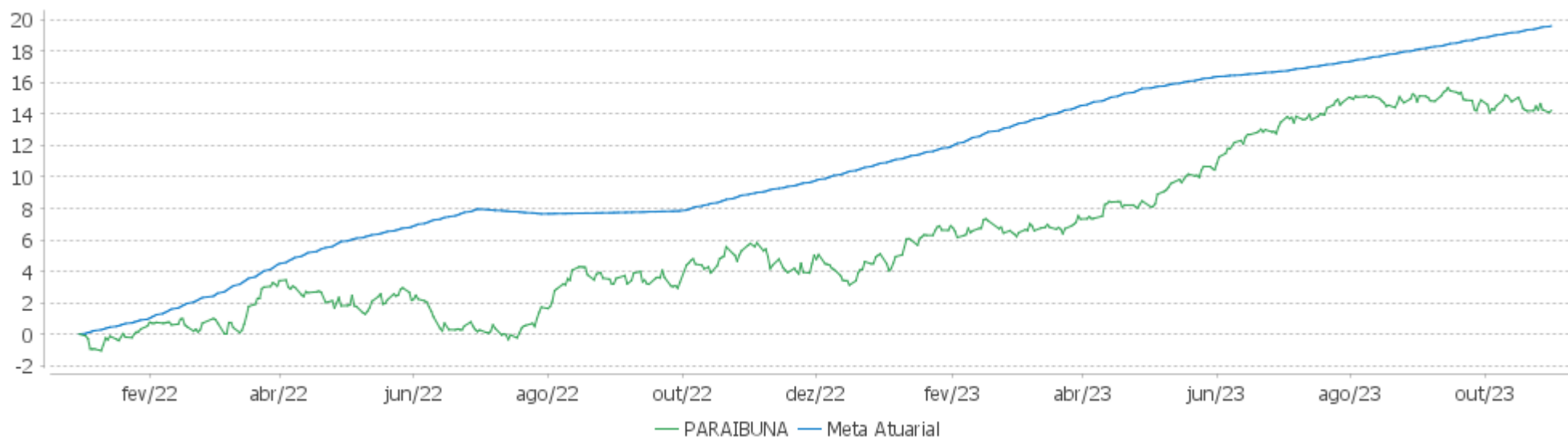
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	9	40,91	03 meses	-0,72	1,98	-2,70	3,39
Meses abaixo - Meta Atuarial	13	59,09	06 meses	5,32	3,52	1,80	3,36
			12 meses	8,11	9,97	-1,86	3,87
			24 meses				
Desde 31/12/2021				14,23	19,74	-5,51	4,28

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,74	2023-06
Menor rentabilidade da Carteira	-1,95	2022-06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

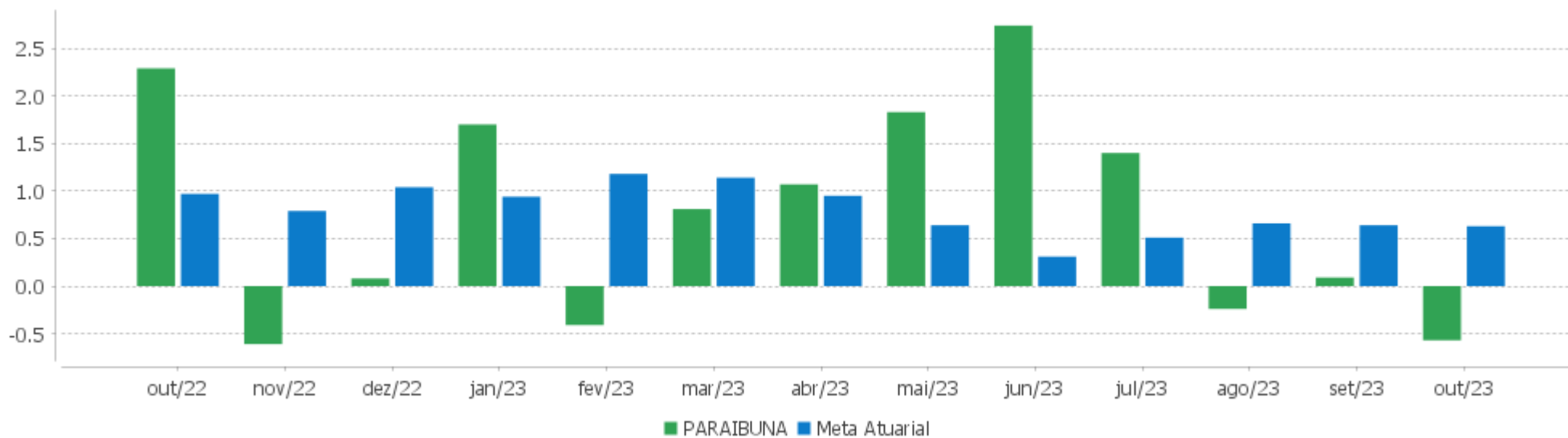


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,32 -0,01	8,44 -0,11	0,39 -0,05	3,03 -0,03	9,06 -0,15	22,79 -0,32	27,94 -0,63
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,33 0,08	8,23 -0,29	0,62 -0,02	3,00 0,09	8,84 -0,19	22,05 -0,60	27,39 -0,92
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,26 0,02	10,64 6,90	1,30 0,56	6,24 5,23	12,00 7,18	24,61 13,01	24,98 1,47
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,29 0,12	8,48 -0,05	0,84 0,20	3,19 0,28	9,04 0,01	22,01 -0,64	27,38 -0,94
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,32 -0,01	8,40 -0,15	0,37 -0,07	2,99 -0,07	8,99 -0,22	22,58 -0,53	27,67 -0,89
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,85 0,61	12,67 8,93	2,79 2,06	7,46 6,45	13,41 8,59	26,00 14,40	28,43 4,92
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,67 -0,02	9,82 -0,24	-2,03 -0,07	3,63 -0,12	8,70 -0,27	20,76 -0,64	22,69 -0,93
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,42 -41,93	-9,63 -87,36	-1,32 -41,95	-8,77 -133,92	0,99 7,35	-59,83 -226,20	-61,97 -202,15
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,33 -0,02	8,33 -0,22	0,35 -0,08	2,95 -0,11	8,94 -0,27	22,26 -0,85	26,54 -2,02
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,05 105,69	11,47 104,02	3,41 108,42	7,05 107,56	13,96 104,06	27,79 105,05	32,52 106,09
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,68 -0,02	9,83 -0,23	-2,09 -0,13	3,68 -0,07	8,73 -0,24	20,76 -0,64	22,62 -1,01
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,90 90,45	10,10 91,64	2,88 91,57	6,02 91,93	12,28 91,53	23,94 90,52	26,71 87,12
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,91 91,71	9,76 88,54	2,89 91,89	5,95 90,80	11,80 87,92	22,71 85,87	25,58 83,44
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA Var. IPCA p.p.	0,29 0,05	11,50 7,75	1,00 0,26	6,19 5,19	11,93 7,11	23,98 12,38	25,04 1,53
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,06 0,09	1,42 -5,77	-8,09 -3,44	6,19 -1,37	-3,74 -10,03	14,87 -8,91	28,94 -11,89
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-5,07 -2,13	-4,56 -7,67	-11,92 -4,71	3,40 -4,94	-10,62 -8,13	2,28 -7,04	-1,62 -22,05
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	-6,28	7,38	-11,39	5,29	-0,93	10,47	24,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,13	0,20	-6,74	-2,28	-7,21	-13,31	-16,49
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,90 0,03	1,40 -1,71	-6,64 0,58	8,29 -0,05	-5,16 -2,66	2,67 -6,65	21,68 1,25
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,69 -4,75	-4,20 -7,30	-16,15 -8,94	2,34 -6,00	-15,43 -12,94	-12,28 -21,60	-3,55 -23,98
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,33 -0,40	-0,10 -3,20	-6,99 0,23	6,49 -1,85	-11,81 -9,32	-11,85 -21,17	-5,85 -26,28
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-5,29 -2,35	0,47 -2,64	-9,76 -2,55	7,47 -0,87	-10,82 -8,32	-1,56 -10,88	1,03 -19,40
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,79 -0,86	-1,85 -4,96	-9,15 -1,94	4,80 -3,54	-7,15 -4,66	-2,25 -11,56	16,87 -3,56
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-1,40 0,17	14,42 -0,97	-2,16 -0,29	6,20 -0,45	16,47 -1,90	-17,58 -1,45	10,07 -4,78
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-1,58 1,36	7,72 4,62	-2,12 5,10	4,68 -3,66	9,14 11,63	-18,02 -27,34	10,65 -9,77
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	-0,41 -40,79	7,92 71,81	-0,30 -9,43	4,88 74,53	7,71 57,45	21,83 82,52	27,03 88,18
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-1,77 -0,55	15,81 9,94	-7,01 -4,49	4,37 2,65	16,80 12,60	7,09 25,47	54,56 42,18
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,96 96,60	11,13 100,92	3,00 95,46	6,88 105,09	13,31 99,21	27,04 102,21	31,36 102,30
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP % do CDI	-0,36 -36,21	7,00 63,54	0,08 2,46	5,25 80,12	7,44 55,47	24,40 92,25	30,40 99,19
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	-1,75 -0,52	15,73 9,85	-7,00 -4,48	4,28 2,55	16,83 12,63	7,03 25,42	54,50 42,12
PARAIBUNA Var. IPCA + 4,83% p.p.	-0,57 -1,22	8,69 0,69	-0,72 -2,70	5,32 1,80	8,11 -1,88		
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+3 du		1,00
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,00
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADERCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADERCO FIA DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADERCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,40
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+13	D+15		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FIDC PREMIUM	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI			D+0	D+1 du		0,35
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA			D+1 du	D+3 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 15% (QUINZE POR CENTO) DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% (CEM POR CENTO) DA VARIAÇÃO DO BM&FBOVESPA SMALL CAP - SMLL, APURADO PELA BM&FBOVESPA. A TAXA DE PERFORMANCE SERÁ CALCULADA A PARTIR DA VALORIZAÇÃO DOS ATIVOS DO FUNDO.	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,96	11,12	3,06	6,61	13,48	26,55	28,80	34,03	43,59
IRF-M 1+	0,12	12,95	0,56	7,03	13,15	26,82	19,34	24,87	47,27
IRF-M TOTAL	0,37	12,04	1,31	6,68	12,95	26,45	22,28	27,70	46,46
IMA-B 5	-0,31	8,55	0,43	3,06	9,21	23,11	28,57	35,91	54,63
IMA-B 5+	-0,98	10,98	-4,11	3,97	8,37	19,37	18,16	11,25	52,40
IMA-B TOTAL	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40	23,62	22,38	55,11
IMA-GERAL TOTAL	0,30	10,92	1,11	5,71	11,71	24,89	26,20	29,58	48,76
IDKA 2	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65	28,32	36,96	53,47
IDKA 20	-1,16	13,95	-7,55	5,69	7,85	15,86	10,01	-4,59	48,02
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43	5,52	29,42
IBRX 100	-3,03	2,31	-7,11	8,24	-3,47	7,90	19,13	5,97	32,25
IBRX 50	-2,99	1,78	-6,48	8,57	-2,99	9,63	22,40	7,19	28,83
SMALL CAP	-7,40	-2,72	-16,71	5,49	-16,24	-16,19	-13,16	-18,52	16,44
Índice Consumo - ICON	-8,90	-13,22	-21,67	-1,55	-29,56	-40,09	-45,26	-46,32	-22,15
Índice Dividendos - IDIV	-3,15	7,18	-4,65	7,57	6,28	23,78	40,83	25,93	75,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-1,22	5,87	-2,52	1,73	4,20	-18,39	12,38	74,39	110,39

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,97	10,06	-1,30	10,41	5,49	17,94	14,06	13,03	40,73

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,10	1,94	-3,96	-1,70	4,45	-23,43	1,25	50,47	78,73

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,24	3,75	0,73	1,00	4,82	11,60	23,51	28,35	31,61
INPC	0,12	3,04	0,43	0,60	4,14	10,87	23,15	29,03	32,32
IGPM	0,50	-4,46	0,73	-3,74	-4,57	1,65	23,73	49,63	54,34
SELIC	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	7,18	1,74	3,04	9,00	20,69	38,87	50,04	59,99
IPCA + 5,00%	0,65	8,03	1,99	3,54	10,04	23,02	42,90	55,86	67,80
IPCA + 5,50%	0,69	8,46	2,11	3,79	10,56	24,19	44,94	58,84	71,82
IPCA + 5,89%	0,72	8,79	2,21	3,98	10,97	25,11	46,55	61,19	75,01
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00	61,85	75,91
INPC + 4,00%	0,45	6,44	1,44	2,62	8,29	19,90	38,47	50,83	60,87
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58	62,71	76,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
295	02/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	399,46	170,82233425	2,3384530000
296	02/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	39,60	16,93427236	2,3384530000
288	03/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.261,04	852,26862455	2,6529663710
289	04/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	893,20	336,53746299	2,6540878750
297	04/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	367,83	157,15993543	2,3404820000
304	04/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.475,20	630,29751991	2,3404820000
279	06/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	43.949,32	16.544,30518156	2,6564621190
280	09/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.509,80	3.954,62452278	2,6575974380
290	09/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.011,50	2.638,28520443	2,6575974380
301	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	25.000,00	0,00	10.667,65890118	2,3435320000
305	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	29.258,68	12.484,86472555	2,3435320000
298	10/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	24.267,06	10.350,42590317	2,3445470000
306	10/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	668,20	285,00175087	2,3445470000
307	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	526,78	224,58564337	2,3455640000
285	16/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	23.027,17	0,00	8.650,08465206	2,6620745260
302	16/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.231,47	0,00	950,53245868	2,3476000000
308	16/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.379,07	1.439,37212472	2,3476000000
309	17/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.354,36	576,66228537	2,3486190000
286	19/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	708.262,73	0,00	265.718,05768254	2,6654670600
291	19/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.672,86	5.129,63007691	2,6654670600
310	19/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.601,08	1.957,35998802	2,3506560000
287	20/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.026,02	0,00	384,76672454	2,6666027350
292	20/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.011,50	2.629,37553764	2,6666027350
311	20/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.500,00	1.063,07206566	2,3516750000
278	23/10/2023	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	455.949,41	0,00	346.199,93688546	1,3170118230
312	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.266,16	538,17362024	2,3526980000
313	24/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	242,56	103,05410808	2,3537150000
299	25/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	55,00	23,35719306	2,3547350000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
314	25/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	469,98	199,58933808	2,3547350000
315	25/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	55,00	23,35719306	2,3547350000
281	26/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	611.941,33	229.098,18643156	2,6710876220
303	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	115.000,00	0,00	48.816,55925609	2,3557580000
282	27/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	43.727,63	16.363,73921281	2,6722272600
283	30/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	159.268,84	59.575,20639841	2,6734081110
293	30/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.662,61	621,90654437	2,6734081110
284	31/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	983,35	367,66741343	2,6745639240
294	31/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.767,84	1.034,87524645	2,6745639240
300	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	101.839,24	43.173,69742406	2,3588260000
316	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	10.236,67	4.339,73086612	2,3588260000
Total			1.330.496,80	1.088.662,75		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.536.620,23

Value-At-Risk: 1,60%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PARAIBUNA		1,60		1,60			96.009.855,63	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,75%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,42	0,04	0,43			15.979.227,72	16,64
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,03	0,03	0,04			1.717.482,34	1,79
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,19	0,05	0,01			5.347.393,77	5,57
BB PREV RF IDKA2		1,10	0,01	0,16			997.482,69	1,04
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,94	0,10	0,31			14.511.691,97	15,11
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,21	0,01	0,02			1.141.313,02	1,19
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,84	0,10	0,85			15.943.915,52	16,61
Sub-total	1,95	0,76	0,34		-0,42	0,17	55.638.507,03	57,95

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B		2,05	0,03	0,04			1.669.349,11	1,74
BB PREV RF FLUXO FIC		0,02	0,00	0,02			215.819,37	0,22
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	0,00	0,01			396.811,44	0,41
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,18	0,03	0,06			3.396.225,75	3,54
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA		1,13	0,03	1,14			3.184.388,77	3,32
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,02	-0,00	0,02			5.172.386,42	5,39
Sub-total	2,03	0,76	0,09		-0,33	0,32	14.034.980,86	14,62

Artigo 7º V, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC PREMIUM		0,11	-0,00	0,11			415.624,65	0,43
Sub-total	3,51	0,11	-0,00		-0,40	-0,42	415.624,65	0,43

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,35%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		7,37	0,15	0,79			2.182.174,24	2,27
BRADESCO FIA DIVIDENDOS		7,38	0,26	2,55			3.630.410,70	3,78
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI		7,22	0,07	3,75			1.071.362,44	1,12
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,41	0,18	1,11			2.566.630,34	2,67
BRADESCO F I A SELECTION		7,78	0,07	2,63			979.709,58	1,02
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		7,35	0,06	1,33			787.921,62	0,82
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		7,61	0,14	2,81			1.876.325,54	1,95
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA		9,62	0,07	5,17			757.957,33	0,79
Sub-total	16,54	7,35	1,00		-0,31	-4,15	13.852.491,79	14,43

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,29%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,82	0,04	1,82			2.450.914,13	2,55
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,06	0,05	5,27			1.393.263,23	1,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP		1,77	0,03	1,77			1.727.081,82	1,80
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		6,04	0,05	5,27			1.392.633,09	1,45
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI		0,16	0,00	0,16			2.005.156,34	2,09
Sub-total	5,98	2,29	0,17		-0,25	-0,52	8.969.048,61	9,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,87%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,90	0,01	0,71			1.739.794,33	1,81
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I		6,92	0,01	10,29			1.359.408,36	1,42
Sub-total	16,48	6,87	0,01		-0,15	-1,48	3.099.202,69	3,23

(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 (%)