



**LDB**  
EMPRESAS

**PARAIBUNA**  
SETEMBRO 2023



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.09.2023.

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 72,37%

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	2,28	0,09	0,88	11,72	15.391.125,14	15,98	6.050.581.610,41	0,25
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,92	0,51	-0,97	10,56	1.729.135,16	1,80	5.367.605.963,99	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,19	0,22	0,11	8,79	5.364.651,83	5,57	8.162.684.334,70	0,07
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,28	0,19	0,21	8,59	1.000.782,66	1,04	6.063.437.379,24	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,35	0,19	0,36	8,79	14.554.151,98	15,11	5.412.384.350,74	0,27
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,21	0,22	0,11	8,75	1.145.022,71	1,19	5.453.684.801,95	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	0,17	0,40	10,36	15.903.100,59	16,51	5.614.661.167,38	0,28
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,87</b>	<b>0,17</b>	<b>0,44</b>	<b>10,07</b>	<b>55.087.970,07</b>	<b>57,19</b>		

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	4,94	0,52	-0,97	10,58	1.680.750,37	1,74	923.636.374,46	0,18
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	0,90	9,12	384.574,38	0,40	3.380.807.738,12	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,04	0,90	8,77	433.704,91	0,45	861.359.920,43	0,05
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,20	0,23	0,10	8,69	3.407.406,89	3,54	935.876.857,53	0,36
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	2,97	0,26	0,14	11,18	3.175.197,77	3,30	720.074.390,87	0,44
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	1,05	10,30	5.118.419,15	5,31	8.906.699.435,49	0,06
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>1,78</b>	<b>0,19</b>	<b>0,38</b>	<b>10,13</b>	<b>14.200.053,47</b>	<b>14,74</b>		

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	-0,46	-0,46	-9,25	417.370,30	0,43	31.280.700,45	1,33
		<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>	<b>13,62</b>	<b>-0,46</b>	<b>-0,46</b>	<b>-9,25</b>	<b>417.370,30</b>	<b>0,43</b>		
		Renda Fixa	1,83	0,17	0,42	9,93	69.705.393,84	72,37		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

15,01%

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	20,06	0,66	0,47	4,43	2.247.410,52	2,33	1.350.797.320,58	0,17
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FIA DIVIDENDOS	18,44	0,70	-0,10	4,62	3.745.121,73	3,89	521.061.013,74	0,72
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	18,69	0,62	-0,29	14,58	1.143.180,72	1,19	497.500.211,96	0,23
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	19,78	0,78	0,26	2,02	2.667.839,00	2,77	809.353.434,17	0,33
BRAM	BEM	BRADERSCO F I A SELECTION	19,69	0,90	-0,96	0,53	1.032.015,65	1,07	431.844.819,05	0,24
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	21,27	0,83	0,87	3,35	815.095,41	0,85	828.578.487,48	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,48	0,67	-0,01	6,08	1.981.062,16	2,06	628.673.074,03	0,32
ITAU	ITAU	ITAU SMALL CAP VALUATION FIC FIA	22,70	1,07	-2,22	3,78	821.086,28	0,85	402.802.144,85	0,20
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>19,11</b>	<b>0,74</b>	<b>-0,08</b>	<b>4,59</b>	<b>14.452.811,47</b>	<b>15,01</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>19,11</b>	<b>0,74</b>	<b>-0,08</b>	<b>4,59</b>	<b>14.452.811,47</b>	<b>15,01</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,27%

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	21,98	-0,35	-3,57	16,05	1.764.482,12	1,83	1.999.422.357,55	0,09
BB	BB	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	20,03	-0,44	-3,29	9,45	1.381.187,49	1,43	1.243.206.116,34	0,11
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>20,88</b>	<b>-0,39</b>	<b>-3,45</b>	<b>13,05</b>	<b>3.145.669,61</b>	<b>3,27</b>		
Investimentos no Exterior			20,88	-0,39	-3,45	13,05	3.145.669,61	3,27		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,36%

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	4,34	0,36	0,50	8,36	2.460.928,81	2,55	1.516.685.306,19	0,16
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	17,01	-0,24	-4,46	17,90	1.418.392,24	1,47	1.537.651.847,22	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	3,85	0,25	0,85	7,39	1.733.343,23	1,80	243.984.646,86	0,71
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	16,97	-0,24	-4,44	17,78	1.417.400,83	1,47	1.122.626.979,16	0,13
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	0,39	0,06	0,90	10,07	1.986.017,26	2,06	85.020.517,33	2,34
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>5,54</b>	<b>0,08</b>	<b>-0,96</b>	<b>11,37</b>	<b>9.016.082,37</b>	<b>9,36</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>5,54</b>	<b>0,08</b>	<b>-0,96</b>	<b>11,37</b>	<b>9.016.082,37</b>	<b>9,36</b>		
<b>Total</b>			<b>4,04</b>	<b>0,23</b>	<b>0,09</b>	<b>9,32</b>	<b>96.319.957,29</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	55.087.970,07	57,19	0,00	24,02	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	14.200.053,47	14,74	0,00	19,98	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	417.370,30	0,43	0,00	0,51	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>69.705.393,84</b>	<b>72,37</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	14.452.811,47	15,01	0,00	0,49	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>14.452.811,47</b>	<b>15,01</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	3.145.669,61	3,27	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>3.145.669,61</b>	<b>3,27</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	9.016.082,37	9,36	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>9.016.082,37</b>	<b>9,36</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>96.319.957,29</b>	<b>100,00</b>					



**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	0,44 45,12	10,07 101,40	2,07 64,27	6,03 93,18	12,55 93,33	239.920,59	4.912.623,11
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,38 39,32	10,13 102,04	2,12 65,74	6,27 97,02	12,30 91,50	53.834,79	1.299.296,56
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,46 -47,08	-9,25 -93,18	-1,37 -42,57	-8,75 -135,35	0,98 7,31	-1.924,20	-42.545,69
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,08 -0,79	4,59 -1,63	-2,33 -1,04	12,59 -1,82	2,23 -3,71	-11.467,66	634.392,48
Artigo 9º III % do CDI	-3,45 -353,74	13,05 131,50	1,46 45,41	6,46 99,90	18,18 135,23	-112.330,46	363.235,59
Artigo 10º I % do CDI	-0,96 -98,61	11,37 114,48	0,86 26,67	6,96 107,65	16,18 120,39	-87.498,87	920.114,17
<b>PARAIBUNA (Total)</b>						<b>80.534,19</b>	<b>8.087.116,22</b>

**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	14.803.986,46	455.949,41	0,00	0,00	15.391.125,14	131.189,27	1.385.767,14
BB PREV RF IDKA2	998.668,47	0,00	0,00	0,00	1.000.782,66	2.114,19	79.183,03
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.746.052,62	0,00	0,00	0,00	1.729.135,16	-16.917,46	165.217,24
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1.143.751,41	0,00	0,00	0,00	1.145.022,71	1.271,30	92.169,32
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.502.542,76	0,00	0,00	0,00	14.554.151,98	51.609,22	1.176.342,05
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.358.654,84	0,00	0,00	0,00	5.364.651,83	5.996,99	433.385,75
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	16.488.443,51	0,00	-650.000,00	0,00	15.903.100,59	64.657,08	1.552.188,17
	55.042.100,07	455.949,41	-650.000,00	0,00	55.087.970,07	239.920,59	

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	388.140,17	857.743,34	-866.272,88	0,00	384.574,38	4.963,75	43.312,73

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B	1.697.274,67	0,00	0,00	0,00	1.680.750,37	-16.524,30	160.744,59
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.065.264,46	0,00	0,00	0,00	5.118.419,15	53.154,69	478.160,61
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	3.170.826,36	0,00	0,00	0,00	3.175.197,77	4.371,41	319.290,14
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	3.403.987,82	0,00	0,00	0,00	3.407.406,89	3.419,07	272.309,22
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	499.762,88	127.231,47	-197.739,61	0,00	433.704,91	4.450,17	53.849,68
	14.225.256,36	984.974,81	-1.064.012,49	0,00	14.200.053,47	53.834,79	

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	419.294,50	0,00	0,00	0,00	417.370,30	-1.924,20	-42.545,69
	419.294,50	0,00	0,00	0,00	417.370,30	-1.924,20	

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	1.146.504,56	0,00	0,00	0,00	1.143.180,72	-3.323,84	145.484,18
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	808.072,99	0,00	0,00	0,00	815.095,41	7.022,42	26.398,14
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	2.236.888,26	0,00	0,00	0,00	2.247.410,52	10.522,26	95.335,99
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	2.660.945,18	0,00	0,00	0,00	2.667.839,00	6.893,82	52.865,71
BRADESCO F I A SELECTION	1.042.029,49	0,00	0,00	0,00	1.032.015,65	-10.013,84	5.474,99
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	3.748.902,90	0,00	0,00	0,00	3.745.121,73	-3.781,17	165.443,84
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	1.981.198,90	0,00	0,00	0,00	1.981.062,16	-136,74	113.461,53
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	839.736,85	0,00	0,00	0,00	821.086,28	-18.650,57	29.928,10
	14.464.279,13	0,00	0,00	0,00	14.452.811,47	-11.467,66	

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	1.428.101,17	0,00	0,00	0,00	1.381.187,49	-46.913,68	119.245,12
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.829.898,90	0,00	0,00	0,00	1.764.482,12	-65.416,78	243.990,47
	3.258.000,07	0,00	0,00	0,00	3.145.669,61	-112.330,46	

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	1.484.584,01	0,00	0,00	0,00	1.418.392,24	-66.191,77	215.368,67
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	2.448.707,59	0,00	0,00	0,00	2.460.928,81	12.221,22	189.798,79
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	1.718.725,89	0,00	0,00	0,00	1.733.343,23	14.617,34	119.313,46
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	1.483.283,83	0,00	0,00	0,00	1.417.400,83	-65.883,00	214.018,18
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI	1.968.279,92	0,00	0,00	0,00	1.986.017,26	17.737,34	181.615,07
	9.103.581,24	0,00	0,00	0,00	9.016.082,37	-87.498,87	

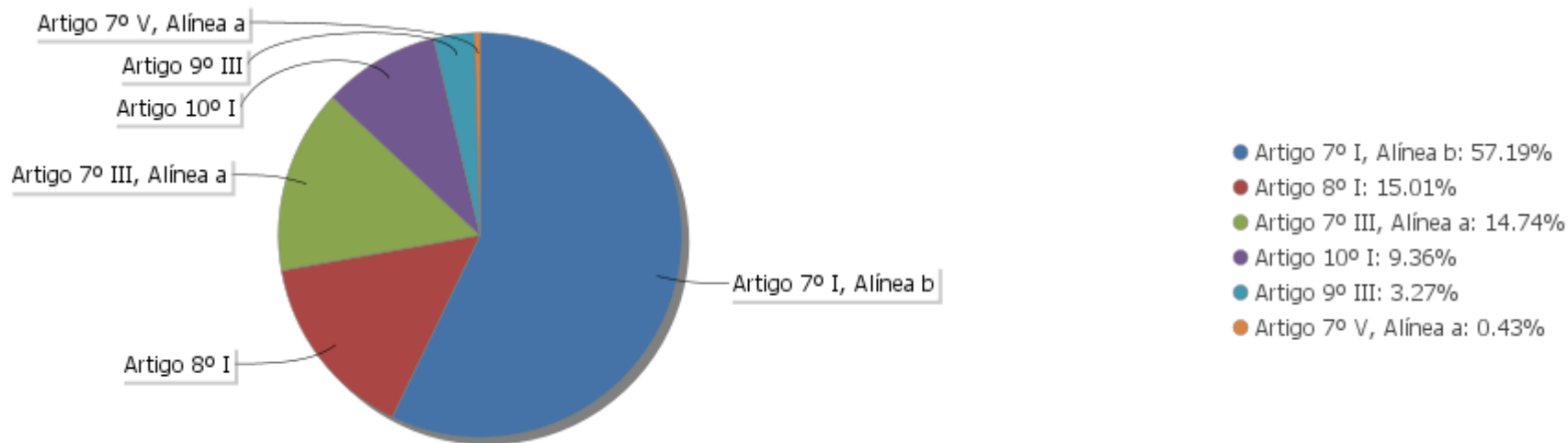
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

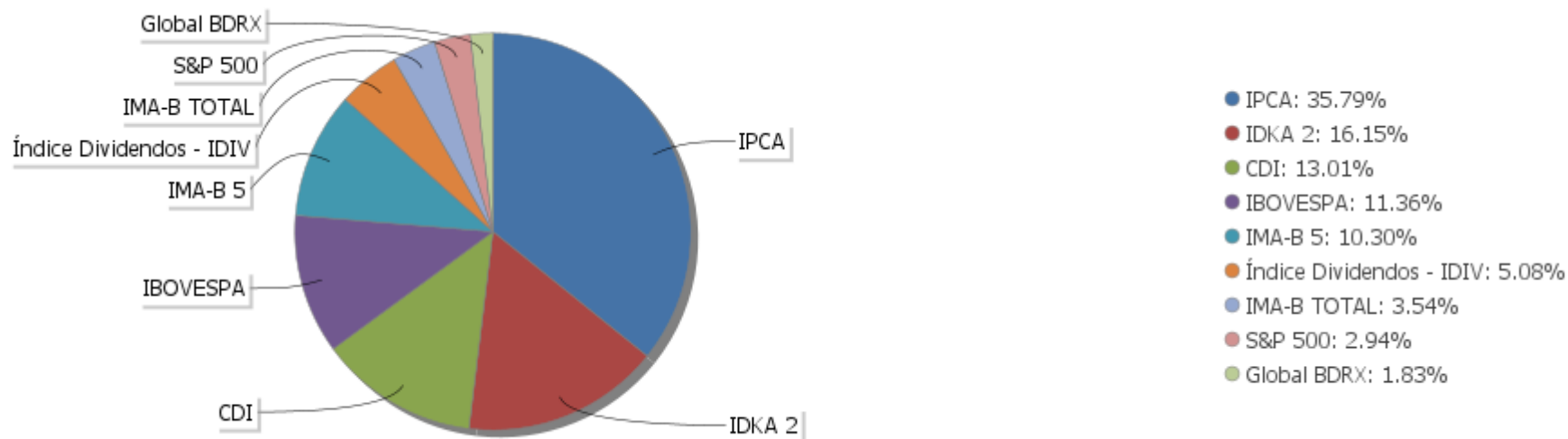
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	91.671.056,13	95,17	91.671.056,13	95,17	
de 31 dias a 365 dias	4.648.901,16	4,83	96.319.957,29	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	96.319.957,29	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

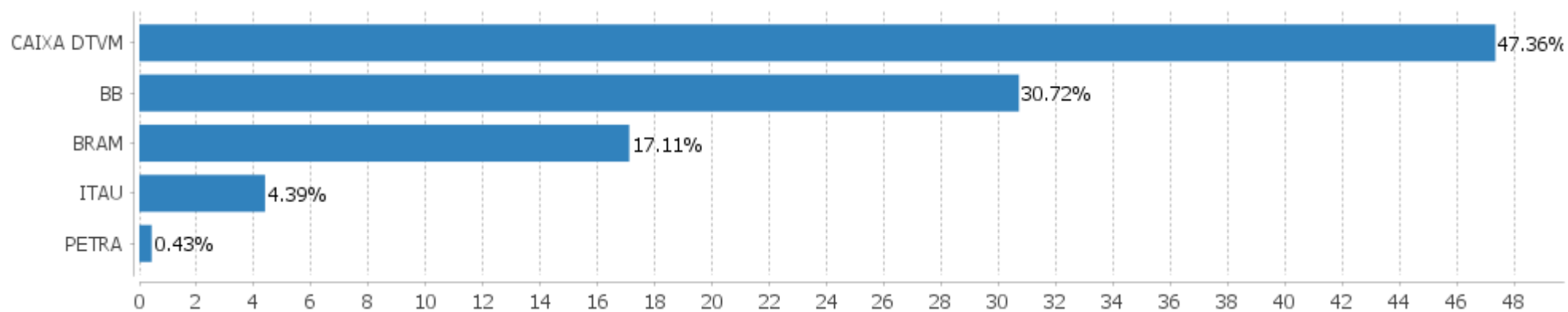


Alocação Por Estratégia



## 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				9,32
IPCA + 4,96%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,65	0,32	0,52	0,67	0,65				7,31
p.p. indexador	0,75	-1,60	-0,35	0,11	1,17	2,42	0,87	-0,91	-0,55				2,01
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

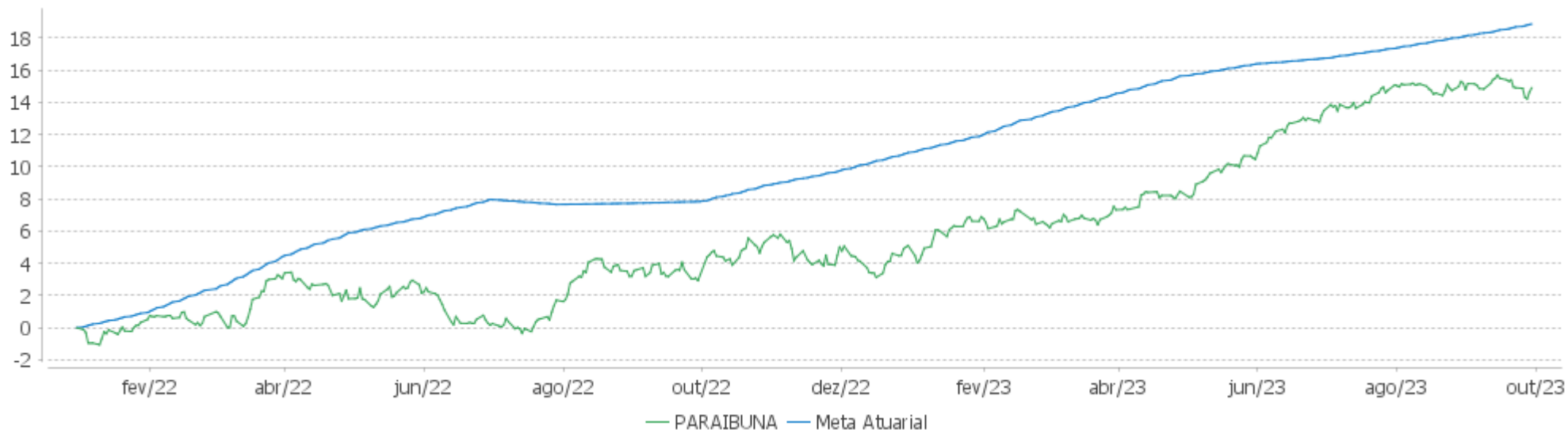
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	9	42,86	03 meses	1,25	1,86	-0,61	3,20
Meses abaixo - Meta Atuarial	12	57,14	06 meses	7,06	3,84	3,22	3,19
			12 meses	11,23	10,33	0,90	4,04
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,74	2023-06	Desde 31/12/2021	14,90	18,97	-4,08	4,30
Menor rentabilidade da Carteira	-1,95	2022-06					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



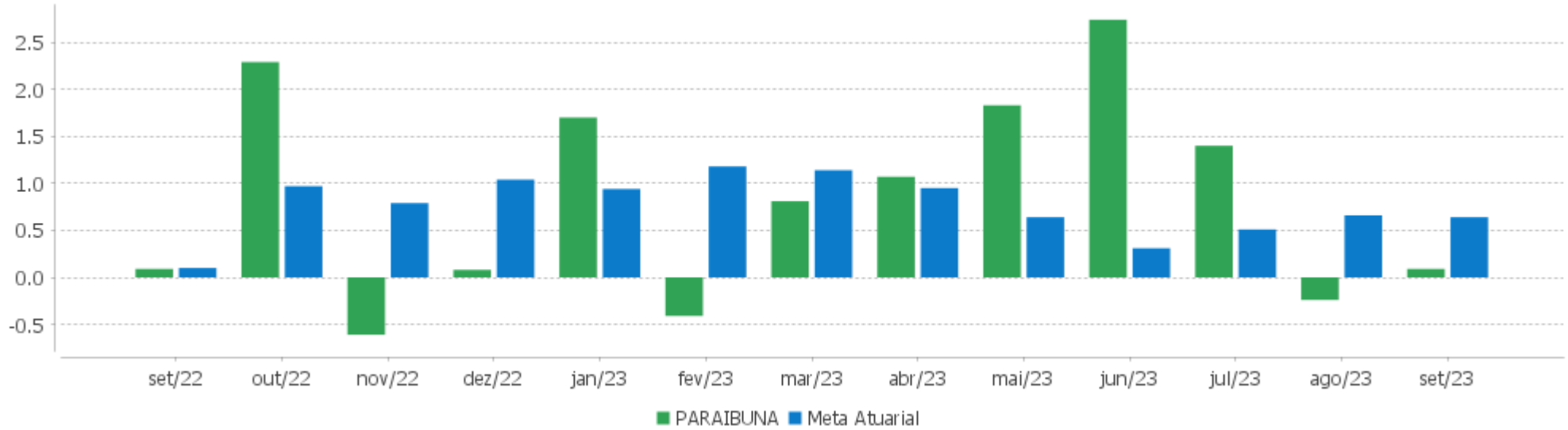
Patrimônio Líquido





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.	0,11 -0,02	8,79 -0,10	1,67 -0,06	4,28 -0,04	11,46 -0,19	21,66 -0,31	28,58 -0,64
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,21 -0,07	8,59 -0,38	1,90 -0,14	4,04 -0,03	11,22 -0,20	20,92 -0,43	28,23 -0,66
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,40 0,14	10,36 6,86	1,94 1,33	6,89 5,51	12,82 7,63	23,47 10,75	24,53 0,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,36 0,07	8,79 -0,18	2,06 0,01	4,24 0,16	11,36 -0,06	20,79 -0,57	27,94 -0,95
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,11 -0,02	8,75 -0,14	1,65 -0,08	4,25 -0,07	11,41 -0,24	21,41 -0,56	28,33 -0,90
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,88 0,62	11,72 8,22	2,73 2,12	7,91 6,53	13,59 8,41	23,82 11,09	27,26 2,98
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,97 -0,02	10,56 -0,22	-0,64 -0,12	6,42 -0,12	10,75 -0,30	18,44 -0,65	23,77 -0,94
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,46 -47,08	-9,25 -93,18	-1,37 -42,57	-8,75 -135,35	0,98 7,31	-59,73 -231,48	-61,87 -209,24
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,10 -0,03	8,69 -0,20	1,63 -0,09	4,20 -0,12	11,31 -0,34	21,09 -0,88	27,12 -2,11
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,05 107,67	10,30 103,80	3,54 109,96	6,88 106,36	13,98 104,03	27,19 105,36	31,34 105,99
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,97 -0,03	10,58 -0,21	-0,66 -0,14	6,49 -0,06	10,77 -0,28	18,43 -0,66	23,68 -1,03
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,90 91,93	9,12 91,85	2,96 91,98	5,95 91,99	12,33 91,75	23,32 90,39	25,64 86,73
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,90 92,03	8,77 88,30	2,96 91,98	5,82 89,95	11,77 87,52	22,06 85,49	24,55 83,03
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA Var. IPCA p.p.	0,14 -0,12	11,18 7,68	1,58 0,97	7,35 5,97	12,82 7,63	22,74 10,02	24,34 0,06
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,10 -1,42	4,62 -6,05	-2,05 -3,30	12,35 -3,03	4,98 -9,18	12,91 -9,49	31,78 -14,58
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-0,96 -1,67	0,53 -5,69	-4,77 -3,48	8,93 -5,48	-0,40 -6,33	-1,54 -6,58	7,08 -16,14
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	-0,29	14,58	-4,52	17,03	11,80	8,54	34,57

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.	-1,61	3,91	-5,77	1,65	-2,36	-13,86	-11,79
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	0,47 -0,24	4,43 -1,79	-0,70 0,59	13,47 -0,94	1,94 -4,00	0,42 -4,61	24,49 1,27
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,22 -2,93	3,78 -2,44	-6,67 -5,38	13,72 -0,69	-3,11 -9,04	-15,43 -20,46	3,00 -20,21
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	0,87 0,16	3,35 -2,88	0,58 1,87	10,91 -3,50	-3,14 -9,08	-16,56 -21,59	-2,80 -26,01
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-0,01 -0,72	6,08 -0,15	-1,83 -0,54	14,98 0,57	1,58 -4,35	-6,59 -11,63	4,64 -18,58
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,26 -0,45	2,02 -4,20	-1,96 -0,67	10,30 -4,11	-0,01 -5,94	-4,02 -9,06	24,18 0,96
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-3,57 -0,12	16,05 -1,18	1,32 -0,49	7,00 -0,82	20,13 -1,72	-7,28 -1,99	9,65 -4,99
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-3,29 -4,00	9,45 3,22	1,64 2,93	5,78 -8,64	15,78 9,85	-7,84 -12,87	10,47 -12,74
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	0,50 51,21	8,36 84,18	1,59 49,37	6,08 94,00	10,18 75,73	21,24 82,30	27,12 91,72
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-4,46 -1,24	17,90 10,72	-1,89 -2,01	8,34 5,49	29,34 18,57	17,35 25,71	53,40 40,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP % do CDI	0,85 87,26	7,39 74,46	1,94 60,16	6,31 97,61	9,60 71,41	23,26 90,15	30,17 102,05
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,90 92,46	10,07 101,38	3,12 96,95	6,75 104,35	13,36 99,36	26,18 101,48	30,36 102,68
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	-4,44 -1,23	17,78 10,60	-1,90 -2,02	8,26 5,40	29,28 18,51	17,25 25,61	53,36 40,16
PARAIBUNA Var. IPCA + 4,83% p.p.	0,09 -0,55	9,32 2,01	1,25 -0,61	7,06 3,22	11,23 0,87		
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91

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	0,93	10,06	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	12,82	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	11,62	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	8,89	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	10,59	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	8,97	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	15,28	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	5,50	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	4,92	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	5,06	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-4,75	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	10,67	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

**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	-3,22	7,19	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	12,28	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	4,13	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	3,50	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	2,91	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-4,93	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

**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	6,57	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	7,34	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	7,72	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	8,01	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	5,97	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70	62,65	77,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
258	01/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	39,60	17,08583041	2,3177100000
252	01/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.261,04	860,25970778	2,6283225630
259	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	13.963,43	6.019,21537506	2,3198090000
263	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.581,77	2.406,13343599	2,3198090000
244	05/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	40.034,50	15.218,54317423	2,6306394470
253	05/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	893,20	339,53721823	2,6306394470
264	11/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	678,89	292,25288146	2,3229540000
245	11/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.502,26	3.986,93611703	2,6341681160
265	12/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	791,77	340,69203810	2,3240050000
266	12/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.601,08	1.979,80641178	2,3240050000
249	14/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	22.665,61	0,00	8.593,05842806	2,6376650630
267	18/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.704,95	1.591,33460441	2,3282030000
271	18/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.231,47	0,00	958,45164704	2,3282030000
268	19/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	840,00	360,63079478	2,3292520000
250	19/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	835.054,48	0,00	316.170,28729833	2,6411541930
269	21/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.020,00	437,51268036	2,3313610000
243	21/09/2023	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	455.949,41	0,00	349.114,08742000	1,3060183660
254	21/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15.038,99	5.688,92964090	2,6435535240
270	22/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.900,00	1.672,11820075	2,3323710000
251	22/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	23,25	0,00	8,79086652	2,6447904700
260	25/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	55,00	23,57091675	2,3333840000
272	25/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	125.000,00	0,00	53.570,26533138	2,3333840000
273	25/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	268,76	115,18035608	2,3333840000
274	25/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	55,00	23,57091675	2,3333840000
246	25/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	625.023,00	236.219,62931298	2,6459401440
275	26/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	324,86	139,16209733	2,3344000000
261	27/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	51.011,00	21.842,40803867	2,3354110000
257	27/09/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	650.000,00	352.763,74109746	1,8425930000



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
276	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.150,00	492,20518194	2,3364240000
247	28/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	169.592,97	64.011,19684976	2,6494266370
255	28/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.433,37	541,01139469	2,6494266370
262	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	69.081,83	29.554,47003796	2,3374410000
277	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	40.671,67	17.400,08410907	2,3374410000
248	29/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	986,75	372,26762215	2,6506468500
256	29/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	506,80	191,19861252	2,6506468500
<b>Total</b>			<b>1.440.924,22</b>	<b>1.714.012,49</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.411.246,71

Value-At-Risk: 1,47%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PARAIBUNA		1,47		1,47			96.319.957,29	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,66%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,59	0,05	0,60			15.391.125,14	15,98
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,83	0,02	0,05			1.729.135,16	1,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,78	0,03	0,03			5.364.651,83	5,57
BB PREV RF IDKA2		0,71	0,00	0,12			1.000.782,66	1,04
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,75	0,06	0,16			14.554.151,98	15,11
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,79	0,01	0,02			1.145.022,71	1,19
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,86	0,09	0,87			15.903.100,59	16,51
<b>Sub-total</b>	1,27	0,69	0,26		-0,42	0,44	55.087.970,07	57,19

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B		1,86	0,02	0,04			1.680.750,37	1,74
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			384.574,38	0,40
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	0,00	0,01			433.704,91	0,45
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		0,79	0,02	0,04			3.407.406,89	3,54
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA		1,02	0,02	1,03			3.175.197,77	3,30
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,02	-0,00	0,02			5.118.419,15	5,31
<b>Sub-total</b>	1,55	0,61	0,06		-0,38	0,38	14.200.053,47	14,74

Artigo 7º V, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC PREMIUM		0,40	0,00	0,40			417.370,30	0,43
<b>Sub-total</b>	1,63	0,40	0,00		-0,88	-0,46	417.370,30	0,43

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,89%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI		6,93	0,15	0,84			2.247.410,52	2,33
BRADESCO FIA DIVIDENDOS		6,96	0,25	2,38			3.745.121,73	3,89
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI		6,34	0,06	3,34			1.143.180,72	1,19
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		6,98	0,18	1,08			2.667.839,00	2,77
BRADESCO F I A SELECTION		7,66	0,08	2,69			1.032.015,65	1,07
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		7,55	0,06	1,66			815.095,41	0,85
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		6,93	0,13	2,51			1.981.062,16	2,06
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA		8,73	0,07	4,53			821.086,28	0,85
<b>Sub-total</b>	16,07	6,89	0,97		-0,07	-0,08	14.452.811,47	15,01

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,00%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,53	0,04	1,53			2.460.928,81	2,55
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		5,17	0,04	5,29			1.418.392,24	1,47
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP		1,52	0,02	1,52			1.733.343,23	1,80
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI		5,18	0,04	5,29			1.417.400,83	1,47
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FIC FI		0,18	0,00	0,18			1.986.017,26	2,06
<b>Sub-total</b>	4,80	2,00	0,15		-0,40	-0,96	9.016.082,37	9,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,52%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,88	0,02	0,68			1.764.482,12	1,83
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I		6,21	0,01	9,90			1.381.187,49	1,43
<b>Sub-total</b>	10,94	6,52	0,02		-0,40	-3,45	3.145.669,61	3,27

(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 (%)