



LDB
EMPRESAS

CUBATÃO
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

83,92%

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,25	0,51	-1,21	7,51	77.426.171,91	7,26	952.566.946,89	8,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,87	0,16	1,10	8,81	35.335.231,85	3,31	3.791.584.166,14	0,93
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RF	4,95	0,52	-0,97	10,56	24.454.548,96	2,29	407.236.463,88	6,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,94	0,51	-0,96	10,59	34.292.521,02	3,21	267.272.249,83	12,83
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,05	0,90	9,81	97.929.477,74	9,18	7.028.296.292,55	1,39
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,76	0,53	-1,05	10,68	68.660.258,21	6,44	391.123.621,73	17,55
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,92	0,51	-0,97	10,56	36.348.912,04	3,41	5.367.605.963,99	0,68
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4,95	0,51	-0,97	10,54	37.853.479,49	3,55	559.428.321,06	6,77
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,96	0,51	-0,96	10,65	73.994.604,94	6,94	5.222.821.325,49	1,42
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,06	0,90	9,73	21.347,32	0,00	39.525.754,08	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,36	0,06	0,91	9,91	33.871.376,15	3,17	7.513.988.203,57	0,45
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,36	0,05	0,91	9,91	1.296.714,63	0,12	697.408.847,56	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,36	0,26	0,15	10,54	19.470.095,10	1,82	594.550.248,64	3,27
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,87	0,16	1,10	8,82	137.682.174,66	12,91	3.520.695.315,59	3,91
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,22	0,33	-0,09	9,67	678.636.914,02	63,61		

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				
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	4,99	0,53	-1,13	10,65	39.174.601,60	3,67	569.383.114,96	6,88
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,09	0,52	-1,00	10,71	39.568.705,47	3,71	1.357.142.226,13	2,92
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	4,94	0,52	-0,97	10,58	47.202.752,28	4,42	923.636.374,46	5,11
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,05	1,02	10,12	39.561.745,46	3,71	2.788.665.794,77	1,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	1,05	10,30	17.289.762,52	1,62	8.906.699.435,49	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	2,16	0,22	0,10	8,46	21.852.689,64	2,05	196.673.469,55	11,11
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			3,20	0,36	-0,35	10,27	204.650.256,97	19,18		

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	Ano				
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	0,32	0,05	1,10	10,00	12.056.769,31	1,13	6.003.378.015,22	0,20
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,32	0,05	1,10	10,00	12.056.769,31	1,13		
Renda Fixa			3,16	0,33	-0,14	9,82	895.343.940,30	83,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

15,30%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	18,38	0,49	0,58	3,98	9.020.425,17	0,85	643.763.945,61	1,40
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	23,19	1,01	0,14	24,25	16.039.902,25	1,50	306.513.550,16	5,23
4UM	BEM	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	17,36	0,13	-0,01	10,64	22.452.242,66	2,10	239.628.374,14	9,37
ITAU	ITAU	ITAU INDEX IBOVESPA 1	20,05	0,72	0,69	6,11	5.524.630,82	0,52	35.459.301,58	15,58
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	18,26	0,53	-1,00	6,85	4.822.262,02	0,45	1.281.232.542,36	0,38
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,50	0,59	0,79	2,14	36.903.996,01	3,46	774.960.951,78	4,76
PLURAL	BEM	PLURAL AÇÕES FIC FIIA	19,21	0,45	-1,15	3,93	19.226.914,23	1,80	224.155.235,27	8,58
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	19,88	0,63	-0,09	0,17	25.750.163,72	2,41	181.853.478,88	14,16
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	16,10	-0,27	-4,67	13,72	19.931.798,82	1,87	1.148.847.623,27	1,73
SAFRA	SAFRA	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	21,64	0,80	-1,20	7,77	3.593.304,82	0,34	283.428.846,96	1,27
Sub-total Artigo 8º I			16,52	0,45	-0,56	6,85	163.265.640,52	15,30		
Renda Variável			16,52	0,45	-0,56	6,85	163.265.640,52	15,30		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,60%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	16,86	-0,25	-4,40	17,53	6.420.631,74	0,60	538.230.379,11	1,19
Sub-total Artigo 10º I			16,86	-0,25	-4,40	17,53	6.420.631,74	0,60		
Investimentos Estruturados			16,86	-0,25	-4,40	17,53	6.420.631,74	0,60		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,17%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	16,71	1,40	-0,99	13,77	1.824.750,00	0,17	1.962.153.724,82	0,09
Sub-total Artigo 11º			16,71	1,40	-0,99	13,77	1.824.750,00	0,17		
Fundos Imobiliários			16,71	1,40	-0,99	13,77	1.824.750,00	0,17		
Total			4,71	0,35	-0,23	9,38	1.066.854.962,56	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	678.636.914,02	63,61	0,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	204.650.256,97	19,18	0,00	20,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	12.056.769,31	1,13	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	895.343.940,30	83,92					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	163.265.640,52	15,30	0,00	16,70	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	163.265.640,52	15,30					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	6.420.631,74	0,60	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	6.420.631,74	0,60					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.824.750,00	0,17	0,00	0,30	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	1.824.750,00	0,17					5,00
Total		1.066.854.962,56	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	-0,09 -9,50	9,67 97,39	1,04 32,25	5,95 92,01	11,09 82,51	-615.965,38	58.027.223,78
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,35 -35,53	10,27 103,48	0,73 22,54	6,35 98,20	11,70 87,00	-711.077,63	19.065.267,13
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,10 113,34	10,00 100,73	3,84 119,24	7,39 114,33	13,77 102,40	131.739,45	1.096.103,70
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,56 -1,27	6,85 0,63	-0,68 0,60	13,45 -0,96	4,92 -1,02	-918.728,67	10.469.378,10
Artigo 10º I % do CDI	-4,40 -451,91	17,53 176,59	-1,92 -59,66	8,12 125,53	28,73 213,72	-295.842,47	957.715,89
Artigo 11º % do CDI	-0,99 -101,77	13,77 138,68	3,02 93,78	21,92 338,94	5,16 38,42	-18.550,00	224.250,00
CUBATÃO (Total)						-2.428.424,70	89.839.938,60

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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	36.704.541,50	0,00	0,00	0,00	36.348.912,04	-355.629,46	3.473.104,44
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	88.807.977,62	12.613.334,77	-4.338.880,00	0,00	97.929.477,74	847.045,35	6.963.477,47
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	136.186.396,22	0,00	0,00	0,00	137.682.174,66	1.495.778,44	11.509.652,98
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.284.960,93	0,00	0,00	0,00	1.296.714,63	11.753,70	116.865,42
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	38.225.329,16	0,00	0,00	0,00	37.853.479,49	-371.849,67	3.608.403,40
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	24.694.668,83	0,00	0,00	0,00	24.454.548,96	-240.119,87	2.335.891,66
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.951.426,91	0,00	0,00	0,00	35.335.231,85	383.804,94	2.951.696,70
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	78.375.267,42	0,00	0,00	0,00	77.426.171,91	-949.095,51	5.588.609,43
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	74.709.627,11	0,00	0,00	0,00	73.994.604,94	-715.022,17	7.122.263,24
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19.441.346,22	0,00	0,00	0,00	19.470.095,10	28.748,88	1.857.389,50
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.146.952,22	699.000,00	-281.090,00	0,00	33.871.376,15	306.513,93	2.591.089,57
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	34.624.798,82	0,00	0,00	0,00	34.292.521,02	-332.277,80	3.282.581,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	69.386.064,12	0,00	0,00	0,00	68.660.258,21	-725.805,91	6.624.305,77
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.157,55	0,00	0,00	0,00	21.347,32	189,77	1.892,57
	670.560.514,63	13.312.334,77	-4.619.970,00	0,00	678.636.914,02	-615.965,38	

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 IMA-B	47.666.826,20	0,00	0,00	0,00	47.202.752,28	-464.073,92	4.514.404,45
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	17.110.208,62	0,00	0,00	0,00	17.289.762,52	179.553,90	1.615.202,51
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	39.623.701,89	0,00	0,00	0,00	39.174.601,60	-449.100,29	3.769.390,96
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	21.831.918,67	0,00	0,00	0,00	21.852.689,64	20.770,97	1.703.992,19
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	39.966.371,53	0,00	0,00	0,00	39.568.705,47	-397.666,06	3.826.887,85
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	39.162.307,69	0,00	0,00	0,00	39.561.745,46	399.437,77	3.635.389,17
	205.361.334,60	0,00	0,00	0,00	204.650.256,97	-711.077,63	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	11.925.029,86	0,00	0,00	0,00	12.056.769,31	131.739,45	1.096.103,70
	11.925.029,86	0,00	0,00	0,00	12.056.769,31	131.739,45	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	22.454.597,04	0,00	0,00	0,00	22.452.242,66	-2.354,38	2.159.616,54
4UM SMALL CAPS FIA	16.017.053,51	0,00	0,00	0,00	16.039.902,25	22.848,74	3.130.081,54
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	25.773.763,65	0,00	0,00	0,00	25.750.163,72	-23.599,93	42.834,96
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	20.908.297,10	0,00	0,00	0,00	19.931.798,82	-976.498,28	2.405.041,05
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	4.871.114,60	0,00	0,00	0,00	4.822.262,02	-48.852,58	309.136,91
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	8.967.988,62	0,00	0,00	0,00	9.020.425,17	52.436,55	345.600,26
ITAU INDEX IBOVESPA 1	5.487.008,75	0,00	0,00	0,00	5.524.630,82	37.622,07	318.230,65
OCCAM FIC FIA	36.616.447,17	0,00	0,00	0,00	36.903.996,01	287.548,84	772.932,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PLURAL AÇÕES FIC FIIA	19.451.078,41	0,00	0,00	0,00	19.226.914,23	-224.164,18	726.855,14
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	3.637.020,34	0,00	0,00	0,00	3.593.304,82	-43.715,52	259.048,06
	164.184.369,19	0,00	0,00	0,00	163.265.640,52	-918.728,67	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	6.716.474,21	0,00	0,00	0,00	6.420.631,74	-295.842,47	957.715,89
	6.716.474,21	0,00	0,00	0,00	6.420.631,74	-295.842,47	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	1.854.500,00	0,00	0,00	0,00	11.200,00	1.824.750,00	-18.550,00	224.250,00
	1.854.500,00	0,00	0,00	0,00	11.200,00	1.824.750,00	-18.550,00	

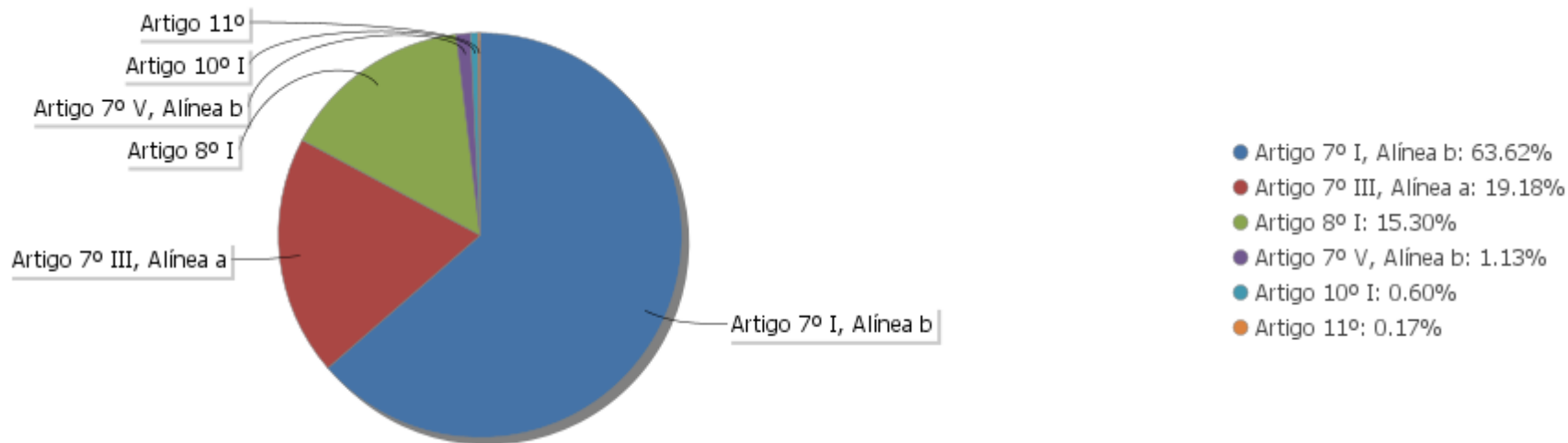
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

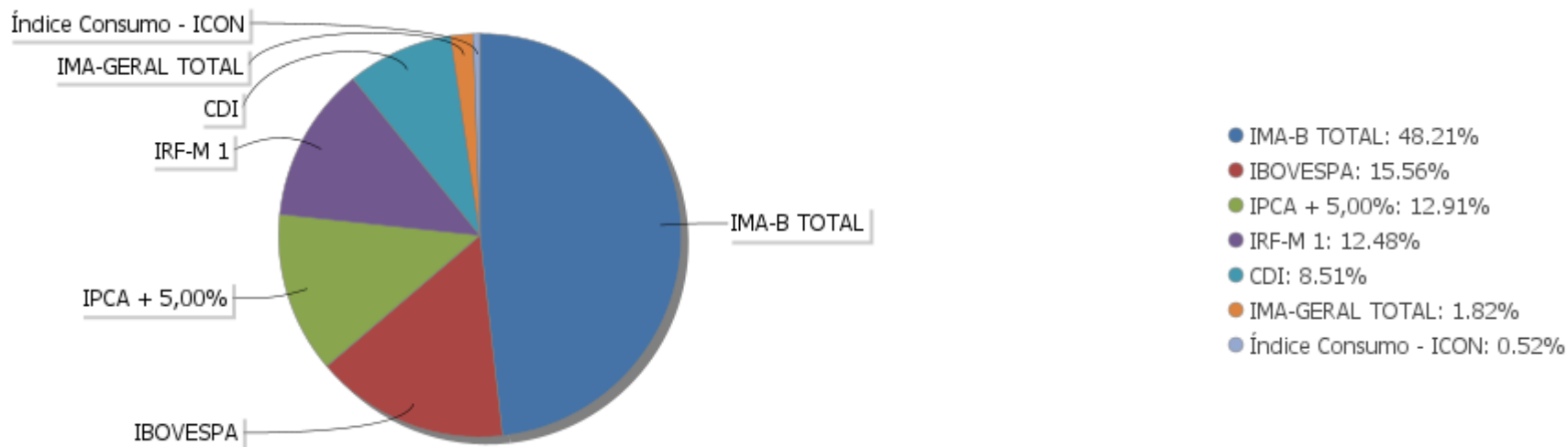
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	812.818.079,32	76,19	812.818.079,32	76,19	
de 31 dias a 365 dias	176.610.711,33	16,55	989.428.790,65	92,74	
acima de 365 dias	77.426.171,91	7,26	1.066.854.962,56	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

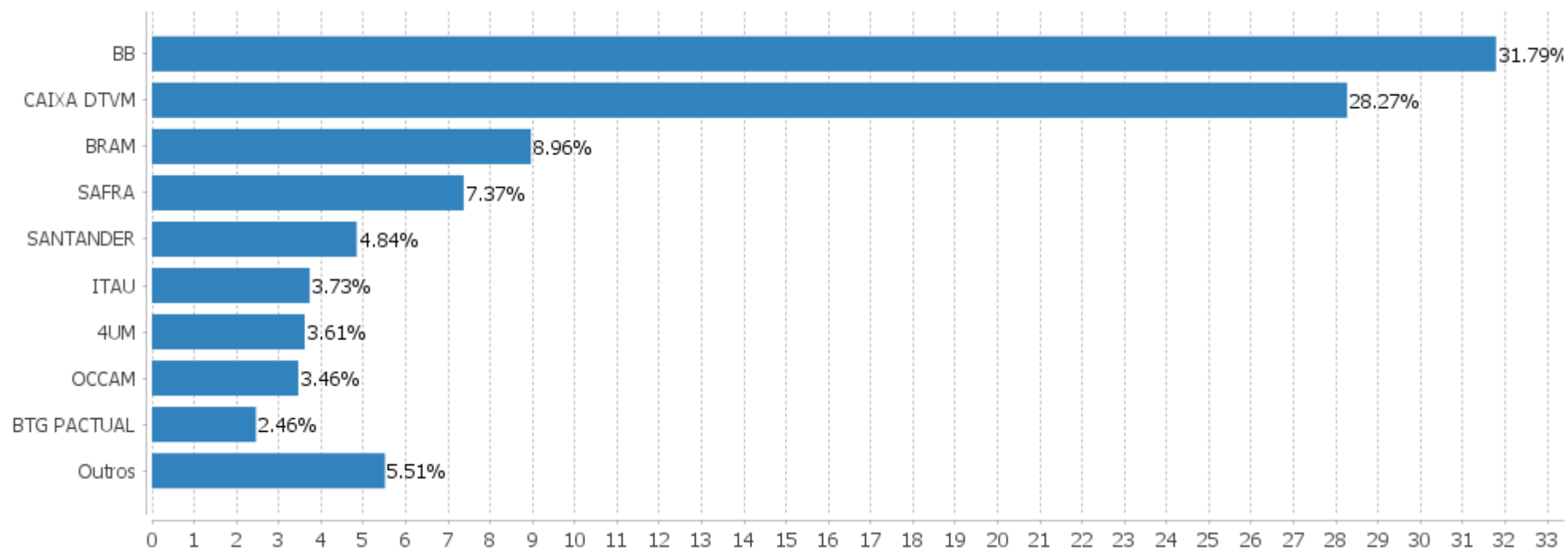


Alocação Por Estratégia



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	1,04	-0,32	1,33	1,49	2,07	2,73	1,32	-0,36	-0,23				9,38
INPC + 5,24%	0,91	1,14	1,11	0,90	0,81	0,33	0,34	0,67	0,52				6,91
p.p. indexador	0,13	-1,46	0,22	0,60	1,26	2,40	0,99	-1,03	-0,74				2,47
2022	0,59	0,41	2,52	-0,97	1,09	-1,55	0,64	1,58	0,73	2,13	-1,17	-0,13	5,94
INPC + 5,45%	1,12	1,40	2,18	1,45	0,92	1,07	-0,16	0,17	0,12	0,89	0,80	1,16	11,68
p.p. indexador	-0,53	-0,99	0,33	-2,41	0,18	-2,61	0,79	1,41	0,61	1,24	-1,97	-1,29	-5,74
2021	-0,95	-1,27	0,53	0,92	1,42	0,34	-0,84	-0,77	-0,97	-2,23	1,55	0,95	-1,41
INPC + 5,86%	0,72	1,23	1,39	0,83	1,44	1,08	1,52	1,38	1,68	1,62	1,30	1,25	16,59
p.p. indexador	-1,67	-2,50	-0,86	0,08	-0,02	-0,74	-2,37	-2,15	-2,65	-3,85	0,25	-0,31	-18,00
2020	0,23	-0,94	-7,44	1,84	1,81	2,26	3,20	-1,32	-1,40	-0,05	2,65	3,68	4,09
INPC + 5,86%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,60
p.p. indexador	-0,46	-1,52	-8,12	1,61	1,61	1,48	2,24	-2,16	-2,75	-1,42	1,25	1,71	-7,52
2019	3,58	0,24	0,31	1,07	2,11	2,57	1,17	0,27	1,76	2,17	-0,86	2,58	18,27
INPC + 6,00%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	2,70	-0,76	-0,90	-0,02	1,45	2,12	0,54	-0,36	1,33	1,60	-1,86	0,87	7,49

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

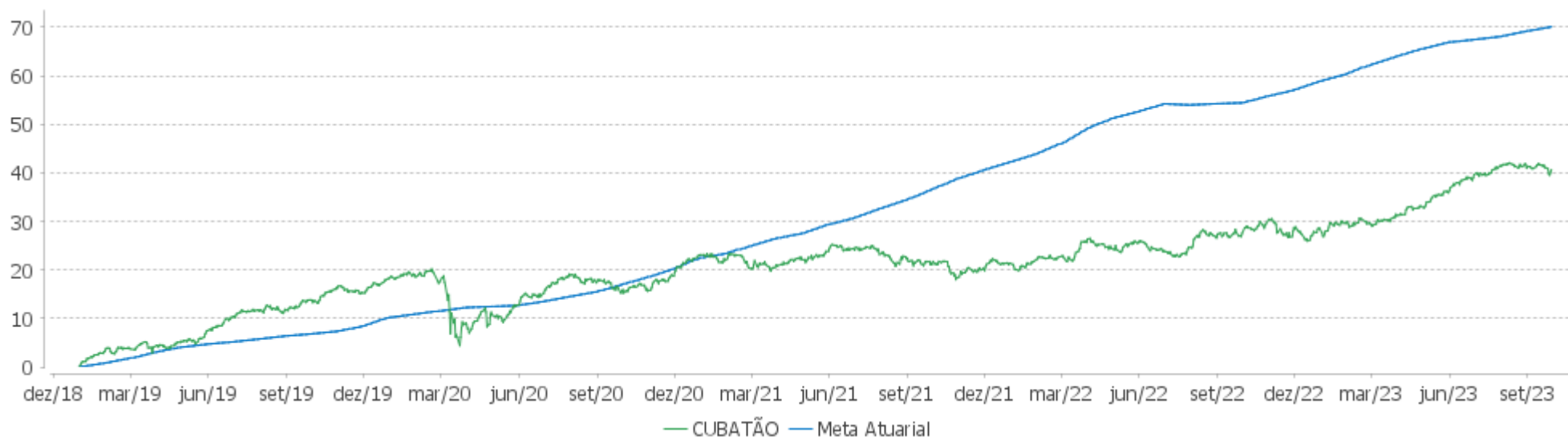
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	27	47,37
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	52,63

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,68	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-7,44	2020-03

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,73	1,53	-0,80	3,60
06 meses	7,19	3,60	3,59	3,55
12 meses	10,26	9,99	0,27	4,71
24 meses	16,14	24,45	-8,31	4,73
36 meses	21,53	45,91	-24,38	4,73
48 meses	23,56	60,52	-36,96	6,75
Desde 31/12/2018	40,64	72,10	-31,46	6,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

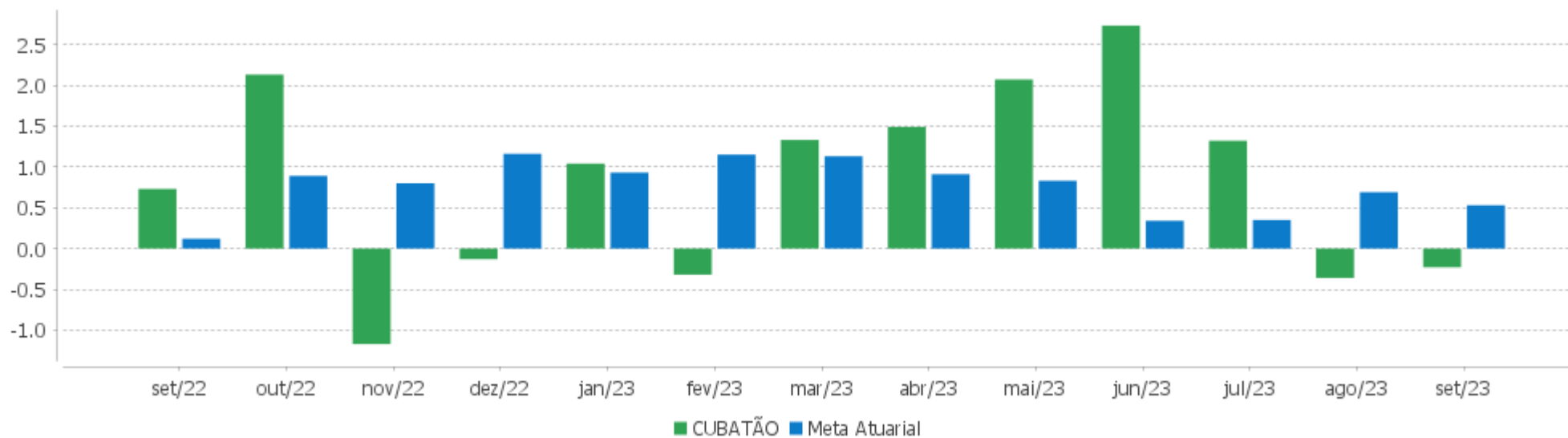


Patrimônio Líquido



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
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,10 113,34	10,00 100,73	3,84 119,24	7,39 114,33	13,77 102,40	27,41 106,24	32,96 111,48
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,96 -0,01	10,65 -0,14	-0,53 -0,01	6,49 -0,06	10,76 -0,28	18,68 -0,41	23,96 -0,74
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,90 -0,03	9,81 -0,26	3,11 -0,07	6,35 -0,15	13,19 -0,34	24,03 -0,65	26,71 -1,08
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,10 0,45	8,82 1,48	3,09 1,23	4,57 0,71	11,76 1,36		
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,97 -0,03	10,56 -0,22	-0,60 -0,08	6,40 -0,15	10,71 -0,34	18,38 -0,72	23,51 -1,19
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,05 -0,10	10,68 -0,11	-0,88 -0,36	6,36 -0,19	11,04 -0,01	16,63 -2,46	19,21 -5,50
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,15 -0,03	10,54 -0,05	1,67 -0,13	6,69 -0,02	12,49 -0,01	22,56 -0,34	24,83 -1,11
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,97 -0,03	10,54 -0,25	-0,60 -0,08	6,39 -0,16	10,71 -0,34	18,31 -0,78	23,45 -1,25
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,90 -0,03	9,73 -0,34	3,08 -0,09	6,30 -0,20	13,08 -0,46	23,76 -0,92	26,45 -1,34
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,96 -0,01	10,59 -0,20	-0,57 -0,05	6,42 -0,12	10,78 -0,26	18,56 -0,54	23,81 -0,89
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 -0,02	9,91 -0,16	3,13 -0,05	6,40 -0,10	13,31 -0,23	24,18 -0,50	26,96 -0,83
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,10 2,04	8,81 -1,97	3,09 3,61	4,57 -1,97	11,76 0,72	21,08 1,99	26,98 2,28
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,21 -0,27	7,51 -3,28	-0,78 -0,26	6,23 -0,32	7,67 -3,38	16,14 -2,95	19,55 -5,15
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
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 -0,02	9,91 -0,15	3,12 -0,05	6,37 -0,13	13,31 -0,22	24,16 -0,52	26,95 -0,84
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP % do CDI	0,10 9,76	8,46 85,19	1,64 50,80	4,16 64,40	11,04 82,12	21,06 81,61	25,97 87,82
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	-1,13	10,65	-0,74	6,40	10,68	18,20	22,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,19	-0,14	-0,22	-0,15	-0,36	-0,89	-2,01
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
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,00 -0,05	10,71 -0,08	-0,52 -0,00	6,60 0,05	10,65 -0,40	18,53 -0,56	23,83 -0,87
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,02 104,64	10,12 101,93	3,52 109,39	6,89 106,60	13,72 102,05	26,84 104,03	31,33 105,95
PLURAL AÇÕES FIC FIIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,15 -1,86	3,93 -2,30	-0,82 0,47	13,52 -0,89	-0,86 -6,79	-5,22 -10,25	4,74 -18,47
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-1,00 -1,71	6,85 0,63	-4,46 -3,17	12,85 -1,56	1,02 -4,91	4,21 -0,82	22,08 -1,13
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,09 -0,80	0,17 -6,06	-2,47 -1,18	11,72 -2,69	-1,97 -7,90	-5,38 -10,41	
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,20 -1,91	7,77 1,54	-1,54 -0,25	14,21 -0,20	-0,24 -6,17	-19,93 -24,96	-9,47 -32,69
4UM SMALL CAPS FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,14 -0,57	24,25 18,02	9,53 10,82	42,98 28,56	13,92 7,99	11,64 6,60	27,88 4,67
ITAU INDEX IBOVESPA 1 Var. Índice Consumo - ICON p.p.	0,69 4,71	6,11 10,86	-1,34 10,77	14,30 5,28	5,83 23,66	4,66 45,30	22,04 63,67
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,67 -5,38	13,72 7,50	-2,27 -0,98	5,40 -9,01	23,45 17,52	10,63 5,60	42,70 19,48
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,79 0,07	2,14 -4,09	-2,31 -1,02	9,30 -5,11	0,55 -5,38	2,27 -2,77	14,40 -8,81
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,58 -0,13	3,98 -2,24	-0,29 1,00	11,66 -2,75	4,41 -1,52	0,60 -4,43	7,58 -15,64
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,01 -0,72	10,64 4,42	0,04 1,33	13,98 -0,43	7,92 1,99	11,25 6,21	36,70 13,49
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-4,40 -5,12	17,53 11,31	-1,92 -0,63	8,12 -6,29	28,73 22,80	16,77 11,74	52,30 29,09
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS Var. IBOVESPA p.p.	-0,99 -1,70	13,77 7,54	3,02 4,31	21,92 7,51	5,16 -0,77	10,86 5,83	-6,59 -29,81
CUBATÃO Var. INPC + 5,45% p.p.	-0,23 -0,74	9,38 2,47	0,73 -0,80	7,19 3,59	10,26 0,32	16,14 -7,88	21,53 -23,03
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
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
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	2,00
4UM SMALL CAPS FIA			D+17 du	D+20 du	-	2,00
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du	-	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,20
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	D+1 du	D+0	D+14 du	D+15 du		2,00
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
ITAU INDEX IBOVESPA 1	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du		0,80
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	-	3,00
PLURAL AÇÕES FIC FIIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	-	3,00
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	Método Passivo.	0,00
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,30
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du		1,00
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,30
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

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
833	05/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	78.000,00	22.908,11537100	3,4049068960
841	05/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	394.000,00	0,00	115.715,35200000	3,4049068960
839	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	190.000,00	0,00	58.099,80016700	3,2702350000
850	05/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	3.552.000,00	0,00	1.043.200,33072600	3,4049068960
847	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	503.000,00	0,00	153.811,57623200	3,2702350000
842	14/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	769.000,00	0,00	225.126,86597100	3,4158517540
848	14/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.000,00	0,00	1.828,82948500	3,2807870000
851	15/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	716.000,00	0,00	209.522,87966918	3,4172878930
852	18/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	382.500,00	0,00	111.883,15925000	3,4187450780
838	19/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.174,77	0,00	3.267,28391800	3,4202016960
834	20/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	18.400,00	0,00	5.377,20606500	3,4218513810
843	20/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	221.000,00	0,00	64.584,92067300	3,4218513810
853	20/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	4.100,00	0,00	1.198,18178600	3,4218513810
835	22/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	87.000,00	25.402,54731300	3,4248533790
844	22/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	90.000,00	0,00	26.278,49722030	3,4248533790
854	22/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	53.000,00	0,00	15.475,11502900	3,4248533790
836	26/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	202.160,00	0,00	58.978,30497114	3,4277010860
837	26/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.085,00	633,35186000	3,2920130000
845	26/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	6.200.000,00	0,00	1.808.792,49515700	3,4277010860
840	26/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	227.835,00	69.208,41374100	3,2920130000
855	26/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	439.200,00	128.132,52643116	3,4277010860
849	26/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	51.170,00	15.543,68095600	3,2920130000
846	28/09/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	3.734.680,00	1.088.883,82046000	3,4298241280
Total			13.312.334,77	4.619.970,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 17.257.098,07

Value-At-Risk: 1,62%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CUBATÃO		1,62		1,62			1.066.854.962,56	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,06%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		1,84	0,11	0,42			77.426.171,91	7,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,48	0,00	1,79			35.335.231,85	3,31
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF		1,85	0,04	0,01			24.454.548,96	2,29
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI		1,85	0,05	0,01			34.292.521,02	3,21
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,12	0,01	0,01			97.929.477,74	9,18
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		1,89	0,10	0,12			68.660.258,21	6,44
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,83	0,05	0,05			36.348.912,04	3,41
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		1,85	0,06	0,00			37.853.479,49	3,55
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,83	0,11	0,04			73.994.604,94	6,94
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,12	0,00	0,02			21.347,32	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,13	0,00	0,01			33.871.376,15	3,17
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,13	0,00	0,01			1.296.714,63	0,12
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,86	0,01	0,04			19.470.095,10	1,82
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,47	0,01	0,48			137.682.174,66	12,91
Sub-total	2,99	1,03	0,56		-0,36	-0,09	678.636.914,02	63,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B		1,84	0,06	0,13			39.174.601,60	3,67
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		1,83	0,06	0,06			39.568.705,47	3,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B		1,86	0,07	0,04			47.202.752,28	4,42
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,02	-0,00	0,02			39.561.745,46	3,71
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,02	-0,00	0,02			17.289.762,52	1,62
FIC CAIXA PATRIMONIO IP RF LP		0,76	0,01	0,76			21.852.689,64	2,05
Sub-total	3,54	1,20	0,20		-0,37	-0,35	204.650.256,97	19,18

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FC YIELD VIP RF REF DI CRÉDITO PRIVADO		0,08	0,00	0,08			12.056.769,31	1,13
Sub-total	0,19	0,08	0,00		0,67	1,10	12.056.769,31	1,13

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,25%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		6,43	0,05	1,59			9.020.425,17	0,85
4UM SMALL CAPS FIA		9,54	0,11	6,75			16.039.902,25	1,50
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA		5,35	0,09	3,62			22.452.242,66	2,10
ITAU INDEX IBOVESPA 1		7,36	0,03	5,45			5.524.630,82	0,52
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES		6,50	0,03	3,18			4.822.262,02	0,45
OCCAM FIC FIA		7,30	0,21	1,28			36.903.996,01	3,46
PLURAL AÇÕES FIC FIIA		7,28	0,11	2,84			19.226.914,23	1,80
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		7,99	0,16	3,03			25.750.163,72	2,41
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA		6,18	0,04	8,06			19.931.798,82	1,87
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC FIA		7,35	0,02	2,09			3.593.304,82	0,34
Sub-total	13,98	6,25	0,85		-0,11	-0,56	163.265.640,52	15,30

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,12%

Artigo 10º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		5,12	0,01	6,87			6.420.631,74	0,60
Sub-total	10,55	5,12	0,01		-0,51	-4,40	6.420.631,74	0,60

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 9,38%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FDO INV IMOB - FII BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS		9,38	-0,00	12,77			1.824.750,00	0,17
Sub-total	18,10	9,38	-0,00		-0,11	-0,99	1.824.750,00	0,17

(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 (%)